



P I M C O

PIMCO FUNDS: GLOBAL INVESTORS SERIES PLC

Jahresbericht

31. Dezember 2023



ALLGEMEINE KENNDATEN

Fondstyp:
OGAW

Anzahl an Teilfonds der Gesellschaft:
56 Teilfonds

Zum 31. Dezember 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 RMB (Hedged)
 Institutional RMB (Unhedged)
 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 HKD (Unhedged)
 Investor JPY (Hedged)
 Investor NOK (Hedged)
 Investor RMB (Hedged)
 Investor SEK (Hedged)
 Investor SGD (Hedged)
 Investor USD (Hedged)
 Investor USD (Unhedged)
 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 Decumulation

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 RMB (Hedged)
 E Class SGD (Hedged)
 E Class SGD (Partially Hedged)
 E Class USD (Currency Exposure)
 E Class USD (Hedged)
 G Retail EUR (Hedged)
 H Institutional
 H Institutional USD (Currency Exposure)
 H Institutional USD (Hedged)
 M Retail
 M Retail AUD (Hedged)
 M Retail Decumulation
 M Retail HKD (Unhedged)
 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 CHF (Hedged)
 W Class EUR (Hedged)
 W Class GBP (Hedged)
 W Class NOK (Hedged)
 W Class SGD (Hedged)
 Z Class
 Z Class AUD (Hedged)

Anteilsarten:

Innerhalb jeder Klasse darf die Gesellschaft, vorbehaltlich der jeweiligen Ergänzung, ausschüttende Anteile (Einkommen ausschüttende Anteile), thesaurierende Anteile (Einkommen thesaurierende Anteile), ausschüttende Anteile II (Anteile, die eine höhere Rendite liefern sollen) und Decumulation-Anteile (Anteile, die darauf abzielen, Ausschüttungen zu bieten, die über das Einkommen hinausgehen) ausgeben.

Nettovermögen (Angaben in Tausend):

USD 165.102.555

Mindestbestand:

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

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

ALLGEMEINE KENNDATEN (Forts.)

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

Handelstag:

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

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

Funktionswährung der Teilfonds:

USD (\$), mit Ausnahme der Teilfonds UK Corporate Bond Fund und UK Long Term Corporate Bond Fund, die auf Pfund Sterling (£) lauten, sowie der Teilfonds 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 Teilfonds 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 Teilfonds 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 Teilfonds entweder als Derivatfonds oder als Nicht-Derivatfonds ist ebenfalls nachstehend angegeben. Es gibt keine Änderungen bezüglich des Einsatzes von Finanzderivaten durch die folgenden Teilfonds:

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
PIMCO Balanced Income and Growth 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 Teilfonds 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
 Global Investment Grade Credit ESG Fund
 Global Low Duration Real Return Fund
 Inflation Multi-Asset Fund
 Low Duration Global Investment Grade Credit Fund
 Low Duration Income Fund
 Low Duration Opportunities Fund
 Low Duration Opportunities ESG Fund
 PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund
 Mortgage Opportunities Fund
 PIMCO StocksPLUS™ AR Fund
 StocksPLUS™ Fund
 Strategic Income Fund
 PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund

UK Corporate Bond Fund
 UK Long Term Corporate Bond Fund
 US Investment Grade Corporate Bond Fund
 US Short-Term Fund

Zulassung in Singapur

Die folgenden Teilfonds werden von der Monetary Authority of Singapore gemäß dem Securities and Futures Act, Chapter 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

	Seite
Markteinblicke*	4
Wichtige Angaben zu den Teilfonds	5
Beschreibungen der Vergleichsindizes	67
Finanzstatus	72
Betriebsergebnisrechnung	92
Ausweis der Nettovermögensänderungen	112
Aufstellung der Wertpapieranlagen	118
Erläuterungen zum Abschluss	752
Bericht des Verwaltungsrats	884
Bericht des unabhängigen Abschlussprüfers	887
Bericht der Verwahrstelle	892
Angaben zur Vergütung (ungeprüft)	893
Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung (ungeprüft)	894
Zweite Aktionärsrichtlinie (ARUG II) (ungeprüft)	950
Angaben zur Offenlegungsverordnung und Taxonomie- Verordnung (ungeprüft)	951
Glossar (ungeprüft)	1070
Allgemeine Informationen (ungeprüft)	1072

TEILFONDS	Teilfonds- überblick*	Aufstellung der Wertpapieranlagen
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	6	118
Asia Strategic Interest Bond Fund	7	127
PIMCO Balanced Income and Growth Fund	8	135
PIMCO Capital Securities Fund	9	149
PIMCO Climate Bond Fund	11	157
Commodity Real Return Fund	12	165
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	13	174
Diversified Income Fund	14	183
Diversified Income Duration Hedged Fund	16	201
Diversified Income ESG Fund	17	212
Dynamic Bond Fund	18	220
Dynamic Multi-Asset Fund	19	237
Emerging Local Bond Fund	20	247
Emerging Local Bond ESG Fund	21	266
Emerging Markets Bond Fund	22	276
Emerging Markets Bond ESG Fund	23	294
Emerging Markets Corporate Bond Fund	24	310
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	25	320
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	26	334
PIMCO ESG Income Fund	27	347
Euro Bond Fund	28	358
Euro Credit Fund	19	366
Euro Income Bond Fund	30	372
Euro Long Average Duration Fund	31	382
Euro Short-Term Fund	32	388
PIMCO European High Yield Bond Fund	33	393
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	34	400
Global Advantage Fund	35	406
Global Bond Fund	36	422
Global Bond ESG Fund	37	445
Global Bond Ex-US Fund	39	460
Global High Yield Bond Fund	40	475
Global Investment Grade Credit Fund	41	485
Global Investment Grade Credit ESG Fund	43	506
Global Low Duration Real Return Fund	44	520
Global Real Return Fund	45	528

TEILFONDS	Teilfonds- überblick*	Aufstellung der Wertpapiieranlagen
Income Fund	46	538
Income Fund II	48	576
Inflation Multi-Asset Fund	49	583
Low Average Duration Fund	50	592
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	51	599
Low Duration Income Fund	52	609
Low Duration Opportunities Fund	53	625
Low Duration Opportunities ESG Fund	54	636
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	55	640
Mortgage Opportunities Fund	56	643
StocksPLUS™ Fund	57	652
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	58	660
Strategic Income Fund	59	666
Total Return Bond Fund	60	683
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	61	697
UK Corporate Bond Fund	62	711
UK Long Term Corporate Bond Fund	63	719
US High Yield Bond Fund	64	725
US Investment Grade Corporate Bond Fund	65	734
US Short-Term Fund	66	745

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

* Dieses Dokument enthält die Meinungen der Gesellschaft, und diese Meinungen können sich ohne Vorankündigung ändern. Dieses Material wurde ausschließlich zu Informationszwecken verteilt. Prognosen, Schätzungen und bestimmte hierin enthaltene Informationen beruhen auf firmeneigenem Research und sollten nicht als Anlageberatung oder Empfehlung eines bestimmten Wertpapiers, einer bestimmten Strategie oder eines bestimmten Anlageprodukts erachtet werden. In einem 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. ©2024, PIMCO.

Sehr geehrte Anteilinhaber,

Dieser Jahresbericht bezieht sich auf den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 (der „Berichtszeitraum“). Auf den nachfolgenden Seiten finden Sie Einzelheiten zu den Anlageergebnissen sowie eine Erörterung der jeweiligen Faktoren, die während des Berichtszeitraums die Wertentwicklung beeinflussten.

Die Weltwirtschaft verzeichnete trotz der unvermindert hohen Inflation, Zinserhöhungen, strafferen Kreditbedingungen und geopolitischen Sorgen, die viele Länder betreffen, weiterhin ein Wachstum. Diese Widerstandsfähigkeit zeigte sich vor allem in den Vereinigten Staaten („USA“). Dagegen verzeichneten einige europäische Volkswirtschaften zuletzt ein relativ flaches Wachstum.

Die Zentralbanken drosselten die Zinserhöhungen

Die Inflation ließ im Berichtszeitraum nach, und mehrere Zentralbankvertreter deuteten an, dass sich die aggressiven Zinserhöhungen verlangsamen könnten. Von März 2022 bis Juli 2023 erhöhte die US-Notenbank (die „Fed“) den Leitzins um insgesamt 5,25 Prozentpunkte. Im September, November und Dezember 2023 hob die Fed die Zinsen nicht an. Im Dezember 2023 deutete die Fed in ihrer Kommunikation an, dass der Leitzins auf oder nahe dem Höhepunkt des Straffungszyklus liegen dürfte. Von Juli 2022 bis September 2023 erhöhte die Europäische Zentralbank („EZB“) ihren Tagesgeldsatz um insgesamt 4,50 Prozentpunkte und hielt die Zinsen bei ihren Sitzungen im Oktober und Dezember 2023 stabil. Unterdessen erhöhte die Bank of England („BoE“) von Dezember 2019 bis Juli 2023 ihren Leitzins um insgesamt 5,15 Prozentpunkte und drehte im September, November und Dezember 2023 nicht an der Zinsschraube. Sowohl die EZB als auch die BoE bestätigten die Möglichkeit von Zinssenkungen im Jahr 2024.

Uneinheitliche Finanzmarktrenditen

Die Rendite der als Benchmark dienenden 10-jährigen US-Staatsanleihen stieg im Berichtszeitraum. In vielen anderen Industrieländern schwankten die Renditen 10-jähriger Staatsanleihen. Insgesamt erholte sich der globale Rentenmarkt gegen Ende 2023, unterstützt durch die Verlautbarungen der Zentralbankvertreter, die ein mögliches Ende der geldpolitischen Straffung signalisierten. Während des Berichtszeitraums entwickelten sich globale Anleihen mit niedrigerem Rating im Allgemeinen besser als ihre höher bewerteten Pendanten. Globale Aktien legten deutlich zu, während die Rohstoffe angesichts der wirtschaftlichen Unsicherheiten gemischt waren. Der US-Dollar wertete gegenüber dem japanischen Yen auf, fiel jedoch gegenüber dem Euro und dem britischen Pfund.

Wir arbeiten weiterhin sorgfältig daran, die dynamischen globalen Märkte zu navigieren und die Vermögenswerte, die Sie uns anvertraut haben, zu verwalten. Wir empfehlen Ihnen, mit Ihrem Finanzberater über Ihre Ziele zu sprechen und unsere neuesten Erkenntnisse auf global.pimco.com zu konsultieren.

Mit freundlichem Gruß



Craig A. Dawson
Vorsitzender

Quelle: Trading Economics

Aussagen über Finanzmarktrends basieren auf aktuellen Marktbedingungen, die schwanken können. Es kann nicht garantiert werden, dass diese Anlagestrategien unter allen Marktbedingungen funktionieren werden oder für alle Anleger geeignet sind, und individuelle Anleger sollten ihre Fähigkeit zu langfristigen Investitionen, insbesondere in Zeiten von Marktabschwüngen, bewerten. Ausblick und Strategien können sich ohne Vorankündigung ändern.

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 gemagneteten Index kann man nicht direkt anlegen.

Gesamtrenditen bestimmter Anlageklassen für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023	
Anlageklasse (gemessen durch, Währung)	12 Monate
U.S. large cap equities (S&P 500 Index. USD)	26,29 %
Global equities (MSCI World Index. USD)	23,79 %
European equities (MSCI Europe Index. EUR)	15,83 %
Emerging market equities (MSCI Emerging Markets Index. EUR)	9,83 %
Japanese equities (Nikkei 225 Index. JPY)	30,90 %
Emerging market local bonds (JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index. USD Unhedged)	12,70 %
Emerging market external debt (JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global. USD Hedged)	10,45 %
Below investment grade bonds (ICE BofAML Developed Markets High Yield Constrained Index. USD Hedged)	13,78 %
Global investment grade credit bonds (Bloomberg Global Aggregate Credit Index. USD Hedged)	8,68 %
Fixed-rate. local currency government debt of investment grade countries (Bloomberg Global Treasury Index. USD Hedged)	6,72 %

Zum 31. Dezember 2023. QUELLE: PIMCO. US-Large-Cap-Aktien, dargestellt durch den S&P 500 Index, globale Aktien, dargestellt durch den MSCI World Index, europäische Aktien, dargestellt durch den MSCI Europe Index, Schwellenländeraktien, dargestellt durch den MSCI Emerging Markets Index, japanische Aktien, dargestellt durch den Nikkei 225 Index, lokale Schwellenländeranleihen, dargestellt durch den JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index, Auslandsschulden von Schwellenländern, dargestellt durch den JPMorgan Emerging Markets Bond Index, Anleihen unterhalb von Investment Grade, dargestellt durch den ICE BofAML Developed Markets High Yield Constrained Index, globale Anleihen mit Investment-Grade-Rating, dargestellt durch den Bloomberg Global Aggregate Credit Index, festverzinsliche, auf Lokalwährung lautende staatliche Schuldtitel von Ländern mit Investment-Grade-Rating, dargestellt durch den Bloomberg Global Treasury Index.

Nur zu illustrativen Zwecken. Bitte beachten Sie, dass die vorgenannten Indizes nicht für das aktive Management eines Fonds verwendet werden. Sie dienen lediglich zu Informationszwecken und zur Darstellung des Marktumfelds.

Wichtige Angaben zu den Teilfonds

Dieses Dokument darf nur in Verbindung mit dem aktuellen Verkaufsprospekt der PIMCO Funds: Global Investors Series plc verwendet werden. Anleger sollten vor einer Anlage in den Teilfonds 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 Teilfonds gehaltenen Rentenpapiere voraussichtlich an Wert verlieren. Die Kursschwankungsintensität von Rentenpapieren kann in Zeiten steigender Zinsen ebenfalls zunehmen und dadurch zu erhöhten Verlusten für die Teilfonds führen. Anleihe-Fonds und einzelne Anleihen mit einer längeren Duration (ein Maß zur Bestimmung der Sensitivität des Kurses eines Wertpapiers gegenüber Zinsänderungen) neigen zu stärkeren Reaktionen auf Zinssatzänderungen, was sie gewöhnlich schwankungsanfälliger macht als Wertpapiere oder Teilfonds 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 Teilfonds können zusätzlich zu den vorstehend, im Verkaufsprospekt der Teilfonds und im Abschnitt „Finanzrisiken“ in den Erläuterungen zum Abschluss beschriebenen Risiken weiteren Risiken unterliegen. Bei einigen dieser Risiken kann es sich unter anderem um folgende handeln: Realzinsrisiko, Derivatrisiko, die mit kleinen Unternehmen, Auslandswertpapieren und Hochzinsspapieren verbundenen Risiken, die mit einem bestimmten Sektor einhergehenden Anlagerisiken und die Risiken in Verbindung mit einer Epidemie/Pandemie. Die Teilfonds 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 Teilfonds eine Position nicht dann glattstellen kann, wenn es für ihn am vorteilhaftesten wäre. Teilfonds, 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 Anleihekaptal 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 Teilfonds mit einem zusätzlichen Risiko und einer zusätzlichen Volatilität einhergehen.

Bestimmte Teilfonds können eine ESG-Anlagestrategie (Umwelt, Soziales und Unternehmensführung) verfolgen, die Wertpapiere bestimmter Emittenten in der Regel aus anderen Gründen als der finanziellen Performance auswählt oder ausschließt. Diese Strategie birgt das Risiko, dass die Wertentwicklung eines Teilfonds von ähnlichen Teilfonds, die keine ESG-Anlagestrategie verwenden, abweicht. Der Einsatz einer solchen Strategie könnte sich beispielsweise auf das Engagement eines Teilfonds in bestimmten Sektoren oder Anlagearten auswirken, was die Wertentwicklung eines Teilfonds potenziell beeinträchtigt. Es besteht keine Garantie, dass die von der Anlageberatungsgesellschaft verwendeten Faktoren die Meinungen eines bestimmten Anlegers widerspiegeln, und die von der Anlageberatungsgesellschaft verwendeten Faktoren können von denjenigen abweichen, die ein bestimmter Anleger bei der Beurteilung der ESG-Praktiken eines Emittenten für relevant hält. Die zukünftige ESG-Entwicklung und -Regulierung können sich auf die Umsetzung der Anlagestrategie eines Teilfonds auswirken. Darüber hinaus können sich Kosten aus ESG-bezogenen Sorgfaltsprüfungen, vermehrten Berichten und der Inanspruchnahme externer ESG-Datenanbieter ergeben.

Die Klassifizierung der Portfoliopositionen eines Teilfonds in diesem Bericht erfolgt gemäß geltenden Standards für die Finanzberichterstattung. Die Einstufung einer bestimmten Portfolioposition im Abschnitt mit der Aufstellung der Wertpapieranlagen sowie in anderen Abschnitten dieses Berichts kann von der Einstufung abweichen, die für die Compliance-Berechnungen eines Teilfonds verwendet wird, einschließlich derjenigen, die jeweils im Verkaufsprospekt, in den Anlagezielen oder in aufsichtsrechtlichen und anderen Anlagebeschränkungen und -richtlinien des Teilfonds verwendet werden, welche gegebenenfalls auf anderen Klassifizierungen in Bezug auf Anlageklassen, Sektoren oder geografische Regionen beruhen können. Alle Teilfonds werden bezüglich der Einhaltung der im Verkaufsprospekt sowie in maßgeblichen Vorschriften enthaltenen Anforderungen separat überwacht. In der Aufstellung der Wertpapieranlagen können spezifische Portfoliobestände zusammengefasst werden, wenn die Anlagen dieselben Attribute (d. h. Anleihezinssätze 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 Teilfonds 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. In Anbetracht der schrittweisen Einstellung der Verwendung des LIBOR müssen die betreffenden Teilfonds auf einen anderen Referenzwert umstellen (z. B. des besicherten Tagesgeldsatzes (Secured Overnight Financing Rate), der den USD-LIBOR ersetzen soll und die Kosten von Übernachtskrediten in der Form von mit US-Schatzpapieren besicherten Pensionsgeschäften misst). Die möglichen Auswirkungen des Übergangs weg vom LIBOR auf einen Fonds oder auf bestimmte Wertpapiere und Instrumente, in die ein Fonds investiert, lassen sich gegebenenfalls nur mit Schwierigkeiten ermitteln, und sie können in Abhängigkeit von verschiedenen Faktoren unterschiedlich ausfallen. Der Übergang kann außerdem zu einer Verringerung des Werts bestimmter von einem Teilfonds gehaltener Anlagen oder zu einer Verringerung der Wirksamkeit damit verbundener Teilfondstransaktionen wie z.B. Absicherungen führen. Derartige Auswirkungen des Übergangs weg vom LIBOR sowie andere unvorhergesehene Auswirkungen könnten dazu führen, dass ein Teilfonds Verluste erleidet.

Auf den Überblicksseiten der einzelnen Teilfonds in diesem Jahresbericht wird die Nettoperformance unter der Annahme erfasst, dass alle Dividenden- und Kapitalgewinnausschüttungen reinvestiert wurden. Die Renditen spiegeln nicht den Abzug von Steuern wider, die ein Anteilhaber zahlen würde: (i) auf Ausschüttungen des Teilfonds; oder (ii) auf die Rücknahme von Teilfondsanteilen. Die Nettoperformancetabelle misst die Wertentwicklung jedes Teilfonds im Vergleich zur Wertentwicklung eines breit angelegten Wertpapiermarkindex (Vergleichsindex). Die frühere Wertentwicklung jedes Teilfonds vor und nach Steuern ist nicht unbedingt ein Indikator dafür, wie sich der Teilfonds in Zukunft entwickeln wird. Anlagen in einem Teilfonds gelten nicht als Bankeinlagen und werden nicht von einer behördlichen Stelle verbürgt oder versichert. Der Wert der und die Einkünfte aus den Anteilen am Teilfonds können steigen oder sinken, und eventuell erhalten Sie nicht den ursprünglich in den Teilfonds investierten Betrag zurück.

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

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

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 14. Feb. 2019)	0,45 %	(2,27 %)
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2019)	0,42 %	(2,26 %)
Investor, thesaurierend (Auflegung: 25. Mai 2021)	0,13 %	(10,42 %)
Investor, ausschüttend (Auflegung: 20. Aug. 2020)	0,06 %	(6,55 %)
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2019)	(0,08 %)	(2,75 %)
Class E, thesaurierend (Auflegung: 01. Jul. 2020)	(0,49 %)	(5,74 %)
Class E, ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2019)	(0,48 %)	(3,14 %)
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Mrz. 2021)	0,26 %	(8,85 %)
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 12. Mrz. 2021)	0,18 %	(8,85 %)
M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 14. Feb. 2019)	(0,43 %)	(3,14 %)
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 14. Feb. 2019)	1,20 %	(1,61 %)
JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index	4,76 %	(2,18 %) ²
Auf AUD lautende Klassen		
Institutional AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Jul. 2021)	(1,57 %)	(10,04 %)
Investor AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Sep. 2020)	(2,01 %)	(7,40 %)
JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (AUD Hedged)	2,47 %	(7,19 %) ²
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 23. Okt. 2020)	(3,73 %)	(8,66 %)
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Okt. 2020)	(3,75 %)	(8,66 %)
Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 23. Okt. 2020)	(4,59 %)	(9,48 %)
Class E CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Okt. 2020)	(4,61 %)	(9,48 %)
JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (CHF Hedged)	0,36 %	(8,54 %)
Auf CNH lautende Klassen		
Investor RMB (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 09. Okt. 2020)	(2,83 %)	(6,59 %)
JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (CNH Hedged)	1,71 %	(6,09 %)
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Sep. 2020)	(1,79 %)	(7,73 %)
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Sep. 2020)	(1,82 %)	(7,71 %)
Investor EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 10. Sep. 2020)	(2,21 %)	(8,44 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Sept. 2020)	(2,60 %)	(8,51 %)
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Sep. 2020)	(2,69 %)	(8,52 %)
JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (EUR Hedged)	2,32 %	(8,14 %) ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Jul. 2021)	(0,26 %)	(9,69 %)
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 06. Mai 2021)	(0,31 %)	(10,22 %)
JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (GBP Hedged)	3,77 %	(9,98 %) ²
Auf HKD lautende Klassen		
Class E HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2019)	(0,52 %)	(3,23 %)
M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend II (Auflegung: 14. Feb. 2019)	(0,47 %)	(3,24 %)
JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (HKD Unhedged)	4,81 %	(2,28 %)
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Jul. 2021)	(1,08 %)	(9,61 %)
Investor SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 20. Aug. 2020)	(1,34 %)	(6,94 %)
Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2019)	(1,94 %)	(3,63 %)
M Retail SGD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 14. Feb. 2019)	(2,00 %)	(3,63 %)
JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (SGD Hedged)	3,05 %	(2,87 %) ²

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO Asia High Yield Bond Fund strebt eine maximale Gesamterträge bei umsichtiger Anlageverwaltung an, indem er in einen Mix aus festverzinslichen Instrumenten (wie im Verkaufsprospekt definiert) von Emittenten, die wirtschaftlich mit asiatischen Ländern, ausgenommen Japan, verbunden sind, sowie verbundenen Derivaten auf diese Wertpapiere investiert. Vom Teilfonds 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 Teilfonds

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

- » Die Titelauswahl bei taktischen Unternehmensanleihen außerhalb der Schwellenmärkte trug zur relativen Wertentwicklung bei.
- » Das übergewichtete Engagement in ausgewählten koreanischen Industriekrediten leistete einen Beitrag zur relativen Wertentwicklung.
- » Die Untergewichtung von Immobilien in Hongkong wirkte sich positiv auf die relative Wertentwicklung aus.
- » Die Titelauswahl im chinesischen Immobiliensektor belastete die relative Wertentwicklung.
- » Die Titelauswahl bei quasi-staatlichen Schwellenmarkt-Schuldtiteln aus Asien war der relativen Wertentwicklung abträglich.
- » Das untergewichtete Engagement in Staatsanleihen aus Sri Lanka war für die relative Wertentwicklung von Nachteil.

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

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

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 02. Mai 2023)	—	2,60 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 04. Sep. 2020)	4,55 %	(2,51 %)
Investor, thesaurierend (Auflegung: 02. Mai 2023)	—	2,40 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 27. Jul. 2023)	—	3,70 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 04. Sep. 2020)	3,60 %	(3,35 %)
Class E, ausschüttend (Auflegung: 01. Jun. 2010)	3,62 %	2,39 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 01. Dez. 2020)	5,11 %	(2,50 %)
JPMorgan Asia Credit Index ³	7,02 %	3,29 % ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Mai 2023)	—	1,30 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 05. Mrz. 2021)	2,40 %	(5,15 %)
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Mai 2023)	—	1,10 %
Investor EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 27. Jul. 2023)	—	2,89 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Mrz. 2021)	1,45 %	(5,95 %)
JPMorgan Asia Credit Index (EUR Hedged) ³	4,67 %	(4,09 %) ²
Auf EUR lautende Klassen (nicht abgesichert)		
Class E EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 03. Jun. 2011)	0,14 %	2,82 %
JPMorgan Asia Credit Index (EUR Unhedged) ³	3,40 %	4,18 %
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 13. Aug. 2021)	3,77 %	(5,03 %)
JPMorgan Asia Credit Index (GBP Hedged) ³	6,11 %	(3,78 %)
Auf HKD lautende Klassen		
Class E HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 04. Sep. 2020)	3,71 %	(3,11 %)
M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Mrz. 2011)	3,71 %	1,07 %
JPMorgan Asia Credit Index (HKD Unhedged) ³	7,23 %	2,24 % ²
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 09. Okt. 2020)	3,05 %	(2,77 %)
Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 09. Okt. 2020)	2,17 %	(3,60 %)
JPMorgan Asia Credit Index (SGD Hedged) ³	5,41 %	(2,33 %)

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

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Asia Strategic Interest Bond Fund strebt die Erwirtschaftung attraktiver und stabiler Erträge an. Der langfristige Kapitalzuwachs gilt als sekundäres Anlageziel. Der Teilfonds kann bis zu 50 % seines Gesamtvermögens in hochverzinsliche Rentenpapiere (wie im Verkaufsprospekt definiert) investieren. Der Teilfonds 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 Teilfonds

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

- » Das Engagement in Unternehmenskrediten außerhalb von China/Hongkong trug zur absoluten Wertentwicklung bei.
- » Das Engagement in asiatischen Staatsanleihen der Schwellenmärkte trug zur absoluten Wertentwicklung bei.
- » Das Engagement in quasi-staatlichen Schuldtiteln asiatischer Schwellenmärkte leistete einen Beitrag zur absoluten Wertentwicklung.
- » Das Engagement in hochverzinslichen Unternehmensanleihen aus China/Hongkong belastete die absolute Wertentwicklung, insbesondere aufgrund von chinesischen Immobilien.
- » Es gab keine weiteren wesentlichen Verlustbringer für diesen Fonds.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Apr. 2009)	11,40 %	5,50 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 24. Sep. 2010)	11,00 %	3,72 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 22. Jun. 2009)	10,06 %	4,02 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Jan. 2011)	10,08 %	2,63 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Apr. 2022)	11,24 %	2,90 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2022)	11,16 %	2,86 %
M Retail, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2023)	—	4,10 %
M Retail, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2023)	—	4,07 %
M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 30. Nov. 2023)	—	4,10 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 06. Jul. 2016)	12,43 %	6,96 %
60 % MSCI All Country World Index/40 % Bloomberg U.S. Aggregate Index ³	16,36 %	7,86 % ²
Auf CNH lautende Klassen		
Institutional RMB (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2023)	—	3,47 %
Institutional RMB (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2023)	—	3,46 %
60 % MSCI All Country World Index/40 % Bloomberg U.S. Aggregate Index (RMB Hedged) ³	—	3,76 %
Auf CNH lautende Klassen (nicht abgesichert)		
Institutional RMB (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2023)	—	3,83 %
Institutional RMB (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2023)	—	3,82 %
60 % MSCI All Country World Index/40 % Bloomberg U.S. Aggregate Index ³	—	4,11 %
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Apr. 2009)	9,02 %	4,54 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 22. Jun. 2009)	7,67 %	3,06 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 24. Jun. 2011)	7,77 %	1,54 %
60 % MSCI All Country World Index/40 % Bloomberg U.S. Aggregate Index (EUR Hedged) ³	13,65 %	6,69 % ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Apr. 2010)	10,61 %	3,89 %
60 % MSCI All Country World Index/40 % Bloomberg U.S. Aggregate Index (GBP Hedged) ³	15,15 %	6,14 %
Auf HKD lautende Klassen		
M Retail HKD (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2023)	—	4,00 %
M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2023)	—	4,07 %
M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend II (Auflegung: 30. Nov. 2023)	—	4,00 %
60 % MSCI All Country World Index/40 % Bloomberg U.S. Aggregate Index ³	—	4,39 %
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2023)	—	3,70 %
M Retail SGD (Hedged) ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2023)	—	3,67 %
M Retail SGD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 30. Nov. 2023)	—	3,70 %
60 % MSCI All Country World Index/40 % Bloomberg U.S. Aggregate Index (SGD Hedged) ³	—	3,82 %

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

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

³ Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den PIMCO Balanced Income and Growth Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis zum 29. November 2023: 60 % MSCI All Country World Index / 40 % Bloomberg Global Aggregate USD Hedged; ab 30. November 2023: 60 % MSCI All Country World Index und 40 % Bloomberg U.S. Aggregate Index.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Teilfonds

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

- » Ein Long-Engagement bei US-Aktien trug zur Wertentwicklung bei, da US-Aktien während des Berichtszeitraums positiv abschnitten.
- » Ein Long-Engagement bei japanischen Aktien leistete einen Beitrag zur Wertentwicklung, da japanische Aktien während des Berichtszeitraums positive Erträge auswiesen.
- » Ein Long-Engagement in taiwanesischen Aktien wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus, da taiwanesischen Aktien während des Berichtszeitraums positive Erträge auswiesen.
- » Ein Long-Engagement in chinesischen Aktien war der Wertentwicklung abträglich, da der Sektor während des Berichtszeitraums negative Erträge auswies.
- » Das Long-Engagement in Agency Mortgage-Backed Securities („MBS“) war der Wertentwicklung abträglich, da das Engagement des Teilfonds in Zeiträumen erhöht war, in denen sich die Spreads stärker ausweiteten als in Zeiträumen mit einer Verengung der Spreads.
- » Das Long-Engagement im japanischen Yen („JPY“) war der Wertentwicklung abträglich, da der JPY während des Berichtszeitraums gegenüber dem US-Dollar („USD“) an Wert verlor.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jul. 2013)	9,10 %	5,13 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 23. Sep. 2014)	9,08 %	4,34 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 19. Mai 2014)	8,72 %	3,91 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 19. Mai 2014)	8,80 %	3,92 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 09. Aug. 2013)	8,55 %	4,54 %
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 09. Aug. 2013)	8,51 %	4,53 %
Administrative, ausschüttend II (Auflegung: 12. Aug. 2022)	8,53 %	4,57 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 28. Okt. 2013)	8,12 %	3,91 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 19. Mai 2014)	8,12 %	3,36 %
M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 23. Dez. 2013)	8,11 %	3,70 %
Class R, ausschüttend (Auflegung: 18. Mrz. 2014)	8,91 %	4,24 %
Class T, ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	7,68 %	3,28 %
Class Z, ausschüttend (Auflegung: 31. Okt. 2013)	9,89 %	5,63 %
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index ³	5,20 %	1,46 % ²
Auf AUD lautende Klassen		
Investor AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Mai 2018)	6,87 %	2,17 %
Class Z AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 11. Aug. 2015)	8,23 %	4,55 %
Bloomberg AusBond Bank Bills Index	3,89 %	1,62 % ²
Auf BRL lautende Klassen		
Institutional BRL (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Jan. 2018)	26,09 %	0,72 %
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (BRL Hedged) ³	21,60 %	0,02 %
Auf CAD lautende Klassen		
Investor CAD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Jun. 2018)	7,99 %	2,99 %
Canadian Overnight Repo Rate (CORRA) ⁴	4,86 %	1,83 %
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Aug. 2013)	4,57 %	2,79 %
Class E CHF (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. Jun. 2014)	3,65 %	0,79 %
ICE BofA SARON Overnight Rate Index ⁵	1,49 %	(0,57 %) ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Aug. 2013)	6,84 %	3,36 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 09. Aug. 2013)	6,87 %	3,36 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 29. Jul. 2014)	6,90 %	2,39 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 26. Feb. 2016)	6,52 %	2,97 %
Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Aug. 2013)	6,33 %	2,84 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Okt. 2013)	5,94 %	2,20 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2015)	5,89 %	1,37 %
Class R EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Jun. 2014)	6,72 %	2,14 %
Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	5,44 %	1,27 %
Euro Short-Term Rate (ESTER) Index ⁶	3,29 %	0,13 % ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Aug. 2013)	8,44 %	4,17 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Jul. 2013)	8,46 %	4,24 %
Investor GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2020)	8,09 %	0,24 %
Class R GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Jun. 2014)	8,28 %	2,98 %
ICE BofA SONIA Overnight Rate Index ⁷	4,78 %	0,98 % ²

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO Capital Securities Fund strebt Engagements mit Fokus auf Capital Securities (wie im Verkaufsprospekt definiert) zusammen mit einer maximalen Gesamterträge an, in Übereinstimmung mit der Kapitalerhaltung und umsichtigen Anlageverwaltung durch die Anlage in ein aktiv verwaltetes, aus Rentenwerten bestehendes Portfolio (wie im Verkaufsprospekt definiert) und andere Wertpapiere, von denen gemäß den im Verkaufsprospekt des Teilfonds angegebenen Richtlinien mindestens 80 % in Capital Securities angelegt werden. Mit dem Teilfonds werden ökologische oder soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen angestrebt.

Kommentare zum Teilfonds

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

- » Das Engagement in zusätzliche Tier 1-Anleihen und insbesondere die Auswahl britischer, niederländischer, spanischer und französischer Emittenten trugen zur Wertentwicklung bei, da die Zinssätze stiegen und sich die Spreads verengten.
- » Das Engagement in erstrangigen Finanztiteln und insbesondere in ausgewählten Emittenten aus der Schweiz, Großbritannien und Italien leistete dank niedrigerer Renditen und engerer Spreads einen Beitrag zur Wertentwicklung.
- » Das Engagement in Tier-2-Anleihen, insbesondere in italienischen und deutschen Emittenten, steigerte aufgrund einer Kombination aus starken Ergebnissen, Rating-Hochstufungen und einer erfolgreichen Kapitalerhöhung die Wertentwicklung.
- » Engagement in AT1s, die von einer Schweizer Bank begeben und nach der Übernahme durch einen lokalen Wettbewerber abgeschlossen wurden.
- » Es gab keine weiteren wesentlichen Verlustbringer für diesen Teilfonds.

Durchschnittliche jährliche Gesamterrendite für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹
(Forts.)

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf HKD lautende Klassen		
M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Jul. 2017)	8,23 %	2,63 %
3 Month HIBOR Index	4,85 %	1,91 %
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Jul. 2021)	7,53 %	(1,93 %)
Investor SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Mai 2018)	7,16 %	2,71 %
Administrative SGD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 12. Aug. 2022)	7,00 %	3,41 %
M Retail SGD (Hedged) ausschüttend II (Auflegung: 23. Dez. 2013)	6,64 %	3,40 %
SORA Singapore Interbank Overnight Rate Average ⁸	3,76 %	1,35 % ²

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

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

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

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

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

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

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

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

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 23. Sep. 2020)	8,62 %	(1,30 %)
Investor, thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2023)	—	7,20 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 23. Sep. 2020)	9,18 %	(0,77 %)
Bloomberg MSCI Green Bond Index (USD Hedged)	9,55 %	(3,12 %) ²
Auf AUD lautende Klassen		
Institutional AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 17. Apr. 2023)	—	4,72 %
Bloomberg MSCI Green Bond Index (AUD Hedged)	—	5,79 %
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 13. Nov. 2020)	3,92 %	(4,17 %)
Bloomberg MSCI Green Bond Index (CHF Hedged)	4,79 %	(6,13 %)
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 23. Sep. 2020)	6,32 %	(2,91 %)
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 02. Dez. 2020)	6,40 %	(3,35 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 23. Sept. 2020)	5,38 %	(3,77 %)
Bloomberg MSCI Green Bond Index (EUR Hedged)	7,07 %	(4,83 %) ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 23. Sep. 2020)	7,68 %	(1,91 %)
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Apr. 2021)	7,80 %	(2,45 %)
Bloomberg MSCI Green Bond Index (GBP Hedged)	8,59 %	(3,85 %) ²
Auf SEK lautende Klassen		
Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2021)	6,27 %	(3,89 %)
Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Okt. 2021)	5,73 %	(4,76 %)
Bloomberg MSCI Green Bond Index (SEK Hedged)	7,20 %	(5,58 %) ²
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 26. Feb. 2021)	6,95 %	(2,19 %)
Bloomberg MSCI Green Bond Index (SGD Hedged)	7,83 %	(3,91 %)

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO Climate Bond Fund strebt optimale risikobereinigte Renditen bei umsichtiger Vermögensverwaltung an und berücksichtigt dabei langfristige klimabezogene Risiken und Chancen. Der Teilfonds 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 Teilfonds

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

- » Eine Verengung der Spreads und ein positiver Carry bei Schuldtiteln mit Investment Grade, insbesondere bei Finanzwerten und Versorgern, trugen zur absoluten Wertentwicklung bei.
- » Eine Verengung der Spreads und ein positiver Carry bei hochverzinslichen Unternehmensanleihen leisteten einen Beitrag zur absoluten Wertentwicklung.
- » Das Long-Engagement in Hartwährungsanleihen aus Schwellenländern, insbesondere im Versorgungssektor, war der absoluten Wertentwicklung zuträglich, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere verengten.
- » Das Long-Engagement bezogen auf die US-Duration belastete die absolute Wertentwicklung, da die Renditen am vorderen Ende der Kurve stiegen.
- » Das Long-Engagement in staatsnahen Anleihen beeinträchtigte die absolute Wertentwicklung, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere ausweiteten.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Aug. 2006)	(7,77 %)	(0,67 %)
Investor, thesaurierend (Auflegung: 11. Aug. 2011)	(8,05 %)	(2,14 %)
Class E, thesaurierend (Auflegung: 21. Sep. 2007)	(8,55 %)	(1,98 %)
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Apr. 2022)	(7,92 %)	(13,86 %)
Bloomberg Commodity Index Total Return	(7,91 %)	(1,92 %) ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Jun. 2010)	(9,90 %)	(1,23 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 07. Mrz. 2012)	(10,71 %)	(3,68 %)
Bloomberg Commodity Index Total Return (EUR Hedged)	(10,07 %)	(2,35 %) ²
Auf EUR lautende Klassen (nicht abgesichert)		
Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 11. Jun. 2021)	(10,94 %)	7,01 %
Bloomberg Commodity Index Total Return (EUR Unhedged)	(11,10 %)	8,23 %
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 01. Mrz. 2017)	(8,43 %)	2,78 %
Bloomberg Commodity Index Total Return (GBP Hedged)	(8,61 %)	2,13 %
Auf GBP lautende Klassen (nicht abgesichert)		
Institutional GBP (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 11. Nov. 2022)	(12,99 %)	(15,43 %)
Bloomberg Commodity Index Total Return (GBP Unhedged)	(13,09 %)	(15,49 %)
Auf SGD lautende Klassen		
Class E SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Dez. 2021)	(9,99 %)	0,88 %
Bloomberg Commodity Index Total Return (SGD Hedged)	(9,40 %)	3,68 %

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Commodity Real Return Fund ist bemüht, einen höchstmöglichen Gesamtertrag bei umsichtiger Anlageverwaltung zu erreichen, indem er in (börsennotierte oder im Freiverkehr (OTC) gehandelte) derivative Instrumente investiert. Hierbei kann es sich um Swaps, Futures, Optionen auf Futures und strukturierte Schuldverschreibungen sowie rohstoffindexgebundene Schuldverschreibungen handeln, die es ihm ermöglichen, ein Engagement in Indizes und Teilindizes (einschließlich unter anderem bei Indizes der Bloomberg Commodity-Indexfamilie) einzugehen, die sich auf Rohstoffe beziehen, die die Anforderungen der irischen Zentralbank erfüllen und gegebenenfalls von dieser freigegeben wurden. Nähere Einzelheiten zu den vom Teilfonds verwendeten Indizes sowie zu den Arten von Rohstoffen, auf die diese sich beziehen, sind auf Anfrage von der Anlageberatungsgesellschaft 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 Teilfonds kann außerdem in Stamm- und Vorzugsaktien sowie in wandelbare Wertpapiere von Emittenten in rohstoffbezogenen Branchen investieren.

Kommentare zum Teilfonds

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

- » Aktive Rohstoffstrategien, darunter ein Engagement in California Carbon Allowances (CCAs) und eine Untergewichtung von Erdgas, trugen zur relativen Wertentwicklung bei, da die CCAs eine Outperformance aufwiesen, während Erdgas hinter dem breiteren Bloomberg Commodity Index zurückblieb.
- » Durationsstrategien in Europa, vor allem das Engagement in Swap-Spreads der Eurozone, als sich die Spreads verengten, waren der relativen Wertentwicklung zuträglich.
- » Ein Engagement in verbrieften Krediten, insbesondere in besicherten Schuldverschreibungen (CDOs), trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die CDO-Spreads verengten.
- » Die strukturelle Allokation in globalen kurzfristigen inflationsgebundenen Anleihen (ILBs) als Sicherheiten zur Deckung des Rohstoffengagements des Teilfonds war für die relative Wertentwicklung negativ, da sich globale kurzfristige TIPS, gemessen am Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (USD Hedged), schwächer entwickelten als die als Sicherheit innerhalb des Rohstoffindex dienenden dreimonatigen US-Schatzwechsel.
- » Ein untergewichtetes Engagement in japanischen Zinsen für Staatsanleihen in der ersten Hälfte des Berichtszeitraums war der relativen Wertentwicklung abträglich, da die Finanzierungskosten der Position die Wertentwicklung schmälerten.
- » Eine Übergewichtung der italienischen Breakeven-Inflation schmälerte die relative Wertentwicklung, da die italienischen Breakeven-Werte fielen.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 14. Okt. 2011)	8,77 %	3,24 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 21. Dez. 2012)	7,86 %	1,73 %
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index ³	5,20 %	1,31 % ²
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Dez. 2012)	4,49 %	0,62 %
ICE BofA SARON Overnight Rate Index ⁴	1,49 %	(0,55 %)
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Okt. 2011)	6,54 %	1,88 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Dez. 2012)	5,54 %	0,26 %
Euro Short-Term Rate (ESTER) Index ⁵	3,29 %	0,21 % ²

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

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

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

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Teilfonds

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

- » Makrostrategien und insbesondere Long-Engagement in US-Kassakurven und US-Kurvenpositionierung waren der Wertentwicklung zuträglich.
- » Ein Long-Engagement in Industriesektoren und insbesondere in ausgewählten Emittenten aus den Sektoren Immobilien und Investitionsgüter trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Ein Long-Engagement bei hochverzinslichen Schultiteln trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Ein Long-Engagement bei Agency-Hypothekentiteln und ausgewählten verbrieften Vermögenswerten schmälerte die Wertentwicklung, da sich die Spreads ausweiteten.
- » Ein Short-Engagement in CDS-Indizes belastete die Wertentwicklung, da sich die Spreads verengten.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2005)	9,48 %	5,24 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 08. Sep. 2008)	9,48 %	5,27 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 30. Apr. 2013)	9,14 %	2,50 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 30. Apr. 2013)	9,03 %	2,49 %
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 21. Jul. 2011)	8,98 %	3,38 %
BM Retail, dekulmulierend (Auflegung: 21. Dez. 2023)	—	0,25 %
BM Retail, ausschüttend II (Auflegung: 28. Apr. 2022)	7,44 %	0,49 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 11. Sep. 2006)	8,49 %	4,25 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 31. Jul. 2006)	8,49 %	4,33 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 08. Jun. 2011)	9,30 %	3,70 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 14. Mai 2020)	9,31 %	0,63 %
M Retail, dekulmulierend (Auflegung: 21. Dez. 2023)	—	0,25 %
M Retail, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2010)	8,53 %	3,20 %
M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 23. Dez. 2013)	8,46 %	2,46 %
N Retail, ausschüttend II (Auflegung: 30. Okt. 2020)	8,60 %	(2,13) %
Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	8,05 %	1,82 %
Class T, ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	8,10 %	1,83 %
Class W, thesaurierend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	9,63 %	(1,32) %
Class W, ausschüttend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	9,65 %	(1,32) %
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	10,84 %	5,13 % ²
Auf AUD lautende Klassen		
M Retail AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 19. Dez. 2012)	6,57 %	2,32 %
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	8,72 %	3,38 %
Auf CAD lautende Klassen		
Institutional CAD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Feb. 2019)	8,62 %	1,19 %
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	9,87 %	1,77 %
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 24. Jun. 2011)	4,74 %	1,86 %
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Aug. 2012)	4,71 %	1,17 %
Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 11. Sept. 2019)	3,84 %	(3,31) %
Class W CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	4,92 %	(3,87) %
Class W CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	4,88 %	(3,85) %
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	5,91 %	2,05 % ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Feb. 2007)	6,99 %	3,94 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 17. Okt. 2007)	7,04 %	3,95 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Jul. 2007)	6,69 %	3,72 %
Investor EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Feb. 2013)	6,62 %	1,04 %
Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Jul. 2007)	6,50 %	3,56 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 03. Jul. 2007)	6,12 %	3,18 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2009)	6,07 %	2,61 %
Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	5,65 %	(0,10) %

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 Teilfonds

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 eines übergewichteten Engagements in ausgewählten Emittenten aus den Sektoren Banken und Flugzeugleasing, da sich diese Wertpapiere überdurchschnittlich entwickelten.
- » Die Zinspositionierung in Industrieländern trug zur Wertentwicklung bei, insbesondere die Positionierung entlang der Zinsstrukturkurve in Europa, da die Renditen zurückgingen.
- » Die Titelauswahl bei Hochzinstiteln war der Wertentwicklung abträglich, darunter ein übergewichtetes Engagement in ausgewählten Emittenten aus den Sektoren Telekommunikation, Medien und Technologie, da sich diese Wertpapiere unterdurchschnittlich entwickelten.
- » Die Titelauswahl in den Schwellenländern war der Wertentwicklung abträglich, einschließlich des Engagements in ausgewählten chinesischen Immobilienentwicklern, da diese Wertpapiere zurückblieben.
- » Das taktische Engagement in verbrieften Krediten war der Wertentwicklung abträglich, einschließlich Nicht-Agency- und Agency-MBS-Anleihen, da diese Wertpapiere eine Underperformance aufwiesen.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹
(Forts.)

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Class T EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	5,57 %	(0,10 %)
Class W EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	7,14 %	(3,06 %)
Class W EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	7,19 %	(3,07 %)
jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, EUR Hedged; ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (EUR Hedged) und JPMorgan EMBI Global (EUR Hedged) ³	8,23 %	3,64 % ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Mai 2006)	8,58 %	4,90 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2006)	8,65 %	4,84 %
Administrative GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 21. Jul. 2011)	8,13 %	2,68 %
Class W GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	8,86 %	(2,00 %)
Class W GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	8,72 %	(2,01 %)
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	9,74 %	4,59 % ²
Auf JPY lautende Klassen		
Administrative JPY (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Okt. 2021)	2,72 %	(7,92 %)
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	4,28 %	(5,67 %)
Auf MXN lautende Klassen		
Institutional MXN (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Dez. 2020)	16,86 %	3,23 %
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	18,07 %	5,03 %
Auf SEK lautende Klassen		
Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	7,05 %	4,28 %
Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Dez. 2020)	6,52 %	(4,91 %)
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	8,24 %	3,97 % ²
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Nov. 2019)	7,84 %	(0,52 %)
Administrative SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Mai 2019)	7,25 %	0,04 %
Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Okt. 2019)	6,90 %	(1,41 %)
Class W SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	7,91 %	(1,82 %)
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	9,04 %	1,33 % ²

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

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

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

Diversified Income Duration Hedged Fund

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2011)	9,18 %	3,65 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	8,85 %	2,73 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 16. Aug. 2013)	8,29 %	2,31 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2011)	8,15 %	2,74 %
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	11,51 %	3,62 % ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Aug. 2011)	7,00 %	2,52 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 01. Okt. 2013)	6,93 %	1,57 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 11. Aug. 2011)	6,02 %	1,70 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Mai 2013)	6,10 %	0,41 %
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	9,12 %	2,64 % ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 23. Aug. 2011)	8,61 %	3,41 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Jan. 2013)	8,59 %	2,27 %
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	10,69 %	3,41 % ²

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

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

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; seit dem 10. November 2015: eine Mischung aus folgenden drei Indizes bei konstanter Duration von 25 Jahren: jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (USD Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (USD Hedged) und JPMorgan EMBI Global (USD Hedged).

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Teilfonds

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 eines übergewichteten Engagements in ausgewählten Emittenten aus den Sektoren Banken und Flugzeugleasing, da sich diese Wertpapiere überdurchschnittlich entwickelten.
- » Das taktische Engagement in Investment-Grade- und Emerging-Markets-CDX trug zur Wertentwicklung bei, da diese Wertpapiere besser abschnitten als Cash-Anleihen.
- » Die Titelauswahl bei Hochzinstiteln war der Wertentwicklung abträglich, darunter ein übergewichtetes Engagement in ausgewählten Emittenten aus den Sektoren Telekommunikation, Medien und Technologie, da sich diese Wertpapiere unterdurchschnittlich entwickelten.
- » Die Zinspositionierung in den Industrieländern war der Wertentwicklung abträglich, insbesondere die Positionierung entlang der Zinskurve in den USA, da die Renditen zurückgingen.
- » Die Titelauswahl in den Schwellenländern war der Wertentwicklung abträglich, einschließlich des Engagements in ausgewählten chinesischen Immobilienentwicklern, da diese Wertpapiere zurückblieben.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	9,91 %	6,01 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	8,93 %	5,05 %
1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets, ICE BofAML BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained ESG Tilt Index und JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index Global Diversified	10,58 %	6,49 %
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	7,48 %	3,40 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	6,58 %	2,50 %
jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets (EUR Hedged), ICE BofAML BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained ESG Tilt Index (EUR Hedged) und JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index Global Diversified (EUR Hedged)	7,97 %	3,66 %
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	8,95 %	4,91 %
jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets (GBP Hedged), ICE BofAML BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained ESG Tilt Index (GBP Hedged) und JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index Global Diversified (GBP Hedged)	9,48 %	5,05 %

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Diversified Income ESG Fund beabsichtigt, seine Erträge mithilfe umsichtiger Anlageverwaltung zu maximieren. Der Teilfonds investiert mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus Rentenwerten mit unterschiedlichen Laufzeiten. Der Teilfonds ist bestrebt, unter normalen Marktbedingungen auf verschiedene Weise ökologische und soziale Merkmale zu bewerten, wie in der Teilfondsergänzung dargelegt, und zielt darauf ab, einen Teil seines Vermögens in nachhaltige Investitionen zu investieren.

Kommentare zum Teilfonds

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

- » Die Zinspositionierung leistete einen Beitrag zur Wertentwicklung, darunter das untergewichtete Durationsengagement gegenüber ausgewählten Märkten in den Industrieländern zu Beginn des Jahres.
- » Eine Übergewichtung von Schuldtiteln mit Investment Grade trug insbesondere im vierten Quartal zur Wertentwicklung bei, da sie auf risikobereinigter Basis eine Outperformance erzielten.
- » Die Zugeständnisse bei Neuemissionen waren positiv für die Wertentwicklung, da ausgewählte Anleihen, die zu attraktiven Bewertungen auf dem Primärmarkt gekauft wurden, nach der Emission eine Outperformance erzielten.
- » Die Titelauswahl in den Schwellenländern war der Wertentwicklung abträglich, darunter ein untergewichtetes Engagement in Schuldtiteln ausgewählter staatlicher Emittenten, die eine Outperformance aufwiesen.
- » Die Wertpapierauswahl bei Hochzinstiteln schadete der Wertentwicklung, darunter ein übergewichtetes Engagement in ausgewählten Emittenten aus den Sektoren Telekommunikation und Gesundheitswesen zu Beginn des Jahres, die eine Underperformance aufwiesen.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Dez. 2008)	7,22 %	2,52 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 22. Feb. 2010)	7,16 %	2,20 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 24. Sep. 2010)	6,89 %	1,55 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 24. Sep. 2010)	6,84 %	1,54 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 21. Jan. 2010)	6,68 %	1,68 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 11. Mai 2010)	6,27 %	1,16 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 11. Mai 2010)	6,20 %	1,17 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Dez. 2018)	7,08 %	1,70 %
Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	7,14 %	1,55 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 15. Sep. 2021)	8,13 %	(0,13 %)
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index ³	5,20 %	1,00 % ²
Auf AUD lautende Klassen		
Class Z AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Mrz. 2014)	6,49 %	3,03 %
Bloomberg AusBond Bank Bills Index	3,89 %	1,76 %
Auf CAD lautende Klassen		
Institutional CAD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Sep. 2018)	6,55 %	1,36 %
Canadian Overnight Repo Rate (CORRA) ⁴	4,86 %	1,71 %
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Sep. 2010)	2,82 %	0,15 %
Class E CHF (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. Apr. 2011)	1,92 %	(0,80 %)
ICE BofA SARON Overnight Rate Index ⁵	1,49 %	(0,31 %) ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Mai 2009)	4,98 %	1,51 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Dez. 2009)	4,95 %	1,11 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2011)	4,56 %	0,41 %
Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Jan. 2010)	4,50 %	0,55 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Nov. 2009)	4,08 %	0,21 %
G Retail EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 14. Dez. 2010)	4,00 %	(0,10 %)
Euro Short-Term Rate (ESTER) Index ⁶	3,29 %	0,23 % ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Dez. 2009)	6,55 %	1,80 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 27. Feb. 2012)	6,56 %	1,49 %
Class E GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Mrz. 2010)	5,59 %	0,79 %
ICE BofA SONIA Overnight Rate Index ⁷	4,78 %	0,84 % ²
Auf NOK lautende Klassen		
Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 11. Apr. 2011)	5,39 %	1,91 %
1 Month NIBOR Rate Index	3,86 %	1,48 %
Auf SEK lautende Klassen		
Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Nov. 2011)	4,59 %	0,58 %
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (SEK Hedged) ³	3,22 %	0,45 %

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

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

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

⁴ Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Dynamic Bond Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2022: 1-Monats-LIBOR-Index (CAD abgesichert); ab 1. Juli 2022: Kanadischer Tagesgeldsatz (CORRA).

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

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

⁷ Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Dynamic Bond Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2021: 1-Monats-GBP-LIBOR-Index; ab 1. Juli 2021: 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 Teilfonds 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 Teilfonds kann bis zu 50 % seiner Vermögenswerte in festverzinsliche Wertpapiere investieren, die wirtschaftlich mit Schwellenländern verbunden sind.

Kommentare zum Teilfonds

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

- » Ein Engagement in US-Barzinsen leistete einen Beitrag zur Wertentwicklung, da diese positiv blieben.
- » Ein Long-Engagement in Unternehmensanleihen mit Investment Grade war der Wertentwicklung zuträglich, da sich die Spreads verengten.
- » Ein Long-Engagement bezogen auf die US-Duration im vorderen und mittleren Teil der Kurve trug zur Wertentwicklung bei, da die kurz- und mittelfristigen Zinsen in den USA fielen.
- » Das Long-Engagement in Collateralized Loan Obligations („CLOs“) mit AAA-Rating leistete einen positiven Beitrag zur Wertentwicklung, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere verengten.
- » Ein Short-Engagement beim polnischen Zloty schmälerte die Wertentwicklung, da die Währung gegenüber dem US-Dollar aufwertete.
- » Ein Short-Engagement in polnischer Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die Zinsen dort sanken.
- » Ein Long-Engagement im japanischen Yen belastete die Wertentwicklung, da der japanische Yen gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.
- » Ein Short-Engagement im Euro belastete die Wertentwicklung, da dieser gegenüber dem US-Dollar hinzugewann.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 25. Feb. 2016)	(0,34 %)	2,23 %
Institutional, ausschüttend II (Auflegung: 25. Feb. 2016)	(0,39 %)	2,23 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 14. Aug. 2020)	(0,75 %)	(2,28 %)
Class E, thesaurierend (Auflegung: 25. Feb. 2016)	(1,35 %)	1,19 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 10. Sep. 2020)	(1,44 %)	(2,76 %)
Class T, thesaurierend (Auflegung: 20. Okt. 2016)	(1,75 %)	0,11 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 01. Aug. 2019)	0,47 %	1,76 %
Euro Short-Term Rate (ESTER) Index ³	3,29 %	0,09 % ²
Auf AUD lautende Klassen		
BM Retail AUD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 28. Ap. 2022)	(1,93 %)	(5,27 %)
M Retail AUD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 08. Apr. 2021)	(0,97 %)	(5,65 %)
Bloomberg AusBond Bank Bills Index	3,89 %	1,88 % ²
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Mrz. 2018)	(2,52 %)	0,07 %
ICE BofA SARON Overnight Rate Index ⁴	1,49 %	(0,30 %)
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Feb. 2016)	1,03 %	3,13 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2019)	1,01 %	2,48 %
ICE BofA SONIA Overnight Rate Index ⁵	4,78 %	1,07 % ²
Auf ILS lautende Klassen		
Institutional ILS (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Sep. 2022)	0,10 %	(0,40 %)
SHIR SHEKEL Overnight Risk Free Rate	4,60 %	4,25 %
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jul. 2021)	0,23 %	(5,23 %)
M Retail SGD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 18. Dez. 2020)	(0,85 %)	(4,29 %)
SORA Singapore Interbank Overnight Rate Average	3,76 %	1,80 % ²
Auf USD lautende Klassen		
Institutional USD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Feb. 2016)	1,98 %	4,31 %
Institutional USD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Apr. 2021)	1,93 %	(3,64 %)
BM Retail USD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 28. Ap. 2022)	(0,06 %)	(3,71 %)
Class E USD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Mrz. 2017)	1,04 %	2,27 %
H Institutional USD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Aug. 2020)	1,78 %	(0,77 %)
M Retail USD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 08. Jan. 2020)	1,00 %	0,76 %
Class T USD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Sep. 2021)	0,59 %	(6,51 %)
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index ⁶	5,20 %	1,70 % ²

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

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

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

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

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

⁶ Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Dynamic Multi-Asset Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2022: 1-Monats-USD-LIBOR-Index; ab 1. Juli 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 Gesamterträge an, indem er sich an einem breiten Spektrum von Vermögensklassen beteiligt. Hierzu zählen beispielsweise Aktientitel (wie im Verkaufsprospekt definiert), Rentenwerte (wie im Verkaufsprospekt definiert) und Währungen sowie mit Rohstoffen und dem Immobiliensektor zusammenhängende Instrumente (wobei jedoch keine Direktanlagen in Rohstoffe und Immobilien vorgenommen werden), die die im Verkaufsprospekt dargestellte Anlagepolitik des Teilfonds vorsieht. Mit dem Teilfonds werden ökologische oder soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen angestrebt.

Kommentare zum Teilfonds

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

- » Ein Long-Engagement in ausgewählten Schwellenländerwährungen trug zu den Renditen bei, da diese gegenüber dem Euro aufwerteten.
- » Ein Long-Engagement bei taiwanesischen Aktien trug zur Rendite bei, da die Kurse stiegen.
- » Ein Long-Engagement in der britischen Duration in der zweiten Hälfte des Berichtszeitraums war der Wertentwicklung zuträglich, da die britischen Renditen fielen.
- » Ein Short-Engagement in europäischen Aktien belastete die Wertentwicklung, da die Kurse stiegen.
- » Ein Short-Engagement in US-Aktien in der ersten Hälfte des Berichtszeitraums schmälerte die Renditen, da die Kurse stiegen.
- » Ein Long-Engagement in inflationsgeschützten US-Schatzpapieren (TIPS) schmälerte die Renditen, da die US-amerikanischen Break-Even-Inflationserwartungen zurückgingen.

Durchschnittliche jährliche Gesamtrendite für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 11. Dez. 2007)	15,91 %	2,40 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 18. Apr. 2008)	15,84 %	2,21 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 18. Aug. 2010)	15,42 %	0,72 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 19. Nov. 2008)	14,74 %	3,10 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 08. Jul. 2010)	14,64 %	0,40 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 26. Feb. 2021)	15,62 %	1,01 %
Class Z, ausschüttend (Auflegung: 18. Nov. 2008)	16,90 %	4,97 %
JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (Unhedged)	12,70 %	2,08 % ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Apr. 2010)	12,03 %	2,81 %
Institutional EUR (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Jun. 2010)	11,90 %	2,27 %
Investor EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Dez. 2019)	11,54 %	0,83 %
Class E EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Jul. 2009)	10,85 %	3,17 %
Class E EUR (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Dez. 2018)	10,92 %	3,35 %
JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (EUR Unhedged)	8,89 %	3,81 % ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Jun. 2008)	9,40 %	5,42 %
JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (GBP Unhedged)	6,34 %	5,05 %

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Emerging Local Bond Fund beabsichtigt, seine Erträge mithilfe umsichtiger Anlageverwaltung zu maximieren. Der Teilfonds 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 Teilfonds

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

- » Ein übergewichtetes Engagement in der lokalen Duration in der Dominikanischen Republik trug zur Wertentwicklung bei, da die dortigen lokalen Renditen sanken.
- » Ein untergewichtetes Engagement in der türkischen Lira trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Währung unterdurchschnittlich entwickelte.
- » Ein übergewichtetes Engagement bei der Duration in Europa und Australien trug zur Wertentwicklung bei, da die dortigen Renditen zurückgingen.
- » Das Engagement im russischen Rubel über lokale russische Anleihen beeinträchtigte die Wertentwicklung, da der russische Rubel nachgab.
- » Ein untergewichtetes Engagement im polnischen Zloty schmälerte die Wertentwicklung, da die polnische Währung aufwertete.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	15,61 %	15,05 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	15,64 %	15,07 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	15,15 %	14,65 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	15,25 %	14,68 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	14,43 %	13,93 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	14,41 %	13,88 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 23. Sep. 2022)	16,71 %	19,71 %
JPMorgan ESG Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index	14,06 %	13,94 % ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	11,68 %	8,18 %
Institutional EUR (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	11,61 %	8,20 %
Investor EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	11,29 %	7,84 %
Investor EUR (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	11,23 %	7,82 %
Class E EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	10,62 %	7,16 %
Class E EUR (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	10,63 %	7,13 %
JPMorgan ESG Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (EUR Unhedged)	10,20 %	7,16 %
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Jun. 2023)	—	4,54 %
JPMorgan ESG Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (GBP Unhedged)	—	3,84 %

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Emerging Local Bond ESG Fund beabsichtigt, seine Erträge mithilfe umsichtiger Anlageverwaltung zu maximieren. Der Teilfonds investiert gewöhnlich mindestens 80 % seines Vermögens in festverzinsliche Instrumente, die auf Währungen von Ländern mit Wertpapiermärkten in Schwellenländern lauten. Der Teilfonds ist bestrebt, unter normalen Marktbedingungen auf verschiedene Weise ökologische und soziale Merkmale zu bewerten, wie in der Teilfondsergänzung dargelegt, und zielt darauf ab, einen Teil seines Vermögens in nachhaltige Investitionen zu investieren.

Kommentare zum Teilfonds

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

- » Ein übergewichtetes Engagement in der Duration in den USA, Europa und Australien trug zur Wertentwicklung bei, da die Renditen in den USA, Europa und Australien zurückgingen.
- » Ein übergewichtetes Engagement in der lokalen Duration in der Dominikanischen Republik trug zur Wertentwicklung bei, da die dortigen lokalen Renditen sanken.
- » Ein untergewichtetes Engagement in der türkischen Lira trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Währung unterdurchschnittlich entwickelte.
- » Ein untergewichtetes Engagement in chinesischer lokaler Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die Lokalrenditen nachgaben.
- » Ein untergewichtetes Engagement in rumänischer lokaler Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die Lokalrenditenrenditen fielen.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jul. 2001)	11,76 %	7,49 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 13. Dez. 2001)	11,73 %	6,89 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 25. Apr. 2002)	11,38 %	6,16 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 29. Mai 2003)	11,22 %	5,13 %
BM Retail, dekulierend (Auflegung: 21. Dez. 2023)	—	0,32 %
BM Retail, ausschüttend II (Auflegung: 28. Apr. 2022)	9,65 %	1,88 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	10,76 %	3,89 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Okt. 2005)	10,80 %	4,04 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 17. Okt. 2002)	11,57 %	7,03 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 03. Sep. 2020)	11,61 %	(2,07 %)
M Retail, dekulierend (Auflegung: 21. Dez. 2023)	—	0,32 %
M Retail, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2010)	10,80 %	2,69 %
M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 23. Dez. 2013)	10,72 %	2,06 %
Class Z, ausschüttend (Auflegung: 18. Nov. 2008)	12,66 %	7,14 %
JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global	10,45 %	6,73 % ²
Auf AUD lautende Klassen		
M Retail AUD (Hedged) ausschüttend (Auflegung: 19. Dez. 2012)	8,81 %	1,34 %
JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (AUD Hedged)	8,20 %	2,12 %
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 16. Dez. 2005)	6,94 %	2,78 %
JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (CHF Hedged)	5,50 %	2,90 %
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Dez. 2002)	9,24 %	5,46 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 20. Dez. 2010)	9,16 %	2,24 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Dez. 2019)	8,82 %	(2,90 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	8,27 %	2,56 %
JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (EUR Hedged)	7,78 %	5,30 % ²
Auf EUR lautende Klassen (nicht abgesichert)		
Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Feb. 2018)	8,00 %	3,36 %
JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (EUR Unhedged)	6,71 %	3,09 %
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Feb. 2004)	10,85 %	5,21 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	10,90 %	4,27 %
JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (GBP Hedged)	9,23 %	5,36 % ²
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Jul. 2018)	10,02 %	1,53 %
Class E SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Feb. 2007)	9,09 %	2,97 %
JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (SGD Hedged)	8,60 %	4,17 % ²

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Teilfonds

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

- » Taktische Engagements in der Duration der Schwellenländer in Lokalwährung und in Euro trugen zur Wertentwicklung bei, da die Zinssätze am mittleren und am langen Ende der Kurven fielen.
- » Ein übergewichtetes Engagement bei venezolanischen Staatsanleihen war der Wertentwicklung zuträglich, da sich die Spreads verengten.
- » Ein übergewichtetes Engagement bei ukrainischen Unternehmensanleihen war der Wertentwicklung zuträglich, da sich die Spreads verengten.
- » Ein untergewichtetes Engagement in Spreads der Schwellenländer schmälerte die Wertentwicklung, da sich die Spreads verengten.
- » Die Titelauswahl bei chinesischen Unternehmensanleihen war der Wertentwicklung abträglich, da sich die Spreads ausweiteten.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 16. Apr. 2010)	10,54 %	3,31 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 10. Jul. 2019)	10,60 %	(0,91 %)
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 10. Jul. 2019)	10,08 %	(1,40 %)
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 10. Jul. 2019)	10,05 %	(1,41 %)
Class E, thesaurierend (Auflegung: 05. Feb. 2021)	9,73 %	(5,60 %)
Class E, ausschüttend (Auflegung: 05. Feb. 2021)	9,60 %	(5,64 %)
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 01. Mrz. 2023)	—	10,60 %
JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified ³	10,26 %	3,78 % ²
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Apr. 2021)	5,75 %	(6,68 %)
JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (CHF Hedged) ³	5,31 %	(6,42 %)
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2013)	8,13 %	0,49 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2017)	8,14 %	(1,83 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Aug. 2018)	7,19 %	(1,77 %)
JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (EUR Hedged) ³	7,59 %	0,96 % ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Dez. 2019)	9,65 %	(2,53 %)
JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (GBP Hedged) ³	9,03 %	(2,79 %)
Auf GBP lautende Klassen (nicht abgesichert)		
Institutional GBP (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 11. Dez. 2020)	4,25 %	(3,26 %)
JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (GBP Unhedged) ³	4,04 %	(2,93 %)
Auf NOK lautende Klassen		
Investor NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Mrz. 2014)	8,04 %	1,20 %
JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (NOK Hedged) ³	7,80 %	1,73 %
Auf SEK lautende Klassen		
Investor SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 06. Feb. 2014)	7,83 %	0,25 %
Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Okt. 2021)	7,66 %	(7,72 %)
JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (SEK Hedged) ³	7,56 %	0,98 % ²

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

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Emerging Markets Bond ESG Fund möchte bei gleichzeitigem Kapitalerhalt, umsichtiger Anlageverwaltung und nachhaltigen Investitionen (durch die explizite Integration von Umwelt-, Sozial- und Governance-Faktoren („ESG“) in den Anlageprozess, wie in der Teilfondsergänzung näher erläutert) den maximal möglichen Gesamtertrag erzielen, indem er mindestens 80 % seines Vermögens in ein aktiv verwaltetes, diversifiziertes Portfolio aus Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) anlegt, deren Emittenten wirtschaftlich mit Schwellenländern 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 in der Teilfondsergänzung näher definiert) erreichen. Alle Wertpapiere werden gemäß dem internen nachhaltigkeitsbezogenen Auswahlverfahren der Anlageberatungsgesellschaft ausgewählt, das darauf ausgelegt ist, ESGFaktoren (Umwelt, Soziales und Governance) zu berücksichtigen, und das unter anderem eine Auswahlstrategie umfasst, die die sozial verantwortliche Anlageberatungsgesellschaft (wie im Verkaufsprospekt definiert) von Zeit zu Zeit vorgibt.

Kommentare zum Teilfonds

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

- » Taktische Engagements in der Duration der Schwellenländer in Lokalwährung und in Euro trugen zur Wertentwicklung bei, da die Zinssätze am mittleren und am langen Ende der Kurven fielen.
- » Ein übergewichtetes Engagement bei ukrainischen Unternehmensanleihen war der Wertentwicklung zuträglich, da sich die Spreads verengten.
- » Ein untergewichtetes Engagement in saudi-arabischen Schuldtiteln trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads ausweiteten.
- » Ein untergewichtetes Engagement in Spreads der Schwellenländer schmälerte die Wertentwicklung, da sich die Spreads verengten.
- » Die Titelauswahl bei chinesischen Unternehmensanleihen war der Wertentwicklung abträglich, da sich die Spreads ausweiteten.

Emerging Markets Corporate Bond Fund

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Nov. 2009)	6,85 %	3,62 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 27. Feb. 2012)	5,90 %	1,83 %
JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified (CEMBI)	8,53 %	4,89 % ²
Auf CHF lautende Klassen		
Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Mai 2012)	1,45 %	(0,17 %)
JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Diversified Index (CHF Hedged)	3,95 %	1,92 %
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 19. Feb. 2010)	4,56 %	2,21 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Mrz. 2010)	3,70 %	1,19 %
JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Diversified Index (EUR Hedged)	6,11 %	3,41 % ²

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der 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 Teilfonds

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

- » Taktische Engagements in der Duration der Schwellenländer in Lokalwährung und in Euro trugen zur Wertentwicklung bei, da die Zinssätze am mittleren und am langen Ende der Kurven fielen.
- » Die Titelauswahl unter ukrainischen Unternehmensanleihen trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Ein untergewichtetes Engagement in Unternehmensanleihen aus Sambia war der Wertentwicklung zuträglich, da sich die Spreads ausweiteten.
- » Ein untergewichtetes Engagement in Spreads der Schwellenländer schmälerte die Wertentwicklung, da sich die Spreads verengten.
- » Die Titelauswahl bei chinesischen Unternehmensanleihen war der Wertentwicklung abträglich, da sich die Spreads ausweiteten.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 04. Jun. 2019)	11,91 %	3,02 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 02. Okt. 2023)	—	7,80 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 02. Okt. 2023)	—	7,79 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 08. Jun. 2022)	12,67 %	8,06 %
50 % JPMorgan EMBI Global Index / 50 % JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (USD) Unhedged	11,60 %	0,47 % ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 04. Jun. 2019)	9,25 %	1,34 %
Class E EUR (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 19. Apr. 2022)	8,24 %	0,70 %
50 % JPMorgan EMBI Global Index (EUR Hedged) / 50 % JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (EUR Unhedged)	8,38 %	(0,37 %) ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Partially Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Mrz. 2022)	9,58 %	2,70 %
50 % JPMorgan EMBI Global Index (GBP Hedged) / 50 % JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (GBP Unhedged)	7,84 %	2,54 %

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Teilfonds

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

- » Ein übergewichtetes Engagement in der lokalen Duration in der Dominikanischen Republik trug zur Wertentwicklung bei, da die dortigen lokalen Renditen sanken.
- » Ein übergewichtetes Engagement in der Duration in Europa und Australien trug zur Wertentwicklung bei, da die dortigen Renditen zurückgingen.
- » Ein untergewichtetes Engagement in der türkischen Lira trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Währung unterdurchschnittlich entwickelte.
- » Ein untergewichtetes Engagement im polnischen Zloty schmälerte die Wertentwicklung, da die polnische Währung aufwertete.
- » Ein untergewichtetes Engagement im mexikanischen Peso beeinträchtigte die Wertentwicklung, da die mexikanische Währung aufwertete.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Class E, thesaurierend (Auflegung: 19. Nov. 2008)	9,21 %	1,56 %
JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (Unhedged)	8,44 %	1,44 %
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Jan. 2010)	6,46 %	2,95 %
Class E EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Jul. 2009)	5,46 %	2,39 %
JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (EUR Unhedged)	4,77 %	2,93 % ²

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund strebt eine maximale Gesamterträge bei Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung an, indem er mindestens 80 % seines Vermögens in Währungen von Schwellenländern oder Renteninstrumente (wie im Verkaufsprospekt definiert) investiert, die auf solche lauten. Bei der Auswahl von Ländern, die die Gesellschaft als Schwellenmärkte erachtet, verfügt die Anlageberatungsgesellschaft über einen breiten Spielraum. Die Anlageberatungsgesellschaft wählt die Zusammensetzung des Teilfonds 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 Teilfonds wird wahrscheinlich auf Asien, Afrika, dem Nahen Osten, Lateinamerika und den aufstrebenden Ländern Europas liegen. Der Teilfonds 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 Teilfonds richtet sich nach den Zinsprognosen der Anlageberatungsgesellschaft. Unter normalen Marktbedingungen wird davon ausgegangen, dass sie nicht länger als zwei Jahre ist. Der Teilfonds 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 Teilfonds

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

- » Ein untergewichtetes Engagement in der türkischen Lira trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Währung unterdurchschnittlich entwickelte.
- » Ein nicht im Vergleichsindex enthaltenes Engagement in der lokalen Duration in der Dominikanischen Republik trug zur Wertentwicklung bei, da die dortigen lokalen Renditen sanken.
- » Ein übergewichtetes Engagement im ungarischen Forint steigerte die Wertentwicklung, nachdem die ungarische Währung aufwertete.
- » Ein untergewichtetes Engagement im polnischen Zloty schmälerte die Wertentwicklung, da die polnische Währung aufwertete.
- » Das übergewichtete Engagement in der tschechischen Krone war der Wertentwicklung abträglich, da sich die tschechische Währung in der zweiten Jahreshälfte abschwächte.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	5,95 %	(0,08 %)
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	5,98 %	(0,07 %)
Class E, thesaurierend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	4,96 %	(0,98 %)
Class E, ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	4,91 %	(1,01 %)
Bloomberg U.S. Aggregate Index	5,53 %	(2,72 %)
Auf AUD lautende Klassen		
Institutional AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 19. Nov. 2021)	4,04 %	(1,76 %)
Class R AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	3,88 %	(1,36 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (AUD Hedged) Index	3,53 %	(3,97 %) ²
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	1,43 %	(2,91 %)
Class E CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	0,43 %	(3,78 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (CHF Hedged) Index	0,82 %	(5,71 %)
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	3,60 %	(1,90 %)
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 21. Mai 2021)	3,57 %	(1,99 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. Jun. 2021)	2,67 %	(3,13 %)
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	2,63 %	(2,79 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (EUR Hedged) Index	3,01 %	(4,71 %) ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	5,08 %	(0,79 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (GBP Hedged) Index	4,47 %	(3,58 %)
Auf NOK lautende Klassen		
Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 01. Mrz. 2023)	—	3,68 %
Bloomberg U.S. Aggregate (NOK Hedged) Index	—	3,98 %
Auf SEK lautende Klassen		
Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Okt. 2021)	3,59 %	(2,31 %)
Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Mai 2022)	3,09 %	0,14 %
Bloomberg U.S. Aggregate (SEK Hedged) Index	3,07 %	(5,91 %) ²
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	4,39 %	(0,68 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (SGD Hedged) Index	3,78 %	(3,43 %)

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Teilfonds

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

- » Ein Long-Engagement in den Barzinssätzen in den USA trug zur Wertentwicklung dank Carry bei.
- » Ein Long-Engagement Position in Unternehmensanleihen mit Investment Grade kam der Wertentwicklung zugute, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere verengten.
- » Ein Long-Engagement in hochverzinslichen Schuldtiteln steigerte die Wertentwicklung, da sich die Spreads verengten.
- » Bestände in US-Agency- und Commercial-Mortgage-Backed-Securities beeinträchtigten die Wertentwicklung, da sich die Spreads dieser Wertpapiere ausweiteten.
- » Ein Short-Engagement in der japanisch Duration im mittleren Teil der Kurve schmälerte die Wertentwicklung, da die japanischen Zinssätze fielen.

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

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

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Dez. 1998)	7,88 %	3,44 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 07. Jan. 2003)	7,84 %	3,12 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 08. Mai 2002)	7,47 %	3,04 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	6,90 %	1,80 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 10. Okt. 2005)	6,85 %	1,59 %
FTSE Euro Broad Investment-Grade Index	7,25 %	3,22 % ²
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2006)	5,63 %	1,88 %
FTSE Euro Broad Investment-Grade (CHF Hedged) Index	5,00 %	1,88 %

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Euro Bond Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Gesamterträge erzielen. Der Teilfonds 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. Mit dem Teilfonds werden ökologische oder soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen angestrebt.

Kommentare zum Teilfonds

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

- » Die Positionierung bezogen auf die Renditekurve im Euro-Block, insbesondere die Übergewichtung im mittleren Bereich der Kurve, trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Zinssätze fielen.
- » Das Long-Engagement in verbrieften Krediten, hauptsächlich über britische und europäische Residential Mortgage Backed Securities und europäische Collateralized Loan Obligations, trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Die Durationspositionierung bei US-Zinssätzen, einschließlich Long-Engagements zum Jahresende, trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Renditen im November und Dezember fielen.
- » Die Titelauswahl im Bankkapital war der Wertentwicklung abträglich, da das Engagement in nachrangigen Schuldtiteln, insbesondere von einer ausgewählten Schweizer Bank, zurückblieb.
- » Ein Short-Engagement in japanischer Duration zu Beginn des Jahres war der relativen Wertentwicklung abträglich, da die Zinsen fielen.
- » Ein Long-Engagement in Unternehmensanleihen mit Investment Grade aus dem Nicht-Finanzsektor trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.

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

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

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2008)	9,21 %	2,81 %
Institutional, ausschüttend II (Auflegung: 01. Okt. 2013)	9,19 %	1,52 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 25. Mai 2010)	8,23 %	1,41 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 07. Jun. 2019)	9,32 %	(1,39 %)
H Institutional, ausschüttend II (Auflegung: 07. Jun. 2019)	9,34 %	(1,39 %)
Bloomberg Euro-Aggregate Credit Index	7,81 %	2,62 % ²

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Euro Credit Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Gesamterträge erzielen. Der Teilfonds 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. Mit dem Teilfonds werden ökologische oder soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen angestrebt.

Kommentare zum Teilfonds

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

- » Makrostrategien trugen aufgrund der Positionierung im Hinblick auf die Duration in den Industrieländern zur Performance bei.
- » Die Titelauswahl im Finanz- und Maklerbereich trug zur Wertentwicklung bei, da sich ausgewählte übergewichtete Emittenten überdurchschnittlich entwickelten.
- » Die Titelauswahl bei den Auslandsschuldtiteln von Schwellenländern trug zur Wertentwicklung bei, da ein ausgewählter übergewichtetes Emittent eine Outperformance erzielte.
- » Ein Engagement in Agency-MBS schmälerte die Wertentwicklung, da sich der Sektor unterdurchschnittlich entwickelte.
- » Ein untergewichtetes Engagement im Automobilsektor beeinträchtigte die Wertentwicklung, da dieser Sektor obenauf lag.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2011)	8,71 %	3,26 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2011)	8,60 %	3,27 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 13. Dez. 2019)	8,41 %	(0,83 %)
Investor, ausschüttend (Auflegung: 29. Mai 2012)	8,29 %	2,89 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2011)	7,69 %	2,34 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2011)	7,74 %	2,34 %
Class T, thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	7,28 %	0,33 %
Class T, ausschüttend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	7,32 %	0,33 %
Bloomberg Euro Aggregate 1-10 Year Bond Index	6,39 %	1,83 % ²

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Euro Income Bond Fund beabsichtigt, seine laufenden Erträge mithilfe umsichtiger Anlageverwaltung zu maximieren. Der langfristige Kapitalzuwachs gilt als sekundäres Anlageziel. Der Teilfonds 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 Teilfonds strebt hohe Dividendenerträge an, indem er in eine breite Palette von Rentenwertsektoren anlegt, die nach Ansicht der Anlageberatungsgesellschaft typischerweise Erträge auf erhöhtem Niveau einbringen. Mit dem Teilfonds werden ökologische oder soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen angestrebt.

Kommentare zum Teilfonds

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

- » Ein Engagement in US-Barzinsen trug zur Wertentwicklung bei, da die kurzfristigen Zinsen positiv blieben.
- » Ein Long-Engagement in Unternehmensanleihen mit Investment Grade war der Wertentwicklung zuträglich, da sich die Spreads verengten.
- » Ein Long-Engagement in europäischen Zinswerten trug zur Wertentwicklung bei, da die Zinsen dort fielen.
- » Ein Long-Engagement in hochverzinslichen Unternehmensanleihen steigerte die Wertentwicklung, da sich deren Spreads verengten.
- » Das Long-Engagement bei US-Agency-MBS war der Wertentwicklung abträglich, da sich die Spreads dieser Wertpapiere ausweiteten.
- » Ein Long-Engagement bei chinesischen USD-Anleihen belastete die Wertentwicklung, da die Kurse dieser Wertpapiere sanken.
- » Long-Engagements im japanischen Yen und australischen Dollar belasteten die Wertentwicklung, da diese Währungen gegenüber dem Euro an Wert verloren.

Durchschnittliche jährliche Gesamtertritte für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 21. Apr. 2006)	10,09 %	4,27 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 03. Nov. 2023)	—	13,30 %
Bloomberg Euro Government (Germany, France, Netherlands) over 15 years Index ³	9,04 %	3,21 % ²

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

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

³ Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Euro Long Average Duration Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis zum 30. März 2011: Citigroup Euro Broad Investment-Grade (EuroBIG) Bond > 15 Years Index; vom 31. März 2011 bis zum 30. Januar 2012: Citigroup Euro Broad Investment-Grade (EuroBIG) Bond AAA rated > 15 Years Index; seit dem 31. Januar 2012: Bloomberg Euro Government (Germany, France, Netherlands) over 15 years Index.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Euro Long Average Duration Fund möchte bei gleichzeitigem Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung den höchstmöglichen Gesamtertrag erzielen. Der Teilfonds 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 Teilfonds von Engagements bei auf Euro lautenden staatlichen und/oder regierungsnahen Rentenwerten ab.

Kommentare zum Teilfonds

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

- » Die Positionierung entlang der Renditekurve im Euro-Block, insbesondere eine Übergewichtung im mittleren Bereich der Kurve, sowie die Auswahl der Instrumente trugen zur Wertentwicklung bei, da die Zinssätze fielen.
- » Ein Long-Engagement in verbrieften Krediten, hauptsächlich über britische und europäische Residential Mortgage Backed Securities und europäische Collateralized Loan Obligations, trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Die Positionierung in Japan zu Beginn des Jahres (Untergewichtung der japanischen Duration und Übergewichtung des japanischen Yen) war der Wertentwicklung abträglich, da die japanischen Zinssätze fielen und der JPY gegenüber dem USD (der Finanzierungswährung) nachgab.
- » Long-Engagements in dänischen Hypotheken zu Beginn des Jahres belasteten die relative Wertentwicklung, da sich die Spreads ausweiteten.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2006)	4,40 %	1,18 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	3,65 %	0,42 %
ICE BofA 3-Month German Treasury Bill Index ³	3,18 %	0,84 % ²

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

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

³ Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Euro Short-Term Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2021: 1-Monats-Euribor-Index; 1. Juli 2021 bis 31. August 2023 – Euro Short-Term Rate (ESTER)-Index; ab 1. September 2023. ICE BofA 3-Month German Treasury Bill 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 Teilfonds 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. Mit dem Teilfonds werden ökologische oder soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen angestrebt.

Kommentare zum Teilfonds

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

- » Ein Long-Engagement in verbrieften Krediten, hauptsächlich über britische und europäische Residential Mortgage-Backed Securities und europäische Collateralized Loan Obligations, trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Ein breit gefächertes Engagement bei Unternehmensanleihen mit Investment Grade trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Die Durationspositionierung in der Eurozone, einschließlich des Long-Engagements im vierten Quartal, trug zur Wertentwicklung bei, da die Zinssätze im vierten Quartal fielen.
- » Die Durationspositionierung in den USA, einschließlich des Long-Engagements im Mai und Juni, war der Wertentwicklung abträglich, da die Zinssätze im Mai und Juni stiegen.
- » Ein Long-Engagement im japanischen Yen schmälerte die Wertentwicklung, da die Währung gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2020)	13,77 %	2,63 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 22. Dez. 2022)	12,80 %	12,47 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 17. Apr. 2023)	—	9,70 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2020)	14,47 %	3,19 %
ICE BofA Merrill Lynch BB-B European Currency High Yield Constrained Index	12,44 %	1,17 % ²

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO European High Yield Bond Fund strebt eine maximale Gesamterträge bei umsichtiger Anlageverwaltung an. Der Teilfonds investiert mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus hochverzinslichen Rentenspapieren, 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 Teilfonds bis zu 20 % seines Vermögens in hochverzinsliche Rentenspapiere 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. Mit dem Teilfonds werden ökologische oder soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen angestrebt.

Kommentare zum Teilfonds

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

- » Ein untergewichtetes Engagement und die Titelauswahl im Finanz- und Maklerbereich trugen zur Wertentwicklung bei, da der Sektor sowie ausgewählte untergewichtete Emittenten hinter dem breiteren Markt zurückblieben.
- » Die Titelauswahl im Gesundheitswesen trug zur Wertentwicklung bei, da ausgewählte übergewichtete Emittenten eine Outperformance verzeichneten.
- » Die Titelauswahl im Festnetzsektor trug zur Wertentwicklung bei, da sich ausgewählte übergewichtete Emittenten überdurchschnittlich entwickelten.
- » Die Titelauswahl im Bankensektor war der Wertentwicklung abträglich, da das Engagement in nachrangigen Schuldtiteln und insbesondere von einer ausgewählten Schweizer Bank zurückblieb.
- » Ein untergewichtetes Engagement und die Titelauswahl im Lebensmittel- und Getränkektor waren der Wertentwicklung abträglich, da der Sektor den breiteren Markt übertraf, während das Engagement in einem ausgewählten Emittenten zurückblieb.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 05. Jul. 2011)	4,18 %	1,10 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 25. Mrz. 2013)	3,72 %	(0,22 %)
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 08. Jan. 2020)	3,98 %	(0,18 %)
Euro Short-Term Rate (ESTER) Index ³	3,31 %	1,16 % ²

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

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO European Short-Term Opportunities Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Gesamterträge erzielen. Der Teilfonds 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 Teilfonds bewegt sich normalerweise zwischen 0 und 5 Jahren, je nach der Prognose der Anlageberatungsgesellschaft für den Zinssatz.

Kommentare zum Teilfonds

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

- » Ein Long-Engagement in verbrieften Krediten, hauptsächlich über britische und europäische Residential Mortgage Backed Securities und europäische Collateralized Loan Obligations, trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Ein Long-Engagement in der europäischen Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Zinsen fielen.
- » Ein Long-Engagement in vorrangigen Finanztiteln war der Wertentwicklung zuträglich, da sich die Spreads verengten.
- » Ein Long-Engagement in gedeckten Anleihen aus Dänemark belastete die Wertentwicklung, da sich die Spreads ausweiteten.
- » Ein Short-Engagement in US-Breakevens belastete die Wertentwicklung, da die Inflationserwartungen zurückgingen.
- » Ein Short-Engagement in japanischer Duration zu Beginn des Jahres schmälerte die Wertentwicklung, da die Renditen nachgaben.

Durchschnittliche jährliche Gesamtrendite für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 09. Jun. 2009)	7,45 %	2,47 %
PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (London Close)	6,63 %	1,94 %
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Partially Hedged), ausschüttend (Auflegung: 02. Aug. 2011)	1,76 %	1,17 %
PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (CHF, Partially Hedged) (London Close)	0,87 %	0,62 %
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 24. Mai 2010)	4,98 %	2,23 %
Class E EUR (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 06. Mai 2010)	3,96 %	1,23 %
PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (EUR, Partially Hedged) (London Close)	4,18 %	1,76 % ²
Auf NOK lautende Klassen		
Institutional NOK (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Mrz. 2012)	7,34 %	3,56 %
PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (NOK, Partially Hedged) (London Close)	6,59 %	3,07 %

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Teilfonds

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

- » Ein ausgewähltes Engagement in Auslandsschulden von Schwellenländern trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Die Durationspositionierung bei EUR-Block-Zinssätzen, einschließlich des untergewichteten Engagements in den ersten zehn Monaten des Jahres, trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Renditen in den ersten zehn Monaten des Jahres stiegen.
- » Die Titelauswahl im Finanzsektor war der relativen Wertentwicklung zuträglich, da ausgewählte übergewichtete Emittenten besser abschnitten als der breitere Markt.
- » Ein untergewichtetes Engagement bei Unternehmensanleihen mit Investment Grade außerhalb des Finanzsektors belastete die relative Wertentwicklung, da sich die Spreads verengten.
- » Ein untergewichtetes Engagement bei chinesischer Duration schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Renditen nachgaben.
- » Die Positionierung innerhalb der Währungen der Industrieländer, hauptsächlich durch ein Long-Engagement im japanischen Yen, war der relativen Wertentwicklung abträglich, da die Währung gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Mrz. 1998)	8,05 %	4,88 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 18. Apr. 2001)	8,01 %	4,56 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 01. Mrz. 1999)	7,68 %	4,37 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 23. Jan. 2001)	7,66 %	4,20 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 14. Jun. 2004)	7,51 %	3,88 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	7,10 %	3,37 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Okt. 2005)	7,08 %	3,33 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Okt. 2002)	7,87 %	4,24 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2020)	7,86 %	(0,22 %)
M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 26. Apr. 2017)	7,08 %	1,14 %
Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	6,68 %	1,38 %
Class T, ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	6,76 %	1,38 %
Class W, thesaurierend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	8,14 %	(0,90 %)
Class W, ausschüttend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	8,18 %	(0,90 %)
Class W, ausschüttend II (Auflegung: 23. Feb. 2023)	—	6,54 %
Bloomberg Global Aggregate (USD Hedged) Index ³	7,15 %	4,14 % ²
Auf USD lautende Klassen (Währungsrisiko)		
Institutional (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 13. Dez. 2002)	6,90 %	3,81 %
Institutional (Currency Exposure), ausschüttend (Auflegung: 23. Mär. 2006)	6,87 %	3,41 %
Class E (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 19. Mai 2010)	5,96 %	1,51 %
Class E (Currency Exposure), ausschüttend (Auflegung: 19. Mai 2010)	5,86 %	1,51 %
H Institutional (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 26. Feb. 2021)	6,73 %	(4,70 %)
Bloomberg Global Aggregate (USD Unhedged) Index ³	5,72 %	2,95 % ²
Auf CAD lautende Klassen		
Institutional CAD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Sep. 2018)	7,22 %	1,54 %
Bloomberg Global Aggregate (CAD Hedged) Index ³	6,33 %	1,22 %
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Mai 2003)	3,50 %	2,32 %
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 10. Apr. 2003)	3,51 %	2,36 %
Investor CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Jun. 2011)	3,12 %	1,39 %
Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 13. Jun. 2018)	2,58 %	(1,61 %)
Class W CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	3,60 %	(3,35 %)
Class W CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	3,64 %	(3,33 %)
Bloomberg Global Aggregate (CHF Hedged) Index ³	2,52 %	1,51 % ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 04. Apr. 2003)	5,71 %	3,33 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Apr. 2005)	5,71 %	3,18 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Feb. 2005)	5,33 %	2,82 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	4,76 %	2,37 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2016)	4,74 %	(0,39 %)
G Retail EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Dez. 2012)	4,78 %	0,33 %
Class R EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	5,40 %	0,96 %
Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	4,41 %	(0,33 %)
Class W EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	5,77 %	(2,53 %)
Class W EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	5,82 %	(2,49 %)
Bloomberg Global Aggregate (EUR Hedged) Index ³	4,73 %	2,46 % ²

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Global Bond Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Gesamterträge erzielen. Der Teilfonds 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 Teilfonds

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

- » Die Positionierung bezogen auf die Renditekurve im Euro-Block, insbesondere die Übergewichtung im mittleren Bereich der Kurve, trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Renditen im dritten und vierten Quartal fielen.
- » Die Auswahl von Instrumenten im Euro-Block, namentlich eine Bevorzugung von Zinsswaps bei einer Verengung der Swap-Spreads, war für die relative Wertentwicklung vorteilhaft.
- » Eine übergewichtete Durationsposition im Dollarblock, insbesondere in Australien im ersten und vierten Quartal, trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Renditen fielen.
- » Eine Untergewichtung von Unternehmensanleihen mit Investment Grade außerhalb des Finanzsektors schmälerte die relative Wertentwicklung, da sich die Spreads verengten.
- » Ein Long-Engagement im japanischen Yen schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Währung gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.
- » Ein untergewichtetes Engagement in chinesischer Duration war für die relative Wertentwicklung von Nachteil, da die Renditen nachgaben.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹
(Forts.)

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf EUR lautende Klassen (Währungsrisiko)		
Institutional EUR (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 20. Feb. 2013)	3,35 %	2,65 %
Bloomberg Global Aggregate (EUR Unhedged) Index ³	2,14 %	2,07 %
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Apr. 2003)	7,26 %	4,33 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Jun. 2004)	7,27 %	4,34 %
Investor GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Apr. 2005)	6,90 %	3,71 %
Class W GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	7,44 %	(1,41 %)
Class W GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	7,39 %	(1,44 %)
Bloomberg Global Aggregate (GBP Hedged) Index ³	6,22 %	3,51 % ²
Auf GBP lautende Klassen (Währungsrisiko)		
Institutional GBP (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 09. Mrz. 2018)	0,94 %	1,28 %
Bloomberg Global Aggregate (GBP Unhedged) Index ³	(0,25 %)	0,88 %
Auf HKD lautende Klassen		
M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend II (Auflegung: 26. Apr. 2017)	7,07 %	1,18 %
Bloomberg Global Aggregate (HKD Unhedged) Index ³	7,20 %	1,68 %
Auf NOK lautende Klassen		
Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2005)	6,03 %	4,29 %
Investor NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 26. Jul. 2006)	5,66 %	4,24 %
Class W NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 13. Apr. 2021)	6,13 %	(2,37 %)
Bloomberg Global Aggregate (NOK Hedged) Index ³	5,21 %	3,41 % ²
Auf NZD lautende Klassen		
Institutional NZD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Nov. 2004)	7,55 %	6,17 %
Bloomberg Global Aggregate (NZD Hedged) Index ³	6,59 %	5,27 %
Auf SEK lautende Klassen		
Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Nov. 2004)	5,73 %	3,48 %
Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Jul. 2021)	5,21 %	(3,92 %)
Bloomberg Global Aggregate (SEK Hedged) Index ³	4,81 %	2,55 % ²
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 07. Aug. 2009)	6,48 %	4,27 %
Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Feb. 2023)	—	5,12 %
M Retail SGD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 23. Feb. 2023)	—	4,26 %
Class E SGD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 23. Feb. 2023)	—	5,23 %
Bloomberg Global Aggregate (SGD Hedged) Index ³	5,49 %	2,81 % ²

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

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

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

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Jan. 2017)	7,46 %	1,87 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 03. Apr. 2020)	7,53 %	0,26 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 07. Nov. 2018)	7,13 %	1,54 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 08. Mrz. 2019)	6,48 %	0,48 %
Bloomberg Global Aggregate (USD Hedged) Index	7,15 %	1,67 % ²
Auf AUD lautende Klassen		
Class Z AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Jan. 2017)	6,20 %	1,81 %
Bloomberg Global Aggregate Index (AUD Hedged)	5,31 %	1,09 %
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Jan. 2017)	2,94 %	(0,81 %)
Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 01. Sept. 2022)	2,07 %	(1,05 %)
Bloomberg Global Aggregate (CHF Hedged) Index	2,52 %	(1,06 %) ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Jan. 2017)	5,11 %	(0,17 %)
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Jan. 2017)	5,12 %	(0,18 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Feb. 2017)	4,26 %	(1,05 %)
Bloomberg Global Aggregate (EUR Hedged) Index	4,73 %	(0,40 %) ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 03. Jun. 2020)	6,76 %	(1,02 %)
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Jan. 2017)	6,74 %	0,88 %
Bloomberg Global Aggregate (USD Hedged) Index in GBP	6,22 %	0,65 % ²
Auf GBP lautende Klassen (Währungsrisiko)		
Institutional GBP (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 04. Aug. 2022)	0,31 %	(2,64 %)
Bloomberg Global Aggregate (GBP Unhedged) Index	(0,25 %)	(3,20 %)
Auf GBP lautende Klassen (nicht abgesichert)		
Institutional GBP (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 11. Dez. 2020)	1,32 %	(0,90 %)
Bloomberg Global Aggregate (GBP Unhedged) Index	1,10 %	(0,48 %)
Auf NOK lautende Klassen		
Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Jan. 2017)	5,44 %	0,92 %
Bloomberg Global Aggregate (NOK Hedged) Index	5,21 %	0,77 %
Auf NZD lautende Klassen		
Institutional NZD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 05. Apr. 2017)	7,02 %	1,60 %
Bloomberg Global Aggregate (NZD Hedged) Index	6,59 %	1,48 %
Auf SEK lautende Klassen		
Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Mai 2021)	5,17 %	(3,35 %)
Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Mai 2023)	—	3,14 %
Bloomberg Global Aggregate (SEK Hedged) Index	4,81 %	(3,18 %) ²

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Global Bond ESG Fund strebt die Maximierung der Gesamterträge bei gleichzeitigem Kapitalerhalt, umsichtiger Anlageverwaltung und nachhaltigen Investitionen an (durch die explizite Integration von Umwelt-, Sozial- und Governance-Faktoren in den Anlageprozess, wie in der Teilfondsergänzung näher erläutert). Der Teilfonds 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 Teilfonds

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

- » Die Durationspositionierung bei den Euro-Block-Zinssätzen, einschließlich des untergewichteten Engagements in den ersten zehn Monaten des Jahres, gefolgt von einem übergewichteten Engagement am Jahresende, trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Zinssätze während des gesamten Jahres stiegen und dann in den letzten beiden Monaten fielen.
- » Die Auswahl bei Finanzwerten trug zur relativen Wertentwicklung bei, da ausgewählte übergewichtete Emittenten den breiteren Markt übertrafen.
- » Übergewichtetes Engagement in der Duration des Dollarblocks, insbesondere im mittleren Bereich der Kurve in Australien, trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Zinssätze fielen.
- » Die Positionierung bei Währungen von Industrieländern, insbesondere das Long-Engagement im japanischen Yen, war der relativen Wertentwicklung abträglich, da der Yen gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.
- » Ein untergewichtetes Engagement bei der chinesischen Duration schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Zinsen fielen.
- » Ein untergewichtetes Engagement bei Unternehmensanleihen mit Investment Grade außerhalb des Finanzsektors belastete die relative Wertentwicklung, da sich die Spreads verengten.

Durchschnittliche jährliche Gesamterrendite für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2003)	9,53 %	4,41 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 09. Nov. 2005)	9,48 %	4,47 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2006)	9,16 %	4,07 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 14. Sep. 2004)	8,97 %	4,04 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 30. Apr. 2008)	8,52 %	3,60 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Dez. 2018)	9,34 %	1,90 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 30. Okt. 2019)	10,04 %	1,22 %
Bloomberg Global Aggregate ex-USD (USD Hedged) Index ³	8,32 %	3,48 % ²
Auf USD lautende Klassen (Währungsrisiko)		
Class E (Currency Exposure), ausschüttend (Auflegung: 04. Okt. 2016)	6,42 %	(1,50 %)
Bloomberg Global Aggregate ex-USD (USD Unhedged) Index ³	5,72 %	(1,33 %)
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 04. Apr. 2006)	7,31 %	3,63 %
Bloomberg Global Aggregate ex-USD (EUR Hedged) Index ³	5,99 %	2,49 %

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

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Global Bond Ex-US Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Gesamterrendite erzielen. Der Teilfonds 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 Teilfonds

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

- » Die Positionierung bezogen auf die Renditekurve im Euro-Block, insbesondere die Übergewichtung im mittleren Bereich der Kurve, trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Renditen im dritten und vierten Quartal fielen.
- » Die Auswahl von Instrumenten im Euro-Block, namentlich eine Bevorzugung von Zinsswaps bei einer Verengung der Swap-Spreads, war für die relative Wertentwicklung vorteilhaft.
- » Die Titelauswahl bei vorrangigen Finanzwerten trug zur relativen Wertentwicklung bei.
- » Ein untergewichtetes Engagement in chinesischer Duration war für die relative Wertentwicklung von Nachteil, da die Renditen nachgaben.
- » Eine Übergewichtung des japanischen Yen schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Währung gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.
- » Eine Untergewichtung von Unternehmensanleihen mit Investment Grade außerhalb des Finanzsektors schmälerte die relative Wertentwicklung, da sich die Spreads verengten.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2005)	13,04 %	5,98 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	13,05 %	6,00 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 22. Jun. 2016)	12,63 %	4,30 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 31. Okt. 2023)	—	8,06 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 27. Jun. 2008)	12,47 %	5,54 %
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 11. Dez. 2015)	12,43 %	4,66 %
M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 28. Apr. 2022)	10,85 %	3,87 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 11. Sep. 2006)	12,01 %	4,97 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 31. Jul. 2006)	12,05 %	5,04 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Aug. 2008)	12,89 %	6,00 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 22. Mrz. 2013)	12,75 %	4,23 %
M Retail, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2010)	12,05 %	4,48 %
M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 23. Dez. 2013)	12,08 %	3,41 %
Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	12,78 %	4,37 %
Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	11,57 %	3,15 %
Class T, ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	11,60 %	3,15 %
ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into USD ³	13,24 %	6,32 % ²
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Feb. 2010)	8,29 %	4,00 %
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Aug. 2012)	8,27 %	2,72 %
ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into CHF ³	8,22 %	4,34 % ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Mai 2008)	10,58 %	4,60 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	10,55 %	4,81 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Jan. 2011)	10,19 %	3,47 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	9,60 %	3,79 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2016)	9,57 %	1,60 %
ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into EUR ³	10,62 %	4,96 % ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Mai 2012)	12,24 %	4,42 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	12,06 %	5,56 %
Class E GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Jun. 2009)	11,18 %	5,41 %
ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into GBP ³	12,19 %	5,73 % ²
Auf SGD lautende Klassen		
Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Apr. 2016)	10,41 %	3,27 %
ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into SGD ³	11,42 %	4,58 %

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

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

³ Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Global High Yield Bond 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 1. 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 Teilfonds versucht, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Gesamtvermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus hoch verzinslichen Rentenpapieren (wie im Verkaufsprospekt definiert) anlegt, die auf wichtige Währungen lauten, die von Moody's mit niedriger als Baa oder von S&P niedriger als BBB bewertet werden oder von Fitch ein gleichwertiges Rating erhalten haben.

Kommentare zum Teilfonds

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

- » Die Titelauswahl im Finanz- und Maklerbereich trug zur Wertentwicklung bei, da ausgewählte untergewichtete Emittenten eine Underperformance aufwiesen, während eine Neuemission eines ausgewählten Emittenten eine Outperformance erzielte.
- » Ein untergewichtetes Engagement und die Titelauswahl im Festnetzsektor trug zur Wertentwicklung bei, da der Sektor schlechter abschnitt als der Gesamtmarkt, während ein ausgewählter untergewichteter Emittent zurückblieb.
- » Ein untergewichtetes Engagement im Immobiliensektor trug zur Wertentwicklung bei, da dieser Sektor schlechter abschnitt als der Gesamtmarkt.
- » Die Titelauswahl im Bankensektor war der Wertentwicklung abträglich, da das Engagement in nachrangigen Schuldtiteln und insbesondere von einer ausgewählten Schweizer Bank zurückblieb.
- » Die Titelauswahl im Festnetzsektor, da ein ausgewählter übergewichteter Emittent hinter dem breiteren Markt zurückblieb.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 18. Apr. 2008)	9,30 %	4,35 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 23. Jul. 2003)	9,19 %	4,51 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 15. Feb. 2005)	8,88 %	3,91 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 22. Jan. 2009)	8,84 %	4,59 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 21. Jan. 2009)	8,70 %	4,42 %
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 21. Jan. 2009)	8,68 %	4,43 %
BM Retail, dekulmierend (Auflegung: 21. Dez. 2023)	—	0,17 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 10. Dez. 2008)	8,35 %	4,20 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 30. Apr. 2008)	8,32 %	3,37 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Aug. 2008)	9,09 %	4,31 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Mai 2018)	9,06 %	1,40 %
M Retail, dekulmierend (Auflegung: 21. Dez. 2023)	—	0,27 %
M Retail, ausschüttend (Auflegung: 28. Sep. 2012)	8,22 %	1,79 %
M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 23. Dez. 2013)	8,34 %	1,97 %
Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	9,06 %	2,31 %
Class R, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	9,02 %	2,32 %
Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	7,89 %	1,11 %
Class W, thesaurierend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	9,41 %	(1,75 %)
Class W, ausschüttend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	9,41 %	(1,72 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (USD Hedged)	8,68 %	3,83 % ²
Auf USD lautende Klassen (Währungsrisiko)		
Institutional (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 02. Aug. 2013)	9,96 %	1,76 %
Institutional (Currency Exposure), ausschüttend (Auflegung: 06. Sep. 2016)	9,90 %	0,86 %
H Institutional (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 26. Feb. 2021)	9,68 %	(4,24 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (USD Unhedged)	9,24 %	1,68 % ²
Auf AUD lautende Klassen		
Institutional AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Apr. 2020)	7,26 %	(0,19 %)
Investor AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Jun. 2018)	6,97 %	0,30 %
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (AUD Hedged)	6,66 %	1,13 % ²
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Dez. 2009)	4,53 %	2,06 %
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 06. Feb. 2015)	4,67 %	(0,31 %)
Investor CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Mai 2011)	4,15 %	0,96 %
Investor CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Jan. 2009)	4,16 %	2,80 %
Administrative CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2013)	3,98 %	(0,07 %)
Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 06. Mrz. 2012)	3,65 %	0,18 %
Class W CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	4,60 %	(4,23 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (CHF Hedged)	3,87 %	2,41 % ²
Auf CZK lautende Klassen		
Institutional CZK (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 19. Mai 2015)	10,71 %	1,78 %
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (CZK Hedged)	10,00 %	1,94 %
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Sep. 2003)	6,78 %	3,51 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Sep. 2008)	6,80 %	3,46 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Mai 2006)	6,44 %	3,00 %
Investor EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Jan. 2009)	6,49 %	3,44 %
Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Feb. 2009)	6,28 %	3,17 %

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 Teilfonds

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

- » Durationsstrategien und insbesondere die Durationspositionierung innerhalb der EUR-Duration leisteten einen Beitrag zur Wertentwicklung.
- » Ein untergewichtetes Engagement im staatsnahen Sektor trug zur Wertentwicklung bei, da staatsnahe und supranationale Emittenten auf Basis der Überschussrendite hinter dem breiteren Markt zurückblieben.
- » Die Titelauswahl bei Finanzunternehmen trug zur Wertentwicklung bei, da ausgewählte übergewichtete Emittenten besser abschnitten als der breitere Markt.
- » Die Titelauswahl im Bankensektor war der Wertentwicklung abträglich, da sich das Engagement in nachrangigen Schuldtiteln und insbesondere in einer ausgewählten Schweizer Bank unterdurchschnittlich entwickelte.
- » Die Titelauswahl bei den Auslandsschuldtiteln von Schwellenländern belastete die Wertentwicklung vor dem Hintergrund von Marktbewegungen in Verbindung mit ausgewählten russischen Altbeständen.

Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹
(Forts.)

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Administrative EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 17. Feb. 2009)	6,34 %	3,17 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	5,88 %	2,39 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 09. Sep. 2010)	5,87 %	1,26 %
Class R EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	6,49 %	0,73 %
Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	5,49 %	(0,66 %)
Class W EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	6,98 %	(3,41 %)
Class W EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	6,95 %	(3,41 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (EUR Hedged)	6,13 %	2,80 % ²
Auf EUR lautende Klassen (Währungsrisiko)		
Institutional EUR (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 16. Aug. 2012)	6,22 %	2,67 %
Class E EUR (Currency Exposure), ausschüttend (Auflegung: 12. Dez. 2018)	5,20 %	0,70 %
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (EUR Unhedged)	5,54 %	2,77 % ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Sep. 2005)	8,39 %	3,94 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 11. Jul. 2008)	8,31 %	4,10 %
Investor GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Jan. 2009)	8,04 %	4,11 %
Administrative GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Jan. 2009)	7,81 %	3,92 %
Class E GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Mrz. 2009)	7,46 %	3,61 %
Class R GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	8,04 %	1,63 %
Class W GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	8,47 %	(2,37 %)
Class W GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	8,44 %	(2,34 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (GBP Hedged)	7,64 %	3,37 % ²
Auf HKD lautende Klassen		
Administrative HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Jul. 2017)	8,85 %	0,91 %
M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Jul. 2017)	8,30 %	0,51 %
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (USD Hedged) Index, denominiert in HKD	8,73 %	1,87 %
Auf NOK lautende Klassen		
Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Jan. 2012)	7,15 %	3,05 %
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (NOK Hedged)	6,57 %	2,86 %
Auf SEK lautende Klassen		
Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 04. Dez. 2009)	6,83 %	3,08 %
Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 13. Dez. 2012)	6,21 %	0,68 %
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (SEK Hedged)	6,18 %	2,67 % ²
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2015)	7,53 %	2,05 %
Investor SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Mai 2018)	7,26 %	0,70 %
Administrative SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Sept. 2017)	7,00 %	0,20 %
Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Jul. 2012)	6,69 %	1,66 %
Class W SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 13. Okt. 2020)	7,62 %	(2,54 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (SGD Hedged)	6,91 %	2,49 % ²

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

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

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2018)	8,55 %	2,35 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 19. Jul. 2019)	8,53 %	0,66 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 04. Mai 2021)	8,17 %	(2,81 %)
Class E, thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	7,60 %	(1,76 %)
Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	7,59 %	(1,76 %)
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 20. Jun. 2019)	9,14 %	1,36 %
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (USD Hedged)	8,68 %	2,13 % ²
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2018)	3,83 %	(0,46 %)
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	3,85 %	(3,37 %)
Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	3,04 %	(4,23 %)
Class E CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	2,85 %	(4,26 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (CHF Hedged)	3,87 %	(0,71 %) ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2018)	6,18 %	0,26 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	6,26 %	(2,56 %)
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Jan. 2023)	—	5,00 %
Investor EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 05. Jan. 2023)	—	5,08 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	5,18 %	(3,47 %)
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	5,14 %	(3,48 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (EUR Hedged)	6,13 %	0,01 % ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2018)	7,75 %	1,30 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 1. Mai 2019)	7,58 %	0,43 %
Class E GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	6,83 %	(2,51 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (GBP Hedged)	7,64 %	1,06 % ²
Auf SEK lautende Klassen		
Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 03. Nov. 2022)	6,16 %	8,65 %
Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Nov. 2019)	5,64 %	(2,03 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (SEK Hedged)	6,18 %	(1,67 %) ²

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Global Investment Grade Credit ESG Fund strebt die Maximierung der Gesamterträge bei gleichzeitigem Kapitalerhalt, umsichtiger Anlageverwaltung und nachhaltigen Investitionen an (durch die explizite Integration von Umwelt-, Sozial- und Governance-Faktoren in den Anlageprozess, wie in der Teilfondsergänzung näher erläutert). Der Teilfonds 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 Teilfonds

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

- » Makrostrategien trugen aufgrund der Positionierung im Hinblick auf die Duration in den Industrieländern zur Performance bei.
- » Die Titelauswahl bei den Auslandsschuldtiteln von Schwellenmärkten, da ein übergewichtetes Engagement in ausgewählten ESG-Anleihen der Wertentwicklung entgegenkam.
- » Eine Untergewichtung des staatsnahen Sektors und insbesondere von supranationalen Titeln trug zur Wertentwicklung bei, da der Sektor im Jahresverlauf auf Basis der Überschussrendite hinter dem breiteren Markt zurückblieb.
- » Die Währungspositionierung in Industrieländern und insbesondere ein moderates Long-Engagement im japanischen Yen belasteten die Wertentwicklung.
- » Die Titelauswahl im Bankensektor war der Wertentwicklung aufgrund der allgemeinen Volatilität im Sektor zu Beginn des Jahres abträglich.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	5,25 %	2,22 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 05. Okt. 2016)	4,90 %	2,53 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	4,32 %	1,30 %
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (USD Hedged)	5,03 %	2,19 % ²
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	1,01 %	(0,02 %)
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (CHF Hedged)	0,65 %	(0,12 %)
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	3,22 %	0,57 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 17. Jan. 2017)	3,17 %	0,82 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	2,22 %	(0,34 %)
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (EUR Hedged)	2,83 %	0,53 % ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Jan. 2017)	4,59 %	1,89 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	4,64 %	1,53 %
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (GBP Hedged)	4,36 %	1,49 % ²
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 22. Sep. 2022)	3,78 %	3,44 %
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (SGD Hedged)	3,54 %	2,81 %

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Teilfonds

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

- » Ein Engagement in US-amerikanischen Agency-Passthrough-MBS kam der relativen Wertentwicklung zugute, da sich die Spreads dieser Titel verengten.
- » Durationsstrategien in Europa, einschließlich Short-Positionen in den ersten drei Quartalen, als die Renditen stiegen, und Engagements in Swap-Spreads der Eurozone in der zweiten Hälfte des Berichtszeitraums, als sich die Spreads verengten, trugen zur relativen Wertentwicklung bei.
- » Die Erhöhung der Übergewichtung der US-Zinssätze nahe dem Höhepunkt des Zyklus trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die US-Zinssätze im letzten Quartal des Jahres deutlich zurückgingen.
- » Eine Untergewichtung deutscher Nominalzinsen für Staatsanleihen beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da die deutschen Nominalrenditen während des Berichtszeitraums fielen.
- » Ein untergewichtetes Engagement in japanischen Zinssätzen für Staatsanleihen in der ersten Hälfte des Berichtszeitraums war der relativen Wertentwicklung abträglich, da sich die Erwartung eines Anstiegs dieser Zinssätze nicht so schnell bewahrheitete, während die Finanzierungskosten der Position abträglich waren.
- » Eine Übergewichtung des japanischen Yen (JPY), insbesondere zu Beginn des Berichtszeitraums, und eine Untergewichtung des kanadischen Dollars (CAD), insbesondere am Ende des Berichtszeitraums, finanziert durch eine Untergewichtung des US-Dollars (USD), belasteten die relative Wertentwicklung, da der JPY an Wert verlor, der CAD hingegen gegenüber dem USD aufwertete.

Durchschnittliche jährliche Gesamtrendite für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2003)	4,86 %	4,12 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	4,92 %	3,77 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 04. Mrz. 2004)	4,51 %	3,60 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 24. Feb. 2009)	4,50 %	4,02 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 17. Dez. 2004)	4,36 %	3,34 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	3,89 %	2,98 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Okt. 2005)	3,93 %	2,89 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 21. Mai 2004)	4,73 %	3,92 %
Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	4,64 %	1,96 %
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond USD Hedged Index	4,52 %	3,89 % ²
Auf USD lautende Klassen (Währungsrisiko)		
Institutional (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 01. Sep. 2017)	5,95 %	0,51 %
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond USD Unhedged Index	5,47 %	0,23 %
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Mai 2008)	0,38 %	1,80 %
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2015)	0,38 %	0,14 %
Investor CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 24. Feb. 2009)	0,00 %	2,20 %
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond CHF Hedged Index	(0,18 %)	1,47 % ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2003)	2,54 %	3,10 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	2,56 %	2,66 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 07. Apr. 2004)	2,24 %	2,63 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	1,61 %	1,90 %
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond EUR Hedged Index	2,02 %	2,83 % ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Feb. 2004)	4,08 %	4,06 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 27. Apr. 2005)	4,05 %	3,63 %
Class R GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	3,79 %	1,28 %
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond GBP Hedged Index	3,52 %	3,86 % ²
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Feb. 2008)	3,29 %	3,14 %
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond SGD Hedged Index	2,80 %	2,98 %

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Global Real Return Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Realrendite erzielen. Der Teilfonds 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. Mit dem Teilfonds werden ökologische oder soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen angestrebt.

Kommentare zum Teilfonds

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

- » Durationsstrategien in Europa, einschließlich Short-Engagements in den ersten drei Quartalen, als die Renditen stiegen, und Engagements in Swap-Spreads der Eurozone in der zweiten Hälfte des Berichtszeitraums, als sich die Spreads verengten, trugen zur relativen Wertentwicklung bei.
- » Ein Engagement in US-amerikanischen Agency-Passthrough-MBS kam der relativen Wertentwicklung zugute, da sich die Spreads dieser Titel verengten.
- » Die Erhöhung des Engagements in US-Zinssätzen nahe dem Höhepunkt des Zyklus trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die US-Zinssätze im letzten Quartal des Jahres deutlich zurückgingen.
- » Die Übergewichtung der japanischen Breakeven-Inflation, als die japanische Breakeven-Inflation stieg, und die Kurvenpositionierung in der britischen Breakeven-Inflation in trugen zur relativen Wertentwicklung bei.
- » Eine Untergewichtung deutscher Nominalzinsen für Staatsanleihen beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da die deutschen Nominalrenditen während des Berichtszeitraums fielen.
- » Ein untergewichtetes Engagement in japanischen Zinssätzen für Staatsanleihen in der ersten Hälfte des Berichtszeitraums war der relativen Wertentwicklung abträglich, da sich die Erwartung eines Anstiegs dieser Zinssätze nicht so schnell bewahrheitete, während die Finanzierungskosten der Position abträglich waren.
- » Eine Übergewichtung des japanischen Yen (JPY), insbesondere zu Beginn des Berichtszeitraums, und eine Untergewichtung des kanadischen Dollars (CAD), insbesondere am Ende des Berichtszeitraums, finanziert durch eine Untergewichtung des US-Dollars (USD), belasteten die relative Wertentwicklung, da der JPY an Wert verlor, der CAD hingegen gegenüber dem USD aufwertete.

Durchschnittliche jährliche Gesamtrendite für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	8,61 %	4,99 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	8,66 %	5,00 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 20. Jan. 2015)	8,26 %	3,75 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 18. Apr. 2013)	8,30 %	3,86 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 13. Feb. 2017)	8,08 %	3,05 %
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	8,08 %	4,48 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	7,62 %	4,06 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	7,74 %	4,06 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 25. Mai 2018)	8,41 %	3,29 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Mai 2018)	8,44 %	3,30 %
Class R, thesaurierend (Auflegung: 07. Nov. 2019)	8,34 %	2,41 %
Class R, ausschüttend (Auflegung: 30. Apr. 2015)	8,31 %	3,66 %
Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	7,26 %	2,64 %
Class T, ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	7,17 %	2,64 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	9,23 %	5,56 %
Bloomberg U.S. Aggregate Index	5,53 %	1,43 % ²
Auf AUD lautende Klassen		
Institutional AUD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Jan. 2018)	6,61 %	2,06 %
Institutional AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Sep. 2023)	—	3,94 %
Investor AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Mai 2018)	6,21 %	2,03 %
Administrative AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 08. Jun. 2016)	6,11 %	2,80 %
Class E AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 16. Feb. 2017)	5,59 %	1,82 %
Class Z AUD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 28. Okt. 2015)	7,17 %	4,13 %
Bloomberg U.S. Aggregate (AUD Hedged) Index	3,53 %	0,95 % ²
Auf BRL lautende Klassen		
Institutional BRL (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 03. Feb. 2016)	25,09 %	7,06 %
Bloomberg Global Aggregate (BRL Hedged) Index	13,51 %	7,65 %
Auf CAD lautende Klassen		
Institutional CAD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 01. Apr. 2016)	7,67 %	3,64 %
Institutional CAD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Sep. 2018)	7,77 %	3,07 %
Bloomberg U.S. Aggregate Index (CAD Hedged)	4,61 %	0,65 % ²
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Dez. 2014)	3,97 %	1,59 %
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2015)	4,02 %	1,37 %
Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	3,00 %	0,94 %
Class E CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	3,08 %	0,95 %
Bloomberg U.S. Aggregate (CHF Hedged) Index	0,82 %	(0,74 %) ²
Auf CNH lautende Klassen		
Institutional RMB (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 11. Dez. 2023)	—	1,94 %
Investor RMB (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 03. Jan. 2018)	5,25 %	3,31 %
Class E RMB (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Mai 2013)	4,68 %	4,69 %
Bloomberg U.S. Aggregate (CNH Hedged) Index	2,45 %	3,27 % ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	6,17 %	3,38 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	6,14 %	3,36 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 29. Jul. 2014)	6,08 %	2,11 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Apr. 2015)	5,83 %	1,54 %

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 Teilfonds investiert mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten. Der Teilfonds strebt hohe Dividendenerträge an, indem er in eine breite Palette von Rentenwertsektoren anlegt, die nach Ansicht der Anlageberatungsgesellschaft typischerweise Erträge auf erhöhtem Niveau einbringen.

Kommentare zum Teilfonds

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

- » Ein Engagement in US-Barzinsen trug zur Wertentwicklung bei, da die kurzfristigen US-Zinsen positiv blieben.
- » Ein Long-Engagement bei hochverzinslichen Unternehmensanleihen steigerte die Wertentwicklung, da sich deren Spreads verengten.
- » Ein Long-Engagement in der US-Duration im mittleren Teil der Kurve trug zur Wertentwicklung bei, da die Zwischenzinssätze in den USA fielen.
- » Ein Long-Engagement in Unternehmensanleihen mit Investment Grade war der Wertentwicklung zuträglich, da sich die Spreads verengten.
- » Ein übergewichtetes Engagement bei Agency-MBS schmälerte die Wertentwicklung, da sich die Spreads ausweiteten.
- » Ein Long-Engagement im japanischen Yen belastete die Wertentwicklung, da der japanische Yen gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.
- » Ein Short-Engagement in japanischer Duration im mittleren Teil der Kurve schmälerte die Wertentwicklung, da mittelfristige japanische Zinsen fielen.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹
(Forts.)

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Investor EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Mai 2015)	5,83 %	1,60 %
Investor EUR (Hedged), ausschüttend A (Auflegung: 16. Dez. 2015)	5,84 %	1,76 %
Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Aug. 2015)	5,59 %	1,51 %
Administrative EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 08. Jun. 2016)	5,57 %	1,31 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	5,15 %	2,44 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	5,21 %	2,45 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 31. Aug. 2018)	5,28 %	0,53 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend II Q (Auflegung: 30. Sep. 2019)	5,18 %	(0,06 %)
G Retail EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Aug. 2017)	5,29 %	0,01 %
Class R EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2016)	5,86 %	1,88 %
Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	4,78 %	0,78 %
Class T EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	4,75 %	0,78 %
Bloomberg U.S. Aggregate (EUR Hedged) Index	3,01 %	(0,12 %) ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 07. Feb. 2019)	7,74 %	2,23 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Feb. 2013)	7,69 %	3,52 %
Investor GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2020)	7,42 %	1,00 %
Administrative GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 02. Sept. 2016)	7,19 %	2,08 %
Class E GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Mrz. 2017)	6,71 %	1,38 %
Class R GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	7,43 %	3,96 %
Bloomberg U.S. Aggregate (GBP Hedged) Index	4,47 %	0,80 % ²
Auf HKD lautende Klassen		
Institutional HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2015)	8,67 %	4,15 %
Investor HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Okt. 2023)	—	6,64 %
Administrative HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 26. Apr. 2017)	8,06 %	2,92 %
Class E HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 04. Feb. 2013)	7,72 %	3,45 %
Bloomberg U.S. Aggregate (HKD Unhedged) Index	5,58 %	1,59 % ²
Auf JPY lautende Klassen		
Institutional JPY (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Mrz. 2023)	—	2,70 %
Investor JPY (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Jun. 2023)	—	2,10 %
Class E JPY (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 01. Sep. 2017)	1,56 %	(0,40 %)
Class E JPY (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 21. Dez. 2022)	1,52 %	0,69 %
Bloomberg U.S. Aggregate (JPY Hedged) Index	(0,86 %)	(1,82 %) ²
Auf NOK lautende Klassen		
Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 19. Apr. 2017)	6,39 %	2,12 %
Bloomberg U.S. Aggregate (NOK Hedged) Index	3,44 %	0,08 %
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Jul. 2020)	6,89 %	2,41 %
Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 16. Dez. 2015)	6,84 %	3,77 %
Investor SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 07. Feb. 2020)	6,61 %	1,24 %
Investor SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Mai 2018)	6,52 %	2,52 %
Administrative SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	6,42 %	4,19 %
Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 19. Feb. 2013)	5,95 %	3,09 %
Bloomberg U.S. Aggregate (SGD Hedged) Index	3,78 %	1,21 % ²

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

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

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Jan. 2021)	8,53 %	0,61 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 03. Mrz. 2023)	—	7,55 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2021)	7,59 %	(0,27 %)
Bloomberg U.S. Aggregate Index	5,53 %	(3,16 %) ²
Auf AUD lautende Klassen		
Class E AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2021)	5,60 %	(1,37 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (AUD Hedged) Index	3,53 %	(4,32 %)
Auf EUR lautende Klassen		
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 17. Feb. 2021)	5,03 %	(2,17 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (EUR Hedged) Index	3,01 %	(4,89 %)
Auf GBP lautende Klassen		
Class E GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 17. Feb. 2021)	6,56 %	(0,96 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (GBP Hedged) Index	4,47 %	(3,77 %)
Auf HKD lautende Klassen		
Class E HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Feb. 2021)	7,47 %	(0,08 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (HKD Unhedged) Index	5,58 %	(2,93 %)
Auf JPY lautende Klassen		
Class E JPY (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Nov. 2023)	—	3,71 %
Bloomberg U.S. Aggregate (JPY Hedged) Index	—	4,67 %

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Teilfonds

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

- » Ein Engagement in US-Barzinsen trug zur Wertentwicklung bei, da die kurzfristigen US-Zinsen positiv blieben.
- » Ein Long-Engagement in der US-Duration im mittleren Teil der Kurve trug zur Wertentwicklung bei, da die Zwischenzinssätze in den USA fielen.
- » Ein Long-Engagement in hochverzinslichen Unternehmensanleihen steigerte die Wertentwicklung, da sich deren Spreads verengten.
- » Ein Long-Engagement in verbrieften Krediten, insbesondere in europäischen Residential Mortgage Backed Securities und Commercial Mortgage Backed Securities, trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere verengten.
- » Ein Short-Engagement in japanischer Duration im mittleren Teil der Kurve schmälerte die Wertentwicklung, da mittelfristige japanische Zinsen fielen.
- » Ein übergewichtetes Engagement bei Agency-MBS schmälerte die Wertentwicklung, da sich die Spreads ausweiteten.
- » Long-Engagements im japanischen Yen und australischen Dollar waren der Wertentwicklung abträglich, da diese Währungen gegenüber dem US-Dollar an Wert verloren.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 14. Feb. 2013)	6,02 %	1,53 %
Administrative, ausschüttend II (Auflegung: 22. Mrz. 2022)	5,56 %	(2,35 %)
Class E, thesaurierend (Auflegung: 14. Feb. 2013)	5,05 %	0,36 %
Class E, ausschüttend II (Auflegung: 02. Aug. 2022)	5,06 %	(0,61 %)
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 23. Aug. 2022)	5,82 %	0,00 %
M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 02. Aug. 2022)	5,01 %	(0,66 %)
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 weighted (USD Hedged) ³	4,63 %	1,34 % ²
Auf AUD lautende Klassen		
Class E AUD (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Aug. 2022)	3,53 %	(2,35 %)
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 weighted (AUD Hedged) ³	2,87 %	(1,93 %)
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Nov. 2021)	3,28 %	(1,19 %)
E Class EUR (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Apr. 2013)	2,37 %	(0,48 %)
Class E EUR (Partially Hedged), ausschüttend (Auflegung: 16. Apr. 2013)	2,44 %	(0,47 %)
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 weighted (EUR Hedged) ³	1,69 %	0,77 % ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Mai 2014)	3,91 %	1,88 %
Class E GBP (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Aug. 2022)	3,08 %	(2,13 %)
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 weighted (GBP Hedged) ³	2,20 %	1,65 % ²
Auf SGD lautende Klassen		
Administrative SGD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 22. Feb. 2022)	3,81 %	(1,74 %)
Class E SGD (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Aug. 2022)	3,42 %	(2,27 %)
45 % Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (SGD Hedged), 15 % JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (SGD Unhedged), 20 % Bloomberg Commodity Total Return Index (SGD Hedged), 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (SGD Unhedged) und 10 % Bloomberg Gold Subindex Total Return Index (SGD Hedged) ³	2,70 %	(2,83 %) ²

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

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Inflation Multi-Asset Fund beabsichtigt, den realen Kapitalwert mithilfe umsichtiger Anlageverwaltung zu erhalten. Der Teilfonds wird aktiv verwaltet und legt primär in ein diversifiziertes Portfolio an, das aus inflationsgekoppelten Anlagen besteht. Der Teilfonds 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 Teilfonds 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 Teilfonds

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

- » Aktive Rohstoffstrategien, darunter ein Engagement in California Carbon Allowances (CCAs) und ein untergewichtetes Engagement in Erdgas, trugen zur relativen Wertentwicklung bei, da die CCAs eine Outperformance aufwiesen, während Erdgas hinter dem breiteren Bloomberg Commodity Index zurückblieb.
- » Durationsstrategien in Europa, einschließlich Short-Engagements in den ersten drei Quartalen und Engagements in Swap-Spreads der Eurozone, trugen zur relativen Wertentwicklung bei, da die Renditen stiegen und sich die Spreads verengten.
- » Ein Engagement in US-amerikanischen Agency-Passthrough-MBS kam der relativen Wertentwicklung zugute, da sich die Spreads dieser Titel verengten.
- » Die Übergewichtung der japanischen Breakeven-Inflation trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die japanische Breakeven-Inflation stieg.
- » Die taktische Untergewichtung von Gold war der relativen Performance abträglich, da die Goldpreise im Berichtszeitraum stiegen.
- » Ein untergewichtetes Engagement in japanischen Zinssätzen für Staatsanleihen in der ersten Hälfte des Berichtszeitraums war der relativen Wertentwicklung abträglich, da sich die Erwartung eines Anstiegs dieser Zinssätze nicht so schnell bewahrheitete, während die Finanzierungskosten der Position abträglich waren.
- » Eine Übergewichtung des japanischen Yen (JPY), insbesondere in der ersten Hälfte des Berichtszeitraums, und eine Untergewichtung des kanadischen Dollars (CAD), insbesondere am Ende des Berichtszeitraums, finanziert durch eine Untergewichtung des US-Dollars (USD), belasteten die relative Wertentwicklung, da der JPY an Wert verlor, der CAD hingegen gegenüber dem USD aufwertete.
- » Die Titelauswahl bei Immobilienaktien aus Industrieländern belastete die relative Wertentwicklung.

Durchschnittliche jährliche Gesamttrendite für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 05. Dez. 2002)	5,00 %	2,37 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 05. Dez. 2002)	5,00 %	2,36 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 13. Mai 2004)	4,65 %	2,06 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 03. Jul. 2003)	4,67 %	1,95 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 08. Sep. 2004)	4,49 %	1,87 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 21. Sep. 2007)	4,06 %	1,27 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Okt. 2005)	4,02 %	1,54 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 04. Nov. 2009)	4,78 %	1,46 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 12. Dez. 2018)	4,82 %	1,19 %
Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	4,69 %	0,81 %
ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year U.S. Treasury Index	4,26 %	1,84 % ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jan. 2012)	2,88 %	(0,01 %)
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	2,80 %	1,42 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 24. Jul. 2009)	1,91 %	(0,21 %)
ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year U.S. Treasury Index (EUR Hedged)	2,08 %	0,82 % ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Jan. 2017)	4,31 %	0,24 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Mrz. 2010)	4,30 %	1,13 %
ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year U.S. Treasury Index (GBP Hedged)	3,60 %	0,64 % ²

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Low Average Duration Fund möchte bei gleichzeitigem Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung den höchstmöglichen Gesamtertrag erzielen. Der Teilfonds 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 Teilfonds

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

- » Durationsstrategien in den USA, insbesondere ein übergewichtetes Engagement im ein- bis fünfjährigen Teil der Kurve in der zweiten Hälfte von 2023, trugen zur relativen Wertentwicklung bei, da die Zinssätze fielen.
- » Ein übergewichtetes Engagement bei Collateralized Loan Obligations trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Positionen bei Unternehmensanleihen mit Investment Grade, insbesondere Finanztitel trugen zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Positionen in Auslandskrediten aus Schwellenländern, insbesondere in Lateinamerika und Mittelamerika, trugen zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Ein Short-Engagement in britischer Duration war der relativen Wertentwicklung abträglich, da die Zinsen sanken.
- » Eine Long-Ausrichtung auf den japanischen Yen gegenüber dem US-Dollar war der relativen Wertentwicklung abträglich, da der Yen an Wert verlor.
- » Ein untergewichtetes Engagement in Credit-Default-Swap-Indizes für hochverzinsliche Unternehmensanleihen belastete die relative Wertentwicklung, da sich die Spreads verengten.

Durchschnittliche jährliche Gesamtertritte für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2014)	7,16 %	2,10 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 22. Jun. 2021)	7,16 %	0,05 %
Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (USD Hedged)	6,83 %	2,10 % ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2014)	4,91 %	0,46 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 03. Jun. 2021)	5,01 %	(1,75 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2014)	4,02 %	(0,45 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (EUR Hedged)	4,59 %	0,43 % ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2014)	6,50 %	1,40 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 03. Jun. 2021)	6,47 %	(0,53 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (GBP Hedged)	6,10 %	1,39 % ²
Auf NOK lautende Klassen		
Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Jul. 2017)	5,39 %	0,91 %
Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (NOK Hedged)	5,08 %	1,11 %
Auf SEK lautende Klassen		
Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Aug. 2023)	—	3,78 %
Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (SEK Hedged)	—	3,46 %

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der 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 Teilfonds

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

- » Die Titelauswahl im Bankensektor trug zur Wertentwicklung bei, da sich das übergewichtete Engagement in vorrangigen Schuldtiteln einer ausgewählten Schweizer Bank vor dem Hintergrund ihrer Übernahme durch einen höher bewerteten Wettbewerber überdurchschnittlich entwickelte.
- » Ein untergewichtete Engagement in staatlichen Titeln trug zur Wertentwicklung bei, da sich der Sektor unterdurchschnittlich entwickelte.
- » Die Titelauswahl bei Finanzunternehmen kam der Wertentwicklung zugute, da das Engagement in einem ausgewählten Emittenten den breiteren Markt übertraf.
- » Durationsstrategien und insbesondere die Kurvenpositionierung in der US-Duration belasteten die Wertentwicklung.
- » Währungsstrategien und insbesondere Short-Positionen im Euro im vierten Quartal schmälerten die Wertentwicklung, da der Euro gegenüber dem US-Dollar aufwertete.

Durchschnittliche jährliche Gesamtrendite für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018)	8,26 %	2,99 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2018)	8,14 %	2,99 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018)	7,25 %	2,11 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 14. Sep. 2018)	7,14 %	2,11 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 03. Sep. 2020)	8,01 %	2,68 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 18. Jan. 2022)	7,99 %	2,14 %
Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index	4,65 %	1,58 % ²
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Okt. 2023)	—	4,00 %
Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index (CHF Hedged)	—	1,64 %
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018)	5,94 %	0,91 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Nov. 2021)	5,97 %	0,19 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018)	5,03 %	0,04 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2018)	4,96 %	0,03 %
Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index (EUR Hedged)	2,51 %	(0,40 %)²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018)	7,52 %	1,97 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2018)	7,43 %	1,94 %
Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index (GBP Hedged)	4,01 %	0,72 %
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Okt. 2020)	6,62 %	2,39 %
Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index (SGD Hedged)	3,20 %	(0,29 %)²

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Low Duration Income Fund strebt unter Anwendung einer umsichtigen Anlageverwaltung attraktive Erträge an. Der langfristige Kapitalzuwachs gilt als sekundäres Anlageziel. Der Teilfonds 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 Teilfonds

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

- » Ein Engagement in US-Barzinsen trug zur Wertentwicklung bei, da die kurzfristigen US-Zinsen positiv blieben.
- » Ein Long-Engagement in hochverzinslichen Unternehmensanleihen steigerte die Wertentwicklung, da sich deren Spreads verengten.
- » Ein Long-Engagement in Unternehmensanleihen mit Investment Grade war der Wertentwicklung zuträglich, da sich die Spreads verengten.
- » Ein Long-Engagement in verbrieften Krediten, unter anderem in europäischen Residential Mortgage Backed Securities und Commercial Mortgage Backed Securities, trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere verengten.
- » Das Long-Engagement bei US-Agency-MBS war der Wertentwicklung abträglich, da sich die Spreads dieser Wertpapiere ausweiteten.
- » Ein Short-Engagement in japanischer Duration im mittleren Teil der Kurve schmälerte die Wertentwicklung, da mittelfristige japanische Zinsen fielen.
- » Ein Long-Engagement im japanischen Yen belastete die Wertentwicklung, da der japanische Yen gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Jan. 2016)	7,03 %	2,03 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 07. Mrz. 2019)	6,95 %	1,31 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 15. Sep. 2021)	7,58 %	(0,26 %)
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index ³	5,20 %	1,68 % ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Jan. 2016)	4,91 %	0,06 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 04. Apr. 2018)	4,86 %	(0,43 %)
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jan. 2018)	4,40 %	(0,88 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Okt. 2017)	4,06 %	(1,30 %)
Euro Short-Term Rate (ESTER) Index ⁴	3,29 %	0,09 % ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Jan. 2016)	6,34 %	1,11 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2019)	6,25 %	0,61 %
ICE BofA SONIA Overnight Rate Index ⁵	4,78 %	1,06 % ²

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

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

³ Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Low Duration Opportunities Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2022: 1-Monats-USD-LIBOR-Index; ab 1. 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-Monats-Euribor-Index; ab 1. Juli 2021: Euro Short-Term Rate (ESTER) Index.

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Low Duration Opportunities 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 Teilfonds strebt Renditen an, die mittel- bis langfristig den ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (ein Maß der Rendite von Geldmarktpapieren) übersteigen. Hierfür investiert er auf Basis der Beurteilung globaler Rentenwerte durch die Anlageberatungsgesellschaft flexibel in eine Vielzahl festverzinslicher Instrumente.

Kommentare zum Teilfonds

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

- » Ein Engagement in US-Barzinsen leistete einen Beitrag zur Wertentwicklung, da diese positiv blieben.
- » Ein Long-Engagement in Unternehmensanleihen mit Investment Grade war der Wertentwicklung zuträglich, da sich die Spreads verengten.
- » Ein Long-Engagement bezogen auf die US-Duration im vorderen und mittleren Teil der Kurve trug zur Wertentwicklung bei, da die kurz- und mittelfristigen Zinsen in den USA fielen.
- » Das Long-Engagement in Collateralized Loan Obligations („CLOs“) mit AAA-Rating leistete einen positiven Beitrag zur Wertentwicklung, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere verengten.
- » Ein Short-Engagement im polnischen Zloty schmälerte die Wertentwicklung, da die Währung gegenüber dem US-Dollar aufwertete.
- » Ein Long-Engagement in hochverzinslichen Unternehmensanleihen belastete die Wertentwicklung, da diese Wertpapiere infolge der Titelauswahl negative Renditen verbuchten.
- » Ein Short-Engagement in polnischer Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die Zinsen dort sanken.
- » Ein Short-Engagement im Euro schmälerte die Wertentwicklung, da die Währung gegenüber dem US-Dollar aufwertete.

Durchschnittliche jährliche Gesamterrendite für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	5,56 %	3,13 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	5,43 %	3,09 %
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index	5,20 %	4,59 %
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	3,37 %	0,77 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	3,26 %	0,72 %
Euro Short-Term Rate (ESTER)	3,31 %	2,54 %
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	4,87 %	2,30 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	4,92 %	2,30 %
ICE BofA SONIA Overnight Rate Index	4,78 %	4,05 %

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 langfristige Rendite bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung zu maximieren. Der Teilfonds verfolgt sein Anlageziel, indem er unter normalen Umständen mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio von Renteninstrumenten mit unterschiedlichen Laufzeiten anlegt. Die durchschnittliche Portfolioduration dieses Teilfonds bewegt sich normalerweise -1 Jahr bis +5 Jahre, je nach der Prognose der Anlageberatungsgesellschaft für den Zinssatz. Der Teilfonds ist bestrebt, unter normalen Marktbedingungen auf verschiedene Weise ökologische und soziale Merkmale zu bewerten, wie in der Teilfondsergänzung dargelegt, und zielt darauf ab, einen Teil seines Vermögens in nachhaltige Investitionen zu investieren.

Kommentare zum Teilfonds

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

- » Ein Engagement in US-Barzinsen trug zur Wertentwicklung bei, da die kurzfristigen US-Zinsen positiv blieben.
- » Ein Long-Engagement in Unternehmensanleihen mit Investment Grade kam der Wertentwicklung zugute, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere verengten.
- » Ein Long-Engagement in der australischen Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die dortigen Zinsen fielen.
- » Das taktische Engagement in der US-Duration war der Wertentwicklung abträglich, da die Carry-Niveaus bei mittelfristigen Anleihen niedriger waren als der Carry aus den Geldmarktzinsen.
- » Ein Short-Engagement im Euro schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Währung gegenüber dem US-Dollar aufwertete.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 25. Nov. 2014)	14,26 %	1,66 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Nov. 2014)	14,38 %	1,67 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 25. Nov. 2014)	13,21 %	0,50 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 07. Jun. 2019)	15,45 %	9,08 %
Alerian MLP Index	26,56 %	0,43 % ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Nov. 2014)	11,79 %	(0,37 %)
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Nov. 2014)	11,88 %	(0,34 %)
Alerian MLP Index EUR (Hedged)	23,64 %	(1,32 %)
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Nov. 2014)	13,47 %	(0,07 %)
Alerian MLP Index GBP (Hedged)	25,34 %	(1,13 %)

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund beabsichtigt, seine Erträge mithilfe umsichtiger Anlageverwaltung zu maximieren. Die vom Teilfonds angestrebte „Gesamterträge“ besteht aus Ertrag und Kapitalzuwachs. Der Teilfonds 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 Teilfonds kann in diese Instrumente entweder auf dem Sekundärmarkt oder während einer Neuemission anlegen.

Kommentare zum Teilfonds

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

- » Ein Engagement in Aktien von Midstream-Energieunternehmen trug zu den absoluten Renditen bei, da der Sektor positive Renditen verzeichnete.
- » Die Titelauswahl im Teilssektor Datenerhebung und -verarbeitung trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Beteiligungen des Fonds innerhalb dieses Sektors eine Outperformance erzielten.
- » Die Titelauswahl unter Verflüssigungsunternehmen leistete einen Beitrag zu den relativen Renditen, da die Beteiligungen des Fonds innerhalb dieses Sektors eine Outperformance erzielten.
- » Die Untergewichtung von Marketing- und Vertriebsunternehmen in beeinträchtigte die relativen Renditen, da der Sektor positive Renditen erzielte.
- » Die Titelauswahl im Erdölraffineriesektor war den relativen Renditen abträglich, da die Beteiligungen des Fonds innerhalb dieses Sektors eine Underperformance aufwiesen.
- » Die Titelauswahl im Teilssektor für Erdgasbeförderung in Pipelines schmälerte die relativen Renditen, da die Beteiligungen des Fonds innerhalb dieses Sektors eine Underperformance aufwiesen.

Durchschnittliche jährliche Gesamtrendite für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	6,98 %	2,02 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	7,06 %	2,04 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 12. Mai 2017)	6,60 %	1,42 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	6,57 %	1,67 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	5,99 %	1,12 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	6,03 %	1,11 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 14. Mai 2020)	6,77 %	1,51 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 02. Okt. 2023)	—	4,00 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 03. Sep. 2019)	7,77 %	4,01 %
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index ³	5,20 %	2,00 % ²
Auf CAD lautende Klassen		
Institutional CAD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 01. Jun. 2021)	6,37 %	(0,58 %)
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (CAD Hedged) ³	4,64 %	2,36 %
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	2,68 %	(0,60 %)
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (CHF Hedged) ³	0,95 %	(0,64 %)
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	4,82 %	0,01 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	4,76 %	0,01 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. Jan. 2017)	3,87 %	(0,89 %)
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (EUR Hedged) ³	3,11 %	0,01 %
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	6,32 %	1,06 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	6,49 %	1,08 %
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (GBP Hedged) ³	4,62 %	1,08 %

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

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

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

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

- » Eine positive Durationsposition, insbesondere im mittleren Bereich der US-Renditekurve, kam der Wertentwicklung zugute, da die Zinsen zurückgingen.
- » Ein Engagement in vorrangigen Non-Agency-RMBS gereichte der Wertentwicklung zum Vorteil, da sich deren Spreads verengten.
- » Ein Engagement in vorrangigen forderungsbesicherten Wertpapieren (ABS) trug zur Wertentwicklung bei, da die Anlageklasse positive Renditen erzielte.
- » Agency MBS Relative-Value-Strategien belasteten die Wertentwicklung, da sich die Spreads leicht ausweiteten.
- » Ein Engagement in einem ausgewählten Non-Agency-CMBS belastete die Wertentwicklung, da der Titel zurückblieb.
- » Es gab keine weiteren wesentlichen Verlustbringer für diesen Teilfonds.

Durchschnittliche jährliche Gesamterrendite für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Dez. 1998)	26,24 %	7,37 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 22. Nov. 2001)	26,24 %	8,59 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 07. Jan. 1999)	25,80 %	6,87 %
BE Retail, thesaurierend (Auflegung: 28. Apr. 2022)	23,79 %	4,23 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 11. Sep. 2006)	25,11 %	8,78 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 08. Jan. 2020)	25,98 %	10,24 %
S&P 500 Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden)	25,67 %	6,96 % ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2012)	23,21 %	11,11 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Aug. 2017)	22,10 %	8,03 %
S&P 500 (EUR Hedged) Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden)	22,19 %	10,75 % ²

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Teilfonds

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

- » Das Engagement des Teilfonds in mit dem S&P 500 Index verbundenen Aktienindexderivaten wirkte sich positiv auf die absoluten Renditen aus, da der S&P 500 Net Total Return Index eine Rendite von 25,67 % verbuchte.
- » Die Alpha-Anleihestrategie des Teilfonds trug zur Rendite bei. Die Wertentwicklung war vor allem auf die folgenden Faktoren zurückzuführen:
 - » Ein Long-Engagement in Unternehmensanleihen mit Investment Grade trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
 - » Positionen bei Non-Agency-MBS trugen zur Rendite bei, da sich die Spreads verengten.
 - » Long-Engagements in US-Zinssätzen waren den Renditen abträglich, da das Engagement des Teilfonds in der ersten Jahreshälfte, als die Zinssätze stiegen, erhöht war.
 - » Ein Short-Engagement in hochverzinslichen Unternehmensanleihen belastete die Wertentwicklung, da sich die Spreads verengten.

Durchschnittliche jährliche Gesamrendite für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Mrz. 2019)	27,08 %	12,99 %
S&P 500 Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden)	25,67 %	12,89 %

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 Gesamrendite 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 Teilfonds

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

- » Das Engagement des Teilfonds in mit dem S&P 500 Index verbundenen Aktienindexderivaten wirkte sich positiv auf die absoluten Renditen aus, da der S&P 500 Net Total Return Index eine Rendite von 25,67 % verbuchte.
- » Die Alpha-Anleihestrategie des Teilfonds trug zur Rendite bei. Die Wertentwicklung war vor allem auf die folgenden Faktoren zurückzuführen:
 - » Ein Long-Engagement in Unternehmensanleihen mit Investment Grade trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
 - » Bestände in Collateralized Loan Obligations trugen zur Rendite bei, da sich die Spreads verengten.
 - » Ein Long-Engagement in US-Zinssätzen belastete die Renditen in Zeiträumen, in denen die Zinssätze stiegen.
 - » Ein Long-Engagement in brasilianischen Zinssätzen war den Renditen abträglich, da das Engagement des Teilfonds bei steigenden Zinssätzen erhöht war.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 14. Mrz. 2018)	9,88 %	3,69 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 16. Dez. 2013)	8,88 %	3,75 %
Class E, ausschüttend II (Auflegung: 16. Dez. 2013)	8,91 %	3,75 %
75 % Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index/25 % MSCI ACWI High Dividend Yield Index ³	6,53 %	3,77 % ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Dez. 2013)	7,34 %	3,21 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Dez. 2013)	6,46 %	2,27 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 16. Dez. 2013)	6,43 %	2,27 %
Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	5,99 %	1,17 %
Class T EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	6,04 %	1,18 %
75 % Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index (EUR Hedged)/25 % MSCI ACWI High Dividend Yield Index (EUR Hedged) ³	3,92 %	2,35 % ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jul. 2022)	8,91 %	5,38 %
75 % Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index (GBP Hedged)/25 % MSCI ACWI High Dividend Yield Index (GBP Hedged) ³	5,40 %	0,48 %

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

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Teilfonds

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

- » Ein Engagement in US-Barzinsen trug zur Wertentwicklung bei, da die dortigen kurzfristigen Zinsen positiv blieben.
- » Ein Long-Engagement in der US-Duration im mittleren Teil der Kurve war für die Wertentwicklung vorteilhaft, da die mittelfristigen Zinssätze in den USA fielen.
- » Ein Long-Engagement in einem ausgewählten Korb von Schwellenländerwährungen trug zur relativen Wertentwicklung bei, da diese Währungen gegenüber dem US-Dollar aufwerteten.
- » Ein Long-Engagement bei US-Aktien trug zur Wertentwicklung bei, da US-Aktien während des Berichtszeitraums positiv abschnitten.
- » Bestände in hochverzinslichen Unternehmensanleihen trugen zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere verengten.
- » Ein Long-Engagement im japanischen Yen belastete die Wertentwicklung, da der japanische Yen gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.
- » Bestände in Non-Agency-MBS waren der Wertentwicklung abträglich, da die Kurse dieser Wertpapiere nachgaben.
- » Ein Short-Engagement in japanischer Duration im mittleren Teil der Kurve schmälerte die Wertentwicklung, da mittelfristige japanische Zinsen fielen.
- » Ein Long-Engagement im argentinischen Pesos schmälerte die Wertentwicklung, da die Währung gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 1998)	6,27 %	4,42 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Apr. 2000)	6,29 %	4,40 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 28. Jan. 1999)	5,92 %	3,87 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 23. Okt. 2000)	5,94 %	3,84 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 16. Mai 2003)	5,77 %	2,99 %
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 21. Jul. 2022)	6,74 %	1,03 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	5,36 %	2,74 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 10. Okt. 2005)	5,35 %	2,65 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Okt. 2002)	6,11 %	3,61 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Mai 2018)	6,15 %	1,04 %
Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	5,01 %	0,29 %
Bloomberg U.S. Aggregate Index	5,53 %	3,99 % ²
Auf CAD lautende Klassen		
Institutional CAD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 02. Mai 2013)	5,37 %	1,12 %
Bloomberg U.S. Aggregate (CAD Hedged) Index	4,61 %	1,24 %
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 24. Jun. 2011)	1,74 %	(0,03 %)
Investor CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 24. Jun. 2011)	1,28 %	(0,38 %)
Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 19. Sept. 2012)	0,84 %	(1,52 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (CHF Hedged) Index	0,82 %	(0,07 %) ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Dez. 2003)	3,82 %	2,56 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	3,78 %	2,48 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Dez. 2004)	3,47 %	2,08 %
Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Okt. 2009)	3,32 %	0,80 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	2,88 %	1,66 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Mrz. 2012)	2,81 %	(0,58 %)
Class R EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	3,47 %	(0,42 %)
Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	2,58 %	(1,42 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (EUR Hedged) Index	3,01 %	2,12 % ²
Auf EUR lautende Klassen (nicht abgesichert)		
Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 13. Jun. 2002)	2,66 %	3,04 %
Bloomberg U.S. Aggregate Index (EUR Unhedged) Index	1,96 %	2,69 %
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 26. Mrz. 2010)	5,39 %	1,87 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	5,35 %	3,32 %
Bloomberg U.S. Aggregate (GBP Hedged) Index	4,47 %	2,91 % ²
Auf HKD lautende Klassen		
M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 20. Feb. 2013)	5,43 %	0,59 %
Bloomberg U.S. Aggregate (HKD Unhedged) Index	5,58 %	1,60 %
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 11. Jan. 2011)	4,60 %	1,88 %
Administrative SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Feb. 2023)	—	3,14 %
Class E SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Feb. 2007)	3,64 %	2,17 %
Bloomberg U.S. Aggregate (SGD Hedged) Index	3,78 %	2,68 % ²

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Total Return Bond Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Gesamterträge erzielen. Der Teilfonds 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 Teilfonds

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

- » Die taktische Durationspositionierung in den USA, einschließlich eines übergewichteten Engagements im mittleren Teil der Kurve und eines untergewichteten Engagements am langen Ende, trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die US-Renditen stiegen.
- » Positionen in verbrieften Krediten, insbesondere Collateralized Loan Obligations und Non-Agency Mortgage-Backed Securities („MBS“), leisteten einen Beitrag zur relativen Wertentwicklung, da sich die Spreads verengten.
- » Die Auswahl bei Unternehmensanleihen mit Investment Grade trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads ausweiteten.
- » Ein übergewichtetes Engagement in Agency-MBS trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Eine untergewichtete Position in hochverzinslichen Unternehmensanleihen belastete die relative Wertentwicklung, da sich die Spreads verengten.
- » Ein Short-Engagement in der Duration in Japan war der relativen Wertentwicklung abträglich, da die Renditen dort im ersten, zweiten und vierten Quartal sanken.
- » Ein moderates Engagement im japanischen Yen schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Währung gegenüber dem US-Dollar abwertete.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2015)	(3,52 %)	2,49 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 23. Sep. 2022)	(3,92 %)	(7,47 %)
Class E, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2015)	(4,58 %)	1,38 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 23. Aug. 2022)	(3,65 %)	(1,78 %)
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 15. Dez. 2021)	(2,15 %)	4,49 %
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index ³	5,20 %	1,74 % ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2015)	(5,14 %)	0,81 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 23. Sep. 2022)	(5,54 %)	(9,00 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2015)	(6,25 %)	(0,30 %)
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (EUR Hedged) ³	3,11 %	0,04 % ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Nov. 2022)	(3,74 %)	(4,40 %)
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Sep. 2022)	(3,75 %)	(7,42 %)
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (GBP Hedged) ³	4,62 %	4,16 % ²

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

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

³ Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2022: 3-Monats-USD-LIBOR-Index; ab 1. Juli 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 Teilfonds dargestellt), Schuldtitel, Aktienindizes, volatilitätsbezogene Instrumente (einschließlich u.a. Futures auf volatilitätsbezogene Indizes) und rohstoffbezogene Instrumente (wie im Verkaufsprospekt des Teilfonds dargestellt) investiert.

Kommentare zum Teilfonds

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

- » Die Positionierung über ein breites Spektrum globaler Zinsmärkte hinweg führte zu Verlusten aufgrund mehrerer starker Umkehrungen während des Jahres. Bemerkenswerte Verlustbringer waren Short-Positionen in Chile und Südafrika sowie Long-Positionen in ungarischen Zinssätzen.
- » Short-Positionen im thailändischen Baht, neuseeländischen Dollar und in der indischen Rupie gegenüber dem US-Dollar belasteten die Wertentwicklung aufgrund von Kursrückschlägen.
- » Die Positionierung in Aktien aus dem asiatisch-pazifischen Raum führte im Laufe des Jahres aufgrund mehrerer starker Umkehrungen zu Verlusten. Bemerkenswerte Verlustbringer waren unter anderem Positionen in den Indizes für Singapur, China und Korea.
- » Long-Positionen im mexikanischen Peso und im kolumbianischen Peso, die jeweils im Vergleich zum US-Dollar zulegen konnten, und Short-Positionen im chinesischen Renminbi, der im Vergleich zum US-Dollar nachgab, waren der Wertentwicklung zuträglich.
- » Short-Positionen in Erdgas trugen zur Wertentwicklung bei, da die Energiepreise zurückgingen.
- » Short-Positionen in der impliziten Volatilität von US-amerikanischen und europäischen Aktien leisteten infolge der anhaltend niedrigen Volatilität einen Beitrag zur Wertentwicklung.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

Auf GBP lautende Klassen	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2007)	8,52 %	4,31 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 08. Jul. 2016)	8,55 %	0,79 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 20. Nov. 2019)	9,02 %	(1,72 %)
ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts Index	8,62 %	4,08 % ²

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der UK Corporate Bond Fund beabsichtigt, seine Erträge mithilfe umsichtiger Anlageverwaltung zu maximieren. Der Teilfonds 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 Teilfonds

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

- » Ein untergewichtetes Engagement in Staatsanleihen, vor allem in supranationalen Anleihen, trug zur Wertentwicklung bei, da sich der Sektor unterdurchschnittlich entwickelte.
- » Die Titelauswahl im Einzelhandelssektor trug zur Wertentwicklung bei, da sich ausgewählte Emittenten überdurchschnittlich entwickelten.
- » Die Titelauswahl im Immobiliensektor trug zur Wertentwicklung bei, da sich ausgewählte Emittenten überdurchschnittlich entwickelten.
- » Makrostrategien und insbesondere die Positionierung in Pfund Sterling-Zinssätzen belasteten die Wertentwicklung.
- » Die Titelauswahl bei Banken und Maklern schmälerte die Wertentwicklung, da sich das Engagement in nachrangigen Schuldtiteln eines ausgewählten Emittenten unterdurchschnittlich entwickelte.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

Auf GBP lautende Klassen	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2005)	9,57 %	4,23 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 14. Aug. 2008)	9,55 %	5,21 %
ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts 10+ Index ³	10,57 %	3,86 % ²

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

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der UK Long Term Corporate Bond Fund möchte bei gleichzeitigem Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung den höchstmöglichen Gesamtertrag erzielen. Der Teilfonds 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 Teilfonds

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

- » Die Titelauswahl bei verbrieften Wertpapieren trug zur Wertentwicklung bei, da sich das Engagement in ausgewählten Emittenten überdurchschnittlich entwickelte und ausgewählte nichtige Emittenten zurückblieben.
- » Die Titelauswahl im Einzelhandelssektor trug zur Wertentwicklung bei, da sich ausgewählte Emittenten überdurchschnittlich entwickelten.
- » Die Titelauswahl bei Banken und Brokerage war der Wertentwicklung abträglich, da sich das Engagement in nachrangigen Schuldtiteln eines ausgewählten Emittenten unterdurchschnittlich entwickelte.
- » Makrostrategien schmälerten die Performance aufgrund der Positionierung in Pfund Sterling-Zinssätzen.
- » Die Titelauswahl bei Versorgern schadete der Wertentwicklung, da ausgewählte untergewichtete Emittenten eine Outperformance verzeichneten.

Durchschnittliche jährliche Gesamterrendite für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 28. Mai 1998)	12,88 %	5,61 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 23. Jan. 2001)	12,83 %	5,93 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 18. Mrz. 1999)	12,48 %	5,26 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 14. Jan. 1999)	12,49 %	5,24 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	11,84 %	4,42 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 31. Jul. 2006)	11,89 %	4,50 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Okt. 2002)	12,68 %	6,63 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2020)	12,72 %	1,82 %
M Retail, ausschüttend (Auflegung: 11. Jan. 2012)	11,90 %	4,23 %
Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	12,64 %	4,30 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 29. Jun. 2016)	13,48 %	5,22 %
ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index ³	13,47 %	5,83 % ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Apr. 2003)	10,34 %	4,95 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	10,37 %	4,23 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Feb. 2003)	9,96 %	4,86 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	9,34 %	3,24 %
ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index (EUR Hedged) ³	10,77 %	5,62 % ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2003)	11,91 %	5,58 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Jun. 2016)	11,96 %	3,32 %
ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index (GBP Hedged) ³	12,35 %	6,07 % ²

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

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

³ Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den US High Yield Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis zum 31. März 2015: ICE BofA Merrill Lynch US High Yield, BB-B Rated, Constrained Index; seit dem 1. 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 Gesamterrendite erzielen. Der Teilfonds versucht, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Gesamtvermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus hoch verzinslichen Rentenpapieren (wie im Verkaufsprospekt definiert) anlegt, die von Moody's mit Baa oder von S&P niedriger als BBB bewertet werden oder von Fitch ein entsprechendes Rating erhalten haben.

Kommentare zum Teilfonds

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

- » Ein übergewichtetes Engagement in und die Auswahl bei Baustofftiteln waren der Wertentwicklung zuträglich, da der Sektor während des Berichtszeitraums den Gesamtmarkt übertraf.
- » Ein untergewichtetes Engagement im Festnetzsektor trug zur Wertentwicklung bei, da der Sektor schlechter abschnitt als der Gesamtmarkt.
- » Die Titelauswahl unter Konsumdienstleistern trug zur Wertentwicklung bei, da ausgewählte nichtige Emittenten eine Underperformance verzeichneten.
- » Die Titelauswahl im Einzelhandelssektor belastete die Wertentwicklung, da sich ausgewählte Emittenten unterdurchschnittlich entwickelten.
- » Die Titelauswahl in den Sektoren Medien, Unterhaltung und Verlage war der Wertentwicklung abträglich, da ein ausgewählter übergewichteter Emittent eine Underperformance aufwies.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Sep. 2016)	8,82 %	1,91 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 15. Sep. 2016)	8,85 %	1,91 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 07. Nov. 2019)	7,80 %	(1,48 %)
Class E, ausschüttend (Auflegung: 08. Mrz. 2019)	7,81 %	0,45 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 23. Aug. 2022)	8,64 %	4,10 %
Bloomberg U.S. Credit Index	8,18 %	1,92 % ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Sep. 2016)	6,29 %	(0,28 %)
Bloomberg U.S. Credit Index (EUR Hedged)	5,50 %	(0,30 %)
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 15. Sep. 2016)	7,85 %	0,71 %
Bloomberg U.S. Credit Index (GBP Hedged)	6,99 %	0,74 %

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der US Investment Grade Corporate Bond Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Gesamterträge 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 Teilfonds

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

- » Die Titelauswahl im Bankensektor trug zur Wertentwicklung bei, da sich das übergewichtete Engagement in vorrangigen Schuldtiteln einer ausgewählten Schweizer Bank vor dem Hintergrund ihrer Übernahme durch einen höher bewerteten Wettbewerber überdurchschnittlich entwickelte.
- » Die Titelauswahl unter Versorgern trug zur Wertentwicklung bei, da ein ausgewählter übergewichteter Emittent eine Outperformance verzeichnete.
- » Ein untergewichtetes Engagement in staatlichen Titeln trug zur Wertentwicklung bei, da sich der Sektor unterdurchschnittlich entwickelte.
- » Das Engagement in verbrieften Titeln war der Wertentwicklung abträglich, da Agency-Hypothekenwerte und ausgewählte Nicht-Agency-Hypothekenwerte zurückblieben.
- » Ein untergewichtetes Engagement im Technologiesektor belastete die Wertentwicklung, da sich der Sektor überdurchschnittlich entwickelte.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2014)	5,81 %	1,95 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 11. Mrz. 2020)	5,87 %	2,10 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2014)	5,44 %	1,60 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2014)	5,46 %	1,56 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Dez. 2018)	5,66 %	1,92 %
Class Z, ausschüttend (Auflegung: 07. Aug. 2014)	6,34 %	2,44 %
FTSE 3-Month Treasury Bill Index	5,26 %	1,32 % ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Jan. 2016)	3,83 %	0,36 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 08. Jun. 2016)	3,46 %	(0,16 %)
ICE BofA Merrill Lynch 3-Month Treasury Bill Index (EUR Hedged)	2,93 %	(0,34 %) ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2023)	—	3,48 %
ICE BofA Merrill Lynch 3-Month Treasury Bill Index (GBP Hedged)	—	2,96 %

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der US Short-Term Fund ist bestrebt, bei Kapitalerhaltung und täglicher Liquidität höchstmögliche laufende Erträge zu erzielen. Der Teilfonds 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 Teilfonds richtet sich nach den Zinsprognosen der Anlageberatungsgesellschaft. Es wird nicht davon ausgegangen, dass sie länger als ein Jahr ist. Der Teilfonds 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 Teilfonds

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

- » Untergewichtung der US-Duration, da die inverse US-Renditekurve einen Carry-Vorteil gegenüber der Benchmark bot, als die kurzfristigen US-Zinsen stiegen.
- » Positionen bei Unternehmensanleihen mit Investment Grade, insbesondere Finanztitel, trugen zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Ein übergewichtetes Engagement bei Collateralized Loan Obligations trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Das übergewichtete Engagement in Agency Mortgage-Backed Securities (in erster Linie von Q1 und Q2 ») war der relativen Wertentwicklung abträglich, da sich die Spreads in diesem Zeitraum ausweiteten.
- » Es gab keine weiteren wesentlichen Verlustbringer für diesen Fonds.

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 BofA BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained ESG Tilt Index und JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index Global Diversified; alle in USD abgesichert	Der Bloomberg Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets Index bietet ein weites Vergleichsspektrum der globalen erstklassigen Rentenmärkte von Industrieländern. Der ICE BofA BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained ESG Tilt Index bildet die Wertentwicklung von Unternehmensanleihen mit einem Rating unterhalb von Investment Grade nach, die in Industrieländern ansässig sind und Ratings von BB1 bis B3 aufweisen, basierend auf einem Durchschnitt von Moody's, S&P und Fitch und angepasst um Wertpapiergewichtungen, um die Gesamtrisikobewertungen im Hinblick auf Umwelt, Soziales und Unternehmensführung („ESG“) des Index zu verbessern. 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 berücksichtigt bei der Indexzusammensetzung Umwelt-, Sozial- und Governance-Faktoren.
jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (USD Hedged), ICE BofA 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 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 Schuldverschreibungen nach, die ihren Firmensitz in Industrieländern haben und über eine erstklassige Bewertung langfristiger Fremdwährungsanleihen 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 verbrieft 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 weighted (USD Hedged)	Der Vergleichsindex ist eine Mischung bestehend aus 45 % Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (USD Hedged), 15 % JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (USD Unhedged), 20 % Bloomberg Commodity Total Return Index, 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (USD Unhedged) und 10 % Bloomberg Gold Subindex Total Return Index weighted (USD Hedged). Der Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index misst die Wertentwicklung der führenden Märkte für inflationsgekoppelte Staatsanleihen aus Industrieländern. Er ist nach Marktkapitalisierung gewichtet und umfasst Laufzeiten bis zu 30 Jahren. Der JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus bildet die Gesamtrenditen 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 verbrieft 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 U.S. Aggregate Bond Index (USD Hedged)	Der Vergleichsindex ist eine Mischung bestehend aus 60 % MSCI All Country World Index (ACWI) und 40 % Bloomberg U.S. Aggregate Bond (USD Hedged) Index. Der MSCI All Country World Index ist ein um Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index, der dazu gedacht ist, die Wertentwicklung der Aktienmärkte in Industrie- und Schwellenländern zu messen. Der Index besteht aus 47 Länderindizes, von denen 23 Indizes von Industrieländern und 23 Indizes von Schwellenländern sind. Der Bloomberg U.S. Aggregate Bond (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 Bloomberg U.S. Aggregate (EUR Hedged) Index bildet Wertpapiere ab, die bei der SEC registriert und steuerpflichtig sind sowie auf US-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. Der MSCI ACWI High Dividend Yield Index basiert auf dem MSCI ACWI (EUR Hedged), seinem Hauptindex, und umfasst Aktien mit hoher und mittlerer Marktkapitalisierung aus 23 Industrieländern und 24 Schwellenländern. Der Index ist so konzipiert, dass er die Wertentwicklung der Aktien im Mutterindex (ohne REITs) widerspiegelt, die höhere Dividendenrenditen und Qualitätsmerkmale als die durchschnittlichen Dividendenrenditen aufweisen, die sowohl nachhaltig als auch beständig sind. Der Index wendet auch Qualitätsfilter an und überprüft die 12-Monats-Performance in der Vergangenheit, um Aktien mit sich möglicherweise verschlechternden Fundamentaldaten auszuschließen, die sie zu einer Dividendenkürzung zwingen könnten.
Alerian MLP Index	Der Alerian MLP Index ist der führende Maßstab für Master Limited Partnership (MLPs) aus dem Energiesektor mit hoher und mittlerer Marktkapitalisierung. Es handelt sich um einen um Streubesitz bereinigten, marktkapitalisierungsgewichteten Index, der 50 führende Unternehmen umfasst.
Bloomberg AusBond Bank Bills Index	Der Bloomberg AusBond Bank Bills Index ist ein nicht verwalteter Index, der die Gesamtertragsleistung australischer Geldmarktpapiere abbildet. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
Bloomberg Commodity Index Total Return	Der Bloomberg Commodity Index Total Return ist ein nicht verwalteter Index aus Terminkontrakten auf eine Reihe physischer Rohstoffe. Der Index wurde als hoch liquider und diversifizierter Vergleichsindex für Rohstoffe als Vermögensklasse geschaffen. Die Futures-Engagements der Benchmark sind durch US-Schatzwechsel besichert. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
Bloomberg Euro-Aggregate 1-10 Year Bond Index	Der Bloomberg Euro Aggregate 1-10 Year Bond Index repräsentiert die Euro Aggregate 1-10-Jahreskomponente des Bloomberg Pan-European Aggregate Index. Der Bloomberg Euro-Aggregate Index besteht aus Anleihen, die in Euro oder den Euro-Vorgängerwährungen der 17 eigenstaatlichen Länder ausgegeben wurden, die an der Europäischen Währungsunion (EWU) teilnehmen. Bei allen Emissionen muss es sich um festverzinsliche Wertpapiere der Kategorie Investment Grade mit einer Restlaufzeit von mindestens einem Jahr handeln. Der Euro-Aggregate Index schließt wandelbare Wertpapiere, variabel verzinsliche Wechsel, Annuitätswechsel, Optionsscheine, gebundene Anleihen und strukturierte Produkte aus. Deutsche Schuldscheine (Quasi-Darlehens-Papiere) sind aufgrund ihrer Handelsbeschränkungen und ihres nicht notierten Status, der zu Illiquidität führt, ebenfalls ausgeschlossen. Das Emissionsland zählt nicht zu den Indexkriterien, und Wertpapiere von Emittenten außerhalb der Eurozone sind inbegriffen, wenn sie die Indexkriterien erfüllen. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
Bloomberg Euro-Aggregate Credit Index	Der Bloomberg Euro-Aggregate Credit Index ist die Anleihekomponekte des Bloomberg Euro-Aggregate Index. Der Bloomberg Euro-Aggregate Index besteht aus Anleihen, die in Euro oder den Euro-Vorgängerwährungen der 17 eigenstaatlichen Länder ausgegeben wurden, die an der Europäischen Währungsunion (EWU) teilnehmen. Bei allen Emissionen muss es sich um festverzinsliche Wertpapiere der Kategorie Investment Grade mit einer Restlaufzeit von mindestens einem Jahr handeln. Der Euro-Aggregate Index schließt wandelbare Wertpapiere, variabel verzinsliche Wechsel, Annuitätswechsel, Optionsscheine, gebundene Anleihen und strukturierte Produkte aus. Deutsche Schuldscheine (Quasi-Darlehens-Papiere) sind aufgrund ihrer Handelsbeschränkungen und ihres nicht notierten Status, der zu Illiquidität führt, ebenfalls ausgeschlossen. Das Emissionsland zählt nicht zu den Indexkriterien, und Wertpapiere von Emittenten außerhalb der Eurozone sind inbegriffen, wenn sie die Indexkriterien erfüllen. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
Bloomberg Euro Government (Germany, France, Netherlands) over 15 years Index	Der Bloomberg Euro Government (Germany, France, Netherlands) over 15 years 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 eigenstaatlichen Ländern begeben 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.
Bloomberg Global Aggregate (USD Hedged) Index	Der Bloomberg Global Aggregate (USD Hedged) Index bietet ein weites Vergleichsspektrum der internationalen Rentenmärkte der Kategorie Investment Grade. Die drei Hauptkomponenten dieses Index sind der U.S. Aggregate Index, der Pan-European Aggregate Index sowie der Asian-Pacific Aggregate Index. Des Weiteren beinhaltet der Index Eurodollar- sowie Euro-Yen-Industrieschuldverschreibungen, kanadische Staatsanleihen und US-Dollar-144A-Wertpapiere der Kategorie Investment Grade. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (USD Hedged)	Bei dem Bloomberg Global Aggregate Credit Index 1-5 Years Index (USD Hedged) handelt es sich um einen nicht gemanagten Index, der ein weites Vergleichsspektrum für die internationalen Rentenmärkte der Kategorie Investment Grade mit einer Laufzeit von mindestens einem 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 verbrieft 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)	Bei dem Bloomberg Global Aggregate Credit-Index (USD Hedged) handelt es sich um einen nicht gemanagten Index, der ein weites Vergleichsspektrum für die internationalen Rentenmärkte der Kategorie Investment Grade bietet. Die drei Hauptkomponenten dieses Index sind der U.S. Aggregate Index, der Pan-European Aggregate Index sowie der Asian-Pacific Aggregate Index. Dieser Index schließt Staatstitel und verbriefte Wertpapiere aus. Des Weiteren beinhaltet der Index Eurodollar- sowie Euro-Yen-Industrieschuldverschreibungen, kanadische Wertpapiere und US-Dollar-144A-Wertpapiere der Kategorie Investment Grade. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
Bloomberg Global Aggregate ex-USD (USD Hedged) Index	Der Bloomberg Global Aggregate ex-USD (USD Hedged) Index bietet ein weites Vergleichsspektrum der internationalen Rentenmärkte der Kategorie Investment Grade. Die drei Hauptkomponenten dieses Index sind der U.S. Aggregate Index, der Pan-European Aggregate Index sowie der Asian-Pacific Aggregate Index. Der Index enthält auch Eurodollar- und Euro-Yen-Unternehmensanleihen, kanadische Staats-, Agency- und Unternehmenswertpapiere sowie auf USD lautende 144A-Wertpapiere mit Investment-Grade-Rating.
Bloomberg MSCI Green Bond Index (USD Hedged)	Der Bloomberg MSCI Green Bond (USD Hedged) Index bietet Anlegern ein objektives und robustes Maß für den globalen Markt für festverzinsliche Wertpapiere, die zur Finanzierung von Projekten mit direktem Umweltnutzen ausgegeben werden. Es wird eine unabhängige, analysegestützte Methodik verwendet, um indexfähige grüne Anleihen zu bewerten und sicherzustellen, dass sie die etablierten Green-Bond-Prinzipien einhalten, und um die Anleihen nach der umweltfreundlichen Verwendung ihrer Erlöse zu klassifizieren. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
Bloomberg U.S. Aggregate Index	Der Bloomberg U.S. Aggregate Index bildet Wertpapiere ab, die bei der SEC registriert und steuerpflichtig sind sowie auf Dollar lauten. Der Index deckt den erstklassigen US-Festzinsanleihemarkt ab und beinhaltet Indexkomponenten für Staatstitel sowie Industrieschuldverschreibungen, Hypotheken-Durchlauf-Wertpapiere sowie forderungsbesicherte Wertpapiere. Diese Hauptsektoren unterteilen sich in spezifischere Indizes, die regelmäßig berechnet und veröffentlicht werden. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index	Der Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index bildet Wertpapiere ab, die bei der SEC registriert und steuerpflichtig sind, auf US-Dollar lauten und eine Laufzeit zwischen ein und drei Jahren haben. Der Index deckt den erstklassigen US-Festzinsanleihemarkt ab und beinhaltet Indexkomponenten für Staatstitel sowie Industrieschuldverschreibungen, Hypotheken-Durchlauf-Wertpapiere sowie forderungsbesicherte Wertpapiere. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
Bloomberg U.S. Credit Index	Bei dem Bloomberg U.S. Credit Index handelt es sich um einen nicht gemanagten Index, der aus öffentlich begebenen Schuldverschreibungen von Unternehmen und bestimmten nicht US-amerikanischen Emittenten sowie besicherten Anleihen besteht, die bestimmten Anforderungen in Bezug auf Laufzeit, Liquidität und Qualität entsprechen. Um für den Index in Frage zu kommen, müssen die Anleihen bei der SEC registriert sein. Dieser Index wurde zuvor als Bloomberg Credit Investment Grade Index bezeichnet. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond (USD Hedged) Index	Der Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond (USD Hedged) Index misst die Wertentwicklung der führenden Märkte für inflationsgekoppelte Staatsanleihen. Der Index umfasst von den folgenden Ländern emittierte, inflationsgekoppelte Schuldtitel: Australien, Kanada, Frankreich, Schweden, das Vereinigte Königreich und die USA. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (USD Hedged)	Bei dem Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (USD Hedged) handelt es sich um einen Index, der die Wertentwicklung der weltweiten Märkte für inflationsgekoppelte Staatsanleihen mit einer Laufzeit von mindestens 1 Jahr und weniger als 5 Jahren misst. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
Canadian Overnight Repo Rate (CORRA)	Der Canadian Overnight Repo Rate (CORRA) misst die Kosten der Besicherung von Tagesgeldaufnahmen in kanadischen Dollar durch mit Schatzwechsel und Anleihen der kanadischen Regierung besicherte Pensionsgeschäfte.
FTSE 3-Month Treasury Bill Index	Bei dem FTSE 3-Month Treasury Bill Index handelt es sich um einen nicht gemanagten Index, der die monatliche Ertrags-Äquivalente der Renditedurchschnitte der US-Schatzwechselemissionen der vergangenen drei Monate repräsentiert. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
FTSE Euro Broad Investment- Grade Index	Bei dem FTSE Euro Broad Investment Grade Index handelt es sich um einen Index des auf Euro basierenden Rentenmarkts der Kategorie Investment Grade, der institutionellen Anlegern (in Euro) zugänglich ist. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
ICE BofA 3-Month German Treasury Bill Index	Der ICE BofA 3-Month German Treasury Bill Index 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 jeder Neugewichtung am Monatsende ausgewählte Emission ist der umlaufende Bundesschatzbrief, der in den nächsten drei Monaten nach dem Neugewichtungstermin, jedoch nicht weniger als in einem Monat fällig wird. Um für die Auswahl berücksichtigt zu werden, muss ein Schatzbrief am oder vor dem Neugewichtungsdatum am Monatsende abgewickelt worden sein.
ICE BofA 1-3 Year U.S. Treasury Index	Bei dem ICE BofA 1-3 Year U.S. Treasury Index handelt es sich um einen nicht gemanagten Index, der US Treasuries (ausgenommen inflationsbesicherte Wertpapiere und STRIPS) mit mindestens 1 Mrd. 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 3-Month Treasury Bill Index (EUR Hedged)	Der ICE BofA 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-monatiger Schatzwechsel ausgewählt werden.

Offizieller Name des Vergleichsindex	Beschreibung des Index
ICE BofA BB-B European Currency High Yield Constrained Index	Der ICE BofA BB-B European Currency High Yield Constrained 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.
ICE BofA BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into USD	Der ICE BofA 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 Schuldverschreibungen nach, die ihren Firmensitz in Industrieländern haben und über eine erstklassige Bewertung langfristiger Fremdwährungsanleihen 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 Sterling Non-Gilts 10+ Index	Der ICE BofA 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 Sterling Non-Gilts Index	Der ICE BofA 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 U.S. High Yield Constrained Index	Der ICE BofA 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 den SARON bis zu einer angegebenen Fälligkeit zahlt. Der Index basiert auf dem angenommenen Kauf eines synthetischen Instruments zum Nennwert, das genau die angegebene Laufzeit hat und mit einem Kupon in Höhe des Fixing-Satzes des jeweiligen Tages ausgestattet ist. Es wird davon ausgegangen, dass diese Emission am folgenden Geschäftstag verkauft (mit einer Rendite, die dem Fixing-Satz 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 den SOFR bis zu einer angegebenen Fälligkeit zahlt. Der Index basiert auf dem angenommenen Kauf eines synthetischen Instruments zum Nennwert, das genau die angegebene Laufzeit hat und mit einem Kupon in Höhe des Fixing-Satzes des jeweiligen Tages ausgestattet ist. Es wird davon ausgegangen, dass diese Emission am folgenden Geschäftstag verkauft (mit einer Rendite, die dem Fixing-Satz 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 den SONIA bis zu einer angegebenen Fälligkeit zahlt. Der Index basiert auf dem angenommenen Kauf eines synthetischen Instruments zum Nennwert, das genau die angegebene Laufzeit hat und mit einem Kupon in Höhe des Fixing-Satzes des jeweiligen Tages ausgestattet ist. Es wird davon ausgegangen, dass diese Emission am folgenden Geschäftstag verkauft (mit einer Rendite, die dem Fixing-Satz des aktuellen Tages entspricht) und in ein neues Instrument übertragen wird.
JPMorgan Asia Credit Index	Der JPMorgan Asia Credit Index misst die Wertentwicklung des asiatischen Marktes für auf USD lautende Anleihen ohne Japan. Der Index bietet eine Benchmark für Anlagegelegenheiten in auf US-Dollar lautenden festverzinslichen Instrumenten, die von staatlichen, quasi-staatlichen und halbstaatlichen Emittenten aus Asien (ohne Japan) begeben werden.
JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified (CEMBI)	Bei dem JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified (CEMBI) handelt es sich um eine besondere, gewichtete Version des CEMBI-Index. Er beschränkt den Anteil der Indexländer mit umfangreicheren Industrieschuldverschreibungen, indem er nur einen bestimmten Anteil des aktuell bankfähigen Nennwerts der Schulden dieser Länder einbezieht. Der CEMBI Diversified führt zu gut verteilten, ausgeglicheneren Gewichtungen für die im Index enthaltenen Länder. Die vom CEMBI Diversified abgedeckten Länder sind mit den vom CEMBI abgedeckten identisch. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (Unhedged)	Der JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (Unhedged) bildet die Gesamterträge für auf lokale Währungen lautende Geldmarktinstrumente in 22 Schwellenmarktländern mit mindestens 10 Mrd. 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 (EMBI) Global Diversified bildet die Gesamterträge von auf US-Dollar lautenden Schuldinstrumenten nach, die von staatlichen und quasi-staatlichen Emittenten aus Schwellenländern begeben werden, und berücksichtigt bei der Indexzusammensetzung Umwelt-, Sozial- und Governance-Faktoren.

Beschreibungen der Vergleichsindizes (Forts.)

Offizieller Name des Vergleichsindex	Beschreibung des Index
JPMorgan ESG Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index	Der JPMorgan ESG Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified (JESG GBI-EM) bildet die Wertentwicklung von Anleihen nach, die von Regierungen von Schwellenländern begeben werden und auf die Lokalwährung des Emittenten lauten. Der Index wendet eine Scoring- und Screening-Methode für Umwelt, Soziales und Governance (ESG) an, um Emittenten, die bei ESG-Kriterien höher eingestuft sind, und grüne Anleihen zu bevorzugen und Emittenten, die niedriger eingestuft sind, unterzugewichten oder auszuschließen.
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 Asia Credit Index Composite Total Return (EUR Hedged)	Der JPMorgan Asia Credit Index (EUR Hedged) misst die Wertentwicklung des asiatischen Marktes für auf USD lautende Anleihen ohne Japan. Der Index bietet eine Benchmark für Anlagegelegenheiten in auf US-Dollar lautenden festverzinslichen Instrumenten, die von staatlichen, quasi-staatlichen und halbstaatlichen Emittenten aus Asien (ohne Japan) begeben werden.
JPMorgan Asia Credit Index Non-Investment Grade	Der JPMorgan Asia Credit Index Non-Investment Grade umfasst festverzinsliche, auf US-Dollar lautende hochverzinsliche Anleihen, die von Staaten, quasi-staatlichen Stellen, Banken und Unternehmen in Asien begeben wurden. Der bestehende JPMorgan Asia Credit Index Non-Investment Grade 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 PIMCO GLADI-Methode ist geistiges Eigentum, das durch das US-Patent Nr. 8.306.892 geschützt ist. GLOBAL ADVANTAGE und GLADI sind Markenzeichen von Pacific Investment Management Company LLC.
S&P 500 Index	Der S&P 500 Index 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 enthält den Tagesgeldsatz für den Shekel und entspricht dem Leitzins der Bank of Israel. An Tagen, an denen der SHIR nicht veröffentlicht wird, entspricht sein Wert dem des letzten Tages, an dem er veröffentlicht wurde. Der Leitzins der Bank of Israel wird achtmal im Jahr vom Währungsausschuss der Bank of Israel festgelegt, in der Regel an Montagen um 16.00 Uhr. Die Termine für die Veröffentlichung und Anwendung der Zinssätze der Bank of Israel werden jedes Jahr auf der Website der Bank of Israel veröffentlicht. Der SHIR wird täglich bis 11:00 Uhr auf der Website der Bank of Israel veröffentlicht, mit Ausnahme von Samstagen, Sonntagen und zusätzlichen Tagen, die jährlich auf der Website der Bank of Israel veröffentlicht werden. Diese 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 Durchschnittssatz für Kreditgeschäfte auf dem unbesicherten Interbanken-Tagesgeldmarkt in Singapur in US-Dollar.

Finanzstatus

(Angaben in Tausend)

	PIMCO Asia High Yield Bond Fund		Asia Strategic Interest Bond Fund	
	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Aktiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes				
Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	\$ 2.167.937	\$ 2.652.171	\$ 160.430	\$ 276.959
Investmentfonds	212.144	239.979	11.571	29.746
Pensionsgeschäfte	3.856	20.572	252	820
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	0
Finanzderivate	22.105	54.267	1.399	3.700
Zahlungsmittel	1.043	0	432	546
Einlagen bei Kontrahenten	29.911	34.314	1.742	2.017
Forderungen aus Einkünften	37.487	48.231	2.427	3.836
Forderungen aus verkauften Anlagen	59.339	18.600	4.588	0
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	0	0	0	0
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	505	5.111	851	119
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	31.996	14.965	422	1.946
Sonstige Aktiva	150	0	0	0
Summe Aktiva	2.566.473	3.088.210	184.114	319.689
Passiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete				
Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(13.307)	(27.401)	(756)	(1.065)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(60.920)	(3.578)	(4.588)	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen	(1.920)	(11.061)	(173)	(76)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(1.379)	(1.671)	(100)	(164)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	(12.951)	0	(505)	0
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	(94)	(41)	0	0
Überziehungskredit	0	(13.527)	0	0
Zu zahlende Dividende	(141)	(161)	(1)	0
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(37.183)	(25.632)	(783)	(1.842)
Einlagen von Kontrahenten	(3.850)	(23.746)	0	(2.555)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	(131.745)	(106.818)	(6.906)	(5.702)
Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	\$ 2.434.728	\$ 2.981.392	\$ 177.208	\$ 313.987

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

⁽¹⁾ Der PIMCO Global Core Asset Allocation Fund wurde am 29. November 2023 in PIMCO Balanced Income and Growth Fund umbenannt.

PIMCO Balanced Income and Growth Fund ⁽¹⁾		PIMCO Capital Securities Fund		PIMCO Climate Bond Fund		Commodity Real Return Fund	
Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
\$ 767.569	\$ 473.435	\$ 5.268.327	\$ 6.129.600	\$ 249.832	\$ 248.281	\$ 1.293.427	\$ 1.750.918
881	251.489	147	140	0	0	127	120
12.604	18.536	7.572	10.172	5.800	36.800	83.018	59.113
0	0	0	0	0	0	0	0
13.769	29.087	64.207	107.561	4.659	8.236	25.732	45.313
592	12.189	0	2.624	1.074	1.484	2.517	4.491
6.088	40.674	55.029	110.882	3.188	8.041	15.924	39.055
1.876	1.307	55.730	66.969	2.454	2.192	3.578	4.250
2.752	4.838	2.691	33.701	0	0	679	50.448
290.704	90.163	0	0	0	0	106.892	206.413
8.328	270	6.536	3.060	169	363	1.490	5.062
14.527	35.050	46.739	54.526	3.546	1.167	11.129	17.822
0	0	0	0	0	0	0	0
1.119.690	957.038	5.506.978	6.519.235	270.722	306.564	1.544.513	2.183.005
(16.776)	(43.855)	(62.651)	(86.485)	(4.527)	(5.599)	(40.086)	(50.044)
(2.036)	0	0	0	0	0	0	0
(2.585)	(1.870)	(540)	(1)	0	0	(40.534)	0
(408.618)	(117.381)	0	0	0	0	(190.314)	(288.321)
(212)	(10.695)	(5.504)	(7.922)	(72)	(193)	(3.763)	(3.460)
(800)	(793)	(4.248)	(4.729)	(128)	(145)	(768)	(1.261)
0	0	(232.205)	(578.475)	(803)	0	(396.058)	(425.302)
0	0	0	0	0	0	0	(17.959)
(45)	(3)	(206)	(237)	0	(24)	(7)	(15)
0	0	(609)	0	0	0	0	0
(6)	(40)	(1.070)	(906)	(276)	(157)	(93)	(336)
(11.712)	(18.837)	(32.876)	(77.568)	(2.060)	(3.321)	(5.728)	(18.239)
(6.784)	(13.488)	(29.183)	(41.321)	(540)	(4.470)	(8.260)	(8.191)
0	0	0	0	0	0	0	0
(449.574)	(206.962)	(369.092)	(797.644)	(8.406)	(13.909)	(685.611)	(813.128)
\$ 670.116	\$ 750.076	\$ 5.137.886	\$ 5.721.591	\$ 262.316	\$ 292.655	\$ 858.902	\$ 1.369.877

Finanzstatus (Forts.)

(Angaben in Tausend)	PIMCO Credit Opportunities Bond Fund		Diversified Income Fund	
	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Aktiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes				
Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	\$ 120.305	\$ 80.195	\$ 6.280.493	\$ 6.620.617
Investmentfonds	3.607	9.649	739.526	876.630
Pensionsgeschäfte	737	6.910	1.221.471	1.746.323
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	0
Finanzderivate	1.941	2.563	157.414	132.621
Zahlungsmittel	196	177	0	0
Einlagen bei Kontrahenten	1.630	1.533	211.549	282.594
Forderungen aus Einkünften	1.062	1.002	77.767	83.844
Forderungen aus verkauften Anlagen	1	206	9.984	51.445
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	39.677	1.296	1.262.381	248.272
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	66	138	11.388	5.685
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	1.083	1.075	46.900	113.759
Sonstige Aktiva	0	0	0	0
Summe Aktiva	170.305	104.744	10.018.873	10.161.790
Passiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete				
Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(1.789)	(2.137)	(67.651)	(150.759)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(3.608)	(304)	(86.708)	(586.220)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	(59.979)	(3.587)	(2.159.820)	(549.539)
Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen	(6)	(50)	(11.377)	(7.240)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(91)	(89)	(6.585)	(8.022)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	(2.942)	0	(49.676)	(6.646)
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	0	0	(155)	(148)
Überziehungskredit	0	0	(531)	(3.465)
Zu zahlende Dividende	0	0	(3.455)	(3.841)
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(793)	(833)	(123.820)	(62.209)
Einlagen von Kontrahenten	(1.034)	(591)	(69.297)	(31.905)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	(70.242)	(7.591)	(2.579.075)	(1.409.994)
Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	\$ 100.063	\$ 97.153	\$ 7.439.798	\$ 8.751.796

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

Diversified Income Duration Hedged Fund		Diversified Income ESG Fund		Dynamic Bond Fund		Dynamic Multi-Asset Fund	
Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
\$ 363.886	\$ 401.584	\$ 51.106	\$ 9.978	\$ 4.176.007	\$ 2.712.201	€ 3.381.141	€ 4.130.924
40.652	55.806	5.470	0	337.503	348.722	312.665	504.414
69.552	102.832	3.000	0	734.416	1.145.692	358.849	124.604
0	0	0	0	0	0	0	0
21.706	19.178	517	60	70.864	74.933	130.271	234.476
856	513	419	108	9.665	7.730	29.609	38.251
20.514	20.323	367	113	90.899	96.997	319.479	395.426
4.588	5.122	649	112	19.762	16.752	18.511	5.003
2.756	1.998	0	0	116	7.837	3.973	9.331
88.965	19.854	8.774	603	1.853.086	454.635	965.122	0
58	98	0	0	5.110	2.056	1.770	2.321
21.368	19.031	268	27	83.836	69.677	47.148	165.342
0	0	0	0	0	0	0	0
634.901	646.339	70.570	11.001	7.381.264	4.937.232	5.568.538	5.610.092
(5.107)	(5.030)	(402)	(73)	(112.104)	(160.788)	(53.086)	(236.948)
0	0	(970)	0	(82.577)	(82.152)	0	0
(32.509)	(940)	(161)	0	(162.221)	(557.164)	(36.114)	(21.731)
(143.391)	(39.365)	(11.118)	(1.000)	(3.458.082)	(607.223)	(2.003.102)	0
(345)	(2.623)	(189)	0	(1.357)	(600)	(7.846)	(13.813)
(330)	(438)	(34)	(6)	(2.660)	(2.772)	(3.382)	(5.575)
(529)	0	0	0	(1.354)	(2.164)	0	(17.828)
0	0	0	0	0	0	0	0
(1)	(2)	0	0	(681)	(68)	(27)	(33)
0	0	0	0	0	0	0	0
(1.027)	(870)	0	0	(1.043)	(680)	(65)	0
(35.680)	(29.190)	(133)	(68)	(33.384)	(28.530)	(141.264)	(115.772)
(3.143)	(3.197)	0	0	(80.228)	(11.490)	(61.607)	(83.222)
0	0	0	0	0	0	0	0
(222.062)	(81.655)	(13.007)	(1.147)	(3.935.691)	(1.453.631)	(2.306.493)	(494.922)
\$ 412.839	\$ 564.684	\$ 57.563	\$ 9.854	\$ 3.445.573	\$ 3.483.601	€ 3.262.045	€ 5.115.170

Finanzstatus (Forts.)

(Angaben in Tausend)

	Emerging Local Bond Fund		Emerging Local Bond ESG Fund	
	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Aktiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes				
Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	\$ 2.843.626	\$ 1.772.984	\$ 83.869	\$ 6.270
Investmentfonds	233.751	131.643	0	0
Pensionsgeschäfte	0	0	15.600	0
Einlagen bei Kreditinstituten	48.155	7.054	134	4
Finanzderivate	135.418	315.328	1.505	269
Zahlungsmittel	16.830	35.990	961	127
Einlagen bei Kontrahenten	68.149	51.091	1.388	39
Forderungen aus Einkünften	49.909	35.522	1.604	122
Forderungen aus verkauften Anlagen	222.222	26.063	10.117	0
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	0	0	344	0
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	1.423	4.086	0	0
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	70.465	102.125	1.372	11
Sonstige Aktiva	0	17	0	0
Summe Aktiva	3.689.948	2.481.903	116.894	6.842
Passiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete				
Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(134.807)	(313.285)	(1.041)	(215)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(296.249)	(28.070)	(10.705)	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	0	0	(343)	0
Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen	(610)	(665)	0	0
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(2.257)	(1.496)	(60)	(4)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	(281.349)	(85.313)	(722)	0
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	(835)	(206)	(22)	(2)
Überziehungskredit	0	0	0	0
Zu zahlende Dividende	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(61.675)	(83.123)	(1.523)	(12)
Einlagen von Kontrahenten	(31.163)	(50.077)	(70)	0
Sonstige Verbindlichkeiten	(62)	0	0	0
Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	(809.007)	(562.235)	(14.486)	(233)
Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	\$ 2.880.941	\$ 1.919.668	\$ 102.408	\$ 6.609

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

Emerging Markets Bond Fund		Emerging Markets Bond ESG Fund		Emerging Markets Corporate Bond Fund		PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	
Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
\$ 3.933.972	\$ 3.267.661	\$ 2.833.512	\$ 2.422.256	\$ 148.275	\$ 143.387	\$ 264.943	\$ 181.600
192.346	52.797	0	0	6.863	16.518	836	14.797
2.599	9.160	13.694	44.661	993	8.386	6.274	706
60.900	2.227	45.181	1.659	2.753	0	5.043	137
71.306	69.071	55.089	56.599	2.340	4.439	30.376	34.841
11.960	4.943	7.900	2.605	805	262	2.267	1.447
32.680	49.025	23.558	25.425	1.732	1.839	13.141	10.495
65.470	52.462	46.301	37.299	2.052	1.915	3.143	1.549
3.198	400	12.207	215	259	1	20.374	207
162.903	26.106	128.924	4.814	5.331	1.285	22.390	0
32.733	714	7.335	10.705	6	55	357	0
19.143	25.590	11.359	10.516	707	984	6.457	5.129
0	0	14	0	0	0	0	0
4.589.210	3.560.156	3.185.074	2.616.754	172.116	179.071	375.601	250.908
(43.533)	(49.305)	(30.895)	(23.713)	(1.329)	(618)	(29.047)	(31.528)
0	0	0	0	0	0	0	0
(16.221)	(10.331)	(6.098)	(3.745)	(1.746)	(2.163)	(21.839)	0
(217.275)	(49.405)	(128.520)	(7.710)	(8.675)	(2.563)	(22.311)	0
(1.778)	(13.371)	(2.002)	(461)	(80)	(10)	(24)	(586)
(2.776)	(2.521)	(2.046)	(1.929)	(159)	(172)	(99)	(64)
(402.727)	(75.356)	(214.833)	(38.840)	(166)	0	(5.271)	0
0	0	(56.665)	0	0	0	0	0
(83)	(12)	(53)	(1)	(3)	0	(2)	(8)
0	0	0	0	0	0	0	0
(317)	(276)	(2.039)	(2.167)	0	0	(1)	0
(33.004)	(15.372)	(19.603)	(9.012)	(974)	(1.872)	(13.257)	(10.037)
(25.211)	(38.228)	(28.399)	(36.701)	(1.271)	(2.687)	(960)	(3.554)
0	0	0	0	0	0	0	0
(742.925)	(254.177)	(491.153)	(124.279)	(14.403)	(10.085)	(92.811)	(45.777)
\$ 3.846.285	\$ 3.305.979	\$ 2.693.921	\$ 2.492.475	\$ 157.713	\$ 168.986	\$ 282.790	\$ 205.131

Finanzstatus (Forts.)

(Angaben in Tausend)

	Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund		PIMCO ESG Income Fund	
	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Aktiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	\$ 17.763	\$ 15.264	\$ 274.526	\$ 254.108
Investmentfonds	1.837	2.058	0	0
Pensionsgeschäfte	158	2.766	8.200	44.400
Einlagen bei Kreditinstituten	363	78	0	0
Finanzderivate	1.223	4.060	7.131	5.555
Zahlungsmittel	153	185	1.059	1.533
Einlagen bei Kontrahenten	305	282	2.915	2.737
Forderungen aus Einkünften	112	87	1.980	1.372
Forderungen aus verkauften Anlagen	233	1	20	80
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	976	0	28.121	78.252
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	7	11	459	221
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	233	254	5.731	4.814
Sonstige Aktiva	0	0	0	0
Summe Aktiva	23.363	25.046	330.142	393.072
Passiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(803)	(3.067)	(5.389)	(4.277)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	0	(443)	(2.630)
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(1.028)	(109)	(138)	(707)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	(970)	0	(45.457)	(141.114)
Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen	(1)	(5)	(52)	(12)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(24)	(25)	(146)	(118)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	0	0	0	0
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	0	(1)	(2)	(12)
Überziehungskredit	0	0	0	0
Zu zahlende Dividende	0	0	(1)	(1)
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(320)	(631)	(2.491)	(3.190)
Einlagen von Kontrahenten	(271)	(271)	(4.815)	(3.050)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	(3.417)	(4.109)	(58.934)	(155.111)
Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	\$ 19.946	\$ 20.937	\$ 271.208	\$ 237.961

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

Euro Bond Fund		Euro Credit Fund		Euro Income Bond Fund		Euro Long Average Duration Fund	
Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
€ 1.547.627	€ 1.747.790	€ 536.515	€ 491.678	€ 1.698.144	€ 1.100.441	€ 890.605	€ 103.959
164.208	181.654	9.501	50.689	135.514	134.815	38.073	4.940
97.581	11.515	14.437	44.621	137.975	120.458	52.334	1.500
0	0	0	0	0	0	0	0
52.302	49.805	5.984	9.083	45.840	26.003	18.572	3.789
3.541	3.052	3.470	12.028	17.714	7.361	1.236	397
37.643	59.589	8.072	26.366	49.751	47.460	20.472	4.382
10.531	8.903	6.584	4.187	10.060	8.869	12.456	1.039
200	13.467	0	2.447	228	53.521	554	0
319.172	168.280	46.380	1.073	615.833	117.074	91.778	6.332
1.039	932	721	242	5.934	1.107	3.473	51
12.883	105.486	10.537	33.489	33.918	19.325	4.174	16.625
0	0	0	0	0	0	0	0
2.246.727	2.350.473	642.201	675.903	2.750.911	1.636.434	1.133.727	143.014
(32.678)	(122.819)	(5.319)	(13.081)	(23.982)	(27.457)	(8.349)	(18.830)
0	0	0	0	0	0	0	0
0	(95)	0	(7.404)	(190)	(22.578)	(3.877)	0
(488.304)	(264.938)	(79.001)	(13.488)	(1.248.173)	(208.728)	(159.831)	(11.721)
(1.343)	(405)	(443)	(85)	(1.212)	(1.033)	(70)	0
(702)	(807)	(228)	(252)	(1.266)	(1.244)	(324)	(46)
(1.041)	0	(8.176)	0	(4.268)	0	(10.485)	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(6)	(5)	0	0	(21)	(17)	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(34.354)	(41.188)	(10.718)	(29.619)	(56.332)	(18.036)	(23.159)	(2.369)
(16.586)	(6.941)	(1.130)	(1.966)	(28.240)	(4.361)	(3.663)	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(575.014)	(437.198)	(105.015)	(65.895)	(1.363.684)	(283.454)	(209.758)	(32.966)
€ 1.671.713	€ 1.913.275	€ 537.186	€ 610.008	€ 1.387.227	€ 1.352.980	€ 923.969	€ 110.048

Finanzstatus (Forts.)

(Angaben in Tausend)

	Euro Short-Term Fund		PIMCO European High Yield Bond Fund	
	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Aktiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	€ 174.163	€ 330.698	€ 306.261	€ 157.222
Investmentfonds	0	0	18.291	8.700
Pensionsgeschäfte	12.400	14.100	30.300	3.700
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	0
Finanzderivate	208	5.409	4.615	2.007
Zahlungsmittel	448	896	2.070	3.440
Einlagen bei Kontrahenten	1.628	6.396	9.203	2.986
Forderungen aus Einkünften	1.173	1.735	4.039	1.897
Forderungen aus verkauften Anlagen	1.971	63	1	32
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	0	0	0	0
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	2.058	550	981	71
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	702	5.754	2.730	1.485
Sonstige Aktiva	0	0	0	0
Summe Aktiva	194.751	365.601	378.491	181.540
Passiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(1.031)	(2.312)	(924)	(1.105)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	0	0	(1.470)	(4.181)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen	(143)	(1.514)	(158)	(1)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(63)	(105)	(99)	(13)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	0	0	(1.858)	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	0	(6.452)	(5.955)	(2.078)
Einlagen von Kontrahenten	0	(2.123)	(260)	0
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	(1.237)	(12.506)	(10.724)	(7.378)
Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	€ 193.514	€ 353.095	€ 367.767	€ 174.162

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

PIMCO European Short-Term Opportunities Fund		Global Advantage Fund		Global Bond Fund		Global Bond ESG Fund	
Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
€ 132.036	€ 193.346	\$ 558.153	\$ 443.632	\$ 14.935.571	\$ 11.361.097	\$ 3.995.935	\$ 2.913.880
7.680	18.800	18.210	18.242	1.311.189	1.120.979	0	5.649
1.000	4.400	534	1.408	371.917	1.346.970	165.958	1.157.847
0	0	0	0	0	0	0	0
2.387	7.774	29.981	25.927	701.868	518.391	194.051	94.009
383	640	3.823	3.907	51.511	32.207	13.203	8.552
1.906	4.772	15.196	15.524	497.830	478.539	110.870	125.721
955	1.077	3.128	2.702	59.192	51.007	18.670	10.094
698	1.622	8.712	9.551	277.948	279.220	26.215	26.307
16.715	12.293	271.238	96.161	6.650.551	4.755.367	1.499.812	450.850
635	293	1	3	24.912	77.660	4.091	3.518
2.956	4.861	18.679	22.907	406.567	658.178	102.970	164.909
0	0	0	0	0	0	0	0
167.351	249.878	927.655	639.964	25.289.056	20.679.615	6.131.775	4.961.336
(5.140)	(8.310)	(22.347)	(21.316)	(696.202)	(859.558)	(119.746)	(151.501)
0	0	(42.127)	(28.813)	(930.028)	(721.316)	(277.758)	(119.122)
0	(590)	(8.490)	(8.457)	(346.698)	(930.760)	(116.439)	(622.586)
(30.198)	(23.393)	(391.325)	(140.479)	(9.559.374)	(6.231.107)	(1.839.724)	(792.022)
(68)	(111)	(49)	(35)	(57.022)	(13.836)	(4.171)	(10.843)
(45)	(66)	(256)	(250)	(6.410)	(5.736)	(1.426)	(1.314)
0	0	0	(1.504)	(617)	(1.682)	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	(21)	(17)	(173)	(137)	(7)	(3)
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	(642)	(736)	(485)	(399)
(663)	(5.044)	(20.035)	(23.802)	(451.767)	(407.767)	(131.420)	(125.388)
(627)	(1.192)	(10.715)	(4.832)	(162.861)	(86.868)	(79.419)	(31.968)
0	0	0	0	0	0	0	0
(36.741)	(38.706)	(495.365)	(229.505)	(12.211.794)	(9.259.503)	(2.570.595)	(1.855.146)
€ 130.610	€ 211.172	\$ 432.290	\$ 410.459	\$ 13.077.262	\$ 11.420.112	\$ 3.561.180	\$ 3.106.190

Finanzstatus (Forts.)

(Angaben in Tausend)

	Global Bond Ex-US Fund		Global High Yield Bond Fund	
	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Aktiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	\$ 962.952	\$ 737.412	\$ 2.863.479	\$ 2.850.786
Investmentfonds	10.172	47.322	76.320	201.583
Pensionsgeschäfte	1.005	1.625	0	11.412
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	0
Finanzderivate	48.425	35.105	17.367	36.885
Zahlungsmittel	8.288	5.507	1.951	26
Einlagen bei Kontrahenten	41.103	39.796	34.091	28.611
Forderungen aus Einkünften	4.201	3.559	41.913	40.375
Forderungen aus verkauften Anlagen	16.167	15.805	2.737	23
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	509.310	255.052	0	0
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	3.753	460	7.590	7.615
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	32.367	56.123	11.285	788
Sonstige Aktiva	0	0	95	223
Summe Aktiva	1.637.743	1.197.766	3.056.828	3.178.327
Passiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(48.860)	(63.177)	(7.830)	(20.824)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	(97.971)	(76.200)	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(15.657)	(15.641)	(17.070)	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	(627.293)	(282.153)	0	0
Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen	(1.908)	(75)	(3.108)	(13.817)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(370)	(342)	(1.825)	(1.960)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	0	0	(20.553)	(10.397)
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	(6)	(7)	(23)	(123)
Überziehungskredit	0	0	0	0
Zu zahlende Dividende	0	0	(3.511)	(4.126)
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(42.188)	(41.421)	(9.588)	(3.436)
Einlagen von Kontrahenten	(3.364)	(2.728)	(13.070)	(20.776)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	(837.617)	(481.744)	(76.578)	(75.459)
Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	\$ 800.126	\$ 716.022	\$ 2.980.250	\$ 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 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
\$ 10.091.319	\$ 9.778.544	\$ 2.410.642	\$ 1.489.771	\$ 1.923.658	\$ 1.661.693	\$ 3.700.069	\$ 3.391.396
1.045.218	1.038.326	0	0	506	12.424	23.397	7.043
177.113	75.423	1.300	15.240	2.889	1.053	2.878	2.245
0	0	0	0	0	0	0	0
179.275	212.298	34.989	33.293	28.421	50.766	53.168	106.832
18.362	20.756	1.598	2.079	4.962	9.404	9.826	8.086
189.977	275.295	25.954	30.302	24.578	18.687	53.688	46.251
100.050	90.845	24.605	11.400	4.830	2.931	10.809	7.667
213	34.506	1.105	52.816	1.088	94.773	437.235	68.378
1.178.395	1.919.603	251.937	135.728	160.441	72.965	319.813	191.920
21.980	30.854	4.337	1.945	777	574	921	4.737
68.902	180.542	24.763	13.422	21.747	12.290	30.224	27.734
0	0	0	0	0	0	0	0
13.070.804	13.656.992	2.781.230	1.785.996	2.173.897	1.937.560	4.642.028	3.862.289
(120.283)	(293.790)	(22.233)	(17.969)	(39.941)	(29.733)	(76.489)	(93.426)
0	(136.255)	0	(5.887)	0	0	0	0
(192)	0	0	(8.117)	(2.856)	(30.524)	(5.696)	0
(2.021.670)	(2.481.720)	(394.267)	(202.456)	(287.563)	(132.585)	(576.267)	(325.573)
(8.457)	(32.381)	(3.826)	(188)	(778)	(2.607)	(6.207)	(3.628)
(5.770)	(5.738)	(948)	(605)	(606)	(735)	(1.299)	(1.447)
(7.828)	(4.154)	(108.032)	(75.928)	(618.014)	(261.713)	(1.556.968)	(796.152)
0	0	(36.861)	(75.925)	(24.686)	(79.599)	0	(9.519)
(262)	(339)	(188)	(124)	(1)	(2)	(36)	(51)
0	0	0	0	0	0	0	0
(7.188)	(6.988)	(2.767)	(692)	(527)	(446)	(1.105)	(2.363)
(85.679)	(82.017)	(10.054)	(13.852)	(9.704)	(18.182)	(16.758)	(35.345)
(99.753)	(75.269)	(31.847)	(14.363)	(12.169)	(17.059)	(20.110)	(22.923)
0	0	0	0	0	0	0	0
(2.357.082)	(3.118.651)	(611.023)	(416.106)	(996.845)	(573.185)	(2.260.935)	(1.290.427)
\$ 10.713.722	\$ 10.538.341	\$ 2.170.207	\$ 1.369.890	\$ 1.177.052	\$ 1.364.375	\$ 2.381.093	\$ 2.571.862

Finanzstatus (Forts.)

(Angaben in Tausend)

	Income Fund		Income Fund II	
	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Aktiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	\$ 96.949.829	\$ 67.246.471	\$ 135.928	\$ 56.970
Investmentfonds	1.805.212	2.081.428	123	1.740
Pensionsgeschäfte	274.468	3.421.698	0	0
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	0
Finanzderivate	4.452.969	5.163.114	857	718
Zahlungsmittel	65.968	89.931	2.627	644
Einlagen bei Kontrahenten	1.594.328	1.852.978	1.493	1.022
Forderungen aus Einkünften	463.626	354.824	900	384
Forderungen aus verkauften Anlagen	26.720	60.282	5	5
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	24.623.052	21.347.671	18.950	8.075
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	217.821	88.371	14.089	4.020
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	1.889.968	1.235.828	1.853	637
Sonstige Aktiva	92	236	0	0
Summe Aktiva	132.364.053	102.942.832	176.825	74.215
Passiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(3.184.989)	(3.649.860)	(360)	(406)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	(937.631)	(734.103)	(582)	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(228.964)	(205.883)	(823)	(182)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	(53.120.749)	(37.310.306)	(43.381)	(15.917)
Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen	(91.455)	(145.081)	(741)	0
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(55.002)	(45.253)	(123)	(48)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	(495)	(15.867)	0	0
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	(3.572)	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	(4.542)	(4.925)	0	0
Überziehungskredit	0	0	0	0
Zu zahlende Dividende	(3.824)	(2.737)	0	0
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(2.987.747)	(2.473.835)	(1.793)	(1.036)
Einlagen von Kontrahenten	(1.205.538)	(374.655)	(290)	0
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	(3)
Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	(61.820.936)	(44.962.505)	(51.665)	(17.592)
Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	\$ 70.543.117	\$ 57.980.327	\$ 125.160	\$ 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 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
\$ 289.304	\$ 320.121	\$ 1.099.774	\$ 1.235.606	\$ 1.024.085	\$ 691.422	\$ 2.692.081	\$ 1.213.608
28.256	68.975	82.593	85.631	16.247	643	199.001	106.140
364	40.720	100.744	956	678	1.604	345.484	98.831
0	0	0	0	0	0	0	0
9.713	14.716	3.586	7.284	8.563	13.518	77.338	79.359
1.667	0	2.008	2.692	892	390	7.667	6.374
6.470	8.179	9.047	24.403	11.190	10.136	47.017	34.272
462	688	7.935	6.394	10.372	5.082	11.731	7.264
1.236	13	257.005	723	0	202	426	2.215
67.319	10.546	239.895	380.707	102.013	69.997	988.905	367.632
59	100	647	976	834	2.763	14.906	2.070
7.218	7.201	8.585	7.914	3.456	11.170	31.081	21.540
0	0	0	0	0	0	0	0
412.068	471.259	1.811.819	1.753.286	1.178.330	806.927	4.415.637	1.939.305
(14.826)	(10.695)	(7.795)	(14.403)	(5.543)	(11.395)	(48.681)	(64.082)
0	0	(50.185)	(76.949)	0	(14.029)	(5.624)	(5.209)
(80)	(2.206)	(41.000)	(2.924)	0	(1.062)	(99.442)	(9.219)
(117.222)	(43.111)	(323.595)	(427.587)	(174.185)	(97.540)	(2.128.585)	(724.143)
(988)	(1.769)	(627)	(1.987)	(1.818)	(422)	(2.117)	(185)
(267)	(445)	(380)	(495)	(417)	(289)	(976)	(565)
(15.063)	0	(525.595)	(144.857)	(6.973)	(12.776)	0	0
(1.229)	0	(44.279)	(4.077)	(4.817)	(1.409)	0	0
(3)	(5)	(187)	(10)	0	0	(24)	(24)
0	(980)	0	0	0	0	0	0
0	0	(16)	(13)	(44)	(20)	(600)	(247)
(4.899)	(6.644)	(4.015)	(3.315)	(4.533)	(4.014)	(54.022)	(28.430)
(4.243)	(2.326)	(4.300)	(3.911)	(7.157)	(9.222)	(45.261)	(22.821)
0	0	0	0	0	0	0	0
(158.820)	(68.181)	(1.001.974)	(680.528)	(205.487)	(152.178)	(2.385.332)	(854.925)
\$ 253.248	\$ 403.078	\$ 809.845	\$ 1.072.758	\$ 972.843	\$ 654.749	\$ 2.030.305	\$ 1.084.380

Finanzstatus (Forts.)

(Angaben in Tausend)

	Low Duration Opportunities Fund		Low Duration Opportunities ESG Fund	
	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Aktiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	\$ 1.047.330	\$ 1.216.746	\$ 5.199	\$ 5.070
Investmentfonds	70.798	133.056	0	0
Pensionsgeschäfte	2.805	118.800	0	0
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	0
Finanzderivate	21.493	55.664	27	22
Zahlungsmittel	3.584	3.357	163	122
Einlagen bei Kontrahenten	27.622	57.806	69	31
Forderungen aus Einkünften	5.531	7.718	37	16
Forderungen aus verkauften Anlagen	22	12.795	0	0
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	494.771	282.511	466	274
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	28	542	0	0
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	32.067	45.871	61	51
Sonstige Aktiva	0	0	0	0
Summe Aktiva	1.706.051	1.934.866	6.022	5.586
Passiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(33.847)	(109.833)	(57)	(67)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	(41.577)	(94.108)	(100)	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(9)	(12.575)	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	(796.267)	(347.541)	(624)	(545)
Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen	(185)	(139)	0	0
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(311)	(542)	(2)	(2)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	(15.085)	0	0	0
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	(166)	(8)	0	0
Überziehungskredit	0	0	0	0
Zu zahlende Dividende	(313)	(1.377)	0	0
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(15.582)	(19.443)	(18)	(44)
Einlagen von Kontrahenten	(15.085)	(3.519)	0	0
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	(918.427)	(589.085)	(801)	(658)
Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	\$ 787.624	\$ 1.345.781	\$ 5.221	\$ 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 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
\$ 88.045	\$ 106.959	\$ 1.902.209	\$ 1.724.999	\$ 1.318.561	\$ 711.694	\$ 9.254	\$ 7.750
9.668	11.833	4	23	179.118	92.742	1.042	904
631	811	68.968	17.318	544.588	156.445	1.095	1.374
0	0	0	0	0	0	0	0
264	1.447	16.817	44.003	25.961	12.661	295	258
98	552	300	167	4.397	2.178	22	11
970	2.870	13.878	11.602	57.022	85.945	389	861
36	104	5.108	4.660	6.425	2.660	23	21
351	13	0	1.901	61.217	255	433	0
0	0	2.175.726	1.781.393	162.621	0	3.816	1.240
36	59	866	412	2.442	1.226	0	0
0	0	12.095	17.755	10.848	33.144	559	115
0	0	0	0	0	0	0	0
100.099	124.648	4.195.971	3.604.233	2.373.200	1.098.950	16.928	12.534
(296)	(237)	(13.734)	(17.225)	(17.262)	(30.319)	(323)	(293)
0	0	(432.300)	(518.212)	0	0	0	(583)
(963)	(2.379)	(39.100)	(194.452)	(52.179)	(37.060)	0	(583)
0	0	(2.702.052)	(1.654.287)	(243.902)	0	(4.496)	(1.310)
(119)	(834)	(669)	(596)	(2.282)	(1.097)	0	0
(90)	(109)	(585)	(547)	(1.153)	(656)	(7)	(6)
0	0	(55.855)	(316.493)	0	0	0	0
0	0	(823)	0	0	0	0	0
0	0	(8)	(8)	(13)	(5)	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	(48)	(21)	0	0	0	0
0	0	(5.796)	(18.210)	(31.885)	(15.583)	(637)	(231)
(138)	(952)	(19.745)	(35.034)	(61.536)	(5.491)	(290)	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(1.606)	(4.511)	(3.270.715)	(2.755.085)	(410.212)	(90.211)	(5.753)	(3.006)
\$ 98.493	\$ 120.137	\$ 925.256	\$ 849.148	\$ 1.962.988	\$ 1.008.739	\$ 11.175	\$ 9.528

Finanzstatus (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Strategic Income Fund		Total Return Bond Fund	
	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Aktiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	\$ 654.744	\$ 610.560	\$ 5.908.989	\$ 4.770.861
Investmentfonds	179	29.661	151.381	292.421
Pensionsgeschäfte	605	781	732	170.895
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	0
Finanzderivate	38.858	53.205	60.519	110.789
Zahlungsmittel	2.419	4.623	12.041	15.733
Einlagen bei Kontrahenten	8.906	11.922	63.287	120.293
Forderungen aus Einkünften	3.085	2.787	33.067	25.541
Forderungen aus verkauften Anlagen	65	4.738	80	51.883
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	154.850	224.967	2.343.513	2.180.028
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	315	385	6.409	12.045
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	17.307	14.864	58.602	77.114
Sonstige Aktiva	0	0	0	0
Summe Aktiva	881.333	958.493	8.638.620	7.827.603
Passiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(33.040)	(36.766)	(81.227)	(106.644)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	(13.890)	(13.092)	(34.262)	(68.457)
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(8)	(741)	(81)	(6.344)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	(319.259)	(367.853)	(3.960.404)	(3.304.650)
Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen	(579)	(539)	(6.899)	(3.734)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(501)	(585)	(2.720)	(2.652)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	(33.125)	0	(3.246)	(1.745)
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(1.037)	0	0	(76.810)
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	(131)	(17)	(206)	(210)
Überziehungskredit	0	0	0	0
Zu zahlende Dividende	0	0	(143)	(186)
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(21.991)	(21.409)	(25.978)	(72.167)
Einlagen von Kontrahenten	(7.823)	(10.934)	(103.403)	(33.287)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	(431.384)	(451.936)	(4.218.569)	(3.676.886)
Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	\$ 449.949	\$ 506.557	\$ 4.420.051	\$ 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 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
\$ 203.304	\$ 335.879	£ 365.325	£ 372.745	£ 330.293	£ 309.110	\$ 1.770.912	\$ 1.895.465
23.640	41.693	18.137	5.370	0	0	74.138	39.162
18.466	27.452	5.455	177	6.500	269	912	9.269
0	600	0	0	0	0	0	0
63.061	42.556	2.225	4.161	6.669	8.017	10.460	12.684
4.102	3.994	1.280	1.084	1.177	0	1.581	550
26.538	28.858	3.382	7.199	3.694	14.086	18.827	10.449
1.340	1.601	5.404	4.405	5.519	4.594	29.726	31.884
208	134	57	1.522	0	0	111	3.204
12.700	25.221	19.621	0	25.877	0	0	0
97	11.015	137	61	0	0	1.577	1.390
19.620	17.270	6.788	7.000	1.024	15.391	3.338	270
0	0	0	0	0	0	0	186
373.076	536.273	427.811	403.724	380.753	351.467	1.911.582	2.004.513
(66.665)	(44.109)	(2.583)	(1.718)	(841)	(3.697)	(4.499)	(1.517)
0	0	0	0	0	0	0	0
(203)	(523)	(1.403)	0	(67)	0	(13.824)	(4.262)
(42.429)	(30.301)	(33.437)	0	(43.049)	0	0	0
(81)	(3.552)	(524)	(70)	(4)	0	(3.060)	(2.743)
(242)	(453)	(106)	(127)	(123)	(131)	(1.080)	(1.173)
0	0	(20.592)	0	(3.946)	0	(8.200)	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(1)	0	0	0	0	0	(17)	(148)
0	0	0	0	0	(2.154)	0	0
(528)	(317)	(1.838)	(1.865)	(393)	(371)	(42)	(20)
(16.727)	(16.064)	(5.857)	(10.440)	(6.722)	(19.583)	(4.851)	(1.779)
(5.854)	(5.030)	(410)	(331)	(840)	(511)	(3.122)	(7.949)
0	0	0	0	0	0	0	0
(132.730)	(100.349)	(66.750)	(14.551)	(55.985)	(26.447)	(38.695)	(19.591)
\$ 240.346	\$ 435.924	£ 361.061	£ 389.173	£ 324.768	£ 325.020	\$ 1.872.887	\$ 1.984.922

Finanzstatus (Forts.)

(Angaben in Tausend)	US Investment Grade Corporate Bond Fund	
	Zum	Zum
	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022
Aktiva:		
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:		
Übertragbare Wertpapiere	\$ 487.346	\$ 346.399
Investmentfonds	18.239	38.657
Pensionsgeschäfte	259	15.383
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0
Finanzderivate	7.317	8.390
Zahlungsmittel	680	796
Einlagen bei Kontrahenten	8.358	12.615
Forderungen aus Einkünften	5.209	3.400
Forderungen aus verkauften Anlagen	8	27.549
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	62.254	21.983
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	759	2.561
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	2.128	5.621
Sonstige Aktiva	0	0
Summe Aktiva	592.557	483.354
Passiva:		
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten:		
Finanzderivate	(1.161)	(7.500)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	(2.035)
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(8)	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	(100.772)	(39.829)
Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen	(128)	(58)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(235)	(182)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	0	0
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	(38.655)
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	0	0
Überziehungskredit	0	0
Zu zahlende Dividende	(394)	(156)
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(7.154)	(4.541)
Einlagen von Kontrahenten	(1.844)	(1.876)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0
Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	(111.696)	(94.832)
Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	\$ 480.861	\$ 388.522

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

* Die Summe der Gesellschaft zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 wurde bereinigt, um Überkreuzinvestitionen und Salden im Namen der Gesellschaft zu eliminieren. Nähere Einzelheiten zu Überkreuzinvestitionen sind Erläuterung 14 in den Erläuterungen zum Abschluss zu entnehmen.

Für den Verwaltungsrat:

Verwaltungsratsmitglied: Craig A. Dawson

Verwaltungsratsmitglied: David M. Kennedy

Datum: 25. April 2024

US Short-Term Fund		Summe der Gesellschaft*	
Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
\$ 1.683.085	\$ 1.891.711	\$ 200.471.776	\$ 158.067.452
184.482	226.018	6.375.691	7.205.963
4.561	154.472	5.072.632	10.455.165
0	0	162.529	11.759
716	10.584	7.073.805	8.087.908
1.292	1.993	363.899	369.095
12.558	18.130	3.986.039	4.738.366
13.665	12.016	1.328.589	1.097.303
314	4.313	1.479.653	1.035.370
0	0	48.619.873	36.037.151
6.660	6.106	416.969	405.829
7.819	5.389	3.338.437	3.520.113
0	0	351	662
1.915.152	2.330.732	278.690.243	231.032.136
(8.435)	(5.824)	(5.397.203)	(7.088.064)
0	0	(2.950.061)	(2.699.152)
0	(1.430)	(1.786.064)	(3.353.495)
0	0	(91.155.892)	(57.317.614)
(5.085)	(2.669)	(246.185)	(417.932)
(583)	(722)	(115.314)	(108.234)
0	0	(4.637.552)	(2.874.391)
(43.894)	0	(217.863)	(303.953)
(2)	(4)	(8.387)	(7.630)
0	0	(1.140)	(20.563)
0	0	(31.351)	(30.796)
(2.187)	(4.603)	(4.700.999)	(4.103.580)
(760)	(5.365)	(2.339.615)	(1.182.210)
0	0	(62)	(3)
(60.946)	(20.617)	(113.587.688)	(79.507.617)
\$ 1.854.206	\$ 2.310.115	\$ 165.102.555	\$ 151.524.519

Betriebsergebnisrechnung

(Angaben in Tausend)

	PIMCO Asia High Yield Bond Fund		Asia Strategic Interest Bond Fund	
	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022
Erträge				
Zins- und Dividendenerträge	\$ 240.534	\$ 215.235	\$ 17.723	\$ 15.190
Sonstige Erträge	0	0	65	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(398.489)	(437.831)	(39.020)	(25.277)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	23.335	(75.534)	1.905	(12.295)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	1.147	333	96	152
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	179.674	(288.652)	28.190	(26.718)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	(20.137)	15.038	(2.175)	2.022
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	82	(22)	6	0
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	26.146	(571.433)	6.790	(46.926)
Betriebskosten				
Verwaltungsgebühr	(18.191)	(19.675)	(1.738)	(1.966)
Servicegebühr	(255)	(570)	0	0
Bestandspflegegebühr	(126)	(167)	0	0
Sonstige Aufwendungen	(4)	(3)	0	0
Gesamtaufwendungen	(18.576)	(20.415)	(1.738)	(1.966)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	17	17	4	4
Betriebskosten, netto	(18.559)	(20.398)	(1.734)	(1.962)
Anlageerträge/(-verluste), netto	7.587	(591.831)	5.056	(48.888)
Finanzierungskosten				
Zinsaufwendungen	(224)	(165)	(42)	(17)
Aufwand für Kreditfazilitäten	(182)	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(31.183)	(42.838)	(8.398)	(7.980)
Nettoausgleichskredite und -gebühren	(586)	(557)	(1.093)	(49)
Summe Finanzierungskosten	(32.175)	(43.560)	(9.533)	(8.046)
Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr vor Steuern	(24.588)	(635.391)	(4.477)	(56.934)
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(29)	23	(2)	3
Kapitalertragsteuer	0	0	0	0
Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr nach Steuern	(24.617)	(635.368)	(4.479)	(56.931)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	\$ (24.617)	\$ (635.368)	\$ (4.479)	\$ (56.931)

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Alle Beträge stammen ausschließlich aus fortgeführten Tätigkeiten.

⁽¹⁾ Der PIMCO Global Core Asset Allocation Fund wurde am 29. November 2023 in PIMCO Balanced Income and Growth Fund umbenannt.

PIMCO Balanced Income and Growth Fund ⁽¹⁾		PIMCO Capital Securities Fund		PIMCO Climate Bond Fund		Commodity Real Return Fund	
Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022
\$ 25.321	\$ 15.505	\$ 337.190	\$ 321.673	\$ 9.277	\$ 6.811	\$ 39.408	\$ 118.558
729	0	15	0	0	0	68	0
(28.078)	(53.006)	(652.021)	(339.637)	(16.329)	(21.894)	(60.310)	(70.911)
57.818	(108.236)	(4.525)	281.327	319	(3.655)	(139.912)	302.706
(1.834)	(849)	(22.530)	(92.745)	(22)	(3)	(388)	(8.645)
23.487	(30.206)	875.084	(1.370.283)	36.903	(49.332)	100.823	(183.928)
10.772	(34.286)	(23.075)	9.513	(2.505)	(1.924)	(8.141)	(59.310)
(654)	567	466	473	23	35	(653)	701
87.561	(210.511)	510.604	(1.189.679)	27.666	(69.962)	(69.105)	99.171
(9.476)	(10.327)	(52.909)	(63.252)	(1.638)	(1.683)	(11.156)	(18.878)
(37)	(31)	(1.039)	(1.606)	0	(9)	(113)	(252)
0	0	(1.176)	(1.243)	0	0	0	0
(1)	(2)	(573)	(656)	(11)	(15)	(1)	(2)
(9.514)	(10.360)	(55.697)	(66.757)	(1.649)	(1.707)	(11.270)	(19.132)
327	352	0	302	0	0	0	0
(9.187)	(10.008)	(55.697)	(66.455)	(1.649)	(1.707)	(11.270)	(19.132)
78.374	(220.519)	454.907	(1.256.134)	26.017	(71.669)	(80.375)	80.039
(479)	(235)	(18.823)	(10.267)	(8)	(6)	(18.977)	(6.180)
0	0	0	0	0	0	0	0
(2.909)	(2.897)	(76.063)	(84.957)	(3.580)	(2.206)	(712)	(336)
(4)	(516)	(3.230)	(2.829)	(33)	40	(24)	41
(3.392)	(3.648)	(98.116)	(98.053)	(3.621)	(2.172)	(19.713)	(6.475)
74.982	(224.167)	356.791	(1.354.187)	22.396	(73.841)	(100.088)	73.564
(982)	(721)	(12)	(609)	(5)	3	1	0
(41)	0	0	0	0	0	0	0
73.959	(224.888)	356.779	(1.354.796)	22.391	(73.838)	(100.087)	73.564
\$ 73.959	\$ (224.888)	\$ 356.779	\$ (1.354.796)	\$ 22.391	\$ (73.838)	\$ (100.087)	\$ 73.564

Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)	PIMCO Credit Opportunities Bond Fund		Diversified Income Fund	
	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022
Erträge				
Zins- und Dividendenerträge	\$ 5.811	\$ 4.895	\$ 411.737	\$ 423.503
Sonstige Erträge	65	0	1.915	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(1.626)	(5.524)	(479.821)	(732.205)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	1.275	(2.140)	10.883	(1.031.422)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	(48)	(53)	(48.678)	(127.348)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	5.126	(9.050)	821.317	(1.569.253)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	(248)	350	125.129	(137.498)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	6	(9)	(236)	(2.364)
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	10.361	(11.531)	842.246	(3.176.587)
Betriebskosten				
Verwaltungsgebühr	(1.056)	(1.271)	(85.385)	(117.086)
Servicegebühr	0	0	(602)	(575)
Bestandspflegegebühr	0	0	(712)	(945)
Sonstige Aufwendungen	(2)	(3)	(753)	(488)
Gesamtaufwendungen	(1.058)	(1.274)	(87.452)	(119.094)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	1	1	937	1.707
Betriebskosten, netto	(1.057)	(1.273)	(86.515)	(117.387)
Anlageerträge/(-verluste), netto	9.304	(12.804)	755.731	(3.293.974)
Finanzierungskosten				
Zinsaufwendungen	(56)	(155)	(4.384)	(520)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	0	0	(121.740)	(139.762)
Nettoausgleichskredite und -gebühren	0	0	(3.769)	(5.667)
Summe Finanzierungskosten	(56)	(155)	(129.893)	(145.949)
Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr vor Steuern	9.248	(12.959)	625.838	(3.439.923)
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(4)	5	9	175
Kapitalertragsteuer	0	0	0	0
Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr nach Steuern	9.244	(12.954)	625.847	(3.439.748)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	\$ 9.244	\$ (12.954)	\$ 625.847	\$ (3.439.748)

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Alle Beträge stammen ausschließlich aus fortgeführten Tätigkeiten.

Diversified Income Duration Hedged Fund		Diversified Income ESG Fund		Dynamic Bond Fund		Dynamic Multi-Asset Fund	
Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Berichtszeitraum vom 27. Jul. 2022 bis 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022
\$ 25.508	\$ 32.188	\$ 2.228	\$ 226	\$ 174.261	\$ 97.066	€ 112.566	€ 54.199
197	0	0	0	2.045	0	0	0
(36.982)	(78.712)	(151)	12	(23.502)	(49.022)	(318.591)	(10.017)
15.893	(20.394)	(604)	(135)	95.665	(160.148)	(172.340)	(164.295)
567	(3.436)	(292)	15	(20.876)	(14.875)	3.446	21.614
54.192	(92.998)	1.983	(176)	126.102	(262.668)	269.114	(805.632)
3.446	(15.985)	215	(13)	42.245	(63.001)	68.637	5.000
57	(189)	3	2	813	(254)	33.663	(7.889)
62.878	(179.526)	3.382	(69)	396.753	(452.902)	(3.505)	(907.020)
(4.625)	(7.323)	(299)	(30)	(32.256)	(29.354)	(52.945)	(78.669)
(18)	(27)	0	0	(166)	(197)	(35)	(38)
0	0	0	0	(118)	(178)	0	0
(25)	(11)	(2)	0	(168)	(147)	(336)	(395)
(4.668)	(7.361)	(301)	(30)	(32.708)	(29.876)	(53.316)	(79.102)
2	94	0	0	452	462	916	1.243
(4.666)	(7.267)	(301)	(30)	(32.256)	(29.414)	(52.400)	(77.859)
58.212	(186.793)	3.081	(99)	364.497	(482.316)	(55.905)	(984.879)
(221)	(82)	0	0	(1.666)	(482)	(1.825)	(354)
0	0	0	0	0	0	0	0
(9.001)	(9.289)	0	0	(9.304)	(7.206)	(5.496)	(6.983)
103	(645)	0	0	(96)	(584)	9	555
(9.119)	(10.016)	0	0	(11.066)	(8.272)	(7.312)	(6.782)
49.093	(196.809)	3.081	(99)	353.431	(490.588)	(63.217)	(991.661)
0	12	(5)	(1)	(62)	12	(3.111)	(10.191)
0	0	0	0	(617)	(41)	0	0
49.093	(196.797)	3.076	(100)	352.752	(490.617)	(66.328)	(1.001.852)
\$ 49.093	\$ (196.797)	\$ 3.076	\$ (100)	\$ 352.752	\$ (490.617)	€ (66.328)	€ (1.001.852)

Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Emerging Local Bond Fund		Emerging Local Bond ESG Fund	
	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Berichtszeitraum vom 27. Jul. 2022 bis 31. Dez. 2022
Erträge				
Zins- und Dividendenerträge	\$ 182.687	\$ 110.813	\$ 879	\$ 151
Sonstige Erträge	514	0	0	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(66.925)	(295.703)	134	4
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	73.006	64.889	235	73
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	7.475	(13.501)	33	(13)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	212.424	18.064	2.752	151
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	10.774	(19.913)	422	62
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	(15.024)	488	16	1
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	404.931	(134.863)	4.471	429
Betriebskosten				
Verwaltungsgebühr	(24.014)	(18.109)	(110)	(20)
Servicegebühr	(52)	(95)	0	0
Bestandspflegegebühr	0	0	0	0
Sonstige Aufwendungen	(3)	(3)	(1)	0
Gesamtaufwendungen	(24.069)	(18.207)	(111)	(20)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	0	0	0	0
Betriebskosten, netto	(24.069)	(18.207)	(111)	(20)
Anlageerträge/(-verluste), netto	380.862	(153.070)	4.360	409
Finanzierungskosten				
Zinsaufwendungen	(12.909)	(6.817)	(30)	0
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(16.256)	(11.526)	(4)	(1)
Nettoausgleichskredite und -gebühren	264	95	(1)	0
Summe Finanzierungskosten	(28.901)	(18.248)	(35)	(1)
Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr vor Steuern	351.961	(171.318)	4.325	408
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(1.835)	(681)	(33)	(4)
Kapitalertragsteuer	(914)	(201)	(21)	(2)
Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr nach Steuern	349.212	(172.200)	4.271	402
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	\$ 349.212	\$ (172.200)	\$ 4.271	\$ 402

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Alle Beträge stammen ausschließlich aus fortgeführten Tätigkeiten.

Emerging Markets Bond Fund		Emerging Markets Bond ESG Fund		Emerging Markets Corporate Bond Fund		PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	
Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022
\$ 230.979	\$ 190.399	\$ 153.857	\$ 120.478	\$ 8.637	\$ 7.612	\$ 12.020	\$ 9.073
1.306	0	0	0	274	0	0	0
(117.785)	(411.715)	(135.800)	(132.949)	(10.598)	(10.629)	(14.456)	(34.162)
4.964	(197.333)	26.172	(169.322)	5.550	(12.531)	14.250	(446)
1.954	(5.189)	(295)	(2.769)	(76)	(101)	(427)	410
317.481	(486.975)	274.519	(496.113)	12.923	(25.227)	16.877	(11.867)
4.407	6.524	(7.160)	23.079	(2.724)	2.628	(687)	(811)
(268)	(79)	(3.116)	(644)	11	5	(26)	24
443.038	(904.368)	308.177	(658.240)	13.997	(38.243)	27.551	(37.779)
(30.246)	(31.503)	(22.835)	(21.416)	(1.941)	(2.073)	(934)	(1.565)
(26)	(30)	(10)	(8)	0	0	0	0
(119)	(146)	(5)	(6)	0	0	0	0
(9)	(5)	(11)	(3)	0	0	0	0
(30.400)	(31.684)	(22.861)	(21.433)	(1.941)	(2.073)	(934)	(1.565)
0	0	0	0	0	0	2	2
(30.400)	(31.684)	(22.861)	(21.433)	(1.941)	(2.073)	(932)	(1.563)
412.638	(936.052)	285.316	(679.673)	12.056	(40.316)	26.619	(39.342)
(7.664)	(2.019)	(3.648)	(719)	(52)	(18)	(301)	(9)
0	0	0	0	0	0	0	0
(42.330)	(45.471)	(28.649)	(28.379)	0	0	(53)	(20)
690	(690)	(798)	482	0	0	0	(1)
(49.304)	(48.180)	(33.095)	(28.616)	(52)	(18)	(354)	(30)
363.334	(984.232)	252.221	(708.289)	12.004	(40.334)	26.265	(39.372)
(370)	(171)	(255)	24	(17)	(3)	(77)	(78)
(76)	0	(52)	0	(3)	0	6	(2)
362.888	(984.403)	251.914	(708.265)	11.984	(40.337)	26.194	(39.452)
\$ 362.888	\$ (984.403)	\$ 251.914	\$ (708.265)	\$ 11.984	\$ (40.337)	\$ 26.194	\$ (39.452)

Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund		PIMCO ESG Income Fund	
	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022
Erträge				
Zins- und Dividenderträge	\$ 1.143	\$ 630	\$ 12.268	\$ 4.921
Sonstige Erträge	144	0	0	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(215)	(1.875)	(3.871)	(1.520)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	665	296	431	(1.583)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	75	32	616	(62)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	820	(922)	10.748	(20.930)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	(464)	480	327	91
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	(4)	(16)	82	(46)
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	2.164	(1.375)	20.601	(19.129)
Betriebskosten				
Verwaltungsgebühr	(296)	(361)	(1.632)	(1.005)
Servicegebühr	0	0	0	0
Bestandspflegegebühr	0	0	(39)	(4)
Sonstige Aufwendungen	0	0	(12)	(8)
Gesamtaufwendungen	(296)	(361)	(1.683)	(1.017)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	6	7	0	0
Betriebskosten, netto	(290)	(354)	(1.683)	(1.017)
Anlageerträge/(-verluste), netto	1.874	(1.729)	18.918	(20.146)
Finanzierungskosten				
Zinsaufwendungen	(15)	(5)	(261)	0
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	0	0	(3.339)	(1.282)
Nettoausgleichskredite und -gebühren	0	0	193	40
Summe Finanzierungskosten	(15)	(5)	(3.407)	(1.242)
Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr vor Steuern	1.859	(1.734)	15.511	(21.388)
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(4)	(3)	(94)	(9)
Kapitalertragsteuer	1	0	0	0
Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr nach Steuern	1.856	(1.737)	15.417	(21.397)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	\$ 1.856	\$ (1.737)	\$ 15.417	\$ (21.397)

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Alle Beträge stammen ausschließlich aus fortgeführten Tätigkeiten.

Euro Bond Fund		Euro Credit Fund		Euro Income Bond Fund		Euro Long Average Duration Fund	
Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022
€ 49.273	€ 33.483	€ 17.331	€ 12.380	€ 47.773	€ 40.277	€ 12.247	€ 1.889
359	0	17	0	12	0	62	0
(127.635)	(99.204)	(31.148)	(37.541)	(76.420)	(93.499)	(26.211)	(7.406)
(2.508)	(79.983)	3.702	(74.566)	10.779	(26.595)	(16.677)	(10.447)
5.432	423	728	2.974	(6.071)	9.992	(161)	(10)
135.817	(209.845)	57.872	(64.593)	99.838	(166.879)	51.871	(32.163)
89.992	(36.654)	4.495	(2.141)	23.333	(14.850)	25.783	(10.591)
748	2.140	(41)	711	17.883	2.773	1.379	150
151.478	(389.640)	52.956	(162.776)	117.127	(248.781)	48.293	(58.578)
(9.458)	(11.086)	(2.919)	(3.957)	(14.616)	(18.349)	(1.700)	(597)
(63)	(66)	0	0	(69)	(73)	0	0
0	(9)	0	0	0	0	0	0
(19)	(3)	(1)	(1)	(195)	(156)	0	0
(9.540)	(11.164)	(2.920)	(3.958)	(14.880)	(18.578)	(1.700)	(597)
605	625	157	179	391	313	56	17
(8.935)	(10.539)	(2.763)	(3.779)	(14.489)	(18.265)	(1.644)	(580)
142.543	(400.179)	50.193	(166.555)	102.638	(267.046)	46.649	(59.158)
(412)	(204)	(219)	(179)	(689)	(102)	(179)	(14)
0	0	0	0	0	0	0	0
(1.143)	(969)	(379)	(1.172)	(14.822)	(14.923)	0	0
(57)	7	(38)	(99)	(26)	(1.288)	0	0
(1.612)	(1.166)	(636)	(1.450)	(15.537)	(16.313)	(179)	(14)
140.931	(401.345)	49.557	(168.005)	87.101	(283.359)	46.470	(59.172)
(91)	(2)	0	4	1	4	(27)	0
0	0	0	0	0	0	0	0
140.840	(401.347)	49.557	(168.001)	87.102	(283.355)	46.443	(59.172)
€ 140.840	€ (401.347)	€ 49.557	€ (168.001)	€ 87.102	€ (283.355)	€ 46.443	€ (59.172)

Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)

	Euro Short-Term Fund		PIMCO European High Yield Bond Fund	
	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022
Erträge				
Zins- und Dividendenerträge	€ 7.372	€ 5.127	€ 13.685	€ 6.062
Sonstige Erträge	12	0	0	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(4.406)	(11.983)	(6.765)	(4.104)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	3.059	8.148	2.707	(2.508)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	(215)	1.505	159	192
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	7.990	(12.596)	23.354	(16.840)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	(3.920)	3.715	2.633	1.089
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	162	(257)	(47)	38
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	10.054	(6.341)	35.726	(16.071)
Betriebskosten				
Verwaltungsgebühr	(797)	(1.714)	(698)	(54)
Servicegebühr	0	0	0	0
Bestandspflegegebühr	0	0	0	0
Sonstige Aufwendungen	0	(1)	(6)	0
Gesamtaufwendungen	(797)	(1.715)	(704)	(54)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	0	0	46	28
Betriebskosten, netto	(797)	(1.715)	(658)	(26)
Anlageerträge/(-verluste), netto	9.257	(8.056)	35.068	(16.097)
Finanzierungskosten				
Zinsaufwendungen	(25)	(84)	(24)	(33)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	0	0	0	0
Nettoausgleichskredite und -gebühren	0	0	0	0
Summe Finanzierungskosten	(25)	(84)	(24)	(33)
Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr vor Steuern	9.232	(8.140)	35.044	(16.130)
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(2)	(6)	0	0
Kapitalertragsteuer	0	0	0	0
Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr nach Steuern	9.230	(8.146)	35.044	(16.130)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	€ 9.230	€ (8.146)	€ 35.044	€ (16.130)

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Alle Beträge stammen ausschließlich aus fortgeführten Tätigkeiten.

PIMCO European Short-Term Opportunities Fund		Global Advantage Fund		Global Bond Fund		Global Bond ESG Fund	
Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022
€ 5.406	€ 5.046	\$ 15.702	\$ 19.358	\$ 366.989	\$ 280.279	\$ 107.374	\$ 45.557
2	0	167	0	3.704	0	0	0
(9.385)	(22.144)	(13.630)	(15.302)	(437.741)	(472.968)	(72.539)	(191.964)
1.733	20.693	6.847	(16.446)	282.536	64.670	35.682	(1.708)
163	383	(38)	(143)	(69.520)	(37.039)	132	(6.537)
12.182	(16.574)	28.378	(65.430)	615.232	(1.518.236)	102.932	(179.201)
(3.611)	2.641	2.302	2.911	329.829	(349.556)	128.516	(74.875)
237	123	(304)	(46)	(8.718)	3.275	(1.905)	1.827
6.727	(9.832)	39.424	(75.098)	1.082.311	(2.029.575)	300.192	(406.901)
(657)	(1.114)	(2.934)	(3.204)	(75.151)	(73.778)	(16.187)	(11.828)
0	0	0	0	(1.629)	(1.350)	(38)	(38)
0	0	0	0	(122)	(118)	(5)	(3)
(6)	0	(11)	(7)	(158)	(149)	(4)	(3)
(663)	(1.114)	(2.945)	(3.211)	(77.060)	(75.395)	(16.234)	(11.872)
47	90	0	0	2.817	3.016	0	0
(616)	(1.024)	(2.945)	(3.211)	(74.243)	(72.379)	(16.234)	(11.872)
6.111	(10.856)	36.479	(78.309)	1.008.068	(2.101.954)	283.958	(418.773)
(29)	(52)	(590)	(311)	(7.095)	(1.977)	(2.164)	(463)
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	(4.221)	(3.851)	(32.992)	(28.813)	(13.441)	(7.667)
0	0	0	19	618	2.479	(362)	624
(29)	(52)	(4.811)	(4.143)	(39.469)	(28.311)	(15.967)	(7.506)
6.082	(10.908)	31.668	(82.452)	968.599	(2.130.265)	267.991	(426.279)
(10)	(1)	(12)	(28)	(1.008)	(366)	(720)	(45)
0	0	(4)	4	9	(9)	0	0
6.072	(10.909)	31.652	(82.476)	967.600	(2.130.640)	267.271	(426.324)
€ 6.072	€ (10.909)	\$ 31.652	\$ (82.476)	\$ 967.600	\$ (2.130.640)	\$ 267.271	\$ (426.324)

Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Global Bond Ex-US Fund		Global High Yield Bond Fund	
	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022
Erträge				
Zins- und Dividenderträge	\$ 21.891	\$ 18.377	\$ 169.394	\$ 188.614
Sonstige Erträge	286	0	999	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(20.413)	(26.490)	(189.918)	(169.761)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	15.144	36.891	39.818	(171.171)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	(1.482)	(2.783)	(1.037)	(11.131)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	33.442	(98.263)	404.787	(601.507)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	26.187	(19.836)	(6.554)	(8.034)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	(856)	820	(762)	432
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	74.199	(91.284)	416.727	(772.558)
Betriebskosten				
Verwaltungsgebühr	(4.099)	(4.332)	(22.037)	(27.465)
Servicegebühr	(23)	(29)	(30)	(59)
Bestandspflegegebühr	(51)	(57)	(232)	(335)
Sonstige Aufwendungen	(11)	(4)	(81)	(62)
Gesamtaufwendungen	(4.184)	(4.422)	(22.380)	(27.921)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	1	2	0	0
Betriebskosten, netto	(4.183)	(4.420)	(22.380)	(27.921)
Anlageerträge/(-verluste), netto	70.016	(95.704)	394.347	(800.479)
Finanzierungskosten				
Zinsaufwendungen	(456)	(268)	(998)	(436)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	(673)	(704)
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(2.446)	(1.708)	(50.569)	(60.236)
Nettoausgleichskredite und -gebühren	16	(133)	215	(866)
Summe Finanzierungskosten	(2.886)	(2.109)	(52.025)	(62.242)
Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr vor Steuern	67.130	(97.813)	342.322	(862.721)
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(65)	(10)	0	0
Kapitalertragsteuer	0	0	0	0
Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr nach Steuern	67.065	(97.823)	342.322	(862.721)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	\$ 67.065	\$ (97.823)	\$ 342.322	\$ (862.721)

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Alle Beträge stammen ausschließlich aus fortgeführten Tätigkeiten.

Global Investment Grade Credit Fund		Global Investment Grade Credit ESG Fund		Global Low Duration Real Return Fund		Global Real Return Fund	
Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022
\$ 432.793	\$ 390.373	\$ 74.378	\$ 38.525	\$ 56.203	\$ 88.002	\$ 83.713	\$ 281.845
3.979	0	0	0	0	0	1.734	0
(634.780)	(661.979)	(59.556)	(94.471)	(32.996)	(45.666)	(101.995)	(335.981)
65.395	(643.008)	25.153	(58.018)	40.846	14.927	46.010	206.342
(5.486)	(47.103)	5.453	(6.533)	(642)	(5.085)	(5.486)	(30.133)
1.090.196	(1.965.880)	154.912	(242.999)	82.088	(130.314)	223.714	(810.716)
153.446	(65.555)	(2.609)	7.204	(32.799)	14.994	(38.176)	862
(4.852)	3.046	(37)	327	(176)	(113)	(1.821)	(1.087)
1.100.691	(2.990.106)	197.694	(355.965)	112.524	(63.255)	207.693	(688.868)
(69.518)	(75.989)	(9.272)	(6.912)	(8.133)	(7.358)	(15.905)	(19.357)
(2.139)	(2.500)	(1)	(1)	(22)	(24)	(280)	(434)
(1.114)	(1.462)	(1.757)	(1.331)	0	0	(196)	(283)
(156)	(154)	(2)	(1)	(2)	(1)	(3)	(4)
(72.927)	(80.105)	(11.032)	(8.245)	(8.157)	(7.383)	(16.384)	(20.078)
898	900	0	0	0	0	0	0
(72.029)	(79.205)	(11.032)	(8.245)	(8.157)	(7.383)	(16.384)	(20.078)
1.028.662	(3.069.311)	186.662	(364.210)	104.367	(70.638)	191.309	(708.946)
(2.092)	(2.270)	(7.379)	(1.223)	(23.559)	(3.723)	(46.244)	(12.708)
0	0	0	0	0	0	0	0
(100.347)	(98.678)	(17.614)	(11.513)	(5.067)	(7.400)	(20.393)	(35.436)
5	(5.052)	(132)	707	(69)	12	1.196	(45)
(102.434)	(106.000)	(25.125)	(12.029)	(28.695)	(11.111)	(65.441)	(48.189)
926.228	(3.175.311)	161.537	(376.239)	75.672	(81.749)	125.868	(757.135)
(496)	(425)	(77)	(38)	(29)	0	(31)	7
18	(18)	0	0	0	0	2	(2)
925.750	(3.175.754)	161.460	(376.277)	75.643	(81.749)	125.839	(757.130)
\$ 925.750	\$ (3.175.754)	\$ 161.460	\$ (376.277)	\$ 75.643	\$ (81.749)	\$ 125.839	\$ (757.130)

Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)

	Income Fund		Income Fund II	
	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022
Erträge				
Zins- und Dividendenerträge	\$ 3.152.681	\$ 2.324.046	\$ 4.946	\$ 1.453
Sonstige Erträge	0	0	0	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(1.632.305)	(2.773.433)	(426)	(1.292)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	1.805.571	1.069.480	(258)	591
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	(175.035)	(158.142)	277	29
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	3.151.147	(7.858.396)	3.842	(3.257)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	(308.003)	491.740	152	307
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	29.185	(36.840)	18	(18)
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	6.023.241	(6.941.545)	8.551	(2.187)
Betriebskosten				
Verwaltungsgebühr	(597.826)	(558.064)	(1.198)	(362)
Servicegebühr	(13.417)	(14.853)	0	0
Bestandspflegegebühr	(33.017)	(29.379)	0	0
Sonstige Aufwendungen	(3.814)	(3.771)	(4)	(2)
Gesamtaufwendungen	(648.074)	(606.067)	(1.202)	(364)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	1.008	1.010	0	0
Betriebskosten, netto	(647.066)	(605.057)	(1.202)	(364)
Anlageerträge/(-verluste), netto	5.376.175	(7.546.602)	7.349	(2.551)
Finanzierungskosten				
Zinsaufwendungen	(21.455)	(5.028)	(74)	(2)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(2.035.924)	(1.522.465)	(3.972)	(828)
Nettoausgleichskredite und -gebühren	(21.307)	(7.362)	114	(88)
Summe Finanzierungskosten	(2.078.686)	(1.534.855)	(3.932)	(918)
Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr vor Steuern	3.297.489	(9.081.457)	3.417	(3.469)
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(12.577)	(5.121)	(30)	(6)
Kapitalertragsteuer	1.130	(1.130)	0	0
Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr nach Steuern	3.286.042	(9.087.708)	3.387	(3.475)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	\$ 3.286.042	\$ (9.087.708)	\$ 3.387	\$ (3.475)

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Alle Beträge stammen ausschließlich aus fortgeführten Tätigkeiten.

Inflation Multi-Asset Fund		Low Average Duration Fund		Low Duration Global Investment Grade Credit Fund		Low Duration Income Fund	
Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022
\$ 9.392	\$ 18.013	\$ 47.293	\$ 25.484	\$ 34.589	\$ 14.422	\$ 73.744	\$ 39.539
2	0	447	0	0	0	0	0
(8.994)	(11.601)	(22.219)	(42.813)	(11.239)	(20.974)	(32.020)	(56.562)
11.493	(14.589)	(5.675)	10.878	6.089	(52.392)	21.011	(38.394)
(654)	(1.046)	(133)	(1.316)	(737)	(1.354)	2.090	(394)
18.657	(43.168)	39.445	(57.779)	44.578	(35.028)	81.076	(91.374)
(8.175)	3.742	1.240	(1.564)	1.050	(1.725)	11.644	4.463
(5)	46	(223)	253	(152)	115	(488)	(601)
21.716	(48.603)	60.175	(66.857)	74.178	(96.936)	157.057	(143.323)
(4.033)	(4.863)	(5.214)	(7.440)	(4.399)	(3.531)	(9.191)	(7.436)
0	0	(57)	(84)	0	0	0	(1)
(36)	(41)	(47)	(59)	0	0	0	0
0	0	(3)	(3)	(1)	(1)	(11)	(2)
(4.069)	(4.904)	(5.321)	(7.586)	(4.400)	(3.532)	(9.202)	(7.439)
0	0	168	169	0	0	0	0
(4.069)	(4.904)	(5.153)	(7.417)	(4.400)	(3.532)	(9.202)	(7.439)
17.647	(53.507)	55.022	(74.274)	69.778	(100.468)	147.855	(150.762)
(344)	(42)	(9.866)	(1.538)	(1.541)	(323)	(741)	(200)
0	0	0	0	0	0	0	0
(571)	(732)	(1.606)	(985)	(538)	(399)	(8.680)	(4.686)
17	50	(110)	51	0	3	2.000	(564)
(898)	(724)	(11.582)	(2.472)	(2.079)	(719)	(7.421)	(5.450)
16.749	(54.231)	43.440	(76.746)	67.699	(101.187)	140.434	(156.212)
(300)	(369)	(17)	(33)	(10)	0	(8)	(5)
0	0	(179)	0	0	0	0	0
16.449	(54.600)	43.244	(76.779)	67.689	(101.187)	140.426	(156.217)
\$ 16.449	\$ (54.600)	\$ 43.244	\$ (76.779)	\$ 67.689	\$ (101.187)	\$ 140.426	\$ (156.217)

Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Low Duration Opportunities Fund		Low Duration Opportunities ESG Fund	
	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Berichtszeitraum vom 27. Jul. 2022 bis 31. Dez. 2022
Erträge				
Zins- und Dividendenerträge	\$ 43.539	\$ 55.391	\$ 228	\$ 62
Sonstige Erträge	0	0	0	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(39.342)	(193.300)	(30)	2
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	(10.481)	(377.025)	(20)	(37)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	10.187	(6.253)	(5)	9
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	71.442	(143.747)	133	(22)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	39.829	(76.554)	15	(45)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	167	132	0	1
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	115.341	(741.356)	321	(30)
Betriebskosten				
Verwaltungsgebühr	(5.106)	(13.186)	(26)	(11)
Servicegebühr	(15)	(20)	0	0
Bestandspflegegebühr	0	0	0	0
Sonstige Aufwendungen	(26)	(7)	0	0
Gesamtaufwendungen	(5.147)	(13.213)	(26)	(11)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	209	214	0	0
Betriebskosten, netto	(4.938)	(12.999)	(26)	(11)
Anlageerträge/(-verluste), netto	110.403	(754.355)	295	(41)
Finanzierungskosten				
Zinsaufwendungen	(752)	(379)	0	0
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(5.757)	(7.886)	(1)	0
Nettoausgleichskredite und -gebühren	(541)	104	0	0
Summe Finanzierungskosten	(7.050)	(8.161)	(1)	0
Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr vor Steuern	103.353	(762.516)	294	(41)
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	93	(87)	(2)	0
Kapitalertragsteuer	(159)	(7)	0	0
Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr nach Steuern	103.287	(762.610)	292	(41)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	\$ 103.287	\$ (762.610)	\$ 292	\$ (41)

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Alle Beträge stammen ausschließlich aus fortgeführten Tätigkeiten.

PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund		Mortgage Opportunities Fund		StocksPLUS™ Fund		PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	
Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022
\$ 4.688	\$ 4.517	\$ 48.765	\$ 64.142	\$ 78.334	\$ 33.258	\$ 468	\$ 200
0	0	0	0	34	0	0	0
3.004	12.875	(53.254)	(104.200)	(27.114)	(81.088)	(192)	(38)
10.690	9.251	30.901	(29.390)	254.209	(489.873)	2.220	(2.250)
17	(73)	(2.540)	(5.448)	(3.796)	(4.542)	(26)	18
(1.568)	(1.853)	79.879	(167.826)	48.513	(73.113)	233	(374)
(1.244)	815	(27.098)	(16.819)	26.357	(87.127)	9	(231)
3	3	1.428	(1.441)	68	(18)	0	0
15.590	25.535	78.081	(260.982)	376.605	(702.503)	2.712	(2.675)
(1.104)	(1.351)	(5.672)	(9.762)	(11.635)	(12.870)	(76)	(73)
0	0	(88)	(116)	(85)	(60)	0	0
0	0	(9)	(1)	0	0	0	0
0	0	(8)	(17)	(27)	(6)	0	0
(1.104)	(1.351)	(5.777)	(9.896)	(11.747)	(12.936)	(76)	(73)
0	0	0	0	0	0	1	1
(1.104)	(1.351)	(5.777)	(9.896)	(11.747)	(12.936)	(75)	(72)
14.486	24.184	72.304	(270.878)	364.858	(715.439)	2.637	(2.747)
(39)	(21)	(13.330)	(7.142)	(953)	(199)	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(1.287)	(1.973)	(3.105)	(9.330)	(1.045)	(218)	0	0
(48)	(158)	(1.042)	(159)	29	(322)	0	0
(1.374)	(2.152)	(17.477)	(16.631)	(1.969)	(739)	0	0
13.112	22.032	54.827	(287.509)	362.889	(716.178)	2.637	(2.747)
(580)	(1.066)	0	0	(20)	10	(1)	0
0	0	0	0	0	0	0	0
12.532	20.966	54.827	(287.509)	362.869	(716.168)	2.636	(2.747)
\$ 12.532	\$ 20.966	\$ 54.827	\$ (287.509)	\$ 362.869	\$ (716.168)	\$ 2.636	\$ (2.747)

Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)

	Strategic Income Fund		Total Return Bond Fund	
	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022
Erträge				
Zins- und Dividenderträge	\$ 23.182	\$ 24.332	\$ 179.835	\$ 114.210
Sonstige Erträge	0	0	0	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(7.187)	(10.791)	(122.939)	(308.687)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	19.261	(40.272)	(6.006)	18.095
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	(452)	(504)	(2.380)	(10.559)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	29.411	(66.591)	276.545	(628.624)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	(11.204)	16.280	(26.913)	2.689
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	146	(284)	530	(795)
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	53.157	(77.830)	298.672	(813.671)
Betriebskosten				
Verwaltungsgebühr	(6.178)	(7.425)	(31.945)	(32.300)
Servicegebühr	0	0	(1.648)	(1.509)
Bestandspflegegebühr	0	0	(900)	(722)
Sonstige Aufwendungen	(100)	(105)	(40)	(44)
Gesamtaufwendungen	(6.278)	(7.530)	(34.533)	(34.575)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	0	0	0	512
Betriebskosten, netto	(6.278)	(7.530)	(34.533)	(34.063)
Anlageerträge/(-verluste), netto	46.879	(85.360)	264.139	(847.734)
Finanzierungskosten				
Zinsaufwendungen	(633)	(225)	(1.591)	(857)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(5.258)	(5.529)	(20.419)	(14.771)
Nettoausgleichskredite und -gebühren	(501)	171	(82)	138
Summe Finanzierungskosten	(6.392)	(5.583)	(22.092)	(15.490)
Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr vor Steuern	40.487	(90.943)	242.047	(863.224)
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(1.288)	(1.177)	(161)	(288)
Kapitalertragsteuer	(121)	(9)	0	0
Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr nach Steuern	39.078	(92.129)	241.886	(863.512)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	\$ 39.078	\$ (92.129)	\$ 241.886	\$ (863.512)

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Alle Beträge stammen ausschließlich aus fortgeführten Tätigkeiten.

PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund		UK Corporate Bond Fund		UK Long Term Corporate Bond Fund		US High Yield Bond Fund	
Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022
\$ 16.252	\$ 3.645	£ 15.303	£ 11.760	£ 14.244	£ 11.151	\$ 120.057	\$ 156.507
0	0	30	0	83	0	365	0
775	(4.374)	(27.836)	(30.472)	(17.071)	(27.835)	(155.169)	(135.436)
(24.632)	1.422	6.605	(18.338)	1.241	(26.173)	19.377	(77.001)
(3.823)	(599)	(822)	(25)	(481)	131	283	(1.909)
(2.673)	4.540	41.320	(66.723)	30.886	(80.017)	271.410	(441.841)
(613)	(7.427)	(2.851)	3.502	1.542	1.687	(5.206)	3.016
76	(70)	385	96	603	79	(35)	51
(14.638)	(2.863)	32.134	(100.200)	31.047	(120.977)	251.082	(496.613)
(4.329)	(2.340)	(1.309)	(1.843)	(1.421)	(1.596)	(13.288)	(18.237)
(13)	0	0	0	0	0	(924)	(1.231)
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	(3)	(1)	(8)	(2)	(39)	(10)
(4.342)	(2.340)	(1.312)	(1.844)	(1.429)	(1.598)	(14.251)	(19.478)
81	25	16	12	0	0	0	0
(4.261)	(2.315)	(1.296)	(1.832)	(1.429)	(1.598)	(14.251)	(19.478)
(18.899)	(5.178)	30.838	(102.032)	29.618	(122.575)	236.831	(516.091)
(374)	(89)	(939)	(164)	(243)	(76)	(413)	(38)
0	0	0	0	0	0	(470)	(553)
(2.439)	(319)	(7.360)	(7.385)	(1.587)	(1.401)	(20.197)	(28.068)
(85)	159	(113)	147	(40)	0	198	(1.127)
(2.898)	(249)	(8.412)	(7.402)	(1.870)	(1.477)	(20.882)	(29.786)
(21.797)	(5.427)	22.426	(109.434)	27.748	(124.052)	215.949	(545.877)
0	0	0	6	0	0	0	(22)
0	0	0	0	0	0	0	0
(21.797)	(5.427)	22.426	(109.428)	27.748	(124.052)	215.949	(545.899)
\$ (21.797)	\$ (5.427)	£ 22.426	£ (109.428)	£ 27.748	£ (124.052)	\$ 215.949	\$ (545.899)

Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)	US Investment Grade Corporate Bond Fund	
	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022
Erträge		
Zins- und Dividenderträge	\$ 19.606	\$ 18.748
Sonstige Erträge	0	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(7.531)	(82.238)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	(533)	(42.587)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	258	(237)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	25.385	(56.269)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	5.246	(8.065)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	(153)	93
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	42.278	(170.555)
Betriebskosten		
Verwaltungsgebühr	(2.511)	(2.797)
Servicegebühr	0	0
Bestandspflegegebühr	0	0
Sonstige Aufwendungen	(1)	(1)
Gesamtaufwendungen	(2.512)	(2.798)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	0	0
Betriebskosten, netto	(2.512)	(2.798)
Anlageerträge/(-verluste), netto	39.766	(173.353)
Finanzierungskosten		
Zinsaufwendungen	(59)	(42)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(4.167)	(6.002)
Nettoausgleichskredite und -gebühren	100	(1.021)
Summe Finanzierungskosten	(4.126)	(7.065)
Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr vor Steuern	35.640	(180.418)
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(64)	(60)
Kapitalertragsteuer	0	0
Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr nach Steuern	35.576	(180.478)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	\$ 35.576	\$ (180.478)

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Alle Beträge stammen ausschließlich aus fortgeführten Tätigkeiten.

* Die Summe der Gesellschaft für die Geschäftsjahre zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 wurde bereinigt, um Überkreuzinvestitionen zu eliminieren. Nähere Einzelheiten zu Überkreuzinvestitionen sind Erläuterung 14 in den Erläuterungen zum Abschluss zu entnehmen.

US Short-Term Fund		Summe der Gesellschaft*	
Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022
\$ 99.844	\$ 55.566	\$ 7.470.870	\$ 6.178.757
0	0	19.696	0
(31.452)	(71.854)	(6.487.698)	(8.968.907)
8.463	58.715	2.712.849	(2.110.326)
(1.056)	(2.268)	(336.990)	(570.612)
64.461	(75.579)	10.751.115	(21.700.661)
(12.479)	16.121	597.760	(473.258)
15	(37)	52.339	(34.364)
127.796	(19.336)	14.779.941	(27.679.371)
(8.363)	(10.218)	(1.330.072)	(1.395.118)
(39)	(51)	(22.947)	(25.946)
0	0	(39.781)	(36.489)
(3)	(3)	(6.703)	(6.292)
(8.405)	(10.272)	(1.399.503)	(1.463.845)
718	874	10.067	12.309
(7.687)	(9.398)	(1.389.436)	(1.451.536)
120.109	(28.734)	13.390.505	(29.130.907)
(449)	(1.332)	(218.100)	(69.903)
0	0	(1.325)	(1.257)
(34.453)	(15.307)	(2.754.277)	(2.279.520)
(69)	896	(28.535)	(23.010)
(34.971)	(15.743)	(3.002.237)	(2.373.690)
85.138	(44.477)	10.388.268	(31.504.597)
(2)	1	(24.685)	(21.859)
0	0	(1.021)	(1.417)
85.136	(44.476)	10.362.562	(31.527.873)
\$ 85.136	\$ (44.476)	\$ 10.362.562	\$ (31.527.873)

Ausweis der Nettovermögensänderungen

(Angaben in Tausend)	PIMCO Asia High Yield Bond Fund		Asia Strategic Interest Bond Fund		PIMCO Balanced Income and Growth Fund ⁽¹⁾	
	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	\$ 2.981.392	\$ 3.411.923	\$ 313.987	\$ 361.011	\$ 750.076	\$ 1.035.021
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen	628.884	2.053.140	95.633	98.659	110.446	175.286
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	3.210	10.176	1.079	762	10	7
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(1.154.141)	(1.858.479)	(229.012)	(89.514)	(264.375)	(235.350)
Nominalwechselkursanpassungen	0	0	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	(24.617)	(635.368)	(4.479)	(56.931)	73.959	(224.888)
Nettovermögen zum Ende des Geschäftsjahres	\$ 2.434.728	\$ 2.981.392	\$ 177.208	\$ 313.987	\$ 670.116	\$ 750.076
	Diversified Income Fund		Diversified Income Duration Hedged Fund		Diversified Income ESG Fund	
	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Berichtszeitraum vom 27. Jul. 2022 bis 31. Dez. 2022
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	\$ 8.751.796	\$ 16.447.733	\$ 564.684	\$ 1.305.365	\$ 9.854	\$ 0
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen	1.312.783	1.896.447	28.282	68.633	50.850	9.954
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	14.853	16.545	51	34	0	0
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(3.265.481)	(6.169.181)	(229.271)	(612.551)	(6.217)	0
Nominalwechselkursanpassungen	0	0	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	625.847	(3.439.748)	49.093	(196.797)	3.076	(100)
Nettovermögen zum Ende des Geschäftsjahres	\$ 7.439.798	\$ 8.751.796	\$ 412.839	\$ 564.684	\$ 57.563	\$ 9.854
	Emerging Markets Bond Fund		Emerging Markets Bond ESG Fund		Emerging Markets Corporate Bond Fund	
	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	\$ 3.305.979	\$ 4.714.744	\$ 2.492.475	\$ 2.635.769	\$ 168.986	\$ 212.894
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen	1.315.271	1.975.229	824.351	1.511.574	6.131	26.594
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	2.893	3.115	1.110	2.170	0	0
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(1.140.746)	(2.402.706)	(875.929)	(948.773)	(29.388)	(30.165)
Nominalwechselkursanpassungen	0	0	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	362.888	(984.403)	251.914	(708.265)	11.984	(40.337)
Nettovermögen zum Ende des Geschäftsjahres	\$ 3.846.285	\$ 3.305.979	\$ 2.693.921	\$ 2.492.475	\$ 157.713	\$ 168.986

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

⁽¹⁾ Der PIMCO Global Core Asset Allocation Fund wurde am 29. November 2023 in PIMCO Balanced Income and Growth Fund umbenannt.

PIMCO Capital Securities Fund		PIMCO Climate Bond Fund		Commodity Real Return Fund		PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	
Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022
\$ 5.721.591	\$ 9.110.409	\$ 292.655	\$ 328.081	\$ 1.369.877	\$ 1.444.182	\$ 97.153	\$ 139.704
1.523.897	1.684.526	115.085	140.136	357.526	1.475.400	7.287	9.058
9.386	10.326	6	136	0	0	0	0
(2.473.767)	(3.728.874)	(167.821)	(101.860)	(768.414)	(1.623.269)	(13.621)	(38.655)
0	0	0	0	0	0	0	0
356.779	(1.354.796)	22.391	(73.838)	(100.087)	73.564	9.244	(12.954)
\$ 5.137.886	\$ 5.721.591	\$ 262.316	\$ 292.655	\$ 858.902	\$ 1.369.877	\$ 100.063	\$ 97.153
Dynamic Bond Fund		Dynamic Multi-Asset Fund		Emerging Local Bond Fund		Emerging Local Bond ESG Fund	
Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Berichtszeitraum vom 27. Jul. 2022 bis 31. Dez. 2022
\$ 3.483.601	\$ 3.277.997	€ 5.115.170	€ 7.635.950	\$ 1.919.668	\$ 2.151.129	\$ 6.609	\$ 0
501.746	1.763.140	381.815	862.412	1.657.250	803.400	91.524	6.206
1.248	1.413	55	92	1.946	1.998	4	1
(893.774)	(1.068.332)	(2.168.667)	(2.381.432)	(1.047.135)	(864.659)	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
352.752	(490.617)	(66.328)	(1.001.852)	349.212	(172.200)	4.271	402
\$ 3.445.573	\$ 3.483.601	€ 3.262.045	€ 5.115.170	\$ 2.880.941	\$ 1.919.668	\$ 102.408	\$ 6.609
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund		Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund		PIMCO ESG Income Fund		Euro Bond Fund	
Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022
\$ 205.131	\$ 290.475	\$ 20.937	\$ 29.760	\$ 237.961	\$ 125.087	€ 1.913.275	€ 2.574.129
81.173	167.062	3.869	8.145	213.650	172.394	381.446	335.598
51	20	0	0	930	465	1	0
(29.759)	(212.974)	(6.716)	(15.231)	(196.750)	(38.588)	(763.849)	(595.105)
0	0	0	0	0	0	0	0
26.194	(39.452)	1.856	(1.737)	15.417	(21.397)	140.840	(401.347)
\$ 282.790	\$ 205.131	\$ 19.946	\$ 20.937	\$ 271.208	\$ 237.961	€ 1.671.713	€ 1.913.275

Ausweis der Nettovermögensänderungen (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Euro Credit Fund		Euro Income Bond Fund		Euro Long Average Duration Fund	
	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	€ 610.008	€ 1.017.163	€ 1.352.980	€ 2.482.304	€ 110.048	€ 160.601
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen	131.415	434.310	323.596	446.648	819.102	40.010
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	320	23	1.221	0	0
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(253.794)	(673.784)	(376.474)	(1.293.838)	(51.624)	(31.391)
Nominalwechselkursanpassungen	0	0	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	49.557	(168.001)	87.102	(283.355)	46.443	(59.172)
Nettovermögen zum Ende des Geschäftsjahres	€ 537.186	€ 610.008	€ 1.387.227	€ 1.352.980	€ 923.969	€ 110.048
	Global Bond Fund		Global Bond ESG Fund		Global Bond Ex-US Fund	
	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	\$ 11.420.112	\$ 14.038.846	\$ 3.106.190	\$ 2.302.966	\$ 716.022	\$ 911.707
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen	5.083.690	3.949.985	1.603.900	1.882.825	264.163	307.762
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	3.136	3.168	7.529	4.271	940	678
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(4.397.276)	(4.441.247)	(1.423.710)	(657.548)	(248.064)	(406.302)
Nominalwechselkursanpassungen	0	0	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	967.600	(2.130.640)	267.271	(426.324)	67.065	(97.823)
Nettovermögen zum Ende des Geschäftsjahres	\$ 13.077.262	\$ 11.420.112	\$ 3.561.180	\$ 3.106.190	\$ 800.126	\$ 716.022
	Global Real Return Fund		Income Fund		Income Fund II	
	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	\$ 2.571.862	\$ 3.703.379	\$ 57.980.327	\$ 73.579.726	\$ 56.623	\$ 27.770
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen	476.053	881.779	25.296.693	18.117.060	135.551	35.679
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	2.264	4.676	159.846	124.031	36	62
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(794.925)	(1.260.842)	(16.179.791)	(24.752.782)	(70.437)	(3.413)
Nominalwechselkursanpassungen	0	0	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	125.839	(757.130)	3.286.042	(9.087.708)	3.387	(3.475)
Nettovermögen zum Ende des Geschäftsjahres	\$ 2.381.093	\$ 2.571.862	\$ 70.543.117	\$ 57.980.327	\$ 125.160	\$ 56.623

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

Euro Short-Term Fund		PIMCO European High Yield Bond Fund		PIMCO European Short-Term Opportunities Fund		Global Advantage Fund	
Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022
€ 353.095	€ 629.859	€ 174.162	€ 170.489	€ 211.172	€ 395.491	\$ 410.459	\$ 521.067
88.943	249.387	239.216	37.975	37.094	69.639	9.823	25.733
0	0	0	0	0	0	0	0
(257.754)	(518.005)	(80.655)	(18.172)	(123.728)	(243.049)	(19.644)	(53.865)
0	0	0	0	0	0	0	0
9.230	(8.146)	35.044	(16.130)	6.072	(10.909)	31.652	(82.476)
€ 193.514	€ 353.095	€ 367.767	€ 174.162	€ 130.610	€ 211.172	\$ 432.290	\$ 410.459
Global High Yield Bond Fund		Global Investment Grade Credit Fund		Global Investment Grade Credit ESG Fund		Global Low Duration Real Return Fund	
Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022
\$ 3.102.868	\$ 5.169.160	\$ 10.538.341	\$ 17.154.925	\$ 1.369.890	\$ 1.189.563	\$ 1.364.375	\$ 1.199.076
959.875	1.424.841	4.964.595	3.907.121	1.183.344	1.086.602	320.911	1.093.289
2.851	2.721	3.812	4.308	25	366	17	2
(1.427.666)	(2.631.133)	(5.718.776)	(7.352.259)	(544.512)	(530.364)	(583.894)	(846.243)
0	0	0	0	0	0	0	0
342.322	(862.721)	925.750	(3.175.754)	161.460	(376.277)	75.643	(81.749)
\$ 2.980.250	\$ 3.102.868	\$ 10.713.722	\$ 10.538.341	\$ 2.170.207	\$ 1.369.890	\$ 1.177.052	\$ 1.364.375
Inflation Multi-Asset Fund		Low Average Duration Fund		Low Duration Global Investment Grade Credit Fund		Low Duration Income Fund	
Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022
\$ 403.078	\$ 164.345	\$ 1.072.758	\$ 1.179.138	\$ 654.749	\$ 806.869	\$ 1.084.380	\$ 1.367.475
18.429	474.503	244.183	1.413.022	385.826	182.884	1.115.457	597.584
141	230	582	309	367	254	120	67
(184.849)	(181.400)	(550.922)	(1.442.932)	(135.788)	(234.071)	(310.078)	(724.529)
0	0	0	0	0	0	0	0
16.449	(54.600)	43.244	(76.779)	67.689	(101.187)	140.426	(156.217)
\$ 253.248	\$ 403.078	\$ 809.845	\$ 1.072.758	\$ 972.843	\$ 654.749	\$ 2.030.305	\$ 1.084.380

Ausweis der Nettovermögensänderungen (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Low Duration Opportunities Fund		Low Duration Opportunities ESG Fund		PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	
	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Berichtszeitraum vom 27. Jul. 2022 bis 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	\$ 1.345.781	\$ 3.217.260	\$ 4.928	\$ 0	\$ 120.137	\$ 100.538
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen	324.163	880.588	0	4.969	12.242	78.857
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	2.288	869	1	0	5	6
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(987.895)	(1.990.326)	0	0	(46.423)	(80.230)
Nominalwechselkursanpassungen	0	0	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	103.287	(762.610)	292	(41)	12.532	20.966
Nettovermögen zum Ende des Geschäftsjahres	\$ 787.624	\$ 1.345.781	\$ 5.221	\$ 4.928	\$ 98.493	\$ 120.137
	Total Return Bond Fund		PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund		UK Corporate Bond Fund	
	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	\$ 4.150.717	\$ 4.944.898	\$ 435.924	\$ 101.789	£ 389.173	£ 592.164
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen	1.093.709	1.455.704	127.972	446.424	76.354	89.056
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	10.647	8.134	8	2	0	1
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(1.076.908)	(1.394.507)	(301.761)	(106.864)	(126.892)	(182.620)
Nominalwechselkursanpassungen	0	0	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	241.886	(863.512)	(21.797)	(5.427)	22.426	(109.428)
Nettovermögen zum Ende des Geschäftsjahres	\$ 4.420.051	\$ 4.150.717	\$ 240.346	\$ 435.924	£ 361.061	£ 389.173
	Summe der Gesellschaft*					
	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022				
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	\$ 151.524.519	\$ 209.342.798				
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen	58.350.142	59.195.422				
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	265.656	229.935				
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(55.777.199)	(84.448.259)				
Nominalwechselkursanpassungen	376.875	(1.267.504)				
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	10.362.562	(31.527.873)				
Nettovermögen zum Ende des Geschäftsjahres	\$ 165.102.555	\$ 151.524.519				

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

* Die Summe der Gesellschaft für die Geschäftsjahre zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 wurde bereinigt, um Überkreuzinvestitionen zu eliminieren. Nähere Einzelheiten zu Überkreuzinvestitionen sind Erläuterung 14 in den Erläuterungen zum Abschluss zu entnehmen.

Mortgage Opportunities Fund		StocksPLUS™ Fund		PIMCO StocksPLUS™ AR Fund		Strategic Income Fund	
Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022
\$ 849.148	\$ 2.238.424	\$ 1.008.739	\$ 3.761.156	\$ 9.528	\$ 11.610	\$ 506.557	\$ 619.928
461.414	944.728	1.446.815	951.977	1.944	1.511	35.988	179.697
482	4.620	1.034	215	0	0	22	15
(440.615)	(2.051.115)	(856.469)	(2.988.441)	(2.933)	(846)	(131.696)	(200.954)
0	0	0	0	0	0	0	0
54.827	(287.509)	362.869	(716.168)	2.636	(2.747)	39.078	(92.129)
\$ 925.256	\$ 849.148	\$ 1.962.988	\$ 1.008.739	\$ 11.175	\$ 9.528	\$ 449.949	\$ 506.557

UK Long Term Corporate Bond Fund		US High Yield Bond Fund		US Investment Grade Corporate Bond Fund		US Short-Term Fund	
Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022
£ 325.020	£ 425.748	\$ 1.984.922	\$ 3.923.786	\$ 388.522	\$ 878.100	\$ 2.310.115	\$ 2.650.198
7.700	108.291	442.006	744.251	260.302	223.870	557.195	1.278.210
2	2	3.440	5.395	66	3.292	29.132	13.355
(35.702)	(84.969)	(773.430)	(2.142.611)	(203.605)	(536.262)	(1.127.372)	(1.587.172)
0	0	0	0	0	0	0	0
27.748	(124.052)	215.949	(545.899)	35.576	(180.478)	85.136	(44.476)
£ 324.768	£ 325.020	\$ 1.872.887	\$ 1.984.922	\$ 480.861	\$ 388.522	\$ 1.854.206	\$ 2.310.115

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Asia High Yield Bond Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE											
AUSTRALIEN											
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL											
Emeco Pty. Ltd. 6,250 % fällig am 10.07.2026	AUD 11.810	\$ 7.608	0,31	11,950 % fällig am 22.10.2022 ^	\$ 800	\$ 29	0,00	Yango Justice International Ltd. 7,500 % fällig am 15.04.2024 ^	\$ 17.800	\$ 98	0,01
Mineral Resources Ltd. 8,000 % fällig am 01.11.2027	\$ 6.040	6.201	0,26	11,950 % fällig am 12.11.2023 ^	12.100	439	0,02	7,500 % fällig am 17.02.2025 ^	3.000	30	0,00
Northern Star Resources Ltd. 6,125 % fällig am 11.04.2033	5.894	5.927	0,24	KWG Group Holdings Ltd. 5,950 % fällig am 10.08.2025 ^	16.723	1.146	0,05	7,875 % fällig am 04.09.2024 ^	5.800	32	0,00
Summe Australien		19.736	0,81	Longfor Group Holdings Ltd. 3,950 % fällig am 16.09.2029	15.100	6.961	0,29	8,250 % fällig am 25.11.2023 ^	4.400	34	0,00
BRASILIEN											
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL											
CSN Resources S.A. 4,625 % fällig am 10.06.2031	5.000	4.093	0,17	4,500 % fällig am 16.01.2028	3.900	2.024	0,08	9,250 % fällig am 15.04.2023 ^	10.900	60	0,00
8,875 % fällig am 05.12.2030	3.100	3.233	0,13	Melco Resorts Finance Ltd. 4,875 % fällig am 06.06.2025	28.160	27.338	1,12	Yunda Holding Investment Ltd. 2,250 % fällig am 19.08.2025	15.600	14.274	0,59
Summe Brasilien		7.326	0,30	5,250 % fällig am 26.04.2026	8.324	8.031	0,33	ZhongAn Online P&C Insurance Co. Ltd. 3,125 % fällig am 16.07.2025	14.380	13.312	0,55
CAYMAN-INSELN											
WANDELANLEIHEN & WECHSEL											
Cathay Pacific Finance Ltd. 2,750 % fällig am 05.02.2026	HKD 38.000	5.114	0,21	5,625 % fällig am 17.07.2027	8.250	7.739	0,32	Summe China		47.363	1,95
Hansoh Pharmaceutical Group Co. Ltd. 0,000 % fällig am 22.01.2026 (b)	\$ 12.100	12.037	0,50	5,750 % fällig am 21.07.2028	46.577	43.178	1,77				
Meituan 0,000 % fällig am 27.04.2028 (b)	14.200	12.276	0,50	MGM China Holdings Ltd. 4,750 % fällig am 01.02.2027	37.355	35.566	1,47	KOLUMBIEN			
Sunac China Holdings Ltd. 1,000 % fällig am 30.09.2032	6.339	491	0,02	5,250 % fällig am 18.06.2025	8.500	8.355	0,34	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Wynn Macau Ltd. 4,500 % fällig am 07.03.2029	12.300	12.600	0,52	5,875 % fällig am 15.05.2026	3.100	3.037	0,13	Ecopetrol S.A. 4,625 % fällig am 02.11.2031	4.200	3.567	0,15
Xiaomi Best Time International Ltd. 0,000 % fällig am 17.12.2027 (b)	8.100	7.225	0,30	New Metro Global Ltd. 4,500 % fällig am 02.05.2026	5.200	1.313	0,05	6,875 % fällig am 29.04.2030	3.000	2.977	0,12
		49.743	2,05	PCPD Capital Ltd. 5,125 % fällig am 18.06.2026	7.500	5.937	0,24	Summe Kolumbien		6.544	0,27
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL											
AAC Technologies Holdings, Inc. 3,000 % fällig am 27.11.2024	14.730	14.175	0,58	Sands China Ltd. 4,300 % fällig am 08.01.2026	15.060	14.472	0,59	FRANKREICH			
Agile Group Holdings Ltd. 5,500 % fällig am 21.04.2025	14.195	2.135	0,09	4,625 % fällig am 18.06.2030	11.300	10.297	0,42	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
5,500 % fällig am 17.05.2026	34.510	4.633	0,19	5,375 % fällig am 08.08.2025	1.100	1.085	0,05	BNP Paribas S.A. 7,750 % fällig am 16.08.2029 (d)(f)	4.500	4.605	0,19
5,750 % fällig am 02.01.2025	4.000	627	0,03	Seazen Group Ltd. 4,450 % fällig am 13.07.2025	9.100	2.684	0,11	9,250 % fällig am 17.11.2027 (d)(f)	4.100	4.394	0,18
6,050 % fällig am 13.10.2025	13.170	1.646	0,07	6,000 % fällig am 12.08.2024	10.600	5.936	0,24	Credit Agricole S.A. 7,250 % fällig am 23.09.2028 (d)(f)	€ 7.900	9.264	0,38
7,875 % fällig am 31.07.2024 (d)	6.077	234	0,01	Shui On Development Holding Ltd. 5,500 % fällig am 29.06.2026	14.000	6.693	0,28	Summe Frankreich		18.263	0,75
China Hongqiao Group Ltd. 6,250 % fällig am 08.06.2024	9.600	9.541	0,39	6,150 % fällig am 24.08.2024	1.400	1.085	0,04	HONGKONG			
China Modern Dairy Holdings Ltd. 2,125 % fällig am 14.07.2026	23.100	20.517	0,84	Sunac China Holdings Ltd. 6,000 % fällig am 30.09.2026	3.681	387	0,02	WANDELANLEIHEN & WECHSEL			
CIFI Holdings Group Co. Ltd. 5,250 % fällig am 13.05.2026 ^	1.752	104	0,00	6,250 % fällig am 30.09.2027	3.681	292	0,01	Universe Trek Ltd. 0,000 % fällig am 15.06.2026 (b)	\$ 1.500	1.523	0,06
5,950 % fällig am 20.10.2025 ^	5.867	410	0,02	6,500 % fällig am 30.09.2027	7.362	583	0,02	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
6,450 % fällig am 07.11.2024 ^	16.695	1.190	0,05	6,750 % fällig am 30.09.2028	11.043	502	0,02	Bank of East Asia Ltd. 4,000 % fällig am 29.05.2030 (f)	7.300	6.886	0,28
6,550 % fällig am 28.03.2024 ^	3.098	204	0,01	7,000 % fällig am 30.09.2029	11.043	600	0,02	4,875 % fällig am 22.04.2032 (f)	8.400	7.606	0,31
Country Garden Holdings Co. Ltd. 3,875 % fällig am 22.10.2030 ^	24.644	1.938	0,08	7,250 % fällig am 30.09.2030	5.187	203	0,01	5,825 % fällig am 21.10.2025 (d)(f)	3.100	2.713	0,11
4,200 % fällig am 06.02.2026 ^	15.300	1.316	0,05	Times China Holdings Ltd. 5,550 % fällig am 04.06.2024 ^	16.400	424	0,02	5,875 % fällig am 19.09.2024 (d)(f)	3.800	3.568	0,15
6,150 % fällig am 17.09.2025 ^	300	25	0,00	6,200 % fällig am 22.03.2026 ^	8.000	220	0,01	Dah Sing Bank Ltd. 7,375 % fällig am 15.11.2033 (f)	17.500	18.256	0,75
7,250 % fällig am 08.04.2026 ^	31.420	2.652	0,11	6,600 % fällig am 02.03.2023 ^	7.236	174	0,01	Fortune Star BVI Ltd. 3,950 % fällig am 02.10.2026	€ 14.824	10.467	0,43
eHi Car Services Ltd. 7,000 % fällig am 21.09.2026	5.050	3.396	0,14	6,750 % fällig am 16.07.2023 ^	2.980	82	0,00	5,000 % fällig am 18.05.2026	\$ 27.200	19.953	0,82
FWD Group Holdings Ltd. 5,000 % fällig am 24.09.2024	200	199	0,01	VLL International, Inc. 5,750 % fällig am 28.11.2024	3.285	3.221	0,13	5,050 % fällig am 27.01.2027	8.400	5.567	0,23
5,750 % fällig am 09.07.2024	200	198	0,01	Wynn Macau Ltd. 4,875 % fällig am 01.10.2024	10.471	10.346	0,43	5,950 % fällig am 19.10.2025	14.100	11.755	0,48
6,375 % fällig am 13.09.2024 (d)	15.270	13.514	0,56	5,125 % fällig am 15.12.2029	2.851	2.536	0,10	Franshion Brilliant Ltd. 4,250 % fällig am 23.07.2029	800	521	0,02
8,045 % fällig am 15.06.2024 (d)	5.500	5.028	0,21	5,500 % fällig am 01.10.2027	24.513	23.177	0,95	GLP China Holdings Ltd. 2,950 % fällig am 29.03.2026	13.450	7.868	0,32
Health & Happiness International Holdings Ltd. 13,500 % fällig am 26.06.2026	14.835	14.351	0,59	5,625 % fällig am 26.08.2028	23.930	22.185	0,91	4,974 % fällig am 26.02.2024	2.200	2.075	0,09
Kaisa Group Holdings Ltd. 8,500 % fällig am 30.06.2022 ^	17.900	671	0,03	Summe Cayman-Inseln		443.000	18,21	Huarong Finance Co. Ltd. 3,250 % fällig am 13.11.2024	13.900	13.483	0,56
9,375 % fällig am 30.06.2024 ^	15.750	569	0,02	AKTIEN				3,750 % fällig am 29.05.2024	9.700	9.568	0,39
9,750 % fällig am 28.09.2023 ^	13.200	482	0,02	CHINA				3,875 % fällig am 13.11.2029	7.800	6.629	0,27
10,500 % fällig am 15.01.2025 ^	20.200	736	0,03	STAMMAKTIVEN				4,250 % fällig am 07.11.2027	6.569	6.006	0,25
10,875 % fällig am 23.07.2023 ^	9.800	318	0,01	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				4,500 % fällig am 29.05.2029	15.400	13.658	0,56
11,250 % fällig am 09.04.2022 ^	6.700	245	0,01	Flourish Century 6,600 % fällig am 04.02.2022 ^ (g)	\$ 10.900	998	0,04	4,625 % fällig am 03.06.2026	7.077	6.732	0,28
11,700 % fällig am 11.11.2025 ^	1.450	52	0,00	Greenland Global Investment Ltd. (6,875 % bar oder 1,000 % PIK)				4,750 % fällig am 27.04.2027	19.500	18.306	0,75
				6,875 % fällig am 03.07.2030 (a)	7.150	1.017	0,04	4,875 % fällig am 22.11.2026	7.180	6.822	0,28
				Greenland Global Investment Ltd. (8,250 % bar oder 1,000 % PIK)				5,000 % fällig am 19.11.2025	2.900	2.801	0,12
				8,250 % fällig am 22.01.2031 (a)	17.949	2.610	0,11	6,914 % fällig am 24.02.2025	5.200	5.192	0,21
				New Metro Global Ltd. 4,625 % fällig am 15.10.2025	4.500	1.294	0,05	Nanyang Commercial Bank Ltd. 3,800 % fällig am 20.11.2029 (f)	1.000	977	0,04
				4,800 % fällig am 15.12.2024	14.300	5.684	0,24	Pingan Real Estate Capital Ltd. 3,450 % fällig am 29.07.2026	3.600	2.514	0,10
				Yango Group Co. Ltd. 6,900 % fällig am 31.10.2022 ^ CNY 40.000		796	0,03	Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd. 3,975 % fällig am 09.11.2027	3.500	2.357	0,10
								Yanlord Land HK Co. Ltd. 5,125 % fällig am 20.05.2026	13.599	7.920	0,33
								Summe Hongkong		200.200	8,23
										201.723	8,29

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
INDIEN				Greenko Wind Projects Mauritius Ltd.				SINGAPUR			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Greenko Airport Infra				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Adani Green Energy Ltd.				5,500 % fällig am 06.04.2025	\$ 51.041	\$ 50.046	2,06	Clean Renewable Power Mauritius Pte. Ltd.			
4,375 % fällig am 08.09.2024	\$ 4.800	\$ 4.638	0,19	6,250 % fällig am 25.10.2025	2.152	2.121	0,09	4,250 % fällig am 25.03.2027	\$ 6.705	\$ 6.133	0,25
Adani Green Energy UP Ltd.				India Cleantech Energy				GLP Pte. Ltd.			
6,250 % fällig am 10.12.2024	12.041	11.913	0,49	4,700 % fällig am 10.08.2026	15.116	13.788	0,57	3,875 % fällig am 04.06.2025	11.475	7.631	0,31
GMR Hyderabad International Airport Ltd.				India Green Energy Holdings				4,500 % fällig am 17.05.2026 (d)	7.400	2.372	0,10
4,250 % fällig am 27.10.2027	4.878	4.476	0,18	5,375 % fällig am 29.04.2024	22.873	22.646	0,93	4,600 % fällig am 29.06.2027 (d)	7.000	2.205	0,09
4,750 % fällig am 02.02.2026	25.175	24.258	1,00	India Green Power Holdings				Indika Energy Capital Pte. Ltd.			
HDFC Bank Ltd.				4,000 % fällig am 22.02.2027	4.602	4.227	0,17	8,250 % fällig am 22.10.2025	6.000	6.029	0,25
3,700 % fällig am				India Toll Roads				Medco Bell Pte. Ltd.			
25.08.2026 (d)(f)	11.068	10.100	0,42	5,500 % fällig am 19.08.2024	21.843	21.485	0,88	6,375 % fällig am 30.01.2027	16.567	15.785	0,65
JSW Hydro Energy Ltd.				Summe Mauritius		164.821	6,77	Medco Maple Tree Pte Ltd.			
4,125 % fällig am 18.05.2031	17.428	15.204	0,62					8,960 % fällig am 27.04.2029	10.600	10.781	0,44
JSW Steel Ltd.				MEXIKO				Medco Oak Tree Pte. Ltd.			
5,050 % fällig am 05.04.2032	4.600	3.967	0,16	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				7,375 % fällig am 14.05.2026	13.671	13.591	0,56
Network i2i Ltd.				Banco Mercantil del Norte S.A.				TML Holdings Pte. Ltd.			
3,975 % fällig am 03.03.2026 (d)	8.300	7.740	0,32	5,875 % fällig am				4,350 % fällig am 09.06.2026	4.000	3.800	0,16
5,650 % fällig am 15.01.2025 (d)	7.700	7.626	0,31	24.01.2027 (d)(f)	6.150	5.666	0,23	5,500 % fällig am 03.06.2024	13.524	13.439	0,55
Periana Holdings LLC				6,750 % fällig am				Summe Singapur		81.766	3,36
5,950 % fällig am 19.04.2026	51.000	50.326	2,07	27.09.2024 (d)(f)	1.700	1.682	0,07				
ReNew Wind Energy AP2				Summe Mexiko		7.348	0,30	SÜDAFRIKA			
4,500 % fällig am 14.07.2028	30.988	27.567	1,13					UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Shriram Finance Ltd.				MONGOLEI				Sasol Financing USA LLC			
4,400 % fällig am 13.03.2024	31.358	31.167	1,28	STAATSEMISSIONEN				6,500 % fällig am 27.09.2028	6.700	6.390	0,26
Summe Indien		198.982	8,17	Mongolia Government International Bond				SÜDKOREA			
				4,450 % fällig am 07.07.2031	13.000	10.925	0,45	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
INDONESIEN				5,125 % fällig am 07.04.2026	18.095	17.595	0,72	SK Hynix, Inc.			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				7,875 % fällig am 05.06.2029	200	205	0,01	2,375 % fällig am 19.01.2031	2.300	1.867	0,08
Adaro Indonesia PT				8,650 % fällig am 19.01.2028	16.002	16.791	0,69	6,375 % fällig am 17.01.2028	4.900	5.060	0,21
4,250 % fällig am 31.10.2024	23.174	22.603	0,93	Summe Mongolei		45.516	1,87	Tongyang Life Insurance Co. Ltd.			
Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT								5,250 % fällig am 22.09.2025 (d)	7.300	6.716	0,27
3,750 % fällig am 30.03.2026 (f)	12.354	11.810	0,48	NIEDERLANDE							
4,300 % fällig am				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL							
24.03.2027 (d)(f)	15.300	13.595	0,56	Mong Duong Finance Holdings BV				STAATSEMISSIONEN			
Bukit Makmur Mandiri Utama PT				5,125 % fällig am 07.05.2029	26.063	24.271	1,00	Korea Land & Housing Corp.			
7,750 % fällig am 10.02.2026	14.656	13.972	0,57	Prosus NV				5,750 % fällig am 06.10.2025	8.300	8.399	0,35
Cikarang Listrindo Tbk PT				4,193 % fällig am 19.01.2032	8.500	7.339	0,30	Summe Südkorea		22.042	0,91
4,950 % fällig am 14.09.2026	443	426	0,02	4,987 % fällig am 19.01.2052	6.000	4.516	0,18				
LLPL Capital Pte. Ltd.				Summe Niederlande		36.126	1,48	SRI LANKA			
6,875 % fällig am 04.02.2039	7.483	7.222	0,30					STAATSEMISSIONEN			
Minejesa Capital BV				OMAN				Sri Lanka Government International Bond			
4,625 % fällig am 10.08.2030	4.700	4.471	0,18	STAATSEMISSIONEN				5,750 % fällig am 18.04.2023 ^	19.512	10.036	0,41
Pakuwon Jati Tbk PT				Oman Government International Bond				6,200 % fällig am 11.05.2027 ^	23.800	12.086	0,50
4,875 % fällig am 29.04.2028	8.300	7.736	0,32	7,000 % fällig am 25.01.2051	4.600	4.977	0,20	6,350 % fällig am 28.06.2024 ^	10.500	5.348	0,22
Pelabuhan Indonesia Persero PT				PAKISTAN				6,750 % fällig am 18.04.2028 ^	9.000	4.550	0,19
4,875 % fällig am 01.10.2024	7.200	7.151	0,29	STAATSEMISSIONEN				6,825 % fällig am 18.07.2026 ^	4.500	2.315	0,09
Saka Energi Indonesia PT				Pakistan Government International Bond				6,850 % fällig am 14.03.2024 ^	63.471	32.321	1,33
4,450 % fällig am 05.05.2024	2.621	2.601	0,11	6,000 % fällig am 08.04.2026	56.171	39.822	1,64	6,850 % fällig am 03.11.2025 ^	39.900	20.648	0,85
Summe Indonesien		91.587	3,76	6,875 % fällig am 05.12.2027	56.757	38.961	1,60	7,550 % fällig am 28.03.2030 ^	4.450	2.247	0,09
				7,375 % fällig am 08.04.2031	16.200	9.930	0,41	7,850 % fällig am 14.03.2029 ^	20.600	10.404	0,43
ITALIEN				8,250 % fällig am 15.04.2024	2.400	2.282	0,09	Summe Sri Lanka		99.955	4,11
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				8,250 % fällig am 30.09.2025	9.235	7.871	0,32				
Nexi SpA				Summe Pakistan		98.866	4,06	THAILAND			
2,125 % fällig am 30.04.2029	€ 6.900	6.748	0,28					UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
JERSEY, KANALINSELN				PHILIPPINEN				Bangkok Bank PCL			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				5,000 % fällig am			
West China Cement Ltd.				ACEN Finance Ltd.				23.09.2025 (d)(f)	23.300	22.329	0,92
4,950 % fällig am 08.07.2026	\$ 20.875	15.252	0,63	4,000 % fällig am 08.03.2025 (d)	7.200	4.633	0,19	Kasikornbank PCL			
REPUBLIK MALI				Globe Telecom, Inc.				3,343 % fällig am 02.10.2031 (f)	3.200	2.945	0,12
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				4,200 % fällig am 02.08.2026 (d)	17.700	16.758	0,69	5,275 % fällig am			
Seaspan Corp.				Petron Corp.				14.10.2025 (d)(f)	30.357	29.101	1,19
5,500 % fällig am 01.08.2029	8.500	7.118	0,29	5,950 % fällig am 19.04.2026 (d)	6.260	5.861	0,24	Muang Thai Life Assurance PCL			
MAURITIUS				Royal Capital BV				3,552 % fällig am 27.01.2037 (f)	5.826	5.365	0,22
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				4,875 % fällig am 05.05.2024 (d)	10.571	10.501	0,43	Summe Thailand		59.740	2,45
CA Magnum Holdings				5,000 % fällig am 05.02.2026 (d)	900	882	0,04				
5,375 % fällig am 31.10.2026	31.160	29.057	1,19	San Miguel Corp.				TÜRKEI			
Greenko Dutch BV				5,500 % fällig am 29.07.2025 (d)	11.850	11.021	0,45	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
3,850 % fällig am 29.03.2026	9.117	8.510	0,35	SMC Global Power Holdings Corp.				Mersin Uluslararası Liman İşletmeciliği A/S			
Greenko Solar Mauritius Ltd.				5,450 % fällig am 09.12.2026 (d)	7.875	6.306	0,26	8,250 % fällig am 15.11.2028	6.100	6.377	0,26
5,550 % fällig am 29.01.2025	9.339	9.160	0,38	5,700 % fällig am 21.01.2026 (d)	3.754	3.089	0,13	GROSSBRITANNIEN			
5,950 % fällig am 29.07.2026	3.900	3.781	0,15	5,950 % fällig am 05.05.2025 (d)	9.000	7.942	0,32	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
				7,000 % fällig am 21.10.2025 (d)	16.884	15.055	0,62	Diamond Ltd.			
				Summe Philippinen		88.173	3,62	7,950 % fällig am 28.07.2026	2.400	2.402	0,10

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

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Standard Chartered PLC				JUNGFERNINSELN (BRITISCH)				KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
4,750 % fällig am 14.01.2031 (d)(f)	\$ 8.300	\$ 6.774	0,28	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				KURZFRISTIGE SCHULDTITEL			
6,000 % fällig am 26.07.2025 (d)(f)(h)	30.000	29.507	1,21	Celestial Miles Ltd.				Yango Justice International Ltd.			
7,750 % fällig am 15.08.2027 (d)(f)(h)	58.600	59.988	2,46	5,750 % fällig am 31.01.2024 (d)	\$ 24.504	\$ 24.455	1,00	10,250 % fällig am 15.09.2022 ^	\$ 4.500	\$ 25	0,00
Vedanta Resources Finance PLC				Champion Path Holdings Ltd.				Summe kurzfristige Instrumente		25	0,00
8,950 % fällig am 11.03.2025	39.192	29.180	1,20	4,500 % fällig am 27.01.2026	17.700	16.525	0,68	Summe übertragbare Wertpapiere	\$ 2.167.937	89,05	
Summe Großbritannien		127.851	5,25	4,850 % fällig am 27.01.2028	7.100	6.104	0,25				
				Easy Tactic Ltd. (7,500 % bar oder 7,500 % PIK)				AKTIEN			
USA				7,500 % fällig am 11.07.2025 (a)	1.660	91	0,00	INVESTMENTFONDS			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				7,500 % fällig am 11.07.2027 (a)	53.941	2.647	0,11	ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
Cantor Fitzgerald LP				7,500 % fällig am 11.07.2028 (a)	44.139	1.931	0,08	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e)	19.787.095	197.171	8,10
7,200 % fällig am 12.12.2028	12.200	12.516	0,51	LS Finance Ltd.				PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (e)	744.048	10.117	0,41
Hyundai Capital America				4,800 % fällig am 18.06.2026	800	608	0,03			207.288	8,51
5,950 % fällig am 21.09.2026	13.100	13.329	0,55	NWD Finance BVI Ltd.				Summe Investmentfonds	\$ 212.144	8,71	
Summe USA		25.845	1,06	4,125 % fällig am 10.03.2028 (d)	23.655	12.892	0,53				
US-SCHATZ OblIGATIONEN				4,800 % fällig am 29.01.2024 (d)	6.100	2.662	0,11	BÖRSENGEHANDELTE FONDS			
U.S. Treasury Bonds				5,250 % fällig am 22.03.2026 (d)	25.500	16.912	0,69	PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (e)	48.700	4.856	0,20
1,875 % fällig am 15.11.2051	2.700	1.708	0,07	6,150 % fällig am 16.03.2025 (d)	42.800	34.899	1,43	Summe Investmentfonds	\$ 212.144	8,71	
U.S. Treasury Inflation Protected Securities (c)				NWD MTN Ltd.							
0,125 % fällig am 15.01.2032	50.613	44.480	1,83	4,125 % fällig am 18.07.2029	891	679	0,03				
Summe USA		72.033	2,96	Peak RE BVI Holding Ltd.							
VIETNAM				5,350 % fällig am 28.10.2025 (d)	8.670	7.287	0,30				
STAATSEMISSIONEN				RKPF Overseas Ltd.							
Vietnam Debt & Asset Trading Corp.				5,125 % fällig am 26.07.2026	16.550	3.907	0,16				
1,000 % fällig am 10.10.2025	1.300	1.144	0,05	5,200 % fällig am 12.01.2026	25.100	6.549	0,27				
Vietnam Government International Bond				Studio City Co. Ltd.							
5,500 % fällig am 12.03.2028	912	879	0,03	7,000 % fällig am 15.02.2027	9.630	9.483	0,39				
Summe Vietnam		2.023	0,08	Studio City Finance Ltd.							
				5,000 % fällig am 15.01.2029	11.600	9.761	0,40				
				6,000 % fällig am 15.07.2025	18.351	17.982	0,74				
				6,500 % fällig am 15.01.2028	5.267	4.892	0,20				
				Summe Jungferneinseln (Britisch)	180.266	7,40					

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 Netto- vermögens
SSB	2,600 %	29.12.2023	02.01.2024	\$ 3.856	U.S. Treasury Notes 0,250 % fällig am 31.07.2025	\$ (3.933)	\$ 3.856	\$ 3.857	0,16
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (3.933)	\$ 3.856	\$ 3.857	0,16

(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 5-Year Note March Futures	Long	03/2024	3.002	\$ 6.690	0,27
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03/2024	313	200	0,01
U.S. Treasury 10-Year Ultra March Futures	Long	03/2024	132	738	0,03
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Long	03/2024	578	5.086	0,21
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Long	03/2024	23	281	0,01
				\$ 12.995	0,53
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 12.995	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-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5,000 %	20.06.2026	€ 2.800	\$ 61	0,00
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5,000	20.06.2028	5.000	200	0,01
				\$ 261	0,01

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF⁽²⁾

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
iTraxx Asia Ex-Japan 40 5-Year Index	(1,000) %	20.12.2028	\$ 16.100	\$ (155)	(0,01)

ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,750 %	16.06.2031	\$ 19.400	(550)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,250	15.12.2026	37.550	(366)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,250	15.06.2032	25.700	(57)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,500	15.12.2031	2.400	(15)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.12.2051	39.300	(2.054)	(0,08)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,450	20.12.2024	118.200	84	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,603	18.06.2029	90.100	(1.313)	(0,05)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	20.12.2025	31.200	311	0,01
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	20.03.2029	AUD 105.500	(1.918)	(0,08)
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	20.03.2034	105.500	3.509	0,14
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,250	20.03.2029	€ 15.500	(502)	(0,02)
					\$ (2.871)	(0,11)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ (2.765)	(0,11)

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

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

⁽³⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

⁽⁴⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Longfor Group Holdings Ltd.	1,000 %	20.06.2026	\$ 9.500	\$ (155)	\$ (2.670)	\$ (2.825)	(0,12)
BRC	BOC Aviation Ltd.	1,000	20.06.2026	24.300	(70)	318	248	0,01
CBK	Vietnam Government International Bond	1,000	20.12.2027	9.100	(263)	257	(6)	0,00
					\$ (488)	\$ (2.095)	\$ (2.583)	(0,11)

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

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

CROSS-CURRENCY SWAPS

Kontrahent	Erhalt	Zahlung	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag erhaltener Währung	Nennbetrag gelieferter Währung	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
JPM	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS zzgl. 0,053 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month PHP-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	20.03.2029	\$ 59.110	PHP 3.285.920	\$ (11)	\$ (597)	\$ (608)	(0,02)

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Asia High Yield Bond 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
GST	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500 %	20.03.2029	MYR 241.500	\$ 209	\$ (4)	\$ 205	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	01/2024	AUD	5.079	\$ 3.363	\$ 0	\$ (103)	(0,01)	
BOA	01/2024		770	510	0	(16)	0,00	
	01/2024	NZD	320	195	0	(8)	0,00	
	01/2024	\$	5.016	¥ 740.234	238	0	0,01	
	02/2024	CNY	21.609	\$ 3.058	2	2	0,00	
	03/2024	CNH	31.638	4.370	0	(98)	(0,01)	
	03/2024	MYR	114.015	24.139	0	(860)	(0,04)	
	03/2024	\$	81	PHP 4.534	1	0	0,00	
BPS	01/2024		1.137	AUD 1.729	43	0	0,00	
	01/2024		7.400	€ 6.821	137	0	0,01	
	02/2024	CNY	38.537	\$ 5.429	0	(20)	0,00	
	02/2024	TWD	50.024	1.574	0	(79)	0,00	
	03/2024		151.709	4.815	0	(211)	(0,01)	
	03/2024	\$	1.065	IDR 16.418.819	0	(1)	0,00	
DUB	03/2024	CNH	18.357	\$ 2.548	0	(45)	0,00	
	03/2024	SGD	17.848	13.483	0	(95)	0,00	
GLM	01/2024	\$	3.323	¥ 488.578	145	0	0,01	
	02/2024		12.293	TRY 376.655	0	(123)	(0,01)	
	03/2024	CNH	8.603	\$ 1.192	0	(23)	0,00	
	03/2024	\$	7.179	IDR 110.546.701	0	(11)	0,00	
IND	03/2024		13.043	CNH 93.636	183	0	0,01	
JPM	02/2024		12.993	INR 1.085.458	21	0	0,00	
	03/2024	SGD	118	\$ 89	0	(1)	0,00	
	03/2024	TWD	102.530	3.298	0	(100)	0,00	
	03/2024	\$	8.791	IDR 135.730.054	10	0	0,00	
MBC	01/2024	AUD	2.382	\$ 1.580	0	(46)	0,00	
	01/2024	\$	12.077	¥ 1.747.600	327	0	0,01	
	03/2024	HKD	1.121	\$ 144	0	0	0,00	
	03/2024	PHP	776.602	13.878	0	(141)	(0,01)	
	03/2024	\$	10.724	IDR 165.321.472	0	(4)	0,00	
MYI	01/2024	€	30.708	\$ 33.753	0	(177)	(0,01)	
	01/2024	£	1	2	0	0	0,00	
	01/2024	SGD	436	330	0	0	0,00	
	01/2024	\$	28	€ 26	0	0	0,00	
	01/2024		158	£ 124	0	0	0,00	
	01/2024		2.923	¥ 430.773	135	0	0,01	
	02/2024	CNY	22.564	\$ 3.187	0	(3)	0,00	
	03/2024	CNH	18.849	2.614	0	(49)	0,00	
	03/2024	IDR	300.139.176	19.500	37	0	0,00	
	03/2024	\$	4.757	IDR 73.163.236	0	(12)	0,00	
SCX	01/2024		11.228	MYR 52.446	217	0	0,01	
	02/2024		1.158	CNY 8.287	13	0	0,00	
	03/2024	CNH	18.505	\$ 2.556	0	(58)	0,00	
	03/2024	HKD	23.876	3.063	0	0	0,00	
	03/2024	TWD	82.359	2.609	0	(120)	(0,01)	
	03/2024	\$	938	IDR 14.368.533	0	(6)	0,00	
	03/2024		61	THB 2.110	1	0	0,00	
UAG	01/2024	AUD	1.926	\$ 1.278	0	(37)	0,00	
					\$ 1.510	\$ (2.447)	\$ (937)	(0,04)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 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	01/2024	\$ 1.293	AUD 1.950	\$ 38	\$ 0	\$ 38	0,00
BOA	01/2024	77	116	2	0	2	0,00
BPS	01/2024	AUD 22	\$ 15	0	0	0	0,00
	01/2024	\$ 2	AUD 4	0	0	0	0,00
MBC	01/2024	499	753	15	0	15	0,00
UAG	01/2024	623	939	18	0	18	0,00
				\$ 73	\$ 0	\$ 73	0,00

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilklassen 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	01/2024	CHF 31	\$ 36	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BRC	01/2024	\$ 218	CHF 190	8	0	8	0,00
CBK	01/2024	CHF 95	\$ 109	0	(4)	(4)	0,00
	01/2024	\$ 42	CHF 37	1	0	1	0,00
GLM	01/2024	CHF 4	\$ 5	0	0	0	0,00
	01/2024	\$ 2.002	CHF 1.754	84	0	84	0,01
MYI	01/2024	2.011	1.755	76	0	76	0,00
SCX	01/2024	9	8	0	0	0	0,00
UAG	01/2024	1.767	1.542	66	0	66	0,00
				\$ 235	\$ (4)	\$ 231	0,01

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilklassen 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
BPS	01/2024	€ 582	\$ 633	\$ 0	\$ (10)	\$ (10)	0,00
	01/2024	\$ 18.686	€ 17.080	186	0	186	0,01
BRC	01/2024	134.747	122.522	628	0	628	0,03
CBK	01/2024	€ 260	\$ 286	0	(1)	(1)	0,00
	01/2024	\$ 225	€ 208	6	0	6	0,00
DUB	01/2024	€ 20.428	\$ 22.335	0	(235)	(235)	(0,01)
MBC	01/2024	20.175	22.059	0	(232)	(232)	(0,01)
	01/2024	\$ 53	€ 48	0	0	0	0,00
MYI	01/2024	€ 101	\$ 109	0	(2)	(2)	0,00
	01/2024	\$ 134.666	€ 122.522	709	(1)	708	0,03
UAG	01/2024	134.769	122.522	605	0	605	0,02
				\$ 2.134	\$ (481)	\$ 1.653	0,07

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01/2024	£ 4	\$ 5	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01/2024	\$ 718	£ 565	3	0	3	0,00
BRC	01/2024	12.490	9.868	91	0	91	0,00
CBK	01/2024	£ 394	\$ 499	0	(4)	(4)	0,00
GLM	01/2024	\$ 3	£ 3	0	0	0	0,00
MBC	01/2024	£ 130	\$ 165	0	0	0	0,00
	01/2024	\$ 32	£ 26	0	0	0	0,00
MYI	01/2024	£ 13	\$ 16	0	0	0	0,00
	01/2024	\$ 8	£ 7	0	0	0	0,00
SSB	01/2024	£ 16	\$ 20	0	0	0	0,00
	01/2024	\$ 12.838	£ 10.174	132	0	132	0,01
UAG	01/2024	£ 1	\$ 1	0	0	0	0,00
	01/2024	\$ 12.866	£ 10.166	94	0	94	0,00
				\$ 320	\$ (4)	\$ 316	0,01

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilklasse Investor 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
BPS	01/2024	\$ 148	CNH 1.053	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BRC	01/2024	CNH 2	\$ 0	0	0	0	0,00
CBK	01/2024	\$ 72	CNH 517	0	0	0	0,00
MBC	01/2024	11	78	0	0	0	0,00
SCX	01/2024	CNH 2	\$ 0	0	0	0	0,00
	01/2024	\$ 2	CNH 16	0	0	0	0,00
				\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00

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

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilklassen Institutional SGD (Hedged) ausschüttend, Investor SGD (Hedged) ausschüttend, Class E SGD (Hedged) ausschüttend und M Retail 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
BOA	01/2024	\$	6.420	SGD	8.565	\$ 75	0,01
DUB	01/2024		6.665		8.859	0	0,00
GLM	01/2024	SGD	19	\$	14	0	0,00
	01/2024	\$	1.232	SGD	1.644	0	0,00
MBC	01/2024	SGD	191	\$	143	(2)	0,00
	01/2024	\$	416	SGD	556	0	0,00
	02/2024		426		561	0	0,00
MYI	01/2024		6.217		8.292	0	0,00
	02/2024	SGD	84	\$	64	0	0,00
UAG	01/2024	\$	49	SGD	65	0	0,00
						\$ 218	0,01
						\$ (2)	
						\$ 220	
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ (1.432)	(0,06)
Summe Anlagen						\$ 2.392.735	98,28
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ 41.993	1,72
Nettovermögen						\$ 2.434.728	100,00

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(b) Nullkuponwertpapier.

(c) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

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

(e) Mit dem Fonds verbunden.

(f) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(g) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 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	\$ 998	0,04

(h) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 13.246 (31. Dezember 2022: USD null) wurden zum 31. Dezember 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 630 (31. Dezember 2022: USD null) wurden zum 31. Dezember 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von USD 24.631 (31. Dezember 2022: USD 21.668) wurden zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 5.280 (31. Dezember 2022: USD 12.646) wurden zum 31. Dezember 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert¹

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 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	\$ 2.166.143	\$ 1.794	\$ 2.167.937
Investmentfonds	207.288	4.856	0	212.144
Pensionsgeschäfte	0	3.856	0	3.856
Finanzderivate ⁽³⁾	0	8.798	0	8.798
Summen	\$ 207.288	\$ 2.183.653	\$ 1.794	\$ 2.392.735

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

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

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

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

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften	% des Nettovermögens
BPS	4,700 %	28.09.2023	TBD ⁽¹⁾	\$ (3.947)	\$ (3.996)	(0,16)
	4,750	28.09.2023	TBD ⁽¹⁾	(8.844)	(8.955)	(0,37)
Summe umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (12.951)	(0,53)

(1) Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement ⁽¹⁾
AZD	\$ (65)	\$ 0	\$ (65)	\$ 1.734	\$ (1.360)	\$ 374
BOA	(661)	350	(311)	(199)	350	151
BPS	(2.780)	2.630	(150)	(8.680)	9.734	1.054
BRC	975	(1.700)	(725)	(872)	1.172	300
CBK	(8)	0	(8)	4.080	(4.046)	34
DUB	(322)	440	118	1.048	(1.010)	38
GLM	87	0	87	96	0	96
GST	205	0	205	(732)	660	(72)
IND	183	0	183	k. A.	k. A.	k. A.
JPM	(678)	850	172	(538)	730	192
MBC	(78)	260	182	4.627	(4.030)	597
MYI	785	(1.300)	(515)	479	(240)	239
SCX	47	10	57	4.720	(4.520)	200
SSB	132	(220)	(88)	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	746	740	1.486	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. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	75,37	70,88
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	13,68	18,07
Investmentfonds	8,71	8,05
Pensionsgeschäfte	0,16	0,69
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,53	(0,01)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,11)	0,47
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,06)	0,45
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,53)	k. A.

* Gemäß der Liste der Märkte, die in Anhang 1 zum Prospekt aufgeführt sind und die Kriterien für gemäß OGAW-Vorschriften geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Australien	0,81	1,12
Brasilien	0,30	0,13
Cayman-Inseln	18,21	26,52
China	1,95	1,91
Kolumbien	0,27	k. A.
Frankreich	0,75	0,59
Deutschland	k. A.	0,38
Hongkong	8,29	6,10
Indien	8,17	6,45
Indonesien	3,76	3,84
Israel	k. A.	0,09
Italien	0,28	k. A.
Japan	k. A.	0,24
Jersey, Kanalinseln	0,63	0,84
Luxemburg	k. A.	0,13
Republik Mali	0,29	k. A.
Mauritius	6,77	7,22
Mexiko	0,30	0,37
Mongolei	1,87	1,30
Niederlande	1,48	1,80
Oman	0,20	0,16

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Pakistan	4,06	2,18
Philippinen	3,62	3,53
Singapur	3,36	3,90
Südafrika	0,26	k. A.
Südkorea	0,91	0,20
Sri Lanka	4,11	1,91
Thailand	2,45	2,75
Türkei	0,26	k. A.
Großbritannien	5,25	3,67
USA	2,96	1,57
Vietnam	0,08	0,21
Jungfernseln (Britisch)	7,40	9,83
Kurzfristige Instrumente	0,00	0,01
Investmentfonds	8,71	8,05
Pensionsgeschäfte	0,16	0,69
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,53	(0,01)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,01	(0,01)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,01)	k. A.
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	k. A.	0,03
Zinsswaps	(0,11)	0,45
Freiverkehrsfinanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzkauf	k. A.	(0,09)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	(0,11)	(0,07)
Cross-Currency Swaps	(0,02)	k. A.
Zinsswaps	0,01	k. A.
Devisenterminkontrakte	(0,04)	0,06
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,10	0,55
Sonstige Aktiva und Passiva	1,72	1,40
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				Health & Happiness International Holdings Ltd.				FRANKREICH			
AUSTRALIEN				13,500 % fällig am 26.06.2026				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Kaisa Group Holdings Ltd.				BNP Paribas S.A.			
Emeco Pty. Ltd.	900	\$ 580	0,33	9,375 % fällig am 30.06.2024 ^	800	\$ 29	0,02	9,250 % fällig am 17.11.2027 (c)(e)	\$ 500	\$ 536	0,30
6,250 % fällig am 10.07.2026 AUD				11,250 % fällig am 09.04.2022 ^	500	18	0,01	Credit Agricole S.A.			
Mineral Resources Ltd.	\$ 150	154	0,09	11,950 % fällig am 22.10.2022 ^	300	11	0,01	7,250 % fällig am 23.09.2028 (c)(e)	€ 600	703	0,40
8,000 % fällig am 01.11.2027				11,950 % fällig am 12.11.2023 ^	1.200	44	0,03	Summe Frankreich		1.239	0,70
Northern Star Resources Ltd.	1.100	1.106	0,62	Longfor Group Holdings Ltd.	400	184	0,10	HONGKONG			
6,125 % fällig am 11.04.2033				3,950 % fällig am 16.09.2029				WANDELANLEIHEN & WECHSEL			
Pacific National Finance Pty. Ltd.	600	563	0,32	Melco Resorts Finance Ltd.	900	874	0,49	Universe Trek Ltd.			
4,750 % fällig am 22.03.2028				4,875 % fällig am 06.06.2025	1.700	1.640	0,93	0,000 % fällig am 15.06.2026 (b)			
Santos Finance Ltd.	400	392	0,22	5,250 % fällig am 26.04.2026	500	464	0,26	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
5,250 % fällig am 13.03.2029				5,750 % fällig am 21.07.2028				Bank of East Asia Ltd.			
WestConnex Finance Co. Pty. Ltd.	1.500	1.068	0,60	MGM China Holdings Ltd.	1.000	952	0,54	6,750 % fällig am 15.03.2027			
6,150 % fällig am 09.10.2030 AUD				4,750 % fällig am 01.02.2027	200	197	0,11	China Cinda Management Ltd.			
Woodside Finance Ltd.	\$ 1.000	962	0,54	5,250 % fällig am 18.06.2025	1.400	1.389	0,78	5,750 % fällig am 07.02.2027			
3,700 % fällig am 15.09.2026				Sands China Ltd.	1.500	1.365	0,77	Dah Sing Bank Ltd.			
Summe Australien		4.825	2,72	2,550 % fällig am 08.03.2027 (g)	1.400	1.389	0,78	7,375 % fällig am 15.11.2033 (e)			
				5,650 % fällig am 08.08.2028				15,11.2033 (e)			
BRASILIEN				Seazen Group Ltd.				Fortune Star BVI Ltd.			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				4,450 % fällig am 13.07.2025				3,950 % fällig am 02.10.2026			
CSN Resources S.A.	200	164	0,09	Shui On Development Holding Ltd.	400	191	0,11	5,050 % fällig am 27.01.2027			
4,625 % fällig am 10.06.2031				5,500 % fällig am 29.06.2026				€ 800			
8,875 % fällig am 05.12.2030	400	417	0,24	Sunac China Holdings Ltd.	140	15	0,01	\$ 700			
Summe Brasilien		581	0,33	6,000 % fällig am 30.09.2026	140	11	0,01	900			
				6,250 % fällig am 30.09.2027	279	22	0,01	750			
CAYMAN-INSELN				Times China Holdings Ltd.				Franshion Brilliant Ltd.			
WANDELANLEIHEN & WECHSEL				7,000 % fällig am 30.09.2029				4,250 % fällig am 23.07.2029			
Cathay Pacific Finance Ltd.	2.000	269	0,15	7,250 % fällig am 30.09.2030	197	8	0,00	200			
2,750 % fällig am 05.02.2026 HKD				Tencent Holdings Ltd.	700	467	0,26	200			
Hansoh Pharmaceutical Group Co. Ltd.	\$ 600	597	0,34	3,240 % fällig am 03.06.2050	1.700	1.619	0,91	GLP China Holdings Ltd.			
0,000 % fällig am 22.01.2026 (b)				3,975 % fällig am 11.04.2029	1.400	36	0,02	2,950 % fällig am 29.03.2026			
Meituan	1.400	1.281	0,72	5,550 % fällig am 04.06.2024 ^				4,974 % fällig am 26.02.2024			
0,000 % fällig am 27.04.2027 (b)				Wynn Macau Ltd.	1.500	1.466	0,83	Huarong Finance Co. Ltd.			
0,000 % fällig am 27.04.2028 (b)	500	432	0,25	5,500 % fällig am 15.01.2026	400	378	0,21	4,250 % fällig am 07.11.2027			
Sunac China Holdings Ltd.	241	19	0,01	5,500 % fällig am 01.10.2027	300	278	0,16	4,625 % fällig am 03.06.2026			
1,000 % fällig am 30.09.2032				5,625 % fällig am 26.08.2028				4,875 % fällig am 22.11.2026			
Wynn Macau Ltd.	1.000	1.024	0,58	Summe Cayman-Inseln		20.979	11,84	5,000 % fällig am 19.11.2025			
4,500 % fällig am 07.03.2029						25.404	14,34	6,914 % fällig am 24.02.2025			
Xiaomi Best Time International Ltd.	900	803	0,45	AKTIEN				Lenovo Group Ltd.			
0,000 % fällig am 17.12.2027 (b)				CHINA				5,831 % fällig am 27.01.2028			
		4.425	2,50	STAMMAKTIEN				6,536 % fällig am 27.07.2032			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Sunac Services Holdings Ltd.				Yanlord Land HK Co. Ltd.			
AAC Technologies Holdings, Inc.	800	770	0,44	1.126.686	270	0,15	5,125 % fällig am 20.05.2026				
3,000 % fällig am 27.11.2024	400	304	0,17	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				200			
3,750 % fällig am 02.06.2031				China Life Insurance Overseas Co. Ltd.				116			
Agile Group Holdings Ltd.	700	94	0,05	5,350 % fällig am 15.08.2033				11,056			
5,500 % fällig am 17.05.2026	1.500	187	0,11	Flourish Century				6,24			
6,050 % fällig am 13.10.2025				6,600 % fällig am 04.02.2022 ^ (f)				7,76			
7,875 % fällig am 31.07.2024 (c)	523	20	0,01	Greenland Global Investment Ltd. (6,875 % bar oder 1,000 % PIK)				7,76			
Alibaba Group Holding Ltd.	800	663	0,37	Greenland Global Investment Ltd. (8,250 % bar oder 1,000 % PIK)				7,76			
2,125 % fällig am 09.02.2031	800	548	0,31	8,250 % fällig am 22.01.2031 (a)				7,76			
2,700 % fällig am 09.02.2041				Huaxin Cement International Finance Co. Ltd.				7,76			
China Hongqiao Group Ltd.	600	596	0,34	2,250 % fällig am 19.11.2025				7,76			
6,250 % fällig am 08.06.2024				Midea Investment Development Co. Ltd.				7,76			
China Modern Dairy Holdings Ltd.	1.400	1.243	0,70	2,880 % fällig am 24.02.2027				7,76			
2,125 % fällig am 14.07.2026				New Metro Global Ltd.				7,76			
CIFI Holdings Group Co. Ltd.	100	7	0,00	4,625 % fällig am 15.10.2025				7,76			
4,450 % fällig am 17.08.2026 ^	700	50	0,03	4,800 % fällig am 15.12.2024				7,76			
4,800 % fällig am 17.05.2028 ^	200	14	0,01	SF Holding Investment Ltd.				7,76			
5,950 % fällig am 20.10.2025 ^	200	14	0,01	2,375 % fällig am 17.11.2026				7,76			
6,000 % fällig am 16.07.2025 ^	200	14	0,01	Yango Group Co. Ltd.				7,76			
CK Hutchison International Ltd.	1.500	1.503	0,85	6,900 % fällig am 31.10.2022 ^ CNY				7,76			
4,750 % fällig am 21.04.2028	400	401	0,23	Yango Justice International Ltd.				7,76			
4,875 % fällig am 21.04.2033				7,875 % fällig am 04.09.2024 ^				7,76			
Country Garden Holdings Co. Ltd.	1.500	118	0,07	Yunda Holding Investment Ltd.				7,76			
3,875 % fällig am 22.10.2030 ^	1.500	126	0,07	2,250 % fällig am 19.08.2025				7,76			
4,800 % fällig am 06.08.2030 ^	300	25	0,01	ZhongAn Online P&C Insurance Co. Ltd.				7,76			
5,625 % fällig am 14.01.2030 ^				3,125 % fällig am 16.07.2025				7,76			
FWD Group Holdings Ltd.	650	575	0,32	Summe China				6,859			
6,375 % fällig am 13.09.2024 (c)								3,87			
Geely Automobile Holdings Ltd.	1.300	1.264	0,71								
4,000 % fällig am 09.12.2024 (c)											

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

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
RELIANCE INDUSTRIES LTD.				JERSEY, KANALINSELN				PHILIPPINEN			
2,875 % fällig am 12.01.2032	\$ 400	\$ 343	0,19	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
RENEW POWER PVT LTD.				West China Cement Ltd.	\$ 1.100	\$ 804	0,45	San Miguel Corp.	\$ 500	\$ 465	0,26
5,875 % fällig am 05.03.2027	600	574	0,32					SMC Global Power Holdings Corp.	200	179	0,10
SHIRAM FINANCE LTD.				LUXEMBURG				7,000 % fällig am 21.10.2025 (c)		644	0,36
4,150 % fällig am 18.07.2025	958	918	0,52	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				STAATSEMISSIONEN			
4,400 % fällig am 13.03.2024	1.080	1.073	0,61	Guara Norte SARRL	514	469	0,26	Philippines Government International Bond			
ULTRATECH CEMENT LTD.								3,200 % fällig am 06.07.2046	900	700	0,40
2,800 % fällig am 16.02.2031	1.400	1.186	0,67	MALAYSIA				5,000 % fällig am 17.07.2033	400	411	0,23
Summe Indien		12.825	7,24	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				5,000 % fällig am 13.01.2037	200	206	0,12
				Khazanah Capital Ltd.	300	302	0,17	5,609 % fällig am 13.04.2033	600	642	0,36
INDONESIEN				Khazanah Global Sukuk Bhd.	700	703	0,40	Summe Philippines		2.603	1,47
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Misc Capital Two Labuan Ltd.	2.600	2.543	1,44	SINGAPUR			
Bank Mandiri Persero Tbk PT				Petronas Capital Ltd.				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
5,500 % fällig am 04.04.2026	800	803	0,45	2,480 % fällig am 28.01.2032	400	342	0,19	BOC Aviation Ltd.			
Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT				3,404 % fällig am 28.04.2061	550	396	0,22	3,500 % fällig am 10.10.2024	1.000	986	0,56
3,750 % fällig am 30.03.2026 (e)	1.020	975	0,55			4.286	2,42	Clean Renewable Power Mauritius Pte. Ltd.			
4,300 % fällig am				STAATSEMISSIONEN				4,250 % fällig am 25.03.2027	450	412	0,23
24.03.2027 (c)(e)	1.250	1.111	0,63	Export-Import Bank of Malaysia Bhd.	700	640	0,36	GLP Pte. Ltd.			
BUKIT MAKMUR MANDIRI UTAMA PT				1,831 % fällig am 26.11.2026				3,875 % fällig am 04.06.2025	500	332	0,19
7,750 % fällig am 10.02.2026	700	667	0,38	Summe Malaysia		4.926	2,78	Indika Energy Capital Pte. Ltd.			
CIKARANG LISTRINDO TBK PT				MAURITIUS				8,250 % fällig am 22.10.2025	350	352	0,20
4,950 % fällig am 14.09.2026	200	192	0,11	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Medco Bell Pte. Ltd.			
FREEPOR INDONESIA PT				CA Magnum Holdings	1.600	1.492	0,84	6,375 % fällig am 30.01.2027	478	455	0,26
4,763 % fällig am 14.04.2027	700	691	0,39	Greenko Dutch BV	1.665	1.554	0,88	Medco Maple Tree Pte Ltd.			
5,315 % fällig am 14.04.2032	800	787	0,44	3,850 % fällig am 29.03.2026			8,960 % fällig am 27.04.2029	400	407	0,23	
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT				India Cleantech Energy	1.238	1.129	0,64	Medco Oak Tree Pte. Ltd.			
3,541 % fällig am 27.04.2032	500	433	0,24	4,700 % fällig am 10.08.2026			7,375 % fällig am 14.05.2026	768	763	0,43	
INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM PT				India Green Energy Holdings	1.800	1.782	1,00	Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd.			
5,800 % fällig am 15.05.2050	800	778	0,44	5,375 % fällig am 29.04.2024			4,602 % fällig am 15.06.2032 (e)	1.800	1.779	1,00	
LLPL CAPITAL PTE. LTD.				India Toll Roads	1.300	1.279	0,72	United Overseas Bank Ltd.			
6,875 % fällig am 04.02.2039	644	621	0,35	5,500 % fällig am 19.08.2024			1,750 % fällig am 16.03.2031 (e)	500	462	0,26	
MINEJESA CAPITAL BV				Summe Mauritius		7.236	4,08	Summe Singapur		5.948	3,36
4,625 % fällig am 10.08.2030	200	190	0,11	MEXIKO				SÜDKOREA			
PAKUWON JATI TBK PT				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
4,875 % fällig am 29.04.2028	200	186	0,11	Banco Mercantil del Norte S.A.				GS Caltex Corp.			
PERTAMINA PERSERO PT				5,875 % fällig am	550	506	0,28	Hana Bank			
4,175 % fällig am 21.01.2050	1.200	1.004	0,57	24.01.2027 (c)(e)				3,250 % fällig am 30.03.2027	1.000	956	0,54
6,450 % fällig am 30.05.2044	200	220	0,12	6,750 % fällig am	300	297	0,17	KB Capital Co. Ltd.			
PERUSAHAAN PERSEROAN PERSERO PT PERUSAHAAN				27.09.2024 (c)(e)				1,500 % fällig am 28.10.2025	500	463	0,26
LISTRIK NEGARA				Summe Mexiko		803	0,45	Kodit Global Co. Ltd.			
6,150 % fällig am 21.05.2048	400	411	0,23	MONGOLEI				4,954 % fällig am 25.05.2026	1.000	998	0,56
SAKA ENERGI INDONESIA PT				STAATSEMISSIONEN				Kookmin Bank			
4,450 % fällig am 05.05.2024	233	231	0,13	Mongolia Government International Bond	1.000	841	0,47	2,500 % fällig am 04.11.2030 (e)	900	750	0,42
		9.300	5,25	4,450 % fällig am 07.07.2031	330	346	0,20	POSCO			
STAATSEMISSIONEN				8,650 % fällig am 19.01.2028				5,750 % fällig am 17.01.2028	2.400	2.464	1,39
Indonesia Government International Bond				Summe Mongolei		1.187	0,67	Shinhan Bank Co. Ltd.			
5,250 % fällig am 17.01.2042	900	940	0,53	NIEDERLANDE				4,000 % fällig am 23.04.2029 (e)	200	187	0,11
5,450 % fällig am 20.09.2052	600	644	0,36	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Shinhan Card Co. Ltd.			
		1.584	0,89	Mong Duong Finance Holdings BV	1.383	1.288	0,73	2,500 % fällig am 27.01.2027	2.200	2.031	1,15
Summe Indonesien		10.884	6,14	5,125 % fällig am 07.05.2029				SK Hynix, Inc.			
IRLAND				Prosus NV	500	432	0,24	1,500 % fällig am 19.01.2026	200	184	0,10
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				4,193 % fällig am 19.01.2032				2,375 % fällig am 19.01.2031	1.720	1.396	0,79
AerCap Ireland Capital DAC				Summe Niederlande		1.720	0,97	Tongyang Life Insurance Co. Ltd.			
6,100 % fällig am 15.01.2027	150	153	0,09	PAKISTAN				5,250 % fällig am 22.09.2025 (c)	1.100	1.012	0,57
SMBC AVIATION CAPITAL FINANCE DAC				STAATSEMISSIONEN				Summe Indonesien		11.553	6,52
5,450 % fällig am 03.05.2028	2.100	2.114	1,19	Pakistan Government International Bond	2.950	2.091	1,18	STAATSEMISSIONEN			
Summe Irland		2.267	1,28	6,000 % fällig am 08.04.2026	2.000	2.020	1,14	Korea Electric Power Corp.			
ITALIEN				6,875 % fällig am 05.12.2027	1.400	961	0,54	5,375 % fällig am 06.04.2026	2.000	2.020	1,14
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				8,250 % fällig am 30.09.2025	200	171	0,10	Korea Land & Housing Corp.			
Nexi SpA				Summe Pakistan		3.223	1,82	5,750 % fällig am 06.10.2025	1.000	1.012	0,57
2,125 % fällig am 30.04.2029	€ 500	489	0,28	MONGOLEI				Korea Mine Rehabilitation & Mineral Resources Corp.			
JAPAN				STAATSEMISSIONEN				5,375 % fällig am 11.05.2028	1.450	1.466	0,83
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Pakistan Government International Bond	2.950	2.091	1,18	Korea National Oil Corp.			
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.				6,000 % fällig am 08.04.2026	2.950	2.091	1,18	4,875 % fällig am 03.04.2028	600	604	0,34
5,063 % fällig am 12.09.2025	\$ 1.700	1.694	0,96	6,875 % fällig am 05.12.2027	1.400	961	0,54				
SUMITOMO MITSUI TRUST BANK LTD.				8,250 % fällig am 30.09.2025	200	171	0,10				
4,800 % fällig am 15.09.2025	1.900	1.888	1,06	Summe Pakistan		3.223	1,82				
Summe Japan		3.582	2,02								

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
5,250 % fällig am 14.11.2026 \$	2.200	\$ 2.221	1,25	Standard Chartered PLC				JUNGFERNINSELN (BRITISCH)			
		7.323	4,13	0,991 % fällig am 12.01.2025 \$	800	\$ 799	0,45	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
				1,822 % fällig am 23.11.2025	1.400	1.349	0,76	Celestial Miles Ltd.			
Summe Südkorea		18.876	10,65	3,603 % fällig am 12.01.2033 (f)	500	415	0,23	5,750 % fällig am 31.01.2024 (c)	\$ 700	\$ 699	0,40
				6,000 % fällig am 26.07.2025 (c)(e)	1.000	983	0,56	Champion Path Holdings Ltd.			
SRI LANKA				6,170 % fällig am 09.01.2027	1.500	1.524	0,86	4,500 % fällig am 27.01.2026	600	560	0,32
STAATSEMISSIONEN				6,187 % fällig am 06.07.2027	500	508	0,29	Easy Tactic Ltd. (7,500 % bar oder 7,500 % PIK)			
Sri Lanka Government International Bond				7,750 % fällig am 15.08.2027 (c)(e)	800	819	0,46	7,500 % fällig am 11.07.2027 (a)	726	36	0,02
5,750 % fällig am 18.04.2023 ^	500	257	0,14	Vedanta Resources Finance PLC				7,500 % fällig am 11.07.2028 (a)	1.828	80	0,05
6,200 % fällig am 11.05.2027 ^	1.100	559	0,32	8,950 % fällig am 11.03.2025	650	484	0,27	NWD Finance BVI Ltd.			
6,350 % fällig am 28.06.2024 ^	500	255	0,14	Summe Großbritannien		7.734	4,36	4,125 % fällig am 10.03.2028 (c)	850	463	0,26
6,825 % fällig am 18.07.2026 ^	500	257	0,14	USA				4,800 % fällig am 29.01.2024 (c)	400	174	0,10
6,850 % fällig am 14.03.2024 ^	800	407	0,23	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				5,250 % fällig am 22.03.2026 (c)	1.000	663	0,37
7,850 % fällig am 14.03.2029 ^	900	455	0,26	Cantor Fitzgerald LP				Peak RE BVI Holding Ltd.			
Summe Sri Lanka		2.190	1,23	7,200 % fällig am 12.12.2028	800	821	0,46	5,350 % fällig am 28.10.2025 (c)	800	672	0,38
				Goldman Sachs Group, Inc.				RKPF Overseas Ltd.			
THAILAND				3,272 % fällig am 29.09.2025	100	98	0,06	5,125 % fällig am 26.07.2026	1.300	307	0,17
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Hanwha Q Cells Americas Holdings Corp.				Studio City Finance Ltd.			
Bangkok Bank PCL				5,000 % fällig am 27.07.2028	400	404	0,23	5,000 % fällig am 15.01.2029	1.100	926	0,52
4,300 % fällig am 15.06.2027	600	588	0,33	Hyundai Capital America				6,000 % fällig am 15.07.2025	400	392	0,22
5,300 % fällig am 21.09.2028	1.150	1.169	0,66	2,750 % fällig am 27.09.2026	500	467	0,26	Summe Jungfernseln (Britisch)		4.972	2,81
Kasikornbank PCL				5,950 % fällig am 21.09.2026	1.600	1.628	0,92	Summe übertragbare Wertpapiere	\$ 160.430	90,53	
5,275 % fällig am 14.10.2025 (c)(e)	1.100	1.055	0,59	Wells Fargo & Co.							
5,458 % fällig am 07.03.2028	1.400	1.428	0,81	2,406 % fällig am 30.10.2025	100	97	0,05				
Summe Thailand		4.240	2,39			3.515	1,98				
				US-SCHATZobligationen				AKTIEN			
TÜRKEI				U.S. Treasury Notes				INVESTMENTFONDS			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				3,250 % fällig am 31.08.2024	3.400	3.360	1,90	ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
Mersin Uluslararası Liman Isletmeciligi A/S				Summe USA		6.875	3,88	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (d)	1.057.553	10.538	5,95
8,250 % fällig am 15.11.2028	400	418	0,24					PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (d)	1.880	26	0,01
				VIETNAM						10.564	5,96
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE				STAATSEMISSIONEN				BÖRSENGEHANDELTE FONDS			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Vietnam Debt & Asset Trading Corp.				PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (d)	10.100	1.007	0,57
Masdar Abu Dhabi Future Energy Co.				1,000 % fällig am 10.10.2025	1.000	880	0,50	Summe Investmentfonds	\$ 11.571	6,53	
4,875 % fällig am 25.07.2033	800	794	0,45	Vietnam Government International Bond							
				5,500 % fällig am 12.03.2028	1.900	1.831	1,03				
GROSSBRITANNIEN				Summe Vietnam		2.711	1,53				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL											
HSBC Holdings PLC											
8,000 % fällig am 07.03.2028 (c)(e)	400	413	0,23								
Prudential Funding Asia PLC											
2,950 % fällig am 03.11.2033	500	440	0,25								

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft ⁽¹⁾	% des Netto- vermögens
SSB	2,600 %	29.12.2023	02.01.2024	\$ 252	U.S. Treasury Notes 0,250 % fällig am 31.10.2025	\$ (257)	\$ 252	\$ 252	0,14
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (257)	\$ 252	\$ 252	0,14

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl March Futures	Short	03/2024	6	\$ (6)	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Long	03/2024	19	18	0,01
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03/2024	75	130	0,07
U.S. Treasury 10-Year Ultra March Futures	Long	03/2024	19	47	0,03
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Long	03/2024	40	187	0,11
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Long	03/2024	23	116	0,06
				\$ 492	0,28
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 492	0,28

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

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

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

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Atlantia SpA	1,000 %	20.06.2025	€ 100	\$ 1	0,00
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5,000	20.06.2026	100	2	0,00
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5,000	20.06.2028	400	17	0,01
				\$ 20	0,01

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF⁽²⁾

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
iTraxx Asia Ex-Japan 40 5-Year Index	(1,000) %	20.12.2028	\$ 3.900	\$ (44)	(0,02)

ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,500 %	15.06.2024	\$ 4.200	\$ (84)	(0,05)
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,125	16.05.2024	CNY 50.000	1	0,00
Erhalt	6-Month AUD-BBR-BBSW	0,500	16.12.2025	AUD 800	(5)	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	20.03.2029	6.200	(148)	(0,08)
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	20.03.2034	6.200	258	0,14
					\$ 22	0,01
					\$ (2)	0,00

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

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

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

⁽³⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

⁽⁴⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Longfor Group Holdings Ltd.	1,000 %	20.06.2026	\$ 600	\$ (10)	\$ (168)	\$ (178)	(0,11)
BRC	BOC Aviation Ltd.	1,000	20.06.2026	1.300	(5)	18	13	0,01
GST	Indonesia Government International Bond	1,000	20.12.2028	5.700	0	77	77	0,04
	Philippines Government International Bond	1,000	20.12.2028	1.400	6	18	24	0,02
					\$ (9)	\$ (55)	\$ (64)	(0,04)

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

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

CROSS-CURRENCY SWAPS

Kontrahent	Erhalt	Zahlung	Fälligkeits- datum	Nennbetrag erhaltener Währung	Nennbetrag gelieferter Währung	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Netto- vermögens
JPM	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded- OIS zzgl. 0,053 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month PHP-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	20.03.2029	\$ 4.571	PHP 254.080	\$ (1)	\$ (46)	\$ (47)	(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 Netto- vermögens
GST	Erhalt ⁽¹⁾	3-Month MYR-KLIBOR	3,500 %	20.03.2029	MYR 22.260	\$ 20	\$ (1)	\$ 19	0,01

⁽¹⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	01/2024	AUD 1.142	\$ 756	\$ 0		\$ (23)	(0,01)
	03/2024	\$ 101	CNH 727	2	\$ (23)	\$ (23)	0,00
BOA	01/2024	AUD 606	\$ 401	0	(13)	(13)	(0,01)
	02/2024	CNY 1.874	265	0	0	0	0,00
	02/2024	\$ 117	CNY 837	2	0	2	0,00
	03/2024	CNH 769	\$ 106	0	(3)	(3)	0,00
	03/2024	MYR 8.636	1.828	0	(66)	(66)	(0,04)
	03/2024	\$ 128	INR 10.689	0	0	0	0,00
BPS	01/2024	4.619	€ 4.238	65	0	65	0,04
	01/2024	4	HKD 29	0	0	0	0,00
	01/2024	843	¥ 124.100	38	0	38	0,02
	02/2024	CNY 3.343	\$ 471	0	(2)	(2)	0,00
	02/2024	TWD 7.022	221	0	(11)	(11)	(0,01)
	03/2024	5.813	185	0	(8)	(8)	0,00
	03/2024	\$ 444	INR 37.129	1	0	1	0,00
BRC	03/2024	HKD 1.123	\$ 144	0	0	0	0,00
	03/2024	\$ 5	THB 166	0	0	0	0,00
	03/2024	697	TRY 21.833	0	(9)	(9)	0,00
	04/2024	125	4.034	0	(2)	(2)	0,00
CBK	02/2024	62	CNY 448	1	0	1	0,00
DUB	03/2024	SGD 1.337	\$ 1.010	0	(7)	(7)	0,00
GLM	03/2024	\$ 87	TRY 2.724	0	(1)	(1)	0,00
IND	03/2024	462	CNH 3.317	6	0	6	0,01
JPM	03/2024	CNH 1.263	\$ 175	0	(3)	(3)	0,00
	03/2024	SGD 218	164	0	(1)	(1)	0,00
	03/2024	TWD 13.843	445	0	(13)	(13)	(0,01)
	03/2024	\$ 522	IDR 8.056.132	1	0	1	0,00
	03/2024	133	INR 11.129	0	0	0	0,00
MBC	01/2024	AUD 535	\$ 355	0	(10)	(10)	(0,01)
	01/2024	€ 3.363	3.677	0	(40)	(40)	(0,02)
	01/2024	\$ 863	¥ 124.900	23	0	23	0,01
	03/2024	PHP 57.310	\$ 1.024	0	(10)	(10)	(0,01)
	03/2024	\$ 637	IDR 9.812.494	0	0	0	0,00
MYI	01/2024	€ 2.572	\$ 2.828	1	(14)	(13)	(0,01)
	01/2024	SGD 866	656	0	0	0	0,00
	01/2024	\$ 8	€ 7	0	0	0	0,00
	02/2024	CNY 1.957	\$ 276	0	0	0	0,00
	03/2024	CNH 810	112	0	(2)	(2)	0,00
SCX	01/2024	\$ 11	€ 10	0	0	0	0,00
	01/2024	893	MYR 4.169	17	0	17	0,01
	02/2024	522	CNY 3.736	6	0	6	0,00
	03/2024	CNH 796	\$ 110	0	(3)	(3)	0,00
	03/2024	\$ 290	INR 24.228	0	0	0	0,00
SOG	03/2024	HKD 107	\$ 14	0	0	0	0,00
SSB	03/2024	IDR 2.474.567	161	0	0	0	0,00
TOR	03/2024	CNH 488	68	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 163	\$ (242)	\$ (79)	(0,04)

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

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Investor EUR (Hedged) ausschüttend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
AZD	01/2024	\$ 1.836	€ 1.677	\$ 17	\$ 0	\$ 17	0,01
CBK	01/2024	€ 10	\$ 11	0	0	0	0,00
MBC	01/2024	12	13	0	0	0	0,00
	01/2024	\$ 5.234	€ 4.777	44	0	44	0,03
MYI	01/2024	2.938	2.673	15	0	15	0,01
SCX	01/2024	€ 52	\$ 57	0	0	0	0,00
	01/2024	\$ 5.471	€ 5.027	84	0	84	0,05
SSB	01/2024	175	158	0	(1)	(1)	0,00
UAG	01/2024	2.646	2.405	12	0	12	0,01
				\$ 172	\$ (1)	\$ 171	0,11

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilklasse Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
BOA	01/2024	\$ 8	£ 7	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
CBK	01/2024	£ 1	\$ 1	0	0	0	0,00
GLM	01/2024	14	18	0	0	0	0,00
MBC	01/2024	1	1	0	0	0	0,00
	01/2024	\$ 18	£ 14	0	0	0	0,00
SCX	01/2024	151	120	1	0	1	0,00
SSB	01/2024	127	100	2	0	2	0,00
UAG	01/2024	151	119	1	0	1	0,00
				\$ 4	\$ 0	\$ 4	0,00

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilklassen 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 Netto- vermögens
AZD	01/2024	\$ 3.646	SGD 4.863	\$ 41	\$ 0	\$ 41	0,02
BOA	01/2024	3.957	5.280	46	0	46	0,03
GLM	01/2024	986	1.317	12	0	12	0,01
MBC	01/2024	668	891	7	0	7	0,00
	02/2024	627	826	1	(1)	0	0,00
MYI	01/2024	3.630	4.842	42	0	42	0,02
	02/2024	28	37	0	0	0	0,00
UAG	01/2024	78	103	1	0	1	0,00
				\$ 150	\$ (1)	\$ 149	0,08

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 153 0,09

Summe Anlagen

\$ 172.896 97,57

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ 4.312 2,43

Nettovermögen

\$ 177.208 100,00

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(b) Nullkuponwertpapier.

(c) 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: 0,06 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits- datum	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Netto- vermögens
Flourish Century	6,600 %	4.02.2022	25.08.2021 - 27.08.2021	\$ 1.676	\$ 156	0,09
Standard Chartered PLC	3,603	12.01.2033	6.02.2023	435	415	0,23
				\$ 2.111	\$ 571	0,32

(g) Ein Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von USD 546 (31. Dezember 2022: USD null) wurde zum 31. Dezember 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 1.422 (31. Dezember 2022: USD 1.987) wurden zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 320 (31. Dezember 2022: USD 30) wurden zum 31. Dezember 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 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	\$ 159.876	\$ 554	\$ 160.430
Investmentfonds	10.564	1.007	0	11.571
Pensionsgeschäfte	0	252	0	252
Finanzderivate ⁽³⁾	(6)	649	0	643
Summen	\$ 10.558	\$ 161.784	\$ 554	\$ 172.896

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

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

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

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

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettvermögens
BPS	4,300 %	22.11.2023	TBD ⁽¹⁾	\$ (503)	\$ (505)	(0,28)
Summe umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (505)	(0,28)

⁽¹⁾ Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
AZD	\$ 37	\$ 0	\$ 37	k. A.	k. A.	k. A.
BOA	(34)	0	(34)	(103)	0	(103)
BPS	(95)	270	175	(80)	0	(80)
BRC	2	0	2	(20)	30	10
CBK	1	0	1	917	(820)	97
DUB	(7)	0	(7)	77	0	77
GLM	11	0	11	61	(250)	(189)
GST	120	0	120	k. A.	k. A.	k. A.
IND	6	0	6	k. A.	k. A.	k. A.
JPM	(63)	0	(63)	34	0	34
MBC	14	0	14	661	(670)	(9)
MYI	42	50	92	10	(129)	(119)
SCX	105	0	105	894	(680)	214
SSB	1	0	1	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	(1)	0	(1)	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	14	0	14	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. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	77,00	75,24
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	13,53	12,97
Investmentfonds	6,53	9,47
Pensionsgeschäfte	0,14	0,26
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,28	(0,05)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,00	0,11
Freiverkehrsfinanzderivate	0,09	0,78
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,28)	k. A.

* Gemäß der Liste der Märkte, die in Anhang 1 zum Prospekt aufgeführt sind und die Kriterien für gemäß OGAW-Vorschriften geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Australien	2,72	2,17
Brasilien	0,33	0,10
Cayman-Inseln	14,34	17,23
China	3,87	4,71
Frankreich	0,70	0,56
Deutschland	k. A.	0,68
Hongkong	7,76	5,57
Indien	7,24	7,64
Indonesien	6,14	9,42
Irland	1,28	k. A.
Israel	k. A.	0,15
Italien	0,28	k. A.
Japan	2,02	2,19
Jersey, Kanalinseln	0,45	0,38
Luxemburg	0,26	0,22
Malaysia	2,78	2,11
Mauritius	4,08	4,60
Mexiko	0,45	0,24
Mongolei	0,67	0,53
Niederlande	0,97	1,40
Pakistan	1,82	0,87
Philippinen	1,47	1,62
Singapur	3,36	3,04
Südkorea	10,65	7,62
Sri Lanka	1,23	0,70
Thailand	2,39	2,83
Türkei	0,24	k. A.
Vereinigte Arabische Emirate	0,45	k. A.
Großbritannien	4,36	1,74
USA	3,88	4,01
Vietnam	1,53	k. A.
Jungfernseln (Britisch)	2,81	5,88
Investmentfonds	6,53	9,47
Pensionsgeschäfte	0,14	0,26
Financial Derivative Instruments Dealt in on a Regulated Market		
Futures	0,28	(0,05)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,01	(0,02)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,02)	k. A.
Zinsswaps	0,01	0,13
Freiverkehrsfinanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzkauf	k. A.	(0,04)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	(0,04)	(0,04)
Cross-Currency Swaps	(0,03)	k. A.
Zinsswaps	0,01	k. A.
Devisenterminkontrakte	(0,04)	0,03
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,19	0,83
Sonstige Aktiva und Passiva	2,43	1,22
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Ameriprise Financial, Inc.	1.320	\$ 501	0,07	Singapore Exchange Ltd.	49.200	\$ 366	0,05	Fortune Brands Innovations, Inc. (d)	7.273	\$ 554	0,08
Amundi S.A.	3.510	240	0,04	Sompo Holdings, Inc. (d)	17.000	832	0,12	GEA Group AG	8.804	366	0,05
Arch Capital Group Ltd. (d)	7.866	584	0,09	Swiss Re AG	17.510	1.969	0,29	General Dynamics Corp. (d)	5.999	1.558	0,23
Assicurazioni Generali SpA	58.160	1.230	0,18	Türkiye İş Bankası A.S. 'C'	200.896	158	0,02	GS Holdings Corp.	2.683	85	0,01
AXA S.A.	90.822	2.968	0,44	Visa, Inc. 'A'	8.417	2.191	0,33	Hanwha Aerospace Co. Ltd. (d)	2.038	197	0,03
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.	342.321	3.122	0,47	W.R. Berkley Corp.	11.975	847	0,13	Hitachi Ltd. (d)	24.900	1.791	0,27
Banco de Chile	2.642.680	313	0,05	Washington H Soul Pattinson & Co. Ltd.	13.620	305	0,05	HMM Co. Ltd. (d)	14.062	213	0,03
Banco do Brasil S.A.	49.400	563	0,08	Wells Fargo & Co.	2.356	116	0,02	Horizon Construction Development Ltd. (d)	2.741	2	0,00
Banco Santander S.A.	782.775	3.276	0,49	Yapi ve Kredi Bankası A/S	193.941	128	0,02	Huntington Ingalls Industries, Inc.	2.290	595	0,09
Bank of the Philippine Islands	114.340	214	0,03	Zurich Insurance Group AG	1.156	604	0,09	Hyundai Glovis Co. Ltd. (d)	1.078	160	0,02
BB Seguridade Participacoes S.A.	40.200	279	0,04		52.541	7,84		Industries Qatar QSC	87.941	311	0,05
Berkshire Hathaway, Inc. 'B' (d)	175	62	0,01	GESUNDHEITSWESEN				International Container Terminal Services, Inc.	32.730	146	0,02
Brookfield Asset Management Ltd. 'A'	1.462	59	0,01	AbbVie, Inc. (d)	48.112	7.456	1,11	ITOCHU Corp. (d)	46.600	1.899	0,28
CaixaBank S.A.	236.775	976	0,15	AstraZeneca PLC	1.690	228	0,04	Kawasaki Kisen Kaisha Ltd. (d)	7.900	338	0,05
Choe Global Markets, Inc.	6.060	1.082	0,16	Bristol-Myers Squibb Co. (d)	112.820	5.789	0,87	KOC Holding A/S	43.668	209	0,03
China Construction Bank Corp. 'H'	1.715.000	1.020	0,15	Centene Corp. (d)	30.991	2.300	0,34	Korean Air Lines Co. Ltd. (d)	10.588	196	0,03
China Pacific Insurance Group Co. Ltd. 'A'	175.000	385	0,06	Cigna Group	5.904	1.768	0,26	Kuehne + Nagel International AG	3.118	1.075	0,16
Chubb Ltd.	9.679	2.188	0,33	CSPC Pharmaceutical Group Ltd.	512.000	476	0,07	Makita Corp.	7.700	212	0,03
Cincinnati Financial Corp.	9.024	934	0,14	Gilead Sciences, Inc.	70.103	5.679	0,85	Marubeni Corp. (d)	82.800	1.304	0,19
CME Group, Inc.	5.151	1.085	0,16	GSK PLC (d)	57.364	1.060	0,16	Masco Corp.	12.920	865	0,13
DB Insurance Co. Ltd. (d)	2.647	171	0,03	Humana, Inc.	5.312	2.432	0,36	MISC Bhd.	55.800	88	0,01
Erie Indemnity Co. 'A' (d)	1.458	488	0,07	Ipsen S.A.	2.164	258	0,04	Mitsubishi Corp. (d)	198.000	3.154	0,47
Erste Group Bank AG	19.731	800	0,12	Johnson & Johnson	46.328	7.261	1,08	Mitsui & Co. Ltd. (d)	74.200	2.780	0,42
Eurazeo SE	2.529	201	0,03	Kyowa Kirin Co. Ltd.	15.500	260	0,04	Mitsui OSK Lines Ltd. (d)	19.700	630	0,09
Everest Group Ltd.	2.461	870	0,13	Merck & Co., Inc.	52.378	5.710	0,85	Mytilineos S.A.	5.181	210	0,03
EXOR NV	5.432	544	0,08	Novartis AG	41.660	4.205	0,63	Nippon Yusen KK (d)	27.800	859	0,13
Fairfax Financial Holdings Ltd.	1.225	1.136	0,17	Regeneron Pharmaceuticals, Inc. (d)	1.275	1.120	0,17	Orient Overseas International Ltd.	7.500	105	0,02
Far East Horizon Ltd.	74.000	58	0,01	Richter Gedeon Nyrt	7.285	184	0,03	Owens Corning (d)	5.172	767	0,11
FirstRand Ltd.	289.665	1.163	0,17	Roche Holding AG	11.597	3.369	0,50	PACCAR, Inc. (d)	700	68	0,01
Globe Life, Inc. (d)	1.671	203	0,03	UnitedHealth Group, Inc.	3.204	1.687	0,25	ROCKWOOL A/S 'B'	528	155	0,02
Haci Omer Sabanci Holding A/S	58.559	120	0,02		51.242	7,65		Siemens AG (d)	2.281	428	0,06
Hartford Financial Services Group, Inc.	17.328	1.393	0,21	INDUSTRIEWERTE				Taisei Corp. (d)	8.200	280	0,04
Huatai Securities Co. Ltd. 'A'	25.300	50	0,01	3M Co.	14.829	1.621	0,24	Thales S.A.	6.031	894	0,13
Huatai Securities Co. Ltd. 'H'	75.000	95	0,01	A.O. Smith Corp.	7.149	589	0,09	Toyota Tsusho Corp. (d)	12.200	716	0,11
IGM Financial, Inc.	4.781	127	0,02	AGC, Inc.	11.200	415	0,06	Türkiye Sise ve Cam Fabrikalari A/S	79.122	123	0,02
Industrial & Commercial Bank of China Ltd. 'A'	218.700	147	0,02	Allegion PLC	1.090	138	0,02	Veralto Corp.	13.413	1.103	0,16
Industrial & Commercial Bank of China Ltd. 'H'	107.000	52	0,01	AP Moller - Maersk A/S 'A'	174	309	0,05	Vinci S.A.	28.099	3.538	0,53
Industrivarden AB 'A'	7.539	247	0,04	AP Moller - Maersk A/S 'B'	278	501	0,08	Weichai Power Co. Ltd. 'A'	23.400	45	0,01
JPMorgan Chase & Co. (d)	865	147	0,02	Astra International Tbk PT	1.163.000	427	0,06		46.086	6,88	
Julius Baer Group Ltd.	11.819	663	0,10	AviChina Industry & Technology Co. Ltd. 'H'	143.000	61	0,01	INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
Mastercard, Inc. 'A' (d)	1.215	518	0,08	BAE Systems PLC	174.929	2.476	0,37	Adobe, Inc. (d)	530	316	0,05
Metropolitan Bank & Trust Co. Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	7.032	2.919	0,44	BOC Aviation Ltd.	11.600	89	0,01	Apple, Inc.	82.221	15.831	2,36
New China Life Insurance Co. Ltd. 'H'	47.500	93	0,01	Brambles Ltd.	34.535	321	0,05	Applied Materials, Inc. (d)	11.375	1.844	0,28
ORIX Corp. (d)	22.400	421	0,06	Brenntag SE	7.982	734	0,11	ASE Technology Holding Co. Ltd.	176.000	771	0,11
OTP Bank Nyrt	11.833	540	0,08	Budimex S.A.	734	117	0,02	Asustek Computer, Inc.	36.000	573	0,09
PayPal Holdings, Inc. (d)	60.614	3.722	0,56	Builders FirstSource, Inc. (d)	7.102	1.186	0,18	Autodesk, Inc. (d)	12.268	2.987	0,45
People's Insurance Co. Group of China Ltd. 'H'	501.000	154	0,02	Bunzl PLC	12.485	507	0,08	Broadcom, Inc.	2.520	2.813	0,42
PICC Property & Casualty Co. Ltd. 'H'	396.000	471	0,07	Carlisle Cos., Inc.	2.799	874	0,13	Brother Industries Ltd. (d)	13.300	212	0,03
Poste Italiane SpA	29.980	341	0,05	Caterpillar, Inc. (d)	7.698	2.276	0,34	Canon, Inc.	57.400	1.473	0,22
Powszechny Zakład Ubezpieczeń S.A.	34.735	418	0,06	China Railway Group Ltd. 'A'	70.800	57	0,01	Check Point Software Technologies Ltd. (d)	5.372	821	0,12
Qifu Technology, Inc.	6.062	96	0,01	Cie de Saint-Gobain S.A.	25.979	1.917	0,29	Cisco Systems, Inc. (d)	171.256	8.652	1,29
Samsung Fire & Marine Insurance Co. Ltd. (d)	1.771	361	0,05	COSCO SHIPPING Holdings Co. Ltd. 'A'	44.100	60	0,01	Compal Electronics, Inc.	240.000	311	0,05
SEI Investments Co.	6.504	413	0,06	COSCO Shipping Holdings Co. Ltd. 'H'	173.500	174	0,03	Dropbox, Inc. 'A' (d)	14.896	439	0,07
				CRRC Corp. Ltd. 'A'	83.800	62	0,01	F5, Inc. (d)	790	141	0,02
				CRRC Corp. Ltd. 'H'	251.000	111	0,02	Fortinet, Inc. (d)	35.222	2.062	0,31
				Cummins, Inc.	318	76	0,01	Foxconn Industrial Internet Co. Ltd. 'A'	34.200	73	0,01
				Daqin Railway Co. Ltd. 'A'	52.200	53	0,01	GoDaddy, Inc. 'A' (d)	8.049	854	0,13
				Dassault Aviation S.A.	993	197	0,03	Hon Hai Precision Industry Co. Ltd.	227.000	772	0,12
				Eiffage S.A.	4.218	453	0,07				
				Ferguson PLC	11.737	2.266	0,34				

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

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	
HP, Inc.	30.263	\$ 911	0,14	Nucor Corp.	14.420	\$ 2.510	0,37	REAL ESTATE INVESTMENT TRUSTS				
Intel Corp.	23.150	1.163	0,17	Packaging Corporation of America	954	155	0,02	Fibra Uno Administracion S.A. de C.V.	168.300	\$ 304	0,04	
Juniper Networks, Inc.	18.460	544	0,08	Reliance Steel & Aluminum Co.	3.375	944	0,14	PARI (000S)				
KLA Corp.	5.384	3.130	0,47	Steel Dynamics, Inc.	8.886	1.050	0,16	KURZFRISTIGE INSTRUMENTE				
Lam Research Corp.	1.666	1.305	0,19	Wanhua Chemical Group Co. Ltd. 'A'	10.800	117	0,02	ARGENTINISCHE SCHATZWECHSEL				
Lite-On Technology Corp.	116.000	440	0,07			9.814	1,46	(38,356) % fällig am 20.05.2024 (e)(f)	ARS	9.549	15	0,00
Logitech International S.A.	9.436	897	0,13	IMMOBILIEN				0,000 % fällig am 04.01.2024 (e)(f)	HUF	387.000	1.118	0,17
MediaTek, Inc. (d)	87.000	2.873	0,43	Aldar Properties PJSC	221.134	322	0,05	U.S. TREASURY BILLS				
Microchip Technology, Inc.	3.590	324	0,05	Emaar Properties PJSC	380.492	821	0,12	5,371 % fällig am 11.01.2024 (e)(f)	\$	14.900	14.881	2,22
Microsoft Corp. (d)	39.364	14.802	2,21			1.143	0,17	5,371 % fällig am 29.02.2024 (e)(f)(k)		3.600	3.569	0,53
NetApp, Inc. (d)	11.774	1.038	0,15	VERSORGUNGSUNTERNEHMEN				5,371 % fällig am 29.02.2024 (e)(f)		1.000	992	0,15
Novatek Microelectronics Corp.	33.000	555	0,08	Canadian Utilities Ltd. 'A'	7.525	182	0,03	5,378 % fällig am 29.02.2024 (e)(f)		700	694	0,10
NXP Semiconductors NV	14.909	3.424	0,51	Centrica PLC	299.277	537	0,08	5,382 % fällig am 11.01.2024 (e)(f)		6.000	5.992	0,90
Oracle Corp. Japan (d)	2.200	169	0,03	CEZ A/S	9.364	402	0,06	5,385 % fällig am 22.02.2024 (e)(f)		800	794	0,12
Otsuka Corp.	6.600	272	0,04	CGN Power Co. Ltd. 'H'	609.000	159	0,02	5,394 % fällig am 23.01.2024 (e)(f)		5.400	5.383	0,80
Pegatron Corp.	74.000	210	0,03	CLP Holdings Ltd.	95.500	789	0,12	5,394 % fällig am 25.01.2024 (e)(f)		700	698	0,10
Qorvo, Inc. (d)	5.661	637	0,09	CPFL Energia S.A.	13.200	105	0,02	5,427 % fällig am 26.03.2024 (e)(f)		5.700	5.631	0,84
QUALCOMM, Inc.	53.894	7.795	1,16	E.ON SE	128.833	1.732	0,26				38.634	5,76
Quanta Computer, Inc.	10.000	73	0,01	Endesa S.A.	18.227	372	0,05	Summe kurzfristige Instrumente			39.767	5,93
Realtek Semiconductor Corp.	28.000	429	0,06	Enel Americas S.A. (d)	1.230.210	137	0,02	Summe übertragbare Wertpapiere		\$	767.569	114,54
Renesas Electronics Corp. (d)	33.400	597	0,09	Enel SpA (d)	472.072	3.515	0,52	AKTIEN				
SAP SE	21.262	3.275	0,49	Kansai Electric Power Co., Inc. (d)	40.400	536	0,08	INVESTMENTFONDS				
SCSK Corp. (d)	5.200	103	0,02	Kunlun Energy Co. Ltd.	224.000	202	0,03	ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN				
Shenzhen Transsion Holdings Co. Ltd. 'A'	2.769	54	0,01	PGE Polska Grupa Energetyczna S.A. (d)	51.572	114	0,02	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Capital Securities Fund (i)	0	0	0,00	
Skyworks Solutions, Inc.	9.136	1.027	0,15	Sembcorp Industries Ltd.	51.300	206	0,03	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (i)	88.444	881	0,13	
STMicroelectronics NV (d)	36.578	1.836	0,27	Vistra Corp.	16.753	645	0,10				881	0,13
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd. (d)	322.000	6.173	0,92			9.633	1,44	Summe Investmentfonds		\$	881	0,13
Tokyo Electron Ltd. (d)	1.800	320	0,05	VORZUGSWERTPAPIERE								
Tongwei Co. Ltd. 'A'	15.500	55	0,01	BanColombia S.A. 0,000 %	26.335	203	0,03					
Trend Micro, Inc.	7.800	416	0,06	Cia Energetica de Minas Gerais 0,000 %	79.900	190	0,03					
United Microelectronics Corp.	645.000	1.099	0,16	Nationwide Building Society 10,250 %	1.490	247	0,04					
VeriSign, Inc. (d)	4.625	953	0,14	Petroleo Brasileiro S.A. 0,000 %	273.400	2.086	0,31					
		97.844	14,60			2.726	0,41					
BAUSTOFFE												
Baoshan Iron & Steel Co. Ltd. 'A'	76.700	64	0,01									
BlueScope Steel Ltd.	9.857	157	0,02									
CRH PLC	18.420	1.268	0,19									
Heidelberg Materials AG	7.864	703	0,11									
Holcim AG	29.905	2.347	0,35									
LyondellBasell Industries NV 'A'	5.250	499	0,07									

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft ⁽¹⁾	% des Netto- vermögens
DEU	5,420 %	29.12.2023	02.01.2024	\$ 9.600	U.S. Treasury Bonds 3,750 % fällig am 15.08.2041	\$ (9.824)	\$ 9.600	\$ 9.606	1,43
FICC	2,600	29.12.2023	02.01.2024	2.484	U.S. Treasury Notes 4,875 % fällig am 30.11.2025	(2.534)	2.484	2.485	0,37
SSB	2,600	29.12.2023	02.01.2024	520	U.S. Treasury Notes 0,250 % fällig am 31.10.2025	(530)	520	520	0,08
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (12.888)	\$ 12.604	\$ 12.611	1,88

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Australia Government 10-Year Bond March Futures	Long	03/2024	10	\$ 18	0,00
CAC 40 Index January Futures	Short	01/2024	10	6	0,00
E-mini S&P 500 Index March Futures	Long	03/2024	1	(1)	0,00

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro STOXX 50 March Futures	Short	03/2024	19	\$ 6	0,00
FTSE 100 Index March Futures	Short	03/2024	3	(6)	0,00
FTSE China A50 Index January Futures	Long	01/2024	82	23	0,00
FTSE/JSE Index March Futures	Long	03/2024	1	0	0,00
IBEX 35 January Futures	Long	01/2024	3	(1)	0,00
Mini MSCI Emerging Markets Index March Futures	Short	03/2024	7	(17)	0,00
MSCI Singapore Index January Futures	Short	01/2024	46	(47)	(0,01)
OMXS30 Index January Futures	Long	01/2024	12	0	0,00
S&P CNX Nifty Index January Futures	Long	01/2024	7	3	0,00
S&P/Toronto Stock Exchange 60 March Futures	Short	03/2024	7	(35)	(0,01)
SPI 200 Index March Futures	Short	03/2024	19	(54)	(0,01)
Topix Index March Futures	Short	03/2024	8	(4)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Short	03/2024	7	(25)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Ultra March Futures	Short	03/2024	53	(305)	(0,04)
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Long	03/2024	48	429	0,07
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03/2024	42	(476)	(0,07)
WIG20 Index March Futures	Short	03/2024	8	1	0,00
				\$ (485)	(0,07)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (485)	(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 – SCHUTZKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
iTraxx Crossover 40 5-Year Index	(5,000) %	20.12.2028	€ 1.220	\$ (39)	(0,01)
iTraxx Europe Main 39 5-Year Index	(1,000)	20.06.2028	1.980	(10)	0,00
iTraxx Europe Main 40 5-Year Index	(1,000)	20.12.2028	3.000	(15)	0,00
				\$ (64)	(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.HY-41 5-Year Index	5,000 %	20.12.2028	\$ 168	\$ 2	0,00
CDX.IG-41 5-Year Index	1,000	20.12.2028	350	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
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,500 %	20.03.2034	£ 1.100	\$ 59	0,01
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,050	15.12.2031	¥ 690.000	(17)	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,125	12.10.2024	18.020.000	(18)	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,450	15.12.2051	300.000	6	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	1,000	21.03.2034	594.200	(57)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,250	16.03.2024	\$ 14.500	509	0,08
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.06.2029	800	(8)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.06.2032	14.300	(300)	(0,04)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.06.2052	3.100	(186)	(0,03)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.06.2052	4.000	248	0,04
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,385	08.06.2032	6.100	(150)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,750	21.06.2053	7.400	(605)	(0,09)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,000	21.06.2033	5.100	(175)	(0,03)
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,085	13.02.2034	23.920	(1.116)	(0,17)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,250	21.06.2028	12.900	(177)	(0,03)
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,250	20.03.2034	2.200	60	0,01
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,308	21.02.2029	21.700	561	0,08
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	02.04.2026	50.600	566	0,08
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2030	26.600	(917)	(0,14)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2033	27.240	(1.295)	(0,19)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2033	19.140	683	0,10
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,525	02.03.2030	1.600	29	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	21.06.2025	43.100	8	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.12.2028	6.200	109	0,02
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2031	4.000	(8)	0,00
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2036	10.100	17	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,760	23.08.2033	7.135	303	0,04
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,800	10.03.2028	4.504	52	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,800	22.08.2030	1.817	53	0,01

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

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,800 %	30.08.2033	\$ 4.300	\$ 185	0,03
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,830	12.10.2053	475	50	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	20.12.2025	52.120	511	0,08
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	20.03.2031	13.800	(301)	(0,05)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	22.11.2033	1.700	(83)	(0,01)
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	20.03.2034	7.600	(205)	(0,03)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,604	04.01.2027	BRL 27.900	84	0,01
Zahlung ⁽⁴⁾	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,250	20.03.2034	CAD 600	20	0,00
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.03.2034	€ 1.100	48	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,700	05.11.2027	MXN 63.500	45	0,01
					\$ (1.412)	(0,21)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ (1.474)	(0,22)

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

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

(3) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

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

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

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

VERKAUFSOPTIONEN

INFLATION-CAPPED OPTIONS

Kontrahent	Beschreibung	Anfänglicher Index	Variabler Zinssatz	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens
GLM	Cap - OTC CPALEMU	\$ 100,151	Maximal [(Final Index/Initial Index - 1) - 3,000 %] or 0	22.06.2035	8.200	\$ (253)	\$ (275)	(0,04)
JPM	Cap - OTC CPURNSA	234,781	Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 4,000 %] oder 0	16.05.2024	1.500	0	0	0,00
						\$ (253)	\$ (275)	(0,04)

(1) Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Netto- vermögens	
GST	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500 %	17.11.2059	\$ 2.900	\$ (9)	\$ 9	\$ 0	0,00	
MYC	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	12.200	(40)	39	(1)	0,00	
SAL	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	2.200	(22)	13	(9)	0,00	
						\$ (71)	\$ 61	\$ (10)	0,00

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn- betrag	Fälligkeits- datum	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Netto- vermögens	
CBK	Erhalt	NDUEACWF Index	35.000	1-Month USD-LIBOR plus a specified spread	\$ 13.584	05.06.2024	\$ 0	\$ (34)	\$ (34)	(0,01)	
MEI	Erhalt	BOVESPA Index	23	0,000 %	BRL 2.984	14.02.2024	0	28	28	0,01	
MYI	Zahlung	KOSPI2 Index	3.500.000	0,000	KRW 1.179.290	14.03.2024	0	(70)	(70)	(0,01)	
	Zahlung	SET 50 Index	16.200	0,000	THB 14.050	28.03.2024	0	(3)	(3)	0,00	
	Erhalt	NDUEACWF Index	1	1-Month USD-LIBOR plus a specified spread	\$ 41.539	27.11.2024	0	(188)	(188)	(0,03)	
								\$ 0	\$ (267)	\$ (267)	(0,04)

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
AZD	01/2024	AUD	\$	14.630	9.678	\$	(307)	(0,05)
	01/2024	\$	AUD	4.285	6.471		131	0,02
	01/2024		¥	6.260	914.500		231	0,04
	01/2024		NZD	459	746		13	0,00
	03/2024	CNH	\$	25.240	3.502		(63)	(0,01)
	03/2024	\$	NZD	634	1.000		(1)	0,00
BOA	01/2024	COP	\$	33.623.954	8.370		(302)	(0,04)
	01/2024	PLN		3.200	814		0	0,00
	01/2024	\$	COP	8.780	33.623.954		(118)	(0,02)
	01/2024		¥	9.488	1.400.143		451	0,07
	02/2024	CNY	\$	2.319	321		(7)	0,00
	02/2024	\$	CNY	888	6.274		1	0,00
	03/2024	CNH	\$	35.524	4.905		(113)	(0,02)
	03/2024	COP		32.820.935	8.457		0	0,02
	03/2024	INR		82.329	984		(3)	0,00
	03/2024	\$	COP	207	803.020		(3)	0,00
	03/2024		IDR	100	1.539.470		0	0,00
	03/2024		INR	106	8.885		0	0,00
	03/2024		KRW	200	257.654		1	0,00
	03/2024		MXN	100	1.718		0	0,00
BPS	01/2024	AUD	\$	86	57		(2)	0,00
	01/2024	BRL		40.598	8.322		(36)	(0,01)
	01/2024	€		3.887	4.254		(41)	(0,01)
	01/2024	HUF		44.927	128		(2)	0,00
	01/2024	¥		34.200	237		(6)	0,00
	01/2024	NZD		1.323	814		(24)	0,00
	01/2024	\$	AUD	3.709	5.505		48	0,01
	01/2024		CAD	22	30		1	0,00
	01/2024		€	946	865		9	0,00
	01/2024		£	1.627	1.288		15	0,00
	01/2024		HUF	238	82.910		0	0,00
	01/2024		¥	4.222	608.900		100	0,02
	01/2024		ZAR	4.810	89.087		53	0,01
	01/2024	ZAR	\$	12.778	689		(8)	0,00
	02/2024	\$	BRL	8.322	40.771		58	0,01
	02/2024		CNY	1.576	11.189		8	0,00
	02/2024		TWD	314	9.990		13	0,00
	03/2024	CNH	\$	24.585	3.416		(56)	(0,01)
	03/2024	INR		285.968	3.419		(8)	0,00
	03/2024	NOK		103	10		0	0,00
	03/2024	TWD		41.710	1.324		(48)	(0,01)
	03/2024	\$	CAD	911	1.200		0	0,00
	03/2024		CNH	24.010	170.117		18	0,00
	03/2024		INR	369	30.862		1	0,00
	03/2024		SEK	270	2.677		(4)	0,00
	06/2024		KRW	172	224.972		4	0,00
BRC	01/2024	BRL	\$	11	2		0	0,00
	01/2024	CHF		4.216	4.875		(137)	(0,02)
	01/2024	DKK		340	50		(1)	0,00
	01/2024	PLN		1.225	280		(31)	0,00
	01/2024	\$	CAD	588	799		19	0,00
	01/2024		CHF	5.522	4.798		182	0,02
	01/2024		€	410	378		8	0,00
	01/2024		£	19	15		0	0,00
	01/2024		NOK	429	4.620		26	0,00
	01/2024		PLN	166	661		2	0,00
	03/2024	CNY	\$	107	15		0	0,00
	03/2024	SGD		52	40		0	0,00
	03/2024	\$	CLP	3.026	2.636.590		(18)	0,00
	03/2024		HUF	200	70.620		2	0,00
	03/2024		ILS	100	362		1	0,00
	03/2024		THB	1	22		0	0,00
	03/2024		TRY	132	4.128		(2)	0,00
	04/2024			1.621	52.085		(23)	0,00
	06/2024		KRW	178	231.887		4	0,00
CBK	01/2024	AUD	\$	152	103		(1)	0,00
	01/2024	CAD		5.475	4.092		(61)	(0,01)
	01/2024	£		2.892	3.675		(12)	0,00
	01/2024	HUF		2.065.993	5.721		(247)	(0,04)
	01/2024	MXN		19.693	1.072		(86)	(0,01)
	01/2024	PLN		5.954	1.357		(157)	(0,02)
	01/2024	SEK		30	3		0	0,00
	01/2024	\$	CAD	451	604		7	0,00
	01/2024		£	784	617		3	0,00
	01/2024		¥	29	4.100		0	0,00
	01/2024		MXN	118	2.109		6	0,00
	01/2024		NOK	130	1.400		7	0,00
	01/2024		PLN	3	12		0	0,00
	01/2024		SEK	101	1.055		4	0,00
	01/2024	ZAR	\$	7.744	412		(12)	0,00
	02/2024	\$	CNY	192	1.388		5	0,00

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

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	03/2024	BRL	2.610	\$ 531	\$ 0	\$ (3)	0,00
	03/2024	CAD	300	225	0	(3)	0,00
	03/2024	PEN	211	56	0	(1)	0,00
	03/2024	PLN	1.888	475	0	(4)	0,00
	03/2024	\$	168	BRL 831	2	2	0,00
	03/2024		537	IDR 8.359.975	5	0	0,00
	03/2024		451	ILS 1.641	6	0	0,00
	03/2024		100	PEN 377	1	0	0,00
DUB	06/2024	KRW	322.966	\$ 251	0	(2)	0,00
	01/2024	NOK	38.810	3.625	0	(197)	(0,03)
	01/2024	PLN	1.183	300	0	0	0,00
	01/2024	\$	252	PLN 1.000	2	2	0,00
	03/2024	BRL	832	\$ 168	0	(3)	0,00
	03/2024	CNH	16.907	2.346	0	(42)	(0,01)
	03/2024	\$	100	BRL 487	0	(1)	0,00
	03/2024		760	SGD 1.005	5	5	0,00
	06/2024	KRW	100.984	\$ 78	0	(2)	0,00
	06/2024	\$	193	KRW 250.690	4	4	0,00
FAR	01/2024	CAD	55	\$ 41	0	(1)	0,00
	03/2024	\$	100	THB 3.409	1	0	0,00
GLM	01/2024	MXN	14.741	\$ 840	0	(26)	0,00
	01/2024	NZD	1.186	739	0	(11)	0,00
	01/2024	\$	167	BRL 821	2	2	0,00
	01/2024		11.920	CAD 16.198	366	366	0,06
	01/2024		1	MXN 17	0	0	0,00
	01/2024		4.132	NOK 42.795	82	82	0,01
	01/2024		249	NZD 400	4	4	0,00
	01/2024	ZAR	384	\$ 21	0	0	0,00
	03/2024	CNH	10.993	1.524	0	(29)	0,00
	03/2024	IDR	25.651.298	1.628	0	(36)	(0,01)
	03/2024	PHP	220	4	0	0	0,00
	03/2024	\$	892	AUD 1.300	0	(3)	0,00
	03/2024		600	THB 20.758	12	12	0,00
	03/2024		16	TRY 515	0	0	0,00
JPM	01/2024	HUF	468.820	\$ 1.295	0	(58)	(0,01)
	01/2024	\$	4.917	BRL 24.775	183	183	0,03
	01/2024		622	MXN 10.698	6	6	0,00
	02/2024	CNY	3.940	\$ 542	0	(16)	0,00
	02/2024	\$	7.493	INR 625.952	15	15	0,00
	02/2024		800	TRY 24.409	0	(4)	0,00
	03/2024	CNY	13.627	\$ 1.920	0	(16)	0,00
	03/2024	IDR	128.916	8	0	0	0,00
	03/2024	INR	85.713	1.025	0	(2)	0,00
	03/2024	\$	111	INR 9.250	0	0	0,00
	03/2024		200	PLN 791	1	1	0,00
	03/2024		485	TWD 15.080	11	11	0,00
	06/2024	KRW	260.464	\$ 199	0	(5)	0,00
	06/2024	\$	173	KRW 223.934	3	3	0,00
MBC	01/2024	€	3.019	\$ 3.267	0	(69)	(0,01)
	01/2024	HUF	72.257	205	0	(3)	0,00
	01/2024	¥	9.100	64	0	(1)	0,00
	01/2024	\$	1.758	AUD 2.651	52	52	0,01
	01/2024		47.083	€ 42.823	232	232	0,03
	01/2024		4.117	£ 3.246	21	21	0,00
	01/2024		3.220	HUF 1.181.199	184	184	0,03
	01/2024		1.802	ZAR 34.446	79	79	0,01
	03/2024	IDR	157.101	\$ 10	0	0	0,00
	03/2024	NZD	200	125	0	(1)	0,00
	03/2024	PHP	1.177	21	0	0	0,00
	03/2024	\$	674	PHP 37.737	7	7	0,00
MYI	01/2024	CAD	9.816	\$ 7.222	0	(223)	(0,03)
	01/2024	€	7	8	0	0	0,00
	01/2024	£	2	3	0	0	0,00
	01/2024	HUF	14.285	41	0	(1)	0,00
	01/2024	MYR	469	100	0	(2)	0,00
	01/2024	PLN	200	50	0	(1)	0,00
	01/2024	\$	150	€ 136	0	(1)	0,00
	01/2024		28	£ 22	0	0	0,00
	01/2024		3.608	¥ 531.866	167	167	0,03
	01/2024		1.021	MYR 4.765	17	17	0,00
	01/2024		515	ZAR 9.467	2	2	0,00
	01/2024	ZAR	84.901	\$ 4.535	0	(103)	(0,01)
	02/2024	\$	925	CNY 6.552	3	3	0,00
	03/2024	CNH	24.085	\$ 3.340	0	(62)	(0,01)
	03/2024	\$	1.538	BRL 7.662	30	30	0,00
	03/2024		3.614	IDR 55.629.663	0	(4)	0,00
	03/2024		100	MYR 459	0	0	0,00
	03/2024		336	NOK 3.388	0	(2)	0,00
	06/2024	KRW	58.071	\$ 45	0	(1)	0,00
	06/2024	\$	70	KRW 90.573	1	1	0,00
RBC	01/2024	BRL	1.310	\$ 266	0	(4)	0,00
	01/2024	MXN	1.987	115	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	
	01/2024	\$	2.720	MXN 46.681	\$ 24	\$ 0	\$ 24	0,00
	03/2024		100	CLP 88.690	1	0	1	0,00
	03/2024		480	IDR 7.397.880	0	0	0	0,00
	03/2024		147	INR 12.257	0	0	0	0,00
	04/2024	MXN	21	\$ 1	0	0	0	0,00
RYL	01/2024	€	46.434	50.859	0	(447)	(447)	(0,07)
	01/2024	\$	20	£ 16	0	0	0	0,00
	03/2024		384	300	0	(1)	(1)	0,00
SCX	03/2024		100	PHP 5.553	0	0	0	0,00
	01/2024		37	¥ 5.300	1	0	1	0,00
	03/2024	AUD	100	\$ 68	0	(1)	(1)	0,00
	03/2024	CNH	23.646	3.266	0	(74)	(74)	(0,01)
	03/2024	INR	194.978	2.331	0	(5)	(5)	0,00
	03/2024	¥	44.939	317	0	(5)	(5)	0,00
	03/2024	TWD	22.643	717	0	(27)	(27)	0,00
	03/2024	\$	110	€ 100	1	0	1	0,00
	03/2024		882	HKD 6.879	0	0	0	0,00
	03/2024		194	INR 16.226	0	0	0	0,00
	06/2024		92	KRW 119.583	2	0	2	0,00
SOG	01/2024	BRL	1.633	\$ 333	0	(3)	(3)	0,00
SSB	01/2024		17.957	3.709	12	0	12	0,00
	01/2024	CLP	2.637.825	2.984	0	(34)	(34)	(0,01)
	01/2024	\$	3.613	BRL 17.957	84	0	84	0,01
	01/2024		300	CLP 265.248	3	0	3	0,00
	03/2024	IDR	31.496.821	\$ 2.010	0	(34)	(34)	(0,01)
	03/2024	\$	100	COP 392.191	0	0	0	0,00
	03/2024		334	€ 300	0	(2)	(2)	0,00
	03/2024		300	INR 25.046	0	0	0	0,00
	03/2024		368	¥ 51.715	3	0	3	0,00
TOR	03/2024		200	SGD 263	0	0	0	0,00
	01/2024		3.660	¥ 536.910	151	0	151	0,02
	03/2024	CNH	11.436	\$ 1.584	0	(31)	(31)	0,00
	03/2024	\$	100	ZAR 1.850	1	0	1	0,00
UAG	01/2024	CAD	799	\$ 591	0	(15)	(15)	0,00
	01/2024	€	3.497	3.806	0	(57)	(57)	(0,01)
	01/2024	£	2.816	3.564	0	(26)	(26)	0,00
	01/2024	HUF	1.360	4	0	0	0	0,00
	01/2024	¥	11.478.400	77.980	0	(3.613)	(3.613)	(0,54)
	01/2024	\$	1.032	AUD 1.558	32	0	32	0,01
	01/2024		103	£ 81	1	0	1	0,00
	01/2024		3.003	HUF 1.053.015	31	0	31	0,01
	01/2024		56.559	¥ 8.387.000	3.092	0	3.092	0,46
	01/2024		627	SEK 6.395	8	0	8	0,00
	01/2024	ZAR	125.207	\$ 6.559	0	(278)	(278)	(0,04)
	03/2024	CZK	80.572	3.619	22	0	22	0,00
	03/2024	\$	352	CHF 296	3	0	3	0,00
					\$ 6.541	\$ (7.538)	\$ (997)	(0,15)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
AZD	01/2024	AUD	3.987	\$ 2.640	\$ 0	\$ (81)	(0,01)	
BOA	01/2024		603	399	0	(13)	0,00	
	01/2024	£	317	403	0	(1)	0,00	
	01/2024	INR	81.284	974	0	(3)	0,00	
	01/2024	¥	1.113.484	7.546	0	(359)	(0,05)	
	01/2024	NZD	402	245	0	(10)	0,00	
BPS	01/2024	\$	203	NOK 2.161	10	0	10	0,00
	01/2024	BRL	6	\$ 1	0	0	0	0,00
	01/2024	DKK	6.228	919	0	(4)	(4)	0,00
	01/2024	€	9.110	9.962	0	(103)	(103)	(0,02)
	01/2024	£	1.210	1.535	0	(8)	(8)	0,00
	01/2024	INR	299.879	3.593	0	(9)	(9)	0,00
	01/2024	¥	700.426	4.766	0	(206)	(206)	(0,03)
	01/2024	\$	25.279	€ 23.168	321	0	321	0,05
	01/2024		525	¥ 75.760	12	0	12	0,00
	02/2024		1	BRL 6	0	0	0	0,00
BRC	01/2024	THB	30.392	\$ 864	0	(27)	(27)	(0,01)
	01/2024	\$	0	CHF 0	0	0	0	0,00
	01/2024		114.911	€ 104.485	536	0	536	0,08
CBK	01/2024	CHF	216	\$ 248	0	(9)	(9)	0,00
	01/2024	€	1.038	1.142	1	(6)	(5)	0,00
	01/2024	KRW	4.580.205	3.557	24	0	24	0,00
	01/2024	NOK	1	0	0	0	0	0,00
	01/2024	SEK	78	7	0	0	0	0,00

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

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
	01/2024	\$	1.231	BRL 6.082	\$ 21	\$ 0	0,00	
	01/2024		0	DKK 1	0	0	0,00	
	01/2024		14	€ 13	0	0	0,00	
	01/2024		869	MXN 14.723	1	0	0,00	
	01/2024		49	NOK 523	3	0	0,00	
	01/2024	ZAR	170	\$ 9	0	0	0,00	
	02/2024	BRL	6.107	1.231	0	(24)	(0,01)	
	02/2024	MXN	14.723	865	(1)	(1)	0,00	
DUB	01/2024	SGD	68	52	0	0	0,00	
FAR	01/2024	BRL	1.745	359	0	0	0,00	
	02/2024	\$	359	BRL 1.753	1	1	0,00	
GLM	01/2024	CAD	10.853	\$ 7.986	0	(246)	(0,04)	
	01/2024	CHF	5.890	6.721	0	(282)	(0,04)	
	01/2024	CNY	24.294	3.440	8	8	0,00	
	01/2024	CZK	10.186	460	4	4	0,00	
	01/2024	DKK	8.250	1.217	0	(6)	0,00	
	01/2024	HUF	147.527	421	0	(5)	0,00	
	01/2024	ILS	791	212	0	(7)	0,00	
	01/2024	MYR	3.173	681	0	(9)	0,00	
	01/2024	PLN	2.257	565	0	(9)	0,00	
	01/2024	\$	164	CLP 144.422	2	2	0,00	
	01/2024		683	MYR 3.173	8	8	0,00	
	02/2024	CLP	144.422	\$ 163	0	(2)	0,00	
	02/2024	MYR	3.173	684	0	(9)	0,00	
IND	01/2024	\$	15	CNY 104	0	0	0,00	
JPM	01/2024	BRL	8.912	\$ 1.829	0	(5)	0,00	
	01/2024	SGD	8	6	0	0	0,00	
MBC	01/2024	AUD	2.643	1.752	0	(52)	(0,01)	
	01/2024	CLP	144.422	165	0	(1)	0,00	
	01/2024	€	6.376	6.968	0	(77)	(0,01)	
	01/2024	MXN	14.723	856	0	(13)	0,00	
	01/2024	\$	163	CAD 220	4	4	0,00	
MYI	01/2024	¥	422.974	\$ 2.869	0	(133)	(0,02)	
	01/2024	PHP	30.830	556	0	0	0,00	
	01/2024	SGD	1.069	802	0	(9)	0,00	
	01/2024	\$	154.486	€ 140.554	814	814	0,12	
SCX	01/2024	CNY	194	\$ 27	0	0	0,00	
	01/2024	HKD	60.661	7.767	0	(2)	0,00	
	01/2024	SEK	26.930	2.593	0	(80)	(0,01)	
	01/2024	TWD	137.090	4.407	0	(90)	(0,01)	
	01/2024	\$	2.034	CNY 14.493	13	13	0,00	
SOG	01/2024	IDR	14.349.923	\$ 923	0	(8)	0,00	
	01/2024	\$	933	BRL 4.581	10	10	0,00	
SSB	01/2024		3	KRW 3.930	0	0	0,00	
UAG	01/2024	£	6.574	\$ 8.320	0	(61)	(0,01)	
	01/2024	NOK	3.686	346	0	(17)	0,00	
	01/2024	\$	154.605	€ 140.554	695	695	0,10	
	01/2024	ZAR	10.717	\$ 578	0	(8)	0,00	
					\$ 2.488	\$ (1.995)	\$ 493	0,07

Zum 31. Dezember 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	01/2024	AUD	8	\$ 5	\$ 0	\$ 0	0,00
	01/2024	¥	1.275	9	0	(1)	0,00
	01/2024	\$	41	£ 32	0	0	0,00
	01/2024		0	NZD 0	0	0	0,00
BPS	01/2024	DKK	8	\$ 1	0	0	0,00
	01/2024	€	2	2	0	0	0,00
	01/2024	INR	468	6	0	0	0,00
	01/2024	¥	1.042	7	0	0	0,00
	01/2024	\$	34	£ 27	0	0	0,00
BRC	01/2024	CHF	1	\$ 1	0	0	0,00
	01/2024	HKD	6	1	0	0	0,00
	01/2024	¥	47	0	0	0	0,00
	01/2024	THB	42	1	0	0	0,00
CBK	01/2024	\$	0	£ 0	0	0	0,00
	01/2024	£	2	\$ 3	0	0	0,00
	01/2024	KRW	6.101	5	0	0	0,00
	01/2024	NOK	2	0	0	0	0,00
	01/2024	SEK	0	0	0	0	0,00
	01/2024	TWD	25	1	0	0	0,00
	01/2024	\$	2	BRL 11	0	0	0,00
	01/2024		6	£ 5	0	0	0,00
	01/2024		1	MXN 16	0	0	0,00
	01/2024	ZAR	0	\$ 0	0	0	0,00
	02/2024	BRL	11	2	0	0	0,00
	02/2024	MXN	16	1	0	0	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
FAR	01/2024	BRL	0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00	
	02/2024	\$	0	BRL 0	0	0	0,00	
GLM	01/2024	CAD	12	\$ 9	0	0	0,00	
	01/2024	CHF	7	7	0	0	0,00	
	01/2024	CNY	12	2	0	0	0,00	
	01/2024	CZK	2	0	0	0	0,00	
	01/2024	HUF	48	0	0	0	0,00	
	01/2024	ILS	3	1	0	0	0,00	
	01/2024	MYR	3	1	0	0	0,00	
	01/2024	PLN	3	1	0	0	0,00	
	01/2024	\$	0	CLP 120	0	0	0,00	
	01/2024	1	1	MYR 3	0	0	0,00	
	02/2024	CLP	120	\$ 0	0	0	0,00	
	02/2024	MYR	3	1	0	0	0,00	
JPM	01/2024	BRL	11	2	0	0	0,00	
MBC	01/2024	CAD	2	1	0	0	0,00	
	01/2024	CLP	120	0	0	0	0,00	
	01/2024	£	8	10	0	0	0,00	
	01/2024	MXN	16	1	0	0	0,00	
	01/2024	\$	7	£ 6	0	0	0,00	
MYI	01/2024	€	24	\$ 27	0	0	0,00	
	01/2024	£	1	1	0	0	0,00	
	01/2024	¥	484	3	0	0	0,00	
	01/2024	PHP	8	0	0	0	0,00	
	01/2024	SGD	1	1	0	0	0,00	
SCX	01/2024	CNY	0	0	0	0	0,00	
	01/2024	HKD	69	9	0	0	0,00	
	01/2024	INR	66	1	0	0	0,00	
	01/2024	SEK	29	3	0	0	0,00	
	01/2024	TWD	162	5	0	0	0,00	
	01/2024	\$	193	£ 153	1	1	0,00	
SOG	01/2024	IDR	12.196	\$ 1	0	0	0,00	
SSB	01/2024	\$	105	£ 84	1	1	0,00	
	01/2024	0	0	KRW 4	0	0	0,00	
UAG	01/2024	CZK	0	\$ 0	0	0	0,00	
	01/2024	DKK	11	2	0	0	0,00	
	01/2024	\$	195	£ 154	1	1	0,00	
	01/2024	ZAR	27	\$ 1	0	0	0,00	
					\$ 3	\$ (1)	\$ 2	0,00

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional RMB (Hedged) thesaurierend und Institutional 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
AZD	01/2024	THB	39	\$ 1	\$ 0	\$ 0	0,00
BOA	01/2024	£	17	22	0	0	0,00
	03/2024	CNY	9	1	0	0	0,00
	03/2024	INR	107	1	0	0	0,00
BPS	01/2024	€	45	49	0	(1)	0,00
	01/2024	¥	4.862	33	0	(2)	0,00
	03/2024	INR	370	4	0	0	0,00
	06/2024	KRW	2.005	2	0	0	0,00
BRC	01/2024	CHF	13	15	0	(1)	0,00
	03/2024	\$	32	CNH 228	0	0	0,00
	06/2024	KRW	2.066	\$ 2	0	0	0,00
CBK	01/2024	DKK	34	5	0	0	0,00
	01/2024	NOK	11	1	0	0	0,00
	01/2024	SEK	49	5	0	0	0,00
	01/2024	\$	4	BRL 18	0	0	0,00
	02/2024	BRL	18	\$ 4	0	0	0,00
	03/2024	ILS	3	1	0	0	0,00
DUB	06/2024	KRW	2.235	2	0	0	0,00
FAR	01/2024	BRL	0	0	0	0	0,00
	02/2024	\$	0	BRL 0	0	0	0,00
GLM	01/2024	MXN	28	\$ 2	0	0	0,00
JPM	01/2024	\$	334	CNH 2.383	1	1	0,00
	03/2024	IDR	18.762	\$ 1	0	0	0,00
	03/2024	INR	111	1	0	0	0,00
	03/2024	SGD	3	2	0	0	0,00
	03/2024	TWD	306	10	0	0	0,00
	06/2024	KRW	3.064	2	0	0	0,00
MBC	01/2024	AUD	15	10	0	0	0,00
	01/2024	CAD	23	17	0	(1)	0,00
	01/2024	€	1	1	0	0	0,00
	01/2024	\$	334	CNH 2.383	1	1	0,00
	03/2024	CNY	20	\$ 3	0	0	0,00
MYI	01/2024	MYR	4	1	0	0	0,00
	01/2024	ZAR	38	2	0	0	0,00
	06/2024	KRW	1.285	1	0	0	0,00

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

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
RBC	01/2024	BRL 18	\$ 4	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	03/2024	IDR 19	0	0	0	0	0,00
	04/2024	MXN 0	0	0	0	0	0,00
SCX	01/2024	¥ 153	1	0	0	0	0,00
	03/2024	HKD 131	17	0	0	0	0,00
	03/2024	INR 241	3	0	0	0	0,00
SOG	01/2024	\$ 334	CNH 2.383	1	0	1	0,00
UAG	03/2024	INR 126	\$ 2	0	0	0	0,00
				\$ 3	\$ (5)	\$ (2)	0,00

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilsklassen M Retail SGD (Hedged) thesaurierend, M Retail SGD (Hedged) ausschüttend und M Retail 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
AZD	01/2024	THB 40	\$ 1	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BOA	01/2024	£ 17	22	0	0	0	0,00
	03/2024	INR 106	1	0	0	0	0,00
BPS	01/2024	€ 45	49	0	(1)	(1)	0,00
	01/2024	¥ 4.861	33	0	(2)	(2)	0,00
	03/2024	INR 368	4	0	0	0	0,00
	03/2024	TWD 31	1	0	0	0	0,00
	06/2024	KRW 2.028	2	0	0	0	0,00
BRC	01/2024	CHF 13	15	0	(1)	(1)	0,00
	03/2024	SGD 2	1	0	0	0	0,00
	06/2024	KRW 2.091	2	0	0	0	0,00
CBK	01/2024	AUD 1	1	0	0	0	0,00
	01/2024	DKK 33	5	0	0	0	0,00
	01/2024	NOK 11	1	0	0	0	0,00
	01/2024	SEK 50	5	0	0	0	0,00
	01/2024	\$ 4	BRL 18	0	0	0	0,00
	02/2024	BRL 18	\$ 4	0	0	0	0,00
	03/2024	CNY 27	4	0	0	0	0,00
	03/2024	ILS 2	1	0	0	0	0,00
DUB	01/2024	\$ 333	SGD 445	4	0	4	0,00
	03/2024	46	60	0	0	0	0,00
	06/2024	KRW 2.260	\$ 2	0	0	0	0,00
FAR	01/2024	BRL 0	0	0	0	0	0,00
	02/2024	\$ 0	BRL 0	0	0	0	0,00
GLM	01/2024	MXN 28	\$ 2	0	0	0	0,00
	01/2024	\$ 333	SGD 445	4	0	4	0,00
	03/2024	INR 79	\$ 1	0	0	0	0,00
JPM	03/2024	IDR 18.976	1	0	0	0	0,00
	03/2024	INR 110	1	0	0	0	0,00
	03/2024	TWD 307	10	0	0	0	0,00
	06/2024	KRW 3.099	2	0	0	0	0,00
MBC	01/2024	AUD 15	10	0	0	0	0,00
	01/2024	CAD 23	17	0	0	0	0,00
	01/2024	€ 1	2	0	0	0	0,00
	01/2024	£ 1	1	0	0	0	0,00
MYI	01/2024	CAD 2	1	0	0	0	0,00
	01/2024	MYR 4	1	0	0	0	0,00
	01/2024	ZAR 38	2	0	0	0	0,00
	06/2024	KRW 1.299	1	0	0	0	0,00
RBC	01/2024	BRL 18	4	0	0	0	0,00
	03/2024	IDR 18	0	0	0	0	0,00
	04/2024	MXN 0	0	0	0	0	0,00
RYL	01/2024	\$ 333	SGD 445	4	0	4	0,00
SCX	01/2024	¥ 211	\$ 1	0	0	0	0,00
	03/2024	HKD 131	17	0	0	0	0,00
	03/2024	INR 240	3	0	0	0	0,00
UAG	03/2024	74	1	0	0	0	0,00
				\$ 12	\$ (4)	\$ 8	0,00

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (1,048) (0,16)

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.03.2054	\$ 2.100	\$ (2.036)	(0,30)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (2.036)	(0,30)
Summe Anlagen		\$ 776.011	115,80
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (105.895)	(15,80)
Nettovermögen		\$ 670.116	100,00

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.

(b) Wertpapier per Emissionstermin.

(c) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(d) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(e) Nullkuponwertpapier.

(f) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(g) 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) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: null):

Emittentenbeschreibung	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettvermögens
Parkland Corp.	12.12.2023	\$ 124	\$ 124	0,02

(k) Ein Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von USD 1.345 (31. Dezember 2022: USD null) und Barmittel in Höhe von USD 350 (31. Dezember 2022: USD 5.030) wurden zum 31. Dezember 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 5.701 (31. Dezember 2022: USD 35.607) wurden zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 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	\$ 247.646	\$ 518.134	\$ 1.789	\$ 767.569
Investmentfonds	881	0	0	881
Pensionsgeschäfte	0	12.604	0	12.604
Finanzderivate ⁽³⁾	(108)	(2.899)	0	(3.007)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(2.036)	0	(2.036)
Summen	\$ 248.419	\$ 525.803	\$ 1.789	\$ 776.011

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 94.207	\$ 379.228	\$ 0	\$ 473.435
Investmentfonds	151.214	100.275	0	251.489
Pensionsgeschäfte	0	18.536	0	18.536
Finanzderivate ⁽³⁾	(15.794)	1.026	0	(14.768)
Summen	\$ 229.627	\$ 499.065	\$ 0	\$ 728.692

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

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

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

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
AZD	\$ (77)	\$ 0	\$ (77)	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ k. A.
BOA	(346)	342	(4)	(3.503)	1.500	(2.003)
BOM	k. A.	k. A.	k. A.	2	0	2
BPS	90	0	90	485	(1.380)	(895)
BRC	539	(1.130)	(591)	(222)	450	228
BSH	k. A.	k. A.	k. A.	(1)	0	(1)
CBK	(560)	350	(210)	4.514	(4.480)	34
CLY	k. A.	k. A.	k. A.	(53)	0	(53)
DUB	(230)	0	(230)	13	0	13
FAR	1	0	1	k. A.	k. A.	k. A.

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
GLM	\$ (463)	\$ (60)	\$ (523)	\$ (829)	\$ 420	\$ (409)
GST	k. A.	k. A.	k. A.	15	(20)	(5)
JPM	114	0	114	(36)	(590)	(626)
MBC	362	(570)	(208)	1.039	(1.100)	(61)
MEI	28	0	28	7	(440)	(433)
MYC	(1)	0	(1)	(27)	180	153
MYI	231	0	231	(55)	780	725
RBC	19	0	19	(57)	0	(57)
RYL	(444)	732	288	(21)	0	(21)
SAL	(9)	0	(9)	(18)	0	(18)
SCX	(266)	271	5	4.106	(3.980)	126
SOG	k. A.	k. A.	k. A.	(81)	(280)	(361)
SSB	33	0	33	(463)	590	127
TOR	121	0	121	(838)	690	(148)
UAG	(190)	(320)	(510)	(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. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	80,16	25,87
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	34,38	35,98
Sonstige übertragbare Wertpapiere	k. A.	1,28
Investmentfonds	0,13	33,53
Pensionsgeschäfte	1,88	2,47
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,07)	(2,13)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,22)	(0,30)
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,16)	0,45
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,30)	k. A.

* Gemäß der Liste der Märkte, die in Anhang 1 zum Prospekt aufgeführt sind und die Kriterien für gemäß OGAW-Vorschriften geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	5,35	3,39
Wandelanleihen & Wechsel	0,14	0,12
US-Regierungsbehörden	24,13	4,77
US-Schatzobligationen	6,91	1,20
Non-Agency-MBS	1,85	1,66
Forderungsbesicherte Wertpapiere	7,89	7,95
Staatsemissionen	4,16	7,97
Stammaktien	57,73	6,88
Vorzugswertpapiere	0,41	0,16
Real Estate Investment Trusts	0,04	5,86
Kurzfristige Instrumente	5,93	23,17
Investmentfonds	0,13	33,53
Pensionsgeschäfte	1,88	2,47
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,07)	(2,13)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	k. A.	(0,01)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	(0,01)	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,00	0,07
Zinsswaps	(0,21)	(0,36)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Inflation-Capped Options	(0,04)	(0,06)
Zinsswapoptionen	k. A.	(0,01)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,00	(0,01)
Zinsswaps	k. A.	(0,04)
Total Return Swaps auf Indizes	(0,04)	0,05
Total Return Swaps auf Wertpapiere	k. A.	0,02
Devisenterminkontrakte	(0,15)	(0,87)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,07	1,37
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,30)	k. A.
Sonstige Aktiva und Passiva	(15,80)	2,85
Nettovermögen	100,00	100,00

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

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
CaixaBank S.A.				8,500 % fällig am 27.03.2028 (d)(f)	£ 34.600	\$ 44.640	0,87	5,364 % fällig am 16.04.2024 (b)(c)	\$ 4.000	\$ 3.939	0,08
3,625 % fällig am 14.09.2028 (d)(f)	€ 44.600	\$ 38.156	0,74	Nationwide Building Society				5,365 % fällig am 08.02.2024 (b)(c)	50.700	50.426	0,98
5,250 % fällig am 23.03.2026 (d)(f)	6.200	6.382	0,12	5,750 % fällig am 20.06.2027 (d)(f)	22.270	26.253	0,51	5,369 % fällig am 14.03.2024 (b)(c)(i)	4.400	4.354	0,09
5,875 % fällig am 09.10.2027 (d)(f)	8.400	9.013	0,18	NatWest Group PLC				5,373 % fällig am 29.02.2024 (b)(c)	27.100	26.870	0,52
6,750 % fällig am 13.06.2024 (d)(f)	46.000	50.858	0,99	4,445 % fällig am 08.05.2030	\$ 33.800	32.417	0,63	5,374 % fällig am 21.03.2024 (b)(c)	6.100	6.031	0,12
8,250 % fällig am 13.03.2029 (d)(f)	46.200	54.199	1,06	4,500 % fällig am 31.03.2028 (d)(f)	£ 12.400	13.269	0,26	5,376 % fällig am 09.01.2024 (b)(c)	2.700	2.697	0,05
Summe Spanien		529.837	10,31	4,600 % fällig am 28.06.2031 (d)(f)	\$ 21.859	16.458	0,32	5,377 % fällig am 07.03.2024 (b)(c)(i)	3.000	2.972	0,06
SCHWEDEN				6,000 % fällig am 29.12.2025 (d)(f)	70.800	68.627	1,34	5,377 % fällig am 28.03.2024 (b)(c)	13.100	12.937	0,25
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				8,000 % fällig am 10.08.2025 (d)(f)	39.900	40.070	0,78	5,378 % fällig am 11.01.2024 (b)(c)	49.800	49.735	0,97
Svenska Handelsbanken AB				Santander UK Group Holdings PLC				5,383 % fällig am 23.01.2024 (b)(c)	22.000	21.932	0,43
4,750 % fällig am 01.03.2031 (d)(f)	\$ 29.600	24.485	0,48	2,896 % fällig am 15.03.2032	1.600	1.368	0,03	5,383 % fällig am 30.01.2024 (b)(c)	7.400	7.370	0,14
SCHWEIZ				6,534 % fällig am 10.01.2029	14.600	15.123	0,29	5,384 % fällig am 15.02.2024 (a)(b)(c)	6.000	5.962	0,12
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				6,750 % fällig am 24.06.2024 (d)(f)	£ 86.735	110.665	2,16	5,385 % fällig am 11.01.2024 (b)(c)	35.000	34.954	0,68
Credit Suisse AG				7,482 % fällig am 29.08.2029	8.200	11.377	0,22	5,385 % fällig am 16.04.2024 (b)(c)	7.500	7.386	0,14
0,495 % fällig am 02.02.2024	600	597	0,01	Standard Chartered PLC				5,394 % fällig am 23.01.2024 (b)(c)	3.300	3.290	0,06
1,250 % fällig am 07.08.2026	500	454	0,01	6,296 % fällig am 06.07.2034	\$ 2.600	2.732	0,05	5,400 % fällig am 02.01.2024 (b)(c)	3.100	3.100	0,06
4,750 % fällig am 09.08.2024	250	249	0,00	Thames Water Utilities Finance PLC				5,400 % fällig am 15.02.2024 (a)(b)(c)	6.200	6.160	0,12
5,000 % fällig am 09.07.2027	1.100	1.101	0,02	8,250 % fällig am 25.04.2040	£ 2.600	3.728	0,07	5,410 % fällig am 22.02.2024 (b)(c)(i)	2.600	2.581	0,05
7,500 % fällig am 15.02.2028	5.550	6.082	0,12	Virgin Money UK PLC				5,418 % fällig am 02.01.2024 (b)(c)	24.000	24.000	0,47
7,950 % fällig am 09.01.2025	250	256	0,01	8,250 % fällig am 17.06.2027 (d)(f)	19.300	22.774	0,44	5,430 % fällig am 01.02.2024 (b)(c)	4.400	4.381	0,09
UBS AG				11,000 % fällig am 08.12.2028 (d)(f)	18.300	23.883	0,47	5,446 % fällig am 18.01.2024 (b)(c)	38.700	38.609	0,75
5,125 % fällig am 15.05.2024 (f)	5.000	4.965	0,10	Summe Großbritannien		1.099.026	21,40	5,450 % fällig am 25.01.2024 (b)(c)	2.100	2.093	0,04
UBS Group AG								5,458 % fällig am 25.01.2024 (b)(c)	7.800	7.774	0,15
2,593 % fällig am 11.09.2025	850	832	0,02	AKTIEN				5,473 % fällig am 27.02.2024 (b)(c)	14.200	14.083	0,27
2,746 % fällig am 11.02.2033 (h)	11.570	9.497	0,18	VORZUGSWERTPAPIERE				5,479 % fällig am 18.01.2024 (b)(c)	23.200	23.146	0,45
3,091 % fällig am 14.05.2032 (h)	4.500	3.835	0,07	Nationwide Building Society				5,480 % fällig am 04.01.2024 (b)(c)	4.000	3.999	0,08
3,750 % fällig am 26.03.2025	700	686	0,01	10,250 %	566.146	94.035	1,83	5,486 % fällig am 20.02.2024 (b)(c)	15.200	15.091	0,29
3,869 % fällig am 12.01.2029	300	283	0,01	Summe Großbritannien		1.099.026	21,40	5,489 % fällig am 23.01.2024 (b)(c)	80.600	80.353	1,56
4,194 % fällig am 01.04.2031 (h)	36.000	33.552	0,65					5,514 % fällig am 30.01.2024 (b)(c)	28.700	28.582	0,56
4,282 % fällig am 09.01.2028	300	291	0,01					5,517 % fällig am 06.02.2024 (a)(b)(c)	31.400	31.239	0,61
4,375 % fällig am 10.02.2031 (d)(f)(h)	35.835	28.391	0,55	USA				Summe kurzfristige Instrumente	585.302	11,39	
4,375 % fällig am 10.02.2031 (d)(f)	4.900	3.882	0,08	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Summe übertragbare Wertpapiere	\$ 5.268.327	102,55	
4,550 % fällig am 17.04.2026	200	197	0,00	Bank of America Corp.				AKTIEN			
4,875 % fällig am 12.02.2027 (d)(f)	41.000	37.032	0,72	4,376 % fällig am 27.04.2028	\$ 1.000	978	0,02	INVESTMENTFONDS			
4,875 % fällig am 12.02.2027 (d)(f)(h)	41.600	37.574	0,73	4,948 % fällig am 22.07.2028	400	400	0,01	ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
5,959 % fällig am 12.01.2034 (h)	5.400	5.587	0,11	5,202 % fällig am 25.04.2029	25.400	25.573	0,50	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e)	14.763	147	0,00
5,959 % fällig am 12.01.2034	700	724	0,01	Summe Schweiz		247.167	4,81	Summe Investmentfonds	\$ 147	0,00	
6,373 % fällig am 15.07.2026	850	860	0,02								
6,442 % fällig am 11.08.2028	2.500	2.598	0,05	GROSSBRITANNIEN							
6,537 % fällig am 12.08.2033 (h)	11.050	11.799	0,23	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL							
7,750 % fällig am 01.03.2029	€ 11.600	14.785	0,29	Barclays PLC							
9,016 % fällig am 15.11.2033 (h)	\$ 650	799	0,02	2,894 % fällig am 15.12.2025 (d)(f)	18.783	17.989	0,35				
9,250 % fällig am 13.11.2028 (d)(f)	19.050	20.598	0,40	7,125 % fällig am 15.06.2025 (d)(f)	£ 34.150	42.452	0,83				
9,250 % fällig am 13.11.2033 (d)(f)	17.700	19.661	0,38	8,000 % fällig am 15.06.2024 (d)(f)	\$ 45.824	45.624	0,89				
Summe Schweiz		247.167	4,81	9,250 % fällig am 15.09.2028 (d)(f)	£ 18.800	23.946	0,47				
				9,625 % fällig am 15.12.2029 (d)(f)	\$ 36.950	38.474	0,75				
				Bupa Finance PLC							
				4,000 % fällig am 24.09.2031 (d)(f)	£ 6.600	5.676	0,11				
				HSBC Holdings PLC							
				2,804 % fällig am 24.05.2032	\$ 200	167	0,00				
				5,875 % fällig am 28.09.2026 (d)(f)	£ 200	243	0,01				
				6,000 % fällig am 22.05.2027 (d)(f)	\$ 18.600	17.811	0,35				
				6,161 % fällig am 09.03.2029	20.000	20.665	0,40				
				6,254 % fällig am 09.03.2034 (h)	1.000	1.063	0,02				
				6,332 % fällig am 09.03.2044 (h)	9.100	9.819	0,19				
				6,375 % fällig am 30.03.2025 (d)(f)	4.800	4.745	0,09				
				8,201 % fällig am 16.11.2034	£ 34.800	49.033	0,96				
				Lloyds Banking Group PLC							
				4,947 % fällig am 27.06.2025 (d)(f)	€ 78.622	84.928	1,65				
				7,500 % fällig am 27.06.2024 (d)(f)	\$ 23.450	23.247	0,45				
				7,500 % fällig am 27.09.2025 (d)(f)	24.591	24.143	0,47				
				7,875 % fällig am 27.06.2029 (d)(f)	£ 52.654	65.824	1,28				
				8,000 % fällig am 27.09.2029 (d)(f)	\$ 41.780	41.968	0,82				
				Deutsche Postbank Funding Trust							
				2,944 % fällig am 02.06.2024 (d)	€ 1.704	1.428	0,03				
				3,125 % fällig am 07.06.2024 (d)	12.980	10.908	0,21				
				Doctors Co. An Interinsurance Exchange							
				4,500 % fällig am 18.01.2032 (h)	\$ 3.400	2.712	0,05				
				Goldman Sachs Group, Inc.							
				3,615 % fällig am 15.03.2028	21.100	20.245	0,39				
				JPMorgan Chase & Co.							
				3,509 % fällig am 23.01.2029	200	190	0,00				
				Liberty Mutual Group, Inc.							
				3,625 % fällig am 23.05.2059	€ 15.500	\$ 16.763	0,33				
				Morgan Stanley							
				5,123 % fällig am 01.02.2029	\$ 21.443	21.553	0,42				
				5,948 % fällig am 19.01.2038 (h)	23.400	23.674	0,46				
				NextEra Energy Capital Holdings, Inc.							
				5,650 % fällig am 01.05.2079 (h)	8.224	7.758	0,15				
				Wells Fargo & Co.							
				2,393 % fällig am 02.06.2028	300	275	0,01				
				Summe USA		162.997	3,17				
				KURZFRISTIGE INSTRUMENTE							
				U.S. TREASURY BILLS							
				5,355 % fällig am 28.03.2024 (b)(c)	60.000	59.256	1,15				

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	2,600 %	29.12.2023	02.01.2024	\$ 7.572	U.S. Treasury Notes 4,875 % fällig am 30.11.2025	\$ (7.724)	\$ 7.572	\$ 7.574	0,15
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (7.724)	\$ 7.572	\$ 7.574	0,15

⁽¹⁾ Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Canada Government 10-Year Bond March Futures	Long	03/2024	215	\$ 885	0,02
Euro-Bobl March Futures	Short	03/2024	1.230	(2.630)	(0,05)
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Long	03/2024	1.170	5.513	0,11
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Short	03/2024	94	(1.179)	(0,02)
Euro-OAT France Government 10-Year Bond March Futures	Short	03/2024	1.551	(6.603)	(0,13)
Euro-Schatz March Futures	Short	03/2024	326	2	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Long	03/2024	5.017	8.023	0,16
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Short	03/2024	3.509	(7.696)	(0,15)
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03/2024	5.035	17.595	0,34
U.S. Treasury 10-Year Ultra March Futures	Long	03/2024	312	240	0,00
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Long	03/2024	155	1.235	0,02
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Long	03/2024	332	3.793	0,07
United Kingdom Long Gilt March Futures	Long	03/2024	467	4.093	0,08
				\$ 23.271	0,45
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 23.271	0,45

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	0,750 %	15.09.2051	£ 3.800	\$ 1.167	0,02
Erhalt ⁽¹⁾	1-Day GBP-SONIO	Compounded-OIS	4,250	20.03.2054	28.000	(4.585)	(0,09)
Erhalt ⁽¹⁾	1-Day GBP-SONIO	Compounded-OIS	4,500	20.03.2034	90.400	(9.163)	(0,18)
Erhalt ⁽¹⁾	1-Day GBP-SONIO	Compounded-OIS	5,000	20.03.2029	104.800	(6.553)	(0,13)
Zahlung ⁽¹⁾	1-Day GBP-SONIO	Compounded-OIS	5,500	20.03.2026	21.300	678	0,02
Erhalt	1-Day USD-SOFR	Compounded-OIS	4,250	20.12.2025	\$ 59.300	(368)	(0,01)
Erhalt ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR		2,750	20.03.2054	€ 63.600	(7.235)	(0,14)
						\$ (26.059)	(0,51)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						\$ (26.059)	(0,51)

⁽¹⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

DEWISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	01/2024	AUD	952	\$ 630	\$ 0	\$ (20)	0,00	
	01/2024	£	28.241	35.826	0	(177)	0,00	
	02/2024	\$	42	CNY 295	0	0	0,00	
BPS	01/2024	€	1.539.682	\$ 1.694.164	0	(7.037)	(0,15)	
	01/2024	£	88.458	112.058	5	(717)	(0,02)	
	01/2024	\$	1.109	CAD 1.491	22	0	0,00	
	01/2024		24.261	€ 22.217	314	(28)	286	0,01
CBK	02/2024		74	CNY 526	0	0	0,00	
	01/2024	€	7.419	\$ 8.124	0	(73)	(0,00)	
	01/2024	£	3.899	4.936	0	(34)	(0,00)	
	01/2024	\$	12.507	€ 11.452	149	(2)	147	0,00
DUB	01/2024		5.539	£ 4.368	30	0	30	0,00
	03/2024	SGD	1.829	\$ 1.382	0	(10)	(10)	0,00
GLM	01/2024	CAD	22.312	16.418	0	(504)	(0,01)	

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

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	01/2024	\$ 3.379	£ 2.652	\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,00
JPM	03/2024	145	SGD 192	1	0	1	0,00
MBC	01/2024	€ 304.960	\$ 333.440	0	(3.511)	(3.511)	(0,07)
	01/2024	£ 7.991	10.077	0	(110)	(110)	0,00
	01/2024	\$ 21.565	€ 19.708	211	0	211	0,00
	01/2024	2.552	£ 2.008	8	0	8	0,00
MYI	01/2024	€ 4.020	\$ 4.465	24	0	24	0,00
	01/2024	£ 706	902	2	0	2	0,00
	01/2024	\$ 243	€ 219	0	(1)	(1)	0,00
	01/2024	2.276	£ 1.796	15	(2)	13	0,00
	01/2024	61	SGD 81	0	0	0	0,00
	02/2024	44	CNY 308	0	0	0	0,00
SCX	01/2024	24.261	£ 19.300	344	0	344	0,01
	01/2024	2	SGD 2	0	0	0	0,00
UAG	01/2024	€ 106	\$ 115	0	(3)	(3)	0,00
	01/2024	£ 386.823	489.468	0	(3.670)	(3.670)	(0,07)
	01/2024	SEK 4.575	443	0	(11)	(11)	0,00
				\$ 1.127	\$ (15.910)	\$ (14.783)	(0,30)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilsklassen 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	01/2024	\$ 32.079	AUD 48.379	\$ 939	\$ 0	\$ 939	0,02
BOA	01/2024	2.438	3.685	78	0	78	0,00
BPS	01/2024	AUD 572	\$ 389	1	(2)	(1)	0,00
	01/2024	\$ 113	AUD 168	1	0	1	0,00
BRC	01/2024	AUD 184	\$ 121	0	(5)	(5)	0,00
CBK	01/2024	350	231	0	(7)	(7)	0,00
	01/2024	\$ 598	AUD 885	6	0	6	0,00
GLM	01/2024	AUD 369	\$ 247	0	(4)	(4)	0,00
MBC	01/2024	25	17	0	0	0	0,00
	01/2024	\$ 12.133	AUD 18.301	357	0	357	0,01
RYL	01/2024	AUD 167	\$ 112	0	(2)	(2)	0,00
UAG	01/2024	\$ 15.435	AUD 23.264	442	0	442	0,01
				\$ 1.824	\$ (20)	\$ 1.804	0,04

Zum 31. Dezember 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	01/2024	BRL 18.667	\$ 3.806	\$ 0	\$ (37)	\$ (37)	0,00
	01/2024	\$ 3.771	BRL 18.558	49	0	49	0,00
	02/2024	3.806	18.745	47	0	47	0,00
BPS	01/2024	BRL 827	\$ 169	0	(1)	(1)	0,00
	01/2024	\$ 570	BRL 2.783	3	0	3	0,00
	02/2024	133	650	1	0	1	0,00
CBK	01/2024	BRL 20.824	\$ 4.216	0	(71)	(71)	0,00
	01/2024	\$ 4.335	BRL 21.286	48	0	48	0,00
	02/2024	4.207	20.866	81	0	81	0,00
GLM	01/2024	BRL 1.934	\$ 401	3	0	3	0,00
	01/2024	\$ 472	BRL 2.333	8	0	8	0,00
	02/2024	400	1.934	0	(2)	(2)	0,00
JPM	01/2024	BRL 24.565	\$ 4.982	0	(74)	(74)	0,00
	01/2024	\$ 4.387	BRL 21.374	13	0	13	0,00
	02/2024	4.170	20.620	68	0	68	0,00
UAG	01/2024	99	482	0	0	0	0,00
				\$ 321	\$ (185)	\$ 136	0,00

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilsklasse Investor CAD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	01/2024	\$ 918	CAD 1.249	\$ 29	\$ 0	\$ 29	0,00
CBK	01/2024	23	31	0	0	0	0,00
GLM	01/2024	CAD 46	\$ 35	0	0	0	0,00
	01/2024	\$ 1.007	CAD 1.369	31	0	31	0,00
MBC	01/2024	114	154	3	0	3	0,00
MYI	01/2024	CAD 46	\$ 35	0	0	0	0,00
	01/2024	\$ 92	CAD 121	0	0	0	0,00
UAG	01/2024	1.011	1.371	29	0	29	0,00
				\$ 92	\$ 0	\$ 92	0,00

Zum 31. Dezember 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	01/2024	CHF 31	\$ 36	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
BRC	01/2024	453	524	0	(15)	(15)	0,00
	01/2024	\$ 1.770	CHF 1.544	65	0	65	0,00
CBK	01/2024	CHF 69	\$ 79	0	(3)	(3)	0,00
	01/2024	\$ 14.580	CHF 12.701	519	0	519	0,01
GLM	01/2024	CHF 41	\$ 48	0	(1)	(1)	0,00
	01/2024	\$ 15.568	CHF 13.642	650	0	650	0,02
MYI	01/2024	15.706	13.710	592	0	592	0,01
				\$ 1.826	\$ (20)	\$ 1.806	0,04

Zum 31. Dezember 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
BPS	01/2024	€ 9.956	\$ 10.788	\$ 0	\$ (213)	\$ (213)	0,00
	01/2024	\$ 801.692	€ 728.946	3.757	(32)	3.725	0,07
BRC	01/2024	698.011	634.682	3.252	0	3.252	0,06
CBK	01/2024	€ 8.445	\$ 9.282	11	(61)	(50)	0,00
	01/2024	\$ 6.318	€ 5.744	29	0	29	0,00
MBC	01/2024	€ 13.691	\$ 14.948	0	(180)	(180)	0,00
	01/2024	\$ 644.683	€ 589.546	6.711	0	6.711	0,13
				\$ 13.760	\$ (486)	\$ 13.274	0,26

Zum 31. Dezember 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	01/2024	£ 10	\$ 13	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01/2024	\$ 7.682	£ 6.062	46	0	46	0,00
BPS	01/2024	£ 8	\$ 10	0	0	0	0,00
	01/2024	\$ 8.398	£ 6.621	42	0	42	0,00
BRC	01/2024	146	116	1	0	1	0,00
CBK	01/2024	£ 329	\$ 417	0	(3)	(3)	0,00
	01/2024	\$ 23	£ 18	0	0	0	0,00
GLM	01/2024	64	50	0	0	0	0,00
MBC	01/2024	£ 1.151	\$ 1.464	0	(4)	(4)	(0,01)
	01/2024	\$ 1.159	£ 914	6	0	6	0,00
MYI	01/2024	£ 215	\$ 275	1	0	1	0,00
SCX	01/2024	\$ 48.407	£ 38.270	381	0	381	0,01
SSB	01/2024	32.046	25.396	331	0	331	0,01
UAG	01/2024	£ 56	\$ 70	0	(1)	(1)	0,00
	01/2024	\$ 48.397	£ 38.242	355	0	355	0,01
				\$ 1.163	\$ (8)	\$ 1.155	0,02

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) ausschüttend, Investor SGD (Hedged) ausschüttend, Administrative SGD (Hedged) ausschüttend II und M Retail 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
DUB	01/2024	\$ 23.418	SGD 31.129	\$ 188	\$ 0	\$ 188	0,00
GLM	01/2024	SGD 411	\$ 308	0	(4)	(4)	0,00
	01/2024	\$ 6.468	SGD 8.687	119	0	119	0,00
JPM	01/2024	4.996	6.663	57	0	57	0,00
MBC	01/2024	SGD 558	\$ 417	0	(5)	(5)	0,00
	01/2024	\$ 613	SGD 817	7	0	7	0,00
	02/2024	SGD 76	\$ 57	0	(1)	(1)	0,00
MYI	01/2024	\$ 21.943	SGD 29.270	253	0	253	0,01
	02/2024	SGD 510	\$ 387	0	0	0	0,00
TOR	01/2024	\$ 20.933	SGD 27.930	246	0	246	0,01
	02/2024	SGD 134	\$ 101	0	0	0	0,00
				\$ 870	\$ (10)	\$ 860	0,02

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 4.344 0,08

Summe Anlagen

\$ 5.277.602 102,72

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (139.716) (2,72)

Nettovermögen

\$ 5.137.886 100,00

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

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

- * Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt
- ^ Das Wertpapier ist in Verzug.
- (a) Wertpapier 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	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Alice France S.A.	11,500 %	01.02.2027	20.12.2023	\$ 532	\$ 556	0,01
Bank of Nova Scotia	3,625	27.10.2081	29.09.2021	18.500	14.253	0,28
Deutsche Bank AG	3,729	14.01.2032	17.10.2023 - 24.01.2023	10.595	11.302	0,22
				<u>\$ 29.627</u>	<u>\$ 26.111</u>	<u>0,51</u>

- (h) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 275.063 (31. Dezember 2022: USD 627.510) wurden zum 31. Dezember 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheiten verpfändet.
- (i) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 4.406 (31. Dezember 2022: USD null) und Barmittel in Höhe von USD 8.850 (31. Dezember 2022: USD 29.992) wurden zum 31. Dezember 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 7.385 (31. Dezember 2022: USD null) und Barmittel in Höhe von USD 12.629 (31. Dezember 2022: USD 18.271) wurden zum 31. Dezember 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von USD 46.179 (31. Dezember 2022: USD 80.890) wurden zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 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	\$ 5.267.319	\$ 1.008	\$ 5.268.327
Investmentfonds	147	0	0	147
Pensionsgeschäfte	0	7.572	0	7.572
Finanzderivate ⁽³⁾	80	1.476	0	1.556
Summen	\$ 227	\$ 5.276.367	\$ 1.008	\$ 5.277.602

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

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

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

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

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
BPS	3,800 %	13.10.2023	TBD ⁽¹⁾	€ (2.013)	\$ (2.242)	(0,04)
		07.07.2023	04.01.2024	\$ (31.031)	(31.918)	(0,62)
BRC	3,950	20.09.2023	TBD ⁽¹⁾	€ (4.620)	(5.159)	(0,10)
IND	5,870	11.10.2023	11.10.2024	\$ (28.999)	(29.387)	(0,57)
JPS	6,010	03.10.2023	03.01.2024	(28.876)	(29.310)	(0,57)
	6,010	28.11.2023	03.01.2024	(1.919)	(1.930)	(0,04)
	6,010	07.12.2023	03.01.2024	(11.613)	(11.661)	(0,23)
MYI	3,500	16.10.2023	TBD ⁽¹⁾	€ (12.002)	(13.355)	(0,26)

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften		
							% des Nettovermögens
RCE	4,500 %	25.09.2023	TBD ⁽¹⁾	\$ (2.346)	\$ (2.375)	(0,05)	
SCX	5,880	10.11.2023	8.02.2024	(51.882)	(52.323)	(1,02)	
WFS	5,870	11.10.2023	9.01.2024	(51.852)	(52.545)	(1,02)	
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (232.205)	(4,52)	

⁽¹⁾ Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
AZD	\$ 939	\$ (980)	\$ (41)	\$ 137	\$ 0	\$ 137
BOA	(14)	0	(14)	1.028	(1.010)	18
BPS	(3.885)	8.850	4.965	(1.308)	1.490	182
BRC	3.327	(7.000)	(3.673)	37	(10)	27
CBK	619	(610)	9	6.857	(6.830)	27
DUB	178	0	178	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	298	(320)	(22)	352	(400)	(48)
GST	k. A.	k. A.	k. A.	(268)	262	(6)
JPM	65	0	65	175	(340)	(165)
MBC	3.492	(5.190)	(1.698)	14.804	(13.250)	1.554
MYI	884	(980)	(96)	771	(650)	121
RBC	k. A.	k. A.	k. A.	34	0	34
RYL	(2)	0	(2)	k. A.	k. A.	k. A.
SCX	725	(960)	(235)	(28.111)	26.890	(1.221)
SSB	331	(450)	(119)	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	246	0	246	(140)	1.350	1.210
UAG	(2.859)	4.406	1.547	(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. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	93,20	82,69
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	8,76	24,44
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,59	k. A.
Investmentfonds	0,00	0,00
Pensionsgeschäfte	0,15	0,18
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,45	0,42
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,51)	0,05
Freiverkehrsfinanzderivate	0,08	(0,10)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(4,52)	(10,11)

* Gemäß der Liste der Märkte, die in Anhang 1 zum Prospekt aufgeführt sind und die Kriterien für gemäß OGAW-Vorschriften geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Österreich	1,55	1,85
Belgien	2,61	1,41
Kanada	1,31	1,20
Cayman-Inseln	k. A.	0,11
China	k. A.	0,01
Dänemark	0,06	0,44
Finnland	0,87	0,82
Frankreich	12,53	13,26
Deutschland	2,70	3,81
Hongkong	k. A.	0,12
Irland	3,99	3,56
Israel	k. A.	0,26
Italien	8,60	7,66
Japan	1,21	k. A.
Jersey, Kanalinseln	1,82	1,51
Luxemburg	k. A.	0,64
Mexiko	k. A.	0,71
Niederlande	12,89	15,07
Norwegen	k. A.	0,36
Portugal	0,34	0,16
Slowenien	0,51	0,60
Spanien	10,31	8,65
Schweden	0,48	0,72

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Schweiz	4,81	7,67
Großbritannien	21,40	18,81
USA	3,17	1,51
Kurzfristige Instrumente	11,39	16,21
Investmentfonds	0,00	0,00
Pensionsgeschäfte	0,15	0,18
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,45	0,42
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	k. A.	(0,03)
Zinsswaps	(0,51)	0,08
Freiverkehrsfinanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	k. A.	(0,04)
Devisenterminkontrakte	(0,30)	(1,11)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,38	1,05
Sonstige Aktiva und Passiva	(2,72)	(7,68)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (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	\$ 272	0,11
Lendlease Finance Ltd.			
3,400 % fällig am 27.10.2027	930	577	0,22
3,700 % fällig am 31.03.2031	200	112	0,04
Summe Australien		961	0,37
ÖSTERREICH			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
UniCredit Bank Austria AG			
3,125 % fällig am 21.09.2029	€ 600	674	0,25
STAATSEMISSIONEN			
Austria Government International Bond			
1,850 % fällig am 23.05.2049	750	678	0,26
Summe Österreich		1.352	0,51
BELGIEN			
STAATSEMISSIONEN			
Belgium Government International Bond			
2,750 % fällig am 22.04.2039	700	755	0,29
Ministeries van de Vlaamse Gemeenschap			
3,250 % fällig am 12.01.2043	500	548	0,21
Summe Belgien		1.303	0,50
BRASILIEN			
STAATSEMISSIONEN			
Brazil Government International Bond			
6,250 % fällig am 18.03.2031	\$ 200	208	0,08
KANADA			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Brookfield Property Finance ULC			
7,125 % fällig am 13.02.2028 (d)	CAD 700	522	0,20
STAATSEMISSIONEN			
Canada Government International Bond			
2,250 % fällig am 01.12.2029	6.400	4.647	1,77
Summe Kanada		5.169	1,97
CHILE			
STAATSEMISSIONEN			
Chile Government International Bond			
0,830 % fällig am 02.07.2031	€ 2.100	1.926	0,73
3,500 % fällig am 15.04.2053	\$ 400	302	0,12
Summe Chile		2.228	0,85
ZYPERN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Atrium Finance PLC			
2,625 % fällig am 05.09.2027	€ 1.100	948	0,36
TSCHECHISCHE REPUBLIK			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
UniCredit Bank Czech Republic & Slovakia A/S			
3,750 % fällig am 20.06.2028	600	678	0,26
DÄNEMARK			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
AP Møller - Maersk A/S			
5,875 % fällig am 14.09.2033	\$ 1.000	1.044	0,40
Danske Bank A/S			
4,750 % fällig am 21.06.2030	€ 700	816	0,31
TDC Net A/S			
5,618 % fällig am 06.02.2030	1.900	2.170	0,83
Summe Dänemark		4.030	1,54

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
FINNLAND			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Nokia Oyj			
4,375 % fällig am 21.08.2031	€ 500	\$ 556	0,21
Nordea Bank Abp			
6,000 % fällig am 02.06.2026	£ 1.800	2.320	0,88
Tornator Oyj			
1,250 % fällig am 14.10.2026	€ 200	207	0,08
		3.083	1,17
STAATSEMISSIONEN			
Kuntarahoitus Oyj			
3,000 % fällig am 25.09.2028	500	566	0,22
Summe Finnland		3.649	1,39
FRANKREICH			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
AXA S.A.			
5,500 % fällig am 11.07.2043	400	474	0,18
Banque Federative du Credit Mutuel S.A.			
0,250 % fällig am 29.06.2028	100	97	0,04
BNP Paribas S.A.			
1,675 % fällig am 30.06.2027	\$ 500	458	0,18
4,625 % fällig am 25.02.2031 (b)(c)	1.000	808	0,31
CNP Assurances SACA			
2,000 % fällig am 27.07.2050	€ 200	192	0,07
4,875 % fällig am 07.10.2030 (b)(c)	\$ 800	630	0,24
Credit Agricole S.A.			
0,125 % fällig am 09.12.2027	€ 100	98	0,04
4,375 % fällig am 27.11.2033	800	930	0,35
6,316 % fällig am 03.10.2029	\$ 500	524	0,20
Ile-de-France Mobilites			
0,400 % fällig am 28.05.2031	€ 800	749	0,29
Kering S.A.			
5,125 % fällig am 23.11.2026	£ 1.500	1.952	0,74
SEB S.A.			
1,375 % fällig am 16.06.2025	€ 600	638	0,24
Societe Generale S.A.			
0,625 % fällig am 02.12.2027	1.200	1.216	0,46
		8.766	3,34
STAATSEMISSIONEN			
Agence Francaise de Developpement			
1,375 % fällig am 17.09.2024	1.000	1.088	0,42
3,500 % fällig am 25.02.2033	800	928	0,35
France Government International Bond			
0,500 % fällig am 25.06.2044	850	589	0,22
Regie Autonome des Transports Parisiens			
3,250 % fällig am 11.04.2033	1.400	1.585	0,60
Region of Ile de France			
3,050 % fällig am 03.02.2033	200	225	0,09
Societe Du Grand Paris EPIC			
0,300 % fällig am 25.11.2031	1.900	1.735	0,66
1,000 % fällig am 18.02.2070	100	49	0,02
3,500 % fällig am 25.05.2043	500	562	0,21
Societe Nationale SNCF S.A.			
0,625 % fällig am 17.04.2030	800	775	0,30
3,375 % fällig am 25.05.2033	800	916	0,35
		8.452	3,22
Summe Frankreich		17.218	6,56
DEUTSCHLAND			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Amprion GmbH			
3,875 % fällig am 07.09.2028	400	456	0,17
Commerzbank AG			
3,000 % fällig am 14.09.2027	500	541	0,21
3,375 % fällig am 12.12.2025	700	780	0,30
5,250 % fällig am 25.03.2029	100	116	0,04
Deutsche Bahn Finance GmbH			
3,250 % fällig am 19.05.2033	600	685	0,26
Deutsche Bank AG			
1,875 % fällig am 23.02.2028	1.900	1.975	0,75

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau			
1,375 % fällig am 07.06.2032	€ 15.600	\$ 15.787	6,02
2,000 % fällig am 15.11.2029	10.400	11.225	4,28
Landwirtschaftliche Rentenbank			
3,250 % fällig am 26.09.2033	1.200	1.403	0,54
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen			
1,000 % fällig am 26.05.2042	700	612	0,23
ZF Finance GmbH			
2,000 % fällig am 06.05.2027	800	819	0,31
2,250 % fällig am 03.05.2028	600	610	0,23
		35.009	13,34
STAATSEMISSIONEN			
Bundesrepublik Deutschland			
0,000 % fällig am 15.08.2031 (a)	1.400	1.340	0,51
Land Nordrhein-Westfalen			
0,000 % fällig am 12.10.2035 (a)	20	16	0,01
		1.356	0,52
Summe Deutschland		36.365	13,86
INDIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
JSW Hydro Energy Ltd.			
4,125 % fällig am 18.05.2031	\$ 1.127	983	0,37
ReNew Wind Energy AP2			
4,500 % fällig am 14.07.2028	1.700	1.513	0,58
Summe Indien		2.496	0,95
IRLAND			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
AIB Group PLC			
2,875 % fällig am 30.05.2031	€ 600	636	0,24
4,625 % fällig am 23.07.2029	1.300	1.484	0,57
Bank of Ireland Group PLC			
5,000 % fällig am 04.07.2031	400	473	0,18
7,594 % fällig am 06.12.2032	€ 600	798	0,30
Smurfit Kappa Treasury ULC			
0,500 % fällig am 22.09.2029	€ 1.000	947	0,36
Zurich Finance Ireland Designated Activity Co.			
3,000 % fällig am 19.04.2051	\$ 650	529	0,20
3,500 % fällig am 02.05.2052	1.200	986	0,38
Summe Irland		5.853	2,23
ITALIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Ferrovie dello Stato Italiane SpA			
3,750 % fällig am 14.04.2027	€ 1.200	1.340	0,51
UniCredit SpA			
5,850 % fällig am 15.11.2027	2.200	2.576	0,98
		3.916	1,49
STAATSEMISSIONEN			
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro			
1,500 % fällig am 30.04.2045	1.050	734	0,28
4,000 % fällig am 30.10.2031	400	460	0,18
		1.194	0,46
Summe Italien		5.110	1,95
JAPAN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.			
0,848 % fällig am 19.07.2029	800	793	0,30
Norinchukin Bank			
2,080 % fällig am 22.09.2031	\$ 1.000	820	0,31
4,867 % fällig am 14.09.2027	600	600	0,23
NTT Finance Corp.			
0,399 % fällig am 13.12.2028	€ 1.300	1.278	0,49
4,239 % fällig am 25.07.2025	\$ 2.900	2.870	1,09
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.			
2,472 % fällig am 14.01.2029	1.300	1.158	0,44
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.			
2,800 % fällig am 10.03.2027	800	750	0,29
Summe Japan		8.269	3,15

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

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
JERSEY, KANALINSELN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Aptiv PLC 3,100 % fällig am 01.12.2051	\$ 200	\$ 131	0,05
LUXEMBURG			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Acef Holding S.C.A. 0,750 % fällig am 14.06.2028	€ 1.600	1.524	0,58
CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV- SIF Pan European Core Fund 0,500 % fällig am 27.01.2028	1.200	1.174	0,45
0,900 % fällig am 12.10.2029	1.000	920	0,35
CPI Property Group S.A. 1,750 % fällig am 14.01.2030	100	63	0,02
2,750 % fällig am 22.01.2028	£ 400	359	0,14
Prologis International Funding S.A. 0,750 % fällig am 23.03.2033	€ 475	402	0,15
0,875 % fällig am 09.07.2029	125	122	0,05
1,625 % fällig am 17.06.2032	1.425	1.326	0,51
3,625 % fällig am 07.03.2030	200	220	0,08
Segro Capital SARRL 0,500 % fällig am 22.09.2031	1.000	870	0,33
SELP Finance SARRL 0,875 % fällig am 27.05.2029	1.500	1.414	0,54
Summe Luxemburg		8.394	3,20
MAURITIUS			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
India Green Power Holdings 4,000 % fällig am 22.02.2027	\$ 400	368	0,14
MEXIKO			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Nemak S.A.B. de C.V. 2,250 % fällig am 20.07.2028	€ 1.000	983	0,37
MULTINATIONAL			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 2,000 % fällig am 01.09.2028	500	492	0,19
3,000 % fällig am 01.09.2029	150	134	0,05
NXP BV 2,500 % fällig am 11.05.2031	\$ 1.200	1.020	0,39
Summe multinational		1.646	0,63
NIEDERLANDE			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
ABN AMRO Bank NV 2,470 % fällig am 13.12.2029	2.400	2.114	0,81
Arcadis NV 4,875 % fällig am 28.02.2028	€ 400	458	0,17
ASR Nederland NV 3,625 % fällig am 12.12.2028	400	448	0,17
CTP NV 1,250 % fällig am 21.06.2029	2.000	1.834	0,70
Digital Intrepid Holding BV 0,625 % fällig am 15.07.2031	1.500	1.303	0,50
DSV Finance BV 0,500 % fällig am 03.03.2031	500	463	0,18
EnBW International Finance BV 4,300 % fällig am 23.05.2034	300	351	0,13
Enel Finance International NV 1,375 % fällig am 12.07.2026	\$ 1.000	911	0,35
7,500 % fällig am 14.10.2032	500	571	0,22
ING Groep NV 1,125 % fällig am 07.12.2028	£ 200	224	0,08
4,875 % fällig am 16.05.2029 (b)(c)	\$ 1.000	830	0,32
JDE Peet's NV 2,250 % fällig am 24.09.2031	1.000	802	0,31
LeasePlan Corp. NV 0,250 % fällig am 07.09.2026	€ 1.400	1.422	0,54
Lseg Netherlands BV 4,231 % fällig am 29.09.2030	500	584	0,22

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Nationale-Niederlanden Bank NV			
0,500 % fällig am 21.09.2028	€ 1.100	\$ 1.074	0,41
1,875 % fällig am 17.05.2032	200	206	0,08
NE Property BV			
2,000 % fällig am 20.01.2030	1.400	1.245	0,47
TenneT Holding BV			
4,500 % fällig am 28.10.2034	700	864	0,33
VIA Outlets BV			
1,750 % fällig am 15.11.2028	1.100	1.082	0,41
Wabtec Transportation Netherlands BV			
1,250 % fällig am 03.12.2027	1.900	1.938	0,74
		18.724	7,14
STAATSEMISSIONEN			
Niederlandse Waterschapsbank NV			
3,000 % fällig am 20.04.2033	900	1.024	0,39
Netherlands Government International Bond			
3,250 % fällig am 15.01.2044	300	369	0,14
		1.393	0,53
Summe Niederlande		20.117	7,67
NORWEGEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
DNB Bank ASA			
4,625 % fällig am 01.11.2029	400	465	0,18
SINGAPUR			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Clean Renewable Power Mauritius Pte. Ltd.			
4,250 % fällig am 25.03.2027	\$ 630	576	0,22
SÜDKOREA			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
LG Energy Solution Ltd.			
5,750 % fällig am 25.09.2028	300	310	0,12
STAATSEMISSIONEN			
Korea Water Resources Corp.			
3,500 % fällig am 27.04.2025	700	686	0,26
Summe Südkorea		996	0,38
SPANIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Acciona Energia Financiacion Filiales S.A.			
5,125 % fällig am 23.04.2031	€ 400	467	0,18
Banco Santander S.A.			
0,625 % fällig am 24.06.2029	900	881	0,34
CaixaBank S.A.			
0,500 % fällig am 09.02.2029	100	98	0,04
1,500 % fällig am 03.12.2026	£ 600	713	0,27
3,750 % fällig am 07.09.2029	€ 1.900	2.156	0,82
Caja Rural de Navarra SCC			
3,000 % fällig am 26.04.2027	2.100	2.324	0,89
EDP Servicios Financieros Espana S.A.			
4,375 % fällig am 04.04.2032	1.300	1.533	0,58
Telefonica Emisiones S.A.			
4,183 % fällig am 21.11.2033	500	581	0,22
		8.753	3,34
STAATSEMISSIONEN			
Autonomous Community of Madrid			
3,596 % fällig am 30.04.2033	300	344	0,13
Spain Government International Bond			
1,000 % fällig am 30.07.2042	1.700	1.257	0,48
Xunta de Galicia			
0,084 % fällig am 30.07.2027	50	50	0,02
		1.651	0,63
Summe Spanien		10.404	3,97
SUPRANATIONAL			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Eurofima Europäische Gesellschaft fuer die Finanzierung von Eisenbahnmaterial			
0,000 % fällig am 28.07.2026 (a)	100	103	0,04

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
0,010 % fällig am 23.06.2028	€ 2.000	\$ 1.974	0,75
0,150 % fällig am 10.10.2034	500	421	0,16
3,125 % fällig am 09.11.2031	800	915	0,35
Europäische Investitionsbank			
0,750 % fällig am 15.07.2027	AUD 500	304	0,12
1,500 % fällig am 15.06.2032	€ 5.600	5.704	2,17
2,250 % fällig am 15.03.2030	1.230	1.345	0,51
3,750 % fällig am 14.02.2033	\$ 5.000	4.906	1,87
Europäische Union			
0,000 % fällig am 04.10.2030 (a)	€ 1.400	1.314	0,50
0,300 % fällig am 04.11.2050	100	57	0,02
0,400 % fällig am 04.02.2037	800	654	0,25
2,625 % fällig am 04.02.2048	900	926	0,35
2,750 % fällig am 04.02.2033	600	672	0,26
Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung			
2,125 % fällig am 03.03.2025	\$ 1.000	971	0,37
International Development Association			
0,750 % fällig am 21.09.2028	£ 1.450	1.618	0,62
Summe Supranational		21.884	8,34
SCHWEDEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Castellum AB			
0,750 % fällig am 04.09.2026	€ 1.100	1.101	0,42
EQT AB			
0,875 % fällig am 14.05.2031	1.200	1.058	0,40
		2.159	0,82
STAATSEMISSIONEN			
Kommuninvest Sverige AB			
3,125 % fällig am 08.12.2027	500	568	0,22
3,375 % fällig am 15.03.2027	200	227	0,09
Svensk Exportkredit AB			
2,000 % fällig am 30.06.2027	1.100	1.188	0,45
		1.983	0,76
Summe Schweden		4.142	1,58
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Masdar Abu Dhabi Future Energy Co.			
4,875 % fällig am 25.07.2033	\$ 600	596	0,23
GROSSBRITANNIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Assura Financing PLC			
1,625 % fällig am 30.06.2033	£ 1.100	1.052	0,40
Berkeley Group PLC			
2,500 % fällig am 11.08.2031	1.300	1.283	0,49
British Land Co. PLC			
2,375 % fällig am 14.09.2029	1.400	1.543	0,59
Burberry Group PLC			
1,125 % fällig am 21.09.2025	600	717	0,27
Chanel Ceres PLC			
1,000 % fällig am 31.07.2031	€ 2.200	2.050	0,78
Compass Group PLC			
4,375 % fällig am 08.09.2032	£ 900	1.159	0,44
Derwent London PLC			
1,875 % fällig am 17.11.2031	1.200	1.219	0,47
DS Smith PLC			
4,375 % fällig am 27.07.2027	€ 400	455	0,17
Grainger PLC			
3,375 % fällig am 24.04.2028	£ 700	824	0,31
Land Securities Capital Markets PLC			
4,875 % fällig am 15.09.2034	500	656	0,25
London & Quadrant Housing Trust			
2,000 % fällig am 31.03.2032	400	416	0,16
Marks & Spencer PLC			
4,500 % fällig am 10.07.2027	300	370	0,14
National Grid PLC			
3,875 % fällig am 16.01.2029	€ 300	341	0,13
NatWest Group PLC			
2,057 % fällig am 09.11.2028	£ 1.200	1.367	0,52
Santander UK Group Holdings PLC			
2,896 % fällig am 15.03.2032	\$ 2.400	2.051	0,78

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	
Severn Trent Utilities Finance PLC 2,625 % fällig am 22.02.2033	£ 600	\$ 644	0,25	Community Preservation Corp. 2,867 % fällig am 01.02.2030	\$ 360	\$ 316	0,12	Public Service Co. of Colorado 2,700 % fällig am 15.01.2051	\$ 75	\$ 47	0,02	
South Eastern Power Networks PLC 1,750 % fällig am 30.09.2034	2.100	2.033	0,78	Continental Wind LLC 6,000 % fällig am 28.02.2033	518	528	0,20	3,200 % fällig am 01.03.2050	425	306	0,12	
SSE PLC 4,000 % fällig am 05.09.2031	€ 600	694	0,26	Crown Cork & Seal Co., Inc. 7,375 % fällig am 15.12.2026	725	762	0,29	Public Service Electric & Gas Co. 4,650 % fällig am 15.03.2033	1.100	1.101	0,42	
Standard Chartered PLC 0,800 % fällig am 17.11.2029	1.800	1.732	0,66	Farmers Exchange Capital 5,454 % fällig am 15.10.2054	30	25	0,01	Solar Star Funding LLC 5,375 % fällig am 30.06.2035	933	927	0,35	
Travis Perkins PLC 3,750 % fällig am 17.02.2026 (e)	£ 1.100	1.324	0,51	Ford Motor Co. 3,250 % fällig am 12.02.2032	200	166	0,06	Southern California Edison Co. 2,500 % fällig am 01.06.2031	1.000	858	0,33	
Vodafone Group PLC 5,125 % fällig am 04.06.2081	\$ 950	719	0,27	Gap, Inc. 3,625 % fällig am 01.10.2029	1.000	856	0,33	Southwestern Public Service Co. 3,150 % fällig am 01.05.2050	450	309	0,12	
Workspace Group PLC 2,250 % fällig am 11.03.2028	£ 400	438	0,17	HAT Holdings LLC 6,000 % fällig am 15.04.2025	500	499	0,19	3,750 % fällig am 15.06.2049	400	307	0,12	
Zenith Finco PLC 6,500 % fällig am 30.06.2027 (e)	500	520	0,20	Host Hotels & Resorts LP 3,375 % fällig am 15.12.2029	600	539	0,20	TerraForm Power Operating LLC 5,000 % fällig am 31.01.2028	650	632	0,24	
		23.607	9,00	3,500 % fällig am 15.09.2030	1.575	1.406	0,54	Topaz Solar Farms LLC 5,750 % fällig am 30.09.2039	762	759	0,29	
STAATSEMISSIONEN				Hudson Pacific Properties LP 3,950 % fällig am 01.11.2027	500	419	0,16	UDR, Inc. 3,100 % fällig am 01.11.2034	150	124	0,05	
United Kingdom Gilt 0,875 % fällig am 31.07.2033	3.700	3.695	1,41	5,950 % fällig am 15.02.2028	800	708	0,27	Verizon Communications, Inc. 1,500 % fällig am 18.09.2030	3.110	2.564	0,98	
3,750 % fällig am 22.10.2053	800	953	0,36	Hyundai Capital America 5,800 % fällig am 26.06.2025	1.700	1.710	0,65	VF Corp. 4,250 % fällig am 07.03.2029	€ 400	426	0,16	
		4.648	1,77	IHG Finance LLC 4,375 % fällig am 28.11.2029	€ 800	917	0,35	Wisconsin Power & Light Co. 4,950 % fällig am 01.04.2033	\$ 600	602	0,23	
Summe Großbritannien		28.255	10,77	JPMorgan Chase & Co. 6,070 % fällig am 22.10.2027	\$ 1.300	1.338	0,51	Wisconsin Public Service Corp. 2,850 % fällig am 01.12.2051	450	298	0,11	
USA				Kilroy Realty LP 2,500 % fällig am 15.11.2032	700	531	0,20			41.932	15,99	
FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				2,650 % fällig am 15.11.2033	100	76	0,03	KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL				
GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2,100 % fällig am 20.05.2048	\$ 972	751	0,29	MidAmerican Energy Co. 2,700 % fällig am 01.08.2052	950	616	0,23	New York City Municipal Water Finance Authority Revenue Bonds, (BABs), Series 2010	5,724 % fällig am 15.06.2042	170	186	0,07
4,000 % fällig am 20.04.2049	969	853	0,33	3,650 % fällig am 01.08.2048	750	596	0,23	New York City Municipal Water Finance Authority Revenue Bonds, Series 2010	5,882 % fällig am 15.06.2044	110	123	0,05
4,950 % fällig am 20.07.2049	1.801	1.658	0,63	4,250 % fällig am 15.07.2049	400	349	0,13	State Board of Administration Finance Corp., Florida Revenue Notes, Series 2020	2,154 % fällig am 01.07.2030	170	145	0,05
5,520 % fällig am 22.02.2055	657	643	0,24	Mississippi Power Co. 3,100 % fällig am 30.07.2051	900	605	0,23			454	0,17	
Loanpal Solar Loan Ltd. 2,220 % fällig am 20.03.2048	561	419	0,16	Moody's Corp. 2,000 % fällig am 19.08.2031	300	249	0,09	US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				
		4.324	1,65	3,100 % fällig am 29.11.2061	840	569	0,22	Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.10.2053	6.371	6.304	2,40	
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				MSCI, Inc. 3,250 % fällig am 15.08.2033	200	167	0,06	US-SCHATZ OblIGATIONEN				
AES Corp. 2,450 % fällig am 15.01.2031	300	252	0,10	4,000 % fällig am 15.11.2029	100	94	0,03	U.S. Treasury Notes 4,125 % fällig am 31.07.2028	1.200	1.213	0,46	
5,450 % fällig am 01.06.2028	700	712	0,27	New York State Electric & Gas Corp. 2,150 % fällig am 01.10.2031	1.100	877	0,33	Summe USA		54.227	20,67	
Alexandria Real Estate Equities, Inc. 2,000 % fällig am 18.05.2032	1.100	883	0,34	5,650 % fällig am 15.08.2028	2.300	2.360	0,90	JUNGFERNINSELN (BRITISCH)				
Amgen, Inc. 3,000 % fällig am 22.02.2029	1.300	1.224	0,47	NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 1,900 % fällig am 15.06.2028	2.100	1.865	0,71	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Autodesk, Inc. 2,400 % fällig am 15.12.2031	1.000	856	0,33	Northern States Power Co. 2,250 % fällig am 01.04.2031	600	515	0,20	Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd. 6,750 % fällig am 24.04.2033	811	811	0,31	
Bank of America Corp. 2,456 % fällig am 22.10.2025	1.100	1.071	0,41	NSTAR Electric Co. 3,100 % fällig am 01.06.2051	1.070	755	0,29	Summe übertragbare Wertpapiere	\$ 249.832	95,24		
4,134 % fällig am 12.06.2028	€ 1.400	1.596	0,61	Oberlin College 2,874 % fällig am 01.10.2051	1.800	1.180	0,45					
6,204 % fällig am 10.11.2028	\$ 500	522	0,20	Pacific Gas & Electric Co. 6,700 % fällig am 01.04.2053	400	435	0,16					
Boston Properties LP 2,450 % fällig am 01.10.2033	1.020	777	0,30	PacifiCorp 2,900 % fällig am 15.06.2052	600	387	0,15					
6,500 % fällig am 15.01.2034	150	158	0,06									
CBRE Services, Inc. 2,500 % fällig am 01.04.2031	1.370	1.160	0,44									
CenterPoint Energy Houston Electric LLC 5,300 % fällig am 01.04.2053	600	629	0,24									

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft ⁽¹⁾	% des Netto- vermögens
BOS	5,420 %	29.12.2023	02.01.2024	\$ 5.800	U.S. Treasury Notes 4,000 % fällig am 28.02.2030	\$ (5.930)	\$ 5.800	\$ 5.803	2,21
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (5.930)	\$ 5.800	\$ 5.803	2,21

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03/2024	256	\$ (1.173)	(0,45)
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Short	03/2024	29	(367)	(0,14)
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Short	03/2024	16	(33)	(0,01)
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03/2024	495	1.318	0,50
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03/2024	186	767	0,29
U.S. Treasury 10-Year Ultra March Futures	Long	03/2024	102	565	0,22
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03/2024	70	(793)	(0,30)
United Kingdom Long Gilt March Futures	Short	03/2024	74	(597)	(0,23)
				\$ (313)	(0,12)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (313)	(0,12)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt ⁽¹⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,250 %	20.03.2054	£ 600	\$ (100)	(0,04)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.06.2027	\$ 6.400	(153)	(0,06)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,840	08.07.2051	100	33	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,943	15.06.2051	400	122	0,05
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,000	16.06.2026	CAD 900	(34)	(0,01)
Erhalt ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	20.03.2054	€ 1.800	(205)	(0,08)
Zahlung ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,250	20.03.2029	6.300	252	0,10
					\$ (85)	(0,03)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ (85)	(0,03)

⁽¹⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01/2024	£ 947	\$ 1.202	\$ 0	\$ (5)	\$ (5)	0,00
	01/2024	\$ 623	¥ 91.882	29	0	29	0,01
	01/2024	29	SEK 304	1	0	1	0,00
BPS	01/2024	€ 3.505	\$ 3.817	0	(56)	(56)	(0,02)
	01/2024	£ 3.125	3.963	0	(20)	(20)	(0,01)
	01/2024	\$ 208	€ 190	2	0	2	0,00
BRC	01/2024	603	¥ 88.800	27	0	27	0,01
	01/2024	€ 44.719	\$ 49.181	0	(229)	(229)	(0,09)
	01/2024	\$ 510	€ 465	4	0	4	0,00
CBK	01/2024	£ 309	\$ 392	0	(2)	(2)	0,00
	01/2024	CAD 8.351	6.145	0	(189)	(189)	(0,07)
GLM	01/2024	€ 576	630	0	(6)	(6)	0,00
	01/2024	£ 26	34	0	0	0	0,00
MYI	01/2024	SGD 26	19	0	0	0	0,00
	01/2024	\$ 20	€ 18	0	0	0	0,00
	01/2024	£ 280	219	0	0	0	0,00
RYL	01/2024	CHF 563	\$ 654	0	(15)	(15)	(0,01)
	01/2024	£ 13.537	17.122	0	(135)	(135)	(0,05)
UAG	01/2024	€ 70.359	77.393	0	(348)	(348)	(0,13)
	01/2024	£ 3.463	4.379	0	(35)	(35)	(0,01)
				\$ 63	\$ (1.040)	\$ (977)	(0,37)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 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
AZD	01/2024	\$ 683	AUD 1.025	\$ 17	\$ 0	\$ 17	0,01
BRC	01/2024	AUD 324	\$ 213	0	(8)	(8)	(0,01)

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
	01/2024	\$ 254	AUD 386	\$ 9	\$ 0	\$ 9	0,00
GLM	01/2024	61	92	2	0	2	0,00
MBC	01/2024	525	792	15	0	15	0,01
SCX	01/2024	115	170	1	0	1	0,00
				\$ 44	\$ (8)	\$ 36	0,01

Zum 31. Dezember 2023 standen fur die Anteilsklasse Institutional CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BPS	01/2024	CHF 4	\$ 5	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BRC	01/2024	\$ 35	CHF 31	1	0	1	0,00
CBK	01/2024	6	5	0	0	0	0,00
GLM	01/2024	299	262	13	0	13	0,01
MYI	01/2024	303	264	11	0	11	0,00
UAG	01/2024	274	239	10	0	10	0,00
				\$ 35	\$ 0	\$ 35	0,01

Zum 31. Dezember 2023 standen fur die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschuttend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BPS	01/2024	€ 1.027	\$ 1.123	\$ 0	\$ (12)	\$ (12)	(0,01)
	01/2024	\$ 5.651	€ 5.178	71	0	71	0,03
BRC	01/2024	44.023	40.029	205	0	205	0,08
CBK	01/2024	€ 579	\$ 638	1	(3)	(2)	0,00
	01/2024	\$ 101	€ 94	2	0	2	0,00
MBC	01/2024	€ 272	\$ 294	0	(6)	(6)	0,00
	01/2024	\$ 18	€ 17	0	0	0	0,00
MYI	01/2024	47.043	42.800	249	0	249	0,09
UAG	01/2024	47.079	42.800	212	0	212	0,08
				\$ 740	\$ (21)	\$ 719	0,27

Zum 31. Dezember 2023 standen fur die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschuttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BOA	01/2024	£ 24	\$ 31	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01/2024	\$ 4.825	£ 3.809	30	0	30	0,01
BPS	01/2024	4.487	3.538	23	0	23	0,01
BRC	01/2024	78	62	1	0	1	0,00
CBK	01/2024	£ 68	\$ 86	0	(2)	(2)	0,00
	01/2024	\$ 41	£ 33	0	0	0	0,00
GLM	01/2024	£ 6	\$ 8	0	0	0	0,00
MBC	01/2024	270	344	0	(1)	(1)	0,00
	01/2024	\$ 56	£ 44	0	0	0	0,00
MYI	01/2024	£ 2	\$ 2	0	0	0	0,00
	01/2024	\$ 69	£ 54	0	0	0	0,00
SCX	01/2024	25.778	20.380	204	0	204	0,08
SSB	01/2024	£ 20	\$ 25	0	0	0	0,00
	01/2024	\$ 16.845	£ 13.349	173	0	173	0,07
UAG	01/2024	£ 9	\$ 11	0	0	0	0,00
	01/2024	\$ 25.774	£ 20.366	189	0	189	0,07
				\$ 620	\$ (3)	\$ 617	0,24

Zum 31. Dezember 2023 standen fur die Anteilsklassen Institutional SEK (Hedged) thesaurierend und Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BOA	01/2024	SEK 6	\$ 1	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01/2024	\$ 548	SEK 5.718	19	0	19	0,01
BRC	01/2024	1	12	0	0	0	0,00
CBK	01/2024	SEK 81	\$ 8	0	0	0	(0,01)
	01/2024	\$ 73	SEK 755	2	0	2	0,00
GLM	01/2024	SEK 4	\$ 0	0	0	0	0,00
	01/2024	\$ 1	SEK 14	0	0	0	0,00
MBC	01/2024	SEK 26	\$ 3	0	0	0	0,00
	01/2024	\$ 1	SEK 5	0	0	0	0,00
SCX	01/2024	SEK 14	\$ 1	0	0	0	0,00
	01/2024	\$ 575	SEK 5.968	18	0	18	0,01
UAG	01/2024	SEK 38	\$ 4	0	0	0	0,00
	01/2024	\$ 590	SEK 6.084	14	0	14	0,01
				\$ 53	\$ 0	\$ 53	0,02

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

Zum 31. Dezember 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		
AZD	01/2024	\$	1.311	SGD	1.749	\$ 15	15	0,01	
BOA	01/2024		1.361		1.816	16	16	0,01	
GLM	01/2024	SGD	6	\$	4	0	0	0,00	
	01/2024	\$	145	SGD	194	2	2	(0,01)	
MBC	01/2024	SGD	12	\$	9	0	0	0,00	
	01/2024	\$	17	SGD	23	0	0	0,00	
	02/2024		24		31	0	0	0,00	
MYI	01/2024		1.254		1.673	14	14	0,01	
	02/2024		3		3	0	0	0,00	
UAG	01/2024		4		5	0	0	0,00	
						\$ 47	\$ 0	\$ 47	0,02
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 530	0,20		
Summe Anlagen						\$ 255.764	97,50		
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ 6.552	2,50		
Nettovermögen						\$ 262.316	100,00		

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

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

- (a) Nullkuponwertpapier.
- (b) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar
- (c) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (d) 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	\$ 522	0,20

- (e) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 623 (31. Dezember 2022: USD null) wurden zum 31. Dezember 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 3.138 (31. Dezember 2022: USD 3.781) wurden zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 50 (31. Dezember 2022: USD 4.260) wurden zum 31. Dezember 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 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	\$ 249.832	\$ 0	\$ 249.832
Pensionsgeschäfte	0	5.800	0	5.800
Finanzderivate ⁽³⁾	(2.137)	2.269	0	132
Summen	\$ (2.137)	\$ 257.901	\$ 0	\$ 255.764

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

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

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

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

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensionsgeschäften		
					% des Nettovermögens		
JML	1,000 %	14.11.2023	TBD ⁽¹⁾	£ (250)	\$ (320)	(0,12)	
	4,100	14.11.2023	TBD ⁽¹⁾	(377)	(483)	(0,19)	
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$	(803)	(0,31)

⁽¹⁾ Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement ⁽¹⁾
AZD	\$ 32	\$ 0	\$ 32	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ k. A.
BOA	90	0	90	(522)	560	38
BPS	35	0	35	(3.021)	2.670	(351)
BRC	(17)	50	33	(6)	40	34
CBK	(2)	0	(2)	1.594	(1.510)	84
DUB	k. A.	k. A.	k. A.	(1.016)	990	(26)
GLM	(172)	0	(172)	42	(110)	(68)
JPM	k. A.	k. A.	k. A.	16	0	16
MBC	2	0	2	1.318	(1.270)	48
MYI	274	(540)	(266)	43	(20)	23
RBC	k. A.	k. A.	k. A.	0	0	0
RYL	(15)	0	(15)	(113)	0	(113)
SCX	88	0	88	1.674	(1.560)	114
SSB	173	0	173	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	42	0	42	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. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	82,55	73,76
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	12,69	11,04
Pensionsgeschäfte	2,21	0,04
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,12)	12,57
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,03)	0,81
Freiverkehrsfinanzderivate	0,20	0,06
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,31)	0,03

*Gemäß der Liste der Märkte, die in Anhang 1 zum Prospekt aufgeführt sind und die Kriterien für gemäß OGAW-Vorschriften geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Australien	0,37	0,31
Österreich	0,51	0,21
Belgien	0,50	0,40
Brasilien	0,08	0,07
Kanada	1,97	1,62
Chile	0,85	0,70
Zypern	0,36	0,28
Tschechische Republik	0,26	k. A.
Dänemark	1,54	k. A.
Finnland	1,39	0,28
Frankreich	6,56	6,29
Deutschland	13,86	11,61
Indien	0,95	1,30
Irland	2,23	1,49
Italien	1,95	1,97
Japan	3,15	3,29
Jersey, Kanalinseln	0,05	0,36
Luxemburg	3,20	2,89
Mauritius	0,14	0,97
Mexiko	0,37	0,29
Multinational	0,63	0,87
Niederlande	7,67	8,65
Norwegen	0,18	k. A.
Singapur	0,22	0,20
Südkorea	0,38	0,31
Spanien	3,97	2,01

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Supranational	8,34	4,97
Schweden	1,58	1,20
Schweiz	k. A.	0,30
Vereinigte Arabische Emirate	0,23	k. A.
Großbritannien	10,77	8,79
USA	20,67	21,97
Jungferninseln (Britisch)	0,31	0,26
Kurzfristige Instrumente	k. A.	0,98
Pensionsgeschäfte	2,21	12,57
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,12)	0,81
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Zinsswaps	(0,03)	0,06
Freiverkehrsfinanzderivate		
Devisenterminkontrakte	(0,37)	(1,53)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,57	1,56
Sonstige Aktiva und Passiva	2,50	1,69
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Commodity Real Return Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Polaris PLC				KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL				Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust			
5,995 % fällig am 23.10.2059	£ 2.696	\$ 3.420	0,40	American Municipal Power, Inc., Ohio Revenue Bonds, Series 2010				6,500 % fällig am 25.03.2032	\$ 6	\$ 6	0,00
Towd Point Mortgage Funding PLC				7,734 % fällig am 15.02.2033	\$ 200	\$ 236	0,03	Sequoia Mortgage Trust			
6,365 % fällig am 20.10.2051	684	873	0,10	Bay Area Toll Authority, California Revenue Bonds, (BABs), Series 2010				5,872 % fällig am 20.07.2036	406	353	0,04
		4.300	0,50	6,918 % fällig am 01.04.2040	600	702	0,08	6,164 % fällig am 20.04.2035	13	12	0,00
				California State General Obligation Bonds, (BABs), Series 2009				6,170 % fällig am 19.10.2026	2	2	0,00
				7,300 % fällig am 01.10.2039	500	606	0,07	Structured Asset Mortgage Investments Trust			
				7,500 % fällig am 01.04.2034	100	122	0,02	6,050 % fällig am 19.07.2034	1	1	0,00
				7,550 % fällig am 01.04.2039	200	253	0,03	6,130 % fällig am 19.10.2034	7	7	0,00
				Los Angeles Department of Water & Power, California Revenue Bonds, Series 2010				6,170 % fällig am 19.03.2034	6	5	0,00
				5,516 % fällig am 01.07.2027	500	516	0,06	Towd Point Mortgage Trust			
				New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue Bonds, (BABs), Series 2010				2,750 % fällig am 25.10.2056	87	87	0,01
				5,508 % fällig am 01.08.2037	200	206	0,02	3,250 % fällig am 25.03.2058	448	435	0,05
				New York State Urban Development Corp. Revenue Bonds, (BABs), Series 2009				WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
				5,770 % fällig am 15.03.2039	100	103	0,01	6,090 % fällig am 25.01.2045	9	9	0,00
								6,210 % fällig am 25.01.2045	49	48	0,01
								6,250 % fällig am 25.10.2044	147	139	0,02
								6,412 % fällig am 25.06.2042	1	1	0,00
										6.786	0,79
Summe Großbritannien		94.055	10,95			2.744	0,32				
				NON-AGENCY-MBS				US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
				Banc of America Funding Trust				Fannie Mae			
				6,496 % fällig am 20.09.2034	3	3	0,00	5,188 % fällig am 01.11.2034	151	150	0,02
				BCAP LLC Trust				6,000 % fällig am 25.02.2044	4	4	0,00
				5,250 % fällig am 26.04.2037	186	106	0,01	6,022 % fällig am 25.09.2036	1	1	0,00
				Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust				6,500 % fällig am 25.06.2028	3	3	0,00
				3,877 % fällig am 25.05.2047	5	5	0,00	Freddie Mac			
				3,974 % fällig am 25.09.2034	43	40	0,00	5,000 % fällig am 15.01.2035	139	138	0,02
				4,924 % fällig am 25.01.2035	20	19	0,00	5,732 % fällig am 25.09.2031	7	7	0,00
				5,224 % fällig am 25.11.2034	4	3	0,00	5,903 % fällig am 15.12.2031	1	1	0,00
				5,453 % fällig am 25.02.2034	6	6	0,00	5,934 % fällig am 01.01.2034	1	1	0,00
				Bear Stearns ALT-A Trust				5,953 % fällig am 15.04.2028	2	2	0,00
				4,235 % fällig am 25.08.2036	12	6	0,00	6,000 % fällig am 15.04.2036	2	3	0,00
				5,044 % fällig am 25.10.2033	0	0	0,00	6,053 % fällig am 15.03.2024	0	0	0,00
				Chase Mortgage Finance Trust				6,103 % fällig am 15.03.2032	40	40	0,01
				4,114 % fällig am 25.03.2037	4	4	0,00	Ginnie Mae			
				Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				5,722 % fällig am 20.02.2035	22	22	0,00
				6,277 % fällig am 25.09.2035	1	1	0,00	5,757 % fällig am 20.10.2043	374	354	0,04
				Countrywide Alternative Loan Trust				5,962 % fällig am 20.02.2038	12	12	0,00
				4,174 % fällig am 25.02.2037	5	5	0,00	6,012 % fällig am 20.03.2060	11	11	0,00
				5,682 % fällig am 20.07.2046	8	6	0,00	6,180 % fällig am 20.08.2062	486	483	0,06
				5,850 % fällig am 25.09.2046	7	7	0,00	6,246 % fällig am 20.08.2068	499	489	0,06
				Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				6,261 % fällig am 20.07.2062	263	263	0,03
				4,430 % fällig am 25.09.2047	5	4	0,00	Uniform Mortgage-Backed Security			
				6,110 % fällig am 25.03.2035	62	57	0,01	4,500 % fällig am 01.09.2052	984	955	0,11
				6,230 % fällig am 25.09.2034	1	1	0,00	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
				GreenPoint Mortgage Funding Trust				4,000 % fällig am 01.02.2054	37.714	35.706	4,16
				5,910 % fällig am 25.06.2045	58	54	0,01	4,500 % fällig am 01.02.2054	30.500	29.586	3,44
				GSR Mortgage Loan Trust				6,000 % fällig am 01.02.2054	21.100	21.426	2,49
				4,381 % fällig am 25.06.2034	3	3	0,00			89.657	10,44
				4,649 % fällig am 25.07.2035	30	27	0,00	US-SCHATZOBIGATIONEN			
				4,836 % fällig am 25.09.2035	2	2	0,00	U.S. Treasury Inflation Protected Securities (c)			
				HarborView Mortgage Loan Trust				0,125 % fällig am 15.07.2024	14.772	14.519	1,69
				6,372 % fällig am 20.06.2035	173	156	0,02	0,125 % fällig am 15.10.2024 (e)	58.162	56.898	6,62
				Impac CMB Trust				0,125 % fällig am 15.04.2025 (e)	36.687	35.381	4,12
				6,370 % fällig am 25.10.2033	1	1	0,00	0,125 % fällig am 15.10.2025 (e)	28.933	27.825	3,24
				IndyMac Mortgage Loan Trust				0,125 % fällig am 15.04.2026 (e)	52.478	49.959	5,82
				5,950 % fällig am 25.07.2035	1.237	1.125	0,13	0,125 % fällig am 15.07.2026	7.073	6.740	0,78
				6,110 % fällig am 25.07.2045	3	2	0,00	0,125 % fällig am 15.10.2026 (e)	130.498	123.948	14,43
				JPMorgan Mortgage Trust				0,125 % fällig am 15.07.2031	16.209	14.419	1,68
				4,916 % fällig am 25.04.2035	17	16	0,00	0,250 % fällig am 15.01.2025 (e)	45.076	43.756	5,09
				5,822 % fällig am 25.08.2035	6	6	0,00	0,250 % fällig am 15.07.2029	1.937	1.790	0,21
				Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust				0,375 % fällig am 15.07.2025	20.219	19.592	2,28
				5,916 % fällig am 15.12.2030	1	1	0,00	0,375 % fällig am 15.01.2027 (e)	34.212	32.519	3,79
				Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				0,375 % fällig am 15.07.2027 (e)	40.349	38.351	4,47
				6,160 % fällig am 25.08.2036	3.211	3.144	0,37	0,500 % fällig am 15.04.2024	37	36	0,00
				New Residential Mortgage Loan Trust				0,500 % fällig am 15.01.2028	41.661	39.435	4,59
				4,500 % fällig am 25.05.2058	398	385	0,05	0,625 % fällig am 15.01.2026	21.132	20.393	2,37
				Optem Mortgage Acceptance Corp. Asset-Backed Pass-Through Certificates				0,750 % fällig am 15.07.2028	22.222	21.274	2,48
				7,270 % fällig am 25.04.2035	500	481	0,06	0,750 % fällig am 15.02.2045	784	614	0,07
				Regal Trust				0,875 % fällig am 15.01.2029	25.954	24.848	2,89
				1,723 % fällig am 29.09.2031	6	5	0,00	0,875 % fällig am 15.02.2047	892	704	0,08
								1,250 % fällig am 15.04.2028	15.592	15.191	1,77
								1,375 % fällig am 15.07.2033	8.408	8.158	0,95
								1,375 % fällig am 15.02.2044	3.036	2.717	0,32
								1,625 % fällig am 15.10.2027 (e)	96.645	95.941	11,17
								1,750 % fällig am 15.01.2028	5.211	5.180	0,60
								2,375 % fällig am 15.01.2025	17.465	17.330	2,02
								2,500 % fällig am 15.01.2029	1.733	1.792	0,21

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
3,875 % fällig am 15.04.2029	\$ 1.218	\$ 1.344	0,16	INVESTMENTFONDS ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
		720.654	83,90	PIMCO Select Funds			
Summe USA		838.128	97,58	plc - PIMCO US Dollar Short- Term Floating NAV Fund (d)	12.743	\$ 127	0,01
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE UNGARISCHE SCHATZWECHSEL				Summe Investmentfonds		\$ 127	0,01
10,900 % fällig am 04.01.2024 (a)(b)	HUF 422.000	1.219	0,14				
Summe kurzfristige Instrumente		1.219	0,14				
Summe übertragbare Wertpapiere		\$ 1.293.427	150,60				

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	5,470 %	02.01.2024	03.01.2024	\$ 40.300	U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 15.08.2032	\$ (41.183)	\$ 40.300	\$ 40.306	4,69
FICC	2,600	29.12.2023	02.01.2024	1.018	U.S. Treasury Notes 4,875 % fällig am 30.11.2025	(1.038)	1.018	1.018	0,12
	5,330	29.12.2023	02.01.2024	41.700	U.S. Treasury Notes 1,500 % fällig am 30.11.2028	(42.534)	41.700	41.700	4,86
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (84.755)	\$ 83.018	\$ 83.024	9,67

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
Australia Government 3-Year Note March Futures	Short	03/2024	69	\$ (50)	(0,01)
Australia Government 10-Year Bond March Futures	Short	03/2024	63	(148)	(0,02)
Euro-Bobl March Futures	Long	03/2024	53	113	0,01
Euro-BTP Italy Government Bond March Futures	Long	03/2024	82	400	0,05
Euro-BTP Italy Government Bond March Futures	Short	03/2024	355	(281)	(0,03)
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03/2024	86	(155)	(0,02)
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Short	03/2024	18	(228)	(0,02)
Euro-OAT France Government 10-Year Bond March Futures	Short	03/2024	15	(62)	(0,01)
Euro-Schatz March Futures	Short	03/2024	267	(59)	(0,01)
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Long	03/2024	62	4	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Short	03/2024	2.006	(4.398)	(0,51)
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03/2024	1.416	4.973	0,58
U.S. Treasury 10-Year Ultra March Futures	Short	03/2024	274	(1.562)	(0,18)
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Short	03/2024	540	(5.295)	(0,62)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Long	03/2024	123	1.581	0,19
United Kingdom Long Gilt March Futures	Long	03/2024	87	764	0,09
				\$ (4.403)	(0,51)

VERKAUFSOPTIONEN

FUTURE-ÄHNLICHE OPTIONEN AUF BÖRSEGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens
Call - ICE Euribor April 2024 Futures	\$ 96,750	12.04.2024	312	\$ (211)	\$ (211)	(0,03)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					\$ (4.614)	(0,54)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,300 %	20.09.2027	¥ 74.880	\$ 3	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,500	15.12.2031	986.000	91	0,01
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,550	14.09.2028	2.370.000	(89)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,000	15.12.2047	\$ 1.750	380	0,04
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,428	20.12.2047	400	59	0,01
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,478	20.12.2047	1.115	152	0,02

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Commodity Real Return Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Varibler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt		1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,499 %	20.12.2047	\$ 570	\$ 77	0,01
Erhalt		1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,840	21.11.2028	13.800	1.275	0,15
Zahlung		1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,880	25.01.2052	5.000	(1.514)	(0,18)
Zahlung		1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,888	21.11.2053	2.800	(902)	(0,11)
Erhalt		1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,237	21.11.2053	10.300	2.004	0,23
Zahlung		1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,340	21.11.2028	50.700	(2.886)	(0,34)
Erhalt ⁽¹⁾		1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,865	13.02.2054	18.600	1.095	0,13
Zahlung ⁽¹⁾		1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,085	13.02.2034	41.800	(909)	(0,11)
Zahlung ⁽¹⁾		1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,900	22.03.2026	17.750	30	0,00
Erhalt		1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	20.12.2025	58.000	(482)	(0,06)
Zahlung		1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,606	31.10.2025	48.600	558	0,06
Zahlung		1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,611	31.10.2025	6.800	79	0,01
Erhalt		1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,868	22.12.2025	17.750	(185)	(0,02)
Erhalt		3-Month NZD-BSB	3,250	21.03.2028	NZD 900	13	0,00
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	0,000	17.03.2053	€ 1.200	544	0,06
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	0,190	04.11.2052	900	393	0,05
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	0,195	04.11.2052	950	472	0,06
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	0,197	08.11.2052	1.600	696	0,08
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	0,550	10.08.2024	200	(7)	0,00
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	0,650	12.04.2027	4.900	(317)	(0,04)
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	0,650	11.05.2027	2.400	(145)	(0,02)
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	0,700	11.04.2027	2.100	(133)	(0,02)
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027	4.700	(233)	(0,03)
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	1,000	18.05.2027	2.100	(103)	(0,01)
Erhalt ⁽¹⁾		6-Month EUR-EURIBOR	2,750	20.03.2054	25.470	(3.467)	(0,40)
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	2,879	15.08.2032	13.400	409	0,05
Zahlung ⁽¹⁾		6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.03.2034	53.680	3.887	0,45
Zahlung		CPTFEMU	1,380	15.03.2031	4.000	(817)	(0,10)
Zahlung		CPTFEMU	1,946	15.03.2048	60	(14)	0,00
Zahlung		CPTFEMU	2,356	15.11.2033	3.200	78	0,01
Zahlung		CPTFEMU	2,363	15.11.2033	1.800	43	0,01
Zahlung		CPTFEMU	2,390	15.11.2033	1.800	46	0,01
Zahlung		CPTFEMU	2,421	15.05.2052	700	(54)	(0,01)
Erhalt		CPTFEMU	2,470	15.07.2032	11.900	8	0,00
Zahlung		CPTFEMU	2,488	15.05.2037	4.790	(150)	(0,02)
Erhalt		CPTFEMU	2,548	15.11.2053	500	(16)	0,00
Erhalt		CPTFEMU	2,570	15.06.2032	8.800	54	0,01
Zahlung		CPTFEMU	2,580	15.03.2052	500	(20)	0,00
Zahlung		CPTFEMU	2,590	15.03.2052	4.940	(147)	(0,02)
Erhalt		CPTFEMU	2,600	15.05.2032	10.600	162	0,02
Erhalt		CPTFEMU	2,620	15.11.2053	200	(12)	0,00
Zahlung		CPTFEMU	2,680	15.04.2053	2.100	163	0,02
Zahlung		CPTFEMU	2,682	15.10.2053	600	49	0,01
Zahlung		CPTFEMU	2,700	15.04.2053	1.100	87	0,01
Zahlung		CPTFEMU	2,736	15.10.2053	900	83	0,01
Zahlung		CPTFEMU	2,763	15.09.2053	1.800	191	0,02
Erhalt		CPTFEMU	4,470	15.09.2024	19.900	(184)	(0,02)
Erhalt		CPURNSA	1,798	25.08.2027	\$ 1.000	146	0,02
Erhalt		CPURNSA	1,890	27.08.2027	3.000	417	0,05
Zahlung		CPURNSA	1,954	03.06.2029	700	(92)	(0,01)
Zahlung		CPURNSA	1,998	25.07.2029	3.600	(455)	(0,05)
Zahlung		CPURNSA	2,155	17.10.2027	1.900	(216)	(0,03)
Erhalt		CPURNSA	2,311	24.02.2031	5.100	531	0,06
Zahlung		CPURNSA	2,335	05.02.2028	2.680	(243)	(0,03)
Zahlung		CPURNSA	2,353	09.05.2028	1.790	(153)	(0,02)
Zahlung		CPURNSA	2,360	09.05.2028	2.690	(227)	(0,03)
Zahlung		CPURNSA	2,364	10.05.2028	2.750	(231)	(0,03)
Erhalt		CPURNSA	2,419	05.03.2026	2.300	215	0,03
Zahlung		CPURNSA	2,560	12.09.2024	3.400	5	0,00
Zahlung		CPURNSA	2,565	12.09.2024	5.000	8	0,00
Erhalt		CPURNSA	2,573	26.08.2028	1.100	65	0,01
Erhalt		CPURNSA	2,645	10.09.2028	1.500	78	0,01
Erhalt		CPURNSA	2,690	01.06.2026	2.100	156	0,02
Erhalt		CPURNSA	2,703	25.05.2026	1.270	94	0,01
Erhalt		CPURNSA	2,768	13.05.2026	3.100	224	0,03
Erhalt		CPURNSA	2,813	14.05.2026	1.400	98	0,01
Erhalt		FRCPXTOB	1,030	15.03.2024	€ 3.300	312	0,04
Zahlung		FRCPXTOB	1,910	15.01.2038	390	(47)	(0,01)
Zahlung		UKRPI	3,100	15.06.2031	£ 2.300	(455)	(0,05)
Zahlung		UKRPI	3,400	15.06.2030	1.610	(371)	(0,04)
Zahlung		UKRPI	3,530	15.10.2031	540	(129)	(0,02)
Zahlung		UKRPI	4,066	15.09.2031	300	(43)	0,00
Erhalt		UKRPI	4,125	15.09.2032	590	0	0,00
Erhalt		UKRPI	4,130	15.09.2032	2.610	(2)	0,00
Erhalt		UKRPI	4,143	15.10.2032	2.300	(5)	0,00
Erhalt		UKRPI	5,200	15.06.2024	1.200	62	0,01
Erhalt		UKRPI	6,600	15.05.2024	4.200	223	0,03
						\$ 360	0,04
						\$ 360	0,04

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

⁽¹⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

VERKAUFSOPTIONEN

INFLATION-CAPPED OPTIONS

Kontrahent	Beschreibung	Anfänglicher Index	Variabler Zinssatz	Verfallsdatum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
GLM	Cap - OTC CPALEMU	\$ 100,151	Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 3,000 %] oder 0	22.06.2035	1.200	\$ (54)	\$ (44)	(0,01)

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfallsdatum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,700 %	13.02.2024	34.100	\$ (149)	\$ (505)	(0,06)
BRC	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	3,150	06.10.2025	13.100	(151)	(340)	(0,04)
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,150	06.10.2025	13.100	(151)	(55)	(0,01)
CBK	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,950	15.09.2025	10.800	(131)	(252)	(0,03)
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,950	15.09.2025	10.800	(131)	(59)	(0,01)
FAR	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,760	16.01.2024	29.500	(137)	(416)	(0,05)
GLM	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,900	20.03.2024	35.500	(171)	(198)	(0,02)
	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,900	29.08.2025	6.800	(89)	(149)	(0,01)
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,900	29.08.2025	6.800	(88)	(34)	0,00
GST	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,800	01.09.2025	14.600	(185)	(298)	(0,03)
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,800	01.09.2025	14.600	(185)	(81)	(0,01)
MYC	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,758	16.01.2024	4.000	(18)	(56)	(0,01)
							\$ (1.586)	\$ (2.443)	(0,28)

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.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
DUB	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500 %	17.10.2057	\$ 1.497	\$ (104)	\$ 105	\$ 1	0,00
GST	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500	17.10.2057	1.796	(93)	94	1	0,00
					\$ (197)	\$ 199	\$ 2	0,00

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,998 %	20.06.2028	ILS 890	\$ 0	\$ (12)	\$ (12)	0,00
BRC	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,950	20.06.2028	810	0	(11)	(11)	0,00
CKL	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	2,100	20.06.2028	750	(3)	(6)	(9)	0,00
GLM	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,971	16.02.2028	1.430	0	(16)	(16)	(0,01)
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,998	20.06.2028	610	0	(8)	(8)	0,00
HUS	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,998	20.06.2028	480	0	(6)	(6)	0,00
						\$ (3)	\$ (59)	\$ (62)	(0,01)

TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Erhalt	BCOMTR Index	9.630	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 2.182	15.02.2024	\$ 0	\$ (6)	\$ (6)	0,00
	Erhalt	BCOMTR1 Index	1.368.505	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	118.440	15.02.2024	0	(388)	(388)	(0,05)
CBK	Erhalt	BCOMF1TC Index	348.889	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	39.186	15.02.2024	0	(128)	(128)	(0,02)
	Erhalt	BCOMTR Index	18.369	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	4.161	15.02.2024	0	(12)	(12)	0,00
	Erhalt	CIXBSTR3 Index	693.551	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	172.357	15.02.2024	0	(448)	(448)	(0,05)
CIB	Erhalt	BCOMTR Index	41.476	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	9.396	15.02.2024	0	(27)	(27)	0,00
GST	Erhalt	BCOMF1TC Index	235.692	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	85.844	15.02.2024	0	(281)	(281)	(0,03)
	Erhalt	BCOMTR Index	882.893	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	200.018	15.02.2024	0	(585)	(585)	(0,07)

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Commodity Real Return Fund (Forts.)

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn- betrag	Fälligkeits- datum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Netto- vermögens
JPM	Erhalt	BCOMF1TC Index	315.223	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 60.047	15.02.2024	\$ 0	\$ (197)	\$ (197)	(0,02)
	Erhalt	BCOMTR Index	200.746	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	45.479	15.02.2024	112	(268)	(156)	(0,02)
	Erhalt	JMABDEWU Index	494.170	0,053 %	79.894	15.02.2024	0	(176)	(176)	(0,02)
	Erhalt	JMABNIU5 Index	164.986	0,000	29.639	15.02.2024	0	(265)	(265)	(0,03)
MAC	Erhalt	PIMCOBDV Index	155.117	0,600	20.171	16.01.2024	0	105	105	0,01
	Erhalt	PIMCOBDU Index	539.651	0,150	85.338	15.03.2024	0	(527)	(527)	(0,06)
MEI	Erhalt	BCOMTR Index	46.584	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	10.553	15.02.2024	0	(33)	(33)	(0,01)
SOG	Erhalt	BCOMTR Index	9.776	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	2.215	15.02.2024	0	(7)	(7)	0,00
							\$ 112	\$ (3.243)	\$ (3.131)	(0,37)

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
AZD	01/2024	AUD	\$ 5.456	\$ 3.613	\$ 0	\$ (110)	(0,01)	
BOA	01/2024		828	547	0	(17)	0,00	
	01/2024	£	3.027	3.844	0	(15)	0,00	
	01/2024	¥	4.487.180	30.407	0	(1.442)	(0,17)	
	01/2024	NZD	3.042	1.853	0	(73)	(0,01)	
	03/2024	CNH	51.959	7.228	0	(111)	(0,01)	
	06/2024	KRW	4.665.657	3.586	0	(46)	(0,01)	
BPS	01/2024	DKK	60.049	8.853	0	(48)	(0,01)	
	01/2024	€	1.648	1.780	0	(40)	0,00	
	01/2024	£	11.024	13.983	0	(71)	(0,01)	
	01/2024	HUF	107.077	305	0	(4)	0,00	
	01/2024	¥	2.733.187	18.638	0	(761)	(0,09)	
	01/2024	KRW	65.689	50	0	(1)	0,00	
	01/2024	\$	611	€ 553	0	0	0,00	
	01/2024		2	HUF 817	0	0	0,00	
	01/2024		100	IDR 1.546.618	0	0	0,00	
	01/2024		3.333	ZAR 61.784	41	41	0,01	
BRC	01/2024	€	209.914	\$ 230.860	0	(1.076)	(0,12)	
	01/2024	KRW	129.230	100	0	0	0,00	
	01/2024	\$	913	£ 717	1	1	0,00	
	01/2024		1.942	MXN 34.068	61	61	0,01	
	01/2024		99	ZAR 1.849	2	2	0,00	
	03/2024		1.999	IDR 31.076.634	16	16	0,00	
CBK	01/2024	AUD	311	\$ 210	0	(2)	0,00	
	01/2024	DKK	3.035	444	0	(6)	0,00	
	01/2024	HUF	8.053	23	0	0	0,00	
	01/2024	IDR	1.542.854	100	0	0	0,00	
	03/2024	ILS	327	90	0	(1)	0,00	
	03/2024	PEN	2.078	552	0	(8)	0,00	
	03/2024	\$	100	IDR 1.543.250	0	0	0,00	
DUB	01/2024	KRW	64.985	\$ 50	0	0	0,00	
GLM	01/2024	CAD	15.561	11.451	0	(352)	(0,04)	
	01/2024	DKK	73.154	10.791	0	(52)	(0,01)	
	01/2024	£	1	2	0	0	0,00	
JPM	01/2024	HUF	294.979	840	0	(12)	0,00	
	01/2024	\$	100	IDR 1.538.700	0	0	0,00	
	01/2024		50	KRW 64.807	0	0	0,00	
	02/2024		2.750	BRL 13.485	22	22	0,00	
	06/2024	KRW	64.252	\$ 50	0	0	0,00	
MBC	01/2024	AUD	2.560	1.697	0	(50)	(0,01)	
	01/2024	\$	18.921	€ 17.304	199	199	0,02	
MYI	01/2024	£	28	\$ 36	0	0	0,00	
	01/2024	HUF	11.276	32	0	(1)	0,00	
	01/2024	¥	1.704.524	11.562	0	(537)	(0,06)	
	01/2024	SGD	48	36	0	0	0,00	
	01/2024	\$	8.733	DKK 59.455	80	80	0,01	
	01/2024		828	€ 746	0	(3)	0,00	
	01/2024		10	£ 8	0	0	0,00	
	03/2024		100	IDR 1.549.650	1	1	0,00	
SCX	01/2024	SEK	143.538	\$ 13.821	0	(426)	(0,05)	
	01/2024	\$	35	€ 31	0	0	0,00	
	01/2024		495	£ 389	1	1	0,00	
	01/2024		1.054	MXN 18.509	34	34	0,00	
	03/2024	TWD	169.260	\$ 5.442	0	(167)	(0,02)	
	03/2024	\$	1.812	INR 151.532	3	3	0,00	
UAG	01/2024	AUD	2.069	\$ 1.373	0	(39)	0,00	
	01/2024	£	59.889	75.791	0	(558)	(0,06)	
	01/2024	¥	179.577	1.226	0	(49)	(0,01)	
	01/2024	\$	158	MXN 2.776	5	5	0,00	
	03/2024		1.723	INR 144.139	4	4	0,00	
					\$ 470	\$ (6.078)	\$ (5.608)	(0,65)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	01/2024	€ 9.257	\$ 10.101	\$ 3	\$ (130)	\$ (127)	(0,01)
	01/2024	\$ 8.355	€ 7.590	32	0	32	0,00
BRC	01/2024	87.498	79.560	408	0	408	0,05
CBK	01/2024	€ 5.437	\$ 5.896	0	(112)	(112)	(0,01)
	01/2024	\$ 2.184	€ 1.974	0	(4)	(4)	0,00
MBC	01/2024	€ 4.368	\$ 4.765	0	(61)	(61)	(0,01)
MYI	01/2024	\$ 87.446	€ 79.560	460	0	460	0,05
UAG	01/2024	87.513	79.560	393	0	393	0,05
				\$ 1.296	\$ (307)	\$ 989	0,12

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilklasse Institutional GBP (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01/2024	\$ 880	£ 694	\$ 5	\$ 0	\$ 5	0,00
BPS	01/2024	1.376	1.084	7	0	7	0,00
BRC	01/2024	28	22	0	0	0	0,00
CBK	01/2024	£ 66	\$ 83	0	(1)	(1)	0,00
	01/2024	\$ 359	£ 283	2	0	2	0,00
GLM	01/2024	£ 68	\$ 87	0	0	0	0,00
MBC	01/2024	234	295	0	(3)	(3)	0,00
	01/2024	\$ 560	£ 442	4	0	4	0,00
MYI	01/2024	9	7	0	0	0	0,00
SCX	01/2024	7.794	6.162	61	0	61	0,01
SSB	01/2024	£ 488	\$ 614	0	(8)	(8)	(0,01)
	01/2024	\$ 6.074	£ 4.813	63	0	63	0,01
UAG	01/2024	£ 17	\$ 21	0	0	0	0,00
	01/2024	\$ 7.793	£ 6.158	57	0	57	0,01
				\$ 199	\$ (12)	\$ 187	0,02

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilklasse Class E SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01/2024	\$ 280	SGD 373	\$ 3	\$ 0	\$ 3	0,00
CBK	01/2024	280	373	3	0	3	0,00
GLM	01/2024	SGD 18	\$ 13	0	0	0	0,00
	01/2024	\$ 19	SGD 25	0	0	0	0,00
JPM	01/2024	SGD 9	\$ 7	0	0	0	0,00
	01/2024	\$ 41	SGD 54	0	0	0	0,00
MBC	01/2024	SGD 44	\$ 33	0	0	0	0,00
	01/2024	\$ 51	SGD 68	1	0	1	0,00
	02/2024	9	11	0	0	0	0,00
MYI	01/2024	255	340	3	0	3	0,00
UAG	01/2024	2	2	0	0	0	0,00
				\$ 10	\$ 0	\$ 10	0,00
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ (10.100)	(1,18)
Summe Anlagen						\$ 1.362.218	158,60
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ (503.316)	(58,60)
Nettovermögen						\$ 858.902	100,00

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Nullkuponwertpapier.

(b) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(c) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(d) Mit dem Fonds verbunden.

(e) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 397.126 (31. Dezember 2022: USD 400.193) wurden zum 31. Dezember 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheiten verpfändet.

Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD null (31. Dezember 2022: USD 17.272) wurden zum 31. Dezember 2023 gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Commodity Real Return Fund (Forts.)

Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 777 (31. Dezember 2022: USD 157) und Barmittel in Höhe von USD 935 (31. Dezember 2022: USD null) wurden zum 31. Dezember 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von USD 10.174 (31. Dezember 2022: USD 19.275) wurden zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 5.750 (31. Dezember 2022: USD 18.770) wurden zum 31. Dezember 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 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	\$ 1.293.241	\$ 186	\$ 1.293.427
Investmentfonds	127	0	0	127
Pensionsgeschäfte	0	83.018	0	83.018
Finanzderivate ⁽³⁾	83	(14.437)	0	(14.354)
Summen	\$ 210	\$ 1.361.822	\$ 186	\$ 1.362.218

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.750.918	\$ 0	\$ 1.750.918
Investmentfonds	120	0	0	120
Pensionsgeschäfte	0	59.113	0	59.113
Finanzderivate ⁽³⁾	8.938	(13.669)	0	(4.731)
Summen	\$ 9.058	\$ 1.796.362	\$ 0	\$ 1.805.420

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

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

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BSN	5,510 %	14.12.2023	04.01.2024	\$ (60.895)	\$ (61.063)	(7,11)
CIB	5,470	07.12.2023	04.01.2024	(107.969)	(108.379)	(12,62)
	5,470	13.12.2023	04.01.2024	(36.056)	(36.160)	(4,21)
	5,470	14.12.2023	04.01.2024	(78.712)	(78.928)	(9,19)
	5,470	19.12.2023	04.01.2024	(70.262)	(70.400)	(8,19)
GRE	5,520	18.12.2023	04.01.2024	(41.040)	(41.128)	(4,79)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (396.058)	(46,11)

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
AZD	\$ (110)	\$ 0	\$ (110)	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ k. A.
BOA	(1.708)	1.650	(58)	(97)	0	(97)
BPS	(1.871)	690	(1.181)	(3.167)	4.390	1.223
BRC	(994)	1.770	776	311	(320)	(9)
CBK	(1.028)	(1.270)	(2.298)	2.368	(1.310)	1.058
CIB	(27)	0	(27)	(334)	470	136
CKL	(9)	0	(9)	(14)	0	(14)
DUB	1	0	1	(1.532)	1.480	(52)
FAR	(416)	400	(16)	k. A.	k. A.	k. A.
FBF	k. A.	k. A.	k. A.	(181)	80	(101)
GLM	(853)	690	(163)	(384)	260	(124)
GSC	k. A.	k. A.	k. A.	(3)	0	(3)
GST	(1.244)	(1.480)	(2.724)	(3.474)	4.890	1.416
HUS	(6)	0	(6)	(10)	0	(10)
JPM	(784)	(390)	(1.174)	(272)	1.520	1.248
MAC	(422)	(10)	(432)	1.137	(840)	297
MBC	90	0	90	(3.160)	2.770	(390)
MEI	(33)	0	(33)	(251)	320	69
MYC	(56)	0	(56)	(26)	260	234

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement ⁽¹⁾
MYI	\$ 3	\$ (530)	\$ (527)	\$ (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	(494)	550	56	4.186	(4.010)	176
SOG	(7)	0	(7)	(497)	570	73
SSB	55	0	55	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	(187)	0	(187)	(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. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	128,93	108,79
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	21,67	18,76
Sonstige übertragbare Wertpapiere	k. A.	0,26
Investmentfonds	0,01	0,01
Pensionsgeschäfte	9,67	4,32
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,54)	0,64
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,04	(0,43)
Freiverkehrsfinanzderivate	(1,18)	(0,56)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(46,11)	(31,05)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	k. A.	(1,31)

* Gemäß der Liste der Märkte, die in Anhang 1 zum Prospekt aufgeführt sind und die Kriterien für gemäß OGAW-Vorschriften geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Australien	0,88	0,51
Kanada	0,29	0,18
Cayman-Inseln	4,88	5,01
Dänemark	1,33	3,73
Frankreich	4,65	5,36
Deutschland	k. A.	1,07
Irland	6,06	4,58
Italien	10,15	6,97
Japan	7,70	4,89
Niederlande	k. A.	0,03
Neuseeland	0,24	0,14
Peru	0,01	0,04
Katar	k. A.	0,02
Saudi-Arabien	k. A.	0,02
Spanien	3,94	3,61
Schweden	1,68	0,99
Schweiz	0,12	k. A.
Großbritannien	10,95	8,89
USA	97,58	81,68
Kurzfristige Instrumente	0,14	0,09
Investmentfonds	0,01	0,01
Pensionsgeschäfte	9,67	4,32
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,51)	0,64
Verkaufsoptionen		
Future-ähnliche Rohstoffoptionen	(0,03)	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	k. A.	0,00
Zinsswaps	0,04	(0,43)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	k. A.	0,22
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Inflation-Capped Options	(0,01)	0,00
Zinsswapoptionen	(0,28)	(0,35)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,00	0,00
Zinsswaps	(0,01)	(0,01)
Total Return Swaps auf Indizes	(0,37)	(0,68)
Devisenterminkontrakte	(0,65)	(0,62)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,14	0,88
Sonstige Aktiva und Passiva	(58,60)	(31,79)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS		
USA				USA				USA					
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE					
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust 6,295 % fällig am 25.12.2045	\$	268	\$ 203	0,20	Amgen, Inc. 5,150 % fällig am 02.03.2028	400	410	0,41	EPR Properties 4,500 % fällig am 01.06.2027	\$	50	\$ 47	0,05
Argent Securities Trust 5,620 % fällig am 25.09.2036		752	242	0,24	5,250 % fällig am 02.03.2030	600	617	0,62	Ford Motor Credit Co. LLC 3,375 % fällig am 13.11.2025		200	191	0,19
5,830 % fällig am 25.04.2036		264	86	0,09	Ares Capital Corp. 7,000 % fällig am 15.01.2027	300	309	0,31	4,389 % fällig am 08.01.2026		700	681	0,68
6,030 % fällig am 25.04.2036		646	210	0,21	Ashtead Capital, Inc. 4,375 % fällig am 15.08.2027	800	769	0,77	Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC 7,875 % fällig am 01.12.2030		200	209	0,21
Citigroup Mortgage Loan Trust 5,790 % fällig am 25.12.2036	1.561	872	0,87	Assured Guaranty U.S. Holdings, Inc. 6,125 % fällig am 15.09.2028	100	105	0,10	FS KKR Capital Corp. 7,875 % fällig am 15.01.2029	100	106	0,11		
First Franklin Mortgage Loan Trust 6,895 % fällig am 25.10.2034	260	260	0,26	Avangrid, Inc. 3,150 % fällig am 01.12.2024	150	147	0,15	Genesis Energy LP 8,250 % fällig am 15.01.2029	100	103	0,10		
GSAMP Trust 5,560 % fällig am 25.01.2037	360	207	0,21	Aviation Capital Group LLC 3,500 % fällig am 01.11.2027	600	553	0,55	Glencore Funding LLC 5,400 % fällig am 08.05.2028	500	510	0,51		
5,590 % fällig am 25.12.2036	518	245	0,25	Bank of America Corp. 3,824 % fällig am 20.01.2028	675	649	0,65	Global Atlantic Fin Co. 3,125 % fällig am 15.06.2031	300	246	0,25		
5,700 % fällig am 25.12.2046	634	315	0,31	5,819 % fällig am 15.09.2029	600	620	0,62	Global Payments, Inc. 5,950 % fällig am 15.08.2052	400	408	0,41		
MASTR Asset-Backed Securities Trust 5,950 % fällig am 25.08.2036	463	178	0,18	5,933 % fällig am 15.09.2027	175	179	0,18	GLP Capital LP 4,000 % fällig am 15.01.2030	600	548	0,55		
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust 4,471 % fällig am 25.11.2037	68	24	0,02	BGC Group, Inc. 8,000 % fällig am 25.05.2028	50	52	0,05	4,000 % fällig am 15.01.2031	100	90	0,09		
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust 5,600 % fällig am 25.01.2037	336	149	0,15	Blue Owl Finance LLC 3,125 % fällig am 10.06.2031	600	495	0,49	6,750 % fällig am 01.12.2033	100	108	0,11		
5,610 % fällig am 25.10.2036	262	113	0,11	Blue Racer Midstream LLC 7,625 % fällig am 15.12.2025	450	456	0,46	Goldman Sachs Group, Inc. 5,798 % fällig am 10.08.2026	100	101	0,10		
5,770 % fällig am 25.09.2036	1.758	623	0,62	Boeing Co. 3,950 % fällig am 01.08.2059	600	460	0,46	GTCR W-2 Merger Sub LLC 7,500 % fällig am 15.01.2031	200	211	0,21		
5,930 % fällig am 25.09.2036	58	25	0,03	5,705 % fällig am 01.05.2040	600	621	0,62	HAT Holdings LLC 3,375 % fällig am 15.06.2026	400	376	0,38		
Morgan Stanley Home Equity Loan Trust 5,570 % fällig am 25.04.2037	59	31	0,03	5,805 % fällig am 01.05.2050	100	104	0,10	8,000 % fällig am 15.06.2027	300	313	0,31		
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 6,465 % fällig am 25.09.2046	609	203	0,20	Booz Allen Hamilton, Inc. 3,875 % fällig am 01.09.2028	300	283	0,28	HCA, Inc. 3,500 % fällig am 01.09.2030	850	771	0,77		
New Century Home Equity Loan Trust 8,470 % fällig am 25.01.2033	57	49	0,05	Boston Scientific Corp. 2,650 % fällig am 01.06.2030	1.100	983	0,98	Host Hotels & Resorts LP 2,900 % fällig am 15.12.2031	500	420	0,42		
NovaStar Mortgage Funding Trust 5,770 % fällig am 25.06.2036	506	359	0,36	Brandywine Operating Partnership LP 3,950 % fällig am 15.11.2027	250	224	0,22	3,375 % fällig am 15.12.2029	100	90	0,09		
5,770 % fällig am 25.09.2036	825	344	0,34	7,800 % fällig am 15.03.2028	25	25	0,03	3,500 % fällig am 15.09.2030	925	826	0,83		
Option One Mortgage Loan Trust 5,720 % fällig am 25.03.2037	485	237	0,24	British Airways Pass-Through Trust 3,300 % fällig am 15.06.2034	84	75	0,08	Howard Midstream Energy Partners LLC 8,875 % fällig am 15.07.2028	300	315	0,31		
Residential Asset Mortgage Products Trust 0,000 % fällig am 25.12.2035	1.091	902	0,90	Cantor Fitzgerald LP 7,200 % fällig am 12.12.2028	100	103	0,10	Hudson Pacific Properties LP 3,950 % fällig am 01.11.2027	300	251	0,25		
Residential Asset Securities Corp. Trust 5,843 % fällig am 25.08.2034	316	307	0,31	Centene Corp. 2,450 % fällig am 15.07.2028	625	557	0,56	5,950 % fällig am 15.02.2028	100	88	0,09		
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust 6,430 % fällig am 25.01.2036	104	94	0,09	Charles Schwab Corp. 5,916 % fällig am 13.05.2026	100	98	0,10	Humana, Inc. 4,875 % fällig am 01.04.2030	500	507	0,51		
Soundview Home Loan Trust 5,650 % fällig am 25.07.2037	234	202	0,20	6,196 % fällig am 17.11.2029	100	105	0,10	Hyundai Capital America 5,500 % fällig am 30.03.2026	100	101	0,10		
Specialty Underwriting & Residential Finance Trust 5,770 % fällig am 25.09.2037	342	235	0,24	Charter Communications Operating LLC 3,950 % fällig am 30.06.2062	575	362	0,36	6,532 % fällig am 04.08.2025	100	100	0,10		
		6.715	6,71		Cheniery Energy Partners LP 3,250 % fällig am 31.01.2032	600	512	0,51	IHG Finance LLC 4,375 % fällig am 28.11.2029	€	100	115	0,11
					4,500 % fällig am 01.10.2029	700	670	0,67	Invitation Homes Operating Partnership LP 5,450 % fällig am 15.08.2030	\$	50	50	0,05
AKTIEN				AKTIEN				AKTIEN					
STAMMAKTIE				STAMMAKTIE				STAMMAKTIE					
ENERGIE				ENERGIE				ENERGIE					
Constellation Oil Services Holding S.A. 'B' (c)(h)	580.149	63	0,06	Cheniery Energy, Inc. 4,625 % fällig am 15.10.2028	600	586	0,59	Ipalco Enterprises, Inc. 3,700 % fällig am 01.09.2024	100	98	0,10		
FINANZWERTE				FINANZWERTE				FINANZWERTE					
Stearns Holdings LLC 'B' (c)	157.159	0	0,00	Chesapeake Energy Corp. 5,500 % fällig am 01.02.2026	100	99	0,10	JPMorgan Chase & Co. 3,540 % fällig am 01.05.2028	1.900	1.813	1,81		
Summe Stammaktien	\$	63	0,06	Choice Hotels International, Inc. 3,700 % fällig am 01.12.2029	700	621	0,62	5,000 % fällig am 01.08.2024 (e)	100	99	0,10		
				3,700 % fällig am 15.01.2031	150	129	0,13	JPMorgan Chase Bank N.A. 5,110 % fällig am 08.12.2026	250	252	0,25		
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Alaska Airlines Pass-Through Trust 4,800 % fällig am 15.02.2029	\$	306	298	0,30	Clearway Energy Operating LLC 4,750 % fällig am 15.03.2028	275	265	0,26	Kinetik Holdings LP 6,625 % fällig am 15.12.2028	100	102	0,10	
Allstate Corp. 8,579 % fällig am 15.08.2053	100	99	0,10	Concentrix Corp. 6,650 % fällig am 02.08.2026	250	256	0,26	Las Vegas Sands Corp. 3,200 % fällig am 08.08.2024	200	196	0,20		
Ally Financial, Inc. 4,750 % fällig am 09.06.2027	600	579	0,58	Continental Resources, Inc. 5,750 % fällig am 15.01.2031	500	498	0,50	Leidos, Inc. 2,300 % fällig am 15.02.2031	1.200	1.005	1,00		
American Airlines Pass-Through Trust 3,375 % fällig am 01.11.2028	345	317	0,32	Credit Acceptance Corp. 9,250 % fällig am 15.12.2028	200	213	0,21	Marvell Technology, Inc. 5,750 % fällig am 15.02.2029	20	21	0,02		
American Builders & Contractors Supply Co., Inc. 4,000 % fällig am 15.01.2028	500	474	0,47	Diamond Sports Group LLC 5,375 % fällig am 15.08.2026 ^	400	20	0,02	Mattel, Inc. 3,375 % fällig am 01.04.2026	900	857	0,86		
American Homes 4 Rent LP 3,375 % fällig am 15.07.2051	600	412	0,41	Edison International 6,950 % fällig am 15.11.2029	100	109	0,11	Mileage Plus Holdings LLC 6,500 % fällig am 20.06.2027	70	70	0,07		
American Tower Corp. 2,700 % fällig am 15.04.2031	300	258	0,26	Elevance Health, Inc. 2,250 % fällig am 15.05.2030	600	520	0,52	Moody's Corp. 3,100 % fällig am 29.11.2061	475	322	0,32		
2,950 % fällig am 15.01.2051	1.125	751	0,75	Endeavor Energy Resources LP 5,750 % fällig am 30.01.2028	325	325	0,32	Morgan Stanley 4,210 % fällig am 20.04.2028	500	489	0,49		
				Energy Transfer LP 4,950 % fällig am 15.06.2028	300	299	0,30	4,889 % fällig am 20.07.2033	1.300	1.268	1,27		
				5,000 % fällig am 15.05.2044	500	440	0,44	MSCI, Inc. 3,625 % fällig am 01.11.2031	1.100	969	0,97		
				Entergy Corp. 3,750 % fällig am 15.06.2050	100	76	0,08	4,000 % fällig am 15.11.2029	100	94	0,09		

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft ⁽¹⁾	% des Netto- vermögens
SSB	2,600 %	29.12.2023	02.01.2024	\$ 737	U.S. Treasury Notes 0,250 % fällig am 31.07.2025 - 31.10.2025	\$ (752)	\$ 737	\$ 737	0,74
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (752)	\$ 737	\$ 737	0,74

(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
3-Month SOFR December Futures	Short	03/2024	50	\$ 340	0,34
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03/2024	3	(14)	(0,02)
Japan Government 10-Year Bond March Futures	Short	03/2024	1	(10)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Short	03/2024	12	(49)	(0,05)
U.S. Treasury 10-Year Ultra March Futures	Short	03/2024	61	(351)	(0,35)
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Short	03/2024	52	(481)	(0,48)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03/2024	13	(151)	(0,15)
				\$ (716)	(0,72)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (716)	(0,72)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

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

Referenzinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AutoZone, Inc.	(1,000) %	20.06.2024	\$ 1.400	\$ 31	0,03
ConocoPhillips	(1,000)	20.12.2024	100	(1)	0,00
Johnson Controls International PLC	(1,000)	20.12.2024	1.500	42	0,04
Tyson Foods, Inc.	(1,000)	20.06.2024	1.400	35	0,04
				\$ 107	0,11

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

Referenzinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2027	\$ 100	\$ 2	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2028	100	2	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20.12.2024	100	(1)	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2025	€ 100	21	0,02
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2025	200	20	0,02
T-Mobile USA, Inc.	5,000	20.06.2028	\$ 300	3	0,00
Toll Brothers Finance Corp.	1,000	20.06.2026	200	4	0,01
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2024	100	0	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2028	100	1	0,00
				\$ 52	0,05

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-41 5-Year Index	(1,000) %	20.12.2028	\$ 2.700	\$ (20)	(0,02)

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,250 %	20.03.2054	£ 100	\$ (17)	(0,02)
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,500	20.03.2034	100	(10)	(0,01)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.09.2027	¥ 94.200	9	0,01
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	1,000	20.09.2043	40.000	9	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,060	27.10.2053	\$ 1.500	353	0,35

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Credit Opportunities Bond Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750 %	20.06.2029	\$ 3.500	\$ (3)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,950	19.12.2033	100	(4)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	22.11.2033	100	(6)	(0,01)
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,750	20.12.2025	CAD 3.600	41	0,04
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,300	28.04.2027	ZAR 15.500	13	0,01
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	20.09.2033	AUD 1.000	24	0,02
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	20.03.2034	100	4	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	17.03.2053	€ 440	199	0,20
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	20.03.2054	400	(63)	(0,06)
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	2,760	03.01.2029	100	(1)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,880	19.12.2028	100	(2)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,910	29.12.2033	100	(4)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,950	29.12.2028	100	(2)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,970	15.12.2033	100	(4)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,063	06.12.2033	100	(5)	(0,01)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,179	29.11.2028	100	(3)	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,250	20.03.2029	200	(8)	(0,01)
					\$ 520	0,52
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ 659	0,66

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

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

⁽³⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

⁽⁴⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,975 %	29.05.2024	1.200	\$ 1	\$ 0	0,00

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 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,545 %	16.01.2024	100	\$ (1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,995	16.01.2024	100	(1)	0	0,00
CBK	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,235	22.01.2024	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,685	22.01.2024	100	0	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,590	05.01.2024	100	0	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,960	05.01.2024	100	0	0	0,00
GLM	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,195	29.05.2024	600	(1)	(2)	(0,01)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,215	22.01.2024	100	0	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300	16.01.2024	100	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,560	05.01.2024	100	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,594	05.01.2024	100	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,648	04.01.2024	100	(1)	(2)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,665	22.01.2024	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	16.01.2024	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,010	05.01.2024	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,044	05.01.2024	100	(1)	0	0,00
GST	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,440	08.01.2024	100	0	(1)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,860	08.01.2024	100	0	0	0,00
JPM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,490	12.01.2024	100	0	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,650	04.01.2024	100	0	(2)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,890	12.01.2024	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,030	04.01.2024	100	0	0	0,00
MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,455	08.01.2024	100	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,670	04.01.2024	100	(1)	(2)	(0,01)

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Netto- vermögens
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,955 %	08.01.2024	100	\$ (1)	\$ 0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,120	04.01.2024	100	(1)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,330	15.01.2024	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,740	15.01.2024	100	0	0	0,00
							\$ (13)	\$ (16)	(0,02)

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Netto- vermögens
BOA	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 5,000 % fällig am 01.01.2054	\$ 97,891	09.01.2024	100	\$ 0	\$ (1)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 6,000 % fällig am 01.02.2054	101,094	06.02.2024	100	0	(1)	0,00
SAL	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.02.2054	95,813	06.02.2024	100	(1)	0	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.02.2054	97,813	06.02.2024	100	(1)	(1)	0,00
					\$ (2)	\$ (3)	0,00

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Netto- vermögens
BRC	Pertamina Persero PT	1,000 %	20.12.2024	\$ 100	\$ 0	\$ 1	\$ 1	0,00

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

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn-betrag	Fälligkeits-datum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Netto- vermögens
BPS	Erhalt	iBoxx USD Liquid Investment Grade Index	k. A.	1,113 %	\$ 4.800	20.03.2024	\$ 59	\$ (425)	\$ (366)	(0,37)

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Netto- vermögens
	03/2024	\$ 39	INR 3.223	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BPS	01/2024	€ 651	\$ 718	4	(5)	(1)	0,00
	01/2024	£ 161	205	0	(1)	(1)	0,00
	01/2024	\$ 447	¥ 65.800	20	0	20	0,02
	01/2024	ZAR 11.028	\$ 595	0	(7)	(7)	(0,01)
	02/2024	\$ 47	BRL 231	1	0	1	0,00
	03/2024	109	CNH 791	2	0	2	0,00
	03/2024	15	IDR 229.327	0	0	0	0,00
	03/2024	134	INR 11.195	0	0	0	0,00
BRC	02/2024	12	TRY 358	0	0	0	0,00
	04/2024	137	4.385	0	(2)	(2)	0,00
CBK	01/2024	MXN 10.467	\$ 588	0	(27)	(27)	(0,03)
	01/2024	\$ 42	NOK 446	2	0	2	0,00
	01/2024	ZAR 3.990	\$ 210	0	(8)	(8)	(0,01)
	02/2024	\$ 144	BRL 728	6	0	6	0,01
GLM	01/2024	MXN 4.077	\$ 234	0	(6)	(6)	(0,01)
	01/2024	\$ 449	MXN 7.871	14	0	14	0,02
	01/2024	77	ZAR 1.407	0	0	0	0,00
	01/2024	ZAR 2.872	\$ 151	0	(6)	(6)	(0,01)
	03/2024	\$ 29	IDR 438.856	0	0	0	0,00
JPM	03/2024	CNH 791	\$ 110	0	(2)	(2)	0,00
	03/2024	\$ 13	IDR 201.201	0	0	0	0,00
	03/2024	40	INR 3.355	0	0	0	0,00
MBC	01/2024	CAD 949	\$ 701	0	(19)	(19)	(0,02)
	01/2024	€ 147	159	0	(4)	(4)	0,00
	01/2024	\$ 237	AUD 358	7	0	7	0,01
	01/2024	ZAR 2.216	\$ 116	0	(5)	(5)	(0,01)
	03/2024	\$ 16	IDR 245.080	0	0	0	0,00
MYI	01/2024	CAD 91	\$ 69	0	0	0	0,00
	01/2024	€ 4.191	4.607	0	(24)	(24)	(0,03)
	01/2024	\$ 5	€ 5	0	0	0	0,00
	03/2024	206	IDR 3.172.202	0	0	0	0,00
RBC	04/2024	1	MXN 11	0	0	0	0,00
SCX	01/2024	ZAR 3.867	\$ 204	0	(7)	(7)	(0,01)
	03/2024	\$ 13	IDR 200.696	0	0	0	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Credit Opportunities Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
	03/2024	\$ 87	INR 7.305	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	03/2024	193	THB 6.659	4	0	4	0,01
UAG	01/2024	£ 920	\$ 1.164	0	(9)	(9)	(0,01)
	01/2024	\$ 187	NOK 1.997	9	0	9	0,01
	01/2024	ZAR 5.687	\$ 298	0	(13)	(13)	(0,01)
				\$ 69	\$ (145)	\$ (76)	(0,08)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2023 standen fur die Anteilsklasse Institutional CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BRC	01/2024	\$ 158	CHF 138	\$ 6	\$ 0	\$ 6	0,01
CBK	01/2024	144	125	5	0	5	0,01
DUB	01/2024	CHF 1.180	\$ 1.354	0	(49)	(49)	(0,05)
GLM	01/2024	\$ 4.810	CHF 4.215	201	0	201	0,20
MYI	01/2024	4.838	4.224	182	0	182	0,19
SCX	01/2024	115	100	4	0	4	0,00
UAG	01/2024	4.790	4.180	179	0	179	0,18
				\$ 577	\$ (49)	\$ 528	0,54

Zum 31. Dezember 2023 standen fur die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BPS	01/2024	€ 34	\$ 38	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01/2024	\$ 444	€ 405	4	0	4	0,00
CBK	01/2024	242	218	0	0	0	0,00
MBC	01/2024	9.438	8.585	47	0	47	0,05
MYI	01/2024	9.248	8.414	49	0	49	0,05
UAG	01/2024	9.209	8.372	41	0	41	0,04
				\$ 141	\$ 0	\$ 141	0,14

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 209 0,21

Summe Anlagen

\$ 124.801 124,72

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (24.738) (24,72)

Nettovermogen

\$ 100.063 100,00

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
- (b) Wertpapier mit Sachwertausschuttung.
- (c) Das Wertpapier hat in den letzten zwolf Monaten keine Ertrage geliefert.
- (d) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (e) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nachsten vertraglichen Kundigungstermin dar.
- (f) Mit dem Fonds verbunden.
- (g) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (h) Eingeschrankte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 1,99 %):

Emittentenbeschreibung	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermogens
Constellation Oil Services Holding S.A. 'B'	10.06.2022	\$ 63	\$ 63	0,06
Intelsat Emergence S.A.	12.11.2019	750	214	0,21
Oracle Corp, 2,300 % fallig am 25.03.2028	04.10.2023	191	201	0,20
		\$ 1.004	\$ 478	0,47

(i) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 2.971 (31. Dezember 2022: USD null) wurden zum 31. Dezember 2023 gema den Rahmenvertragen und/oder globalen Rahmenvertragen fur Pensionsgeschafte als Sicherheiten verpfandet.

Barmittel in Hohe von USD 1.360 (31. Dezember 2022: USD 1.243) wurden zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten fur borsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfandet.

Barmittel in Hohe von USD 270 (31. Dezember 2022: USD 290) wurden zum 31. Dezember 2023 gema den Rahmenvertragen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheiten fur Finanzderivate verpfandet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 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	\$ 118.444	\$ 1.861	\$ 120.305
Investmentfonds	3.208	399	0	3.607
Pensionsgeschäfte	0	737	0	737
Finanzderivate ⁽³⁾	(24)	176	0	152
Summen	\$ 3.184	\$ 119.756	\$ 1.861	\$ 124.801

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 8	\$ 79.539	\$ 648	\$ 80.195
Investmentfonds	9.253	396	0	9.649
Pensionsgeschäfte	0	6.910	0	6.910
Finanzderivate ⁽³⁾	33	393	0	426
Summen	\$ 9.294	\$ 87.238	\$ 648	\$ 97.180

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

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

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
GRE	5,520 %	14.12.2023	4.01.2024	\$ (2.934)	\$ (2.942)	(2,94)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (2.942)	(2,94)

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	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	(2)	0	(2)	(104)	0	(104)
BPS	(349)	270	(79)	(290)	290	0
BRC	5	0	5	5	0	5
CBK	(23)	0	(23)	555	(550)	5
DUB	(49)	0	(49)	4	(40)	(36)
GLM	196	0	196	(23)	0	(23)
GST	(1)	0	(1)	9	0	9
JPM	(5)	0	(5)	(63)	0	(63)
MBC	26	0	26	120	0	120
MYC	(3)	0	(3)	(5)	0	(5)
MYI	207	(260)	(53)	4	0	4
RBC	k. A.	k. A.	k. A.	3	0	3
SAL	(1)	0	(1)	k. A.	k. A.	k. A.
SCX	1	0	1	253	0	253
UAG	207	(260)	(53)	(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. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	52,54	40,41
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	66,59	40,99
Sonstige übertragbare Wertpapiere	1,10	1,15
Investmentfonds	3,60	9,93
Pensionsgeschäfte	0,74	7,11
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,72)	0,41
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,66	(0,43)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,21	0,46
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(2,94)	k. A.

* Gemäß der Liste der Märkte, die in Anhang 1 zum Prospekt aufgeführt sind und die Kriterien für gemäß OGAW-Vorschriften geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Argentinien	0,28	0,24
Australien	0,96	0,90
Bermuda	0,67	k. A.
Brasilien	k. A.	0,41
Kanada	0,58	0,94
Cayman-Inseln	4,87	0,64
China	0,00	0,02
Tschechische Republik	0,53	k. A.
Frankreich	1,40	1,06
Irland	1,13	k. A.
Italien	2,41	0,34
Japan	k. A.	0,80
Liberia	0,48	k. A.
Luxemburg	1,13	1,17
Mexiko	0,50	k. A.
Multinational	0,39	1,02
Niederlande	0,93	0,95
Panama	1,02	k. A.
Peru	k. A.	0,74
Katar	k. A.	0,40
Südafrika	1,53	1,71
Spanien	0,41	0,37
Schweiz	1,61	1,08
Großbritannien	4,11	3,36
USA	95,23	65,91
Jungferinseln (Britisch)	0,06	0,23
Kurzfristige Instrumente	k. A.	0,26
Investmentfonds	3,60	9,93
Pensionsgeschäfte	0,74	7,11
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,72)	0,41
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzkauf	0,11	0,08
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,05	0,04
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,02)	k. A.
Zinsswaps	0,52	(0,55)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,00	0,63
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	(0,02)	(1,06)
Optionen auf Wertpapiere	0,00	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzkauf	k. A.	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	k. A.	0,03
Total Return Swaps auf Indizes	(0,37)	(0,16)
Devisenterminkontrakte	(0,08)	(0,04)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,68	1,08
Sonstige Aktiva und Passiva	(24,72)	(0,03)
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000\$)	MARKT-WERT (000\$)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000\$)	MARKT-WERT (000\$)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000\$)	MARKT-WERT (000\$)	% DES NETTO-VERMÖGENS
7,500 % fällig am 16.02.2061 \$	36.675	21.536	0,29	ZF Finance GmbH				Adagio CLO DAC			
8,500 % fällig am 31.01.2047	9.500	5.937	0,08	2,750 % fällig am 25.05.2027 €	16.200	17.075	0,23	4,685 % fällig am 15.10.2031	€ 5.800	\$ 6.320	0,08
Summe Ägypten		41.842	0,56	3,750 % fällig am 21.09.2028	32.000	34.198	0,46	Ares European CLO DAC			
						169.635	2,28	4,575 % fällig am 15.04.2030	1.630	1.786	0,02
								4,625 % fällig am 15.10.2030	1.899	2.082	0,03
								4,745 % fällig am 15.10.2031	9.771	10.692	0,14
								4,843 % fällig am 20.04.2032	500	544	0,01
								Armada Euro CLO DAC			
								4,685 % fällig am 15.07.2031	11.041	12.067	0,16
								Aurium CLO DAC			
								4,695 % fällig am 16.01.2031	4.789	5.233	0,07
								4,966 % fällig am 23.03.2032	10.400	11.399	0,15
								Avoca CLO DAC			
								4,785 % fällig am 15.10.2032	2.900	3.164	0,04
								Bain Capital Euro CLO DAC			
								4,733 % fällig am 20.01.2032	5.410	5.903	0,08
								Black Diamond CLO DAC			
								4,853 % fällig am 20.01.2032	1.512	1.660	0,02
								4,982 % fällig am 15.05.2032	4.299	4.689	0,06
								Blackrock European CLO DAC			
								4,585 % fällig am 15.10.2031	10.704	11.640	0,16
								BlueMountain Fuji EUR CLO DAC			
								1,050 % fällig am 15.01.2031	993	1.039	0,01
								4,685 % fällig am 15.01.2031	7.747	8.465	0,11
								BNPP AM Euro CLO DAC			
								4,565 % fällig am 15.04.2031	1.000	1.088	0,01
								Bridgepoint CLO DAC			
								5,175 % fällig am 15.01.2034	1.300	1.426	0,02
								Cairn CLO DAC			
								4,745 % fällig am 15.10.2031	8.594	9.338	0,13
								Carlyle Euro CLO DAC			
								4,632 % fällig am 15.08.2030	3.886	4.254	0,06
								4,665 % fällig am 15.01.2031	11.503	12.583	0,17
								4,892 % fällig am 15.08.2032	4.400	4.796	0,06
								Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.			
								4,752 % fällig am 15.11.2031	7.436	8.101	0,11
								CVC Cordatus Loan Fund DAC			
								4,615 % fällig am 15.10.2031	13.172	14.356	0,19
								4,661 % fällig am 27.01.2031	1.372	1.495	0,02
								4,725 % fällig am 15.04.2032	1.322	1.447	0,02
								4,782 % fällig am 15.08.2032	2.380	2.605	0,04
								Dryden Euro CLO DAC			
								4,625 % fällig am 15.04.2033	12.734	13.862	0,19
								4,862 % fällig am 15.05.2034	14.674	15.964	0,21
								Euro-Galaxy CLO DAC			
								4,589 % fällig am 24.04.2034	9.590	10.408	0,14
								4,693 % fällig am 11.04.2031	1.123	1.228	0,02
								GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC			
								4,893 % fällig am 20.01.2032	1.700	1.859	0,02
								Griffith Park CLO DAC			
								4,704 % fällig am 21.11.2031	31.267	33.994	0,46
								Harvest CLO DAC			
								1,040 % fällig am 15.07.2031	1.600	1.674	0,02
								4,566 % fällig am 26.06.2030	1.786	1.952	0,03
								4,673 % fällig am 20.10.2031	18.497	20.132	0,27
								4,725 % fällig am 15.07.2031	10.400	11.324	0,15
								4,815 % fällig am 15.01.2032	17.600	19.194	0,26
								Invesco Euro CLO DAC			
								4,615 % fällig am 15.07.2031	850	924	0,01
								Jubilee CLO DAC			
								4,565 % fällig am 15.04.2030	3.851	4.216	0,06
								4,575 % fällig am 15.04.2030	1.795	1.971	0,03
								4,615 % fällig am 15.04.2031	5.850	6.341	0,09
								Laurelin DAC			
								4,713 % fällig am 20.10.2031	10.356	11.327	0,15
								Madison Park Euro Funding DAC			
								4,715 % fällig am 15.01.2032	35.500	38.644	0,52
								4,765 % fällig am 15.07.2032	5.600	6.102	0,08
								Man GLG Euro CLO DAC			
								4,615 % fällig am 15.12.2031	9.880	10.789	0,15
								4,775 % fällig am 15.10.2032	4.965	5.418	0,07
								Oak Hill European Credit Partners DAC			
								4,723 % fällig am 20.01.2032	2.006	2.194	0,03
								4,733 % fällig am 20.10.2031	15.161	16.563	0,22
								OCP Euro CLO DAC			
								4,785 % fällig am 15.01.2032	2.252	2.476	0,03
								4,882 % fällig am 22.09.2034	12.700	13.829	0,19

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS																												
CTP NV				PHILIPPINEN				SÜDAFRIKA																															
0,500 % fällig am 21.06.2025	€ 1.200	\$ 1.250	0,02	STAATSEMISSIONEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL																															
1,250 % fällig am 21.06.2029	200	184	0,00	Philippines Government International Bond				AngloGold Ashanti Holdings PLC																															
1,500 % fällig am 27.09.2031	1.500	1.294	0,02	5,000 % fällig am 17.07.2033				\$ 2.000 \$ 2.058 0,03																															
Enel Finance International NV				PORTUGAL				Unternehmensanleihen und Wechsel																															
5,000 % fällig am 15.06.2032	\$ 5.000	4.881	0,07	Unternehmensanleihen und Wechsel				Sasol Financing USA LLC																															
Imperial Brands Finance Netherlands BV				Banco Espirito Santo S.A.				6,500 % fällig am 27.09.2028				8.800 8.393 0,11																											
1,750 % fällig am 18.03.2033	€ 28.800	24.960	0,34	4,750 % fällig am				8,750 % fällig am 03.05.2029				5.600 5.720 0,08																											
ING Groep NV				15.01.2018 ^				€ 200 61 0,00				STAATSEMISSIONEN																											
5,750 % fällig am				Galp Energia SGPS S.A.				South Africa Government International Bond				5,650 % fällig am 27.09.2027				13.700 10.993 0,15																							
16.11.2026 (f)(h)	\$ 9.000	8.409	0,11	2,000 % fällig am 15.01.2026				12.300 13.148 0,18				Summe Südafrika				26.846 0,36																							
6,500 % fällig am				Summe Portugal				13.209 0,18				SPANIEN																											
16.04.2025 (f)(h)	18.702	18.248	0,24	RUMÄNIEN				Unternehmensanleihen und Wechsel				ACS Actividades de Construccion y Servicios S.A.																											
6,750 % fällig am				STAATSEMISSIONEN				Romania Government International Bond				1,375 % fällig am				17.06.2025 (j)				€ 700 748 0,01																			
16.04.2024 (f)(h)	14.280	14.229	0,19	2,000 % fällig am 14.04.2033				1.500 1.244 0,02				6,000 % fällig am				29.03.2024 (f)(h)				2.800 3.091 0,04																			
NE Property BV				2,875 % fällig am 13.04.2042				8.000 6.002 0,08				6,000 % fällig am				15.01.2026 (f)(h)				9.200 10.124 0,14																			
3,375 % fällig am 14.07.2027	€ 25.250	26.405	0,35	5,500 % fällig am 18.09.2028				4.000 4.550 0,06				6,138 % fällig am 14.09.2028				\$ 15.800 16.241 0,22																							
NN Group NV				6,375 % fällig am 18.09.2033				16.400 19.191 0,26				Cellnex Finance Co. S.A.				2,000 % fällig am 15.09.2032				€ 14.400 13.644 0,18																			
4,500 % fällig am				6,625 % fällig am 27.09.2029				14.500 17.156 0,23				Lorca Telecom Bondco S.A.				4,000 % fällig am 18.09.2027				1.900 2.054 0,03																			
15.01.2026 (f)	17.900	19.761	0,27	7,625 % fällig am 17.01.2053				\$ 3.000 3.371 0,04				Summe Spanien				47.317 0,64																							
Q-Park Holding BV				Summe Rumänien				51.514 0,69				KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				GRIFOLS S.A.				6,223 % fällig am 15.11.2027				1.292 1.415 0,02															
3,500 % fällig am 01.02.2025	33.350	35.648	0,48	RUSSLAND				Unternehmensanleihen und Wechsel				6,223 % fällig am 15.11.2027				1.292 1.415 0,02																							
Sandoz Finance BV				ALROSA Finance S.A.				3,100 % fällig am				25.06.2027 ^				22.400 1.344 0,02																							
4,220 % fällig am 17.04.2030	1.225	1.406	0,02	4,375 % fällig am 09.05.2030				€ 100 104 0,00				4,650 % fällig am				09.04.2024 ^				3.200 192 0,00																			
4,500 % fällig am 17.11.2033	2.300	2.702	0,04	4,500 % fällig am 01.03.2025				1.808 2.001 0,03				MMK International Capital DAC				4,375 % fällig am				13.06.2024 ^				8.600 516 0,01															
Syngenta Finance NV				Summe Russland				7.093 0,10				STAATSEMISSIONEN				SRI LANKA				STAATSEMISSIONEN				Sri Lanka Government International Bond				7,550 % fällig am				28.03.2030 ^				\$ 16.800 8.482 0,11			
4,892 % fällig am 24.04.2025	\$ 19.895	19.639	0,26	SAUDI-ARABIEN				STAATSEMISSIONEN				7,850 % fällig am				14.03.2029 ^				5.800 2.929 0,04																			
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV				Summe Saudi-Arabien				63.680 0,86				SCHWEDEN				Unternehmensanleihen und Wechsel				Summe Sri Lanka				11.411 0,15															
4,375 % fällig am 09.05.2030	€ 100	104	0,00	SENEGAL				STAATSEMISSIONEN				0,750 % fällig am 04.09.2026				€ 200 200 0,00																							
4,500 % fällig am 01.03.2025	1.808	2.001	0,03	Senegal Government International Bond				5,375 % fällig am 08.06.2037				€ 3.800 3.115 0,04				Sagax AB				2,000 % fällig am 17.01.2024				119 132 0,00															
United Group BV				Summe Senegal				16.967 0,23				SERBIEN				STAATSEMISSIONEN				2,250 % fällig am 13.03.2025				400 430 0,01															
3,625 % fällig am 15.02.2028	1.600	1.643	0,02	SERBIEN				STAATSEMISSIONEN				Volvo Car AB				4,250 % fällig am				31.05.2028 (j)				29.900 33.400 0,45															
5,250 % fällig am 01.02.2030	4.300	4.515	0,06	Serbia Government International Bond				1,650 % fällig am 03.03.2033				8.900 7.297 0,10				Summe Schweden				34.162 0,46																			
Volkswagen International Finance NV				Summe Serbien				16.967 0,23				SCHWEIZ				Unternehmensanleihen und Wechsel				3,869 % fällig am 12.01.2029				\$ 700 661 0,01															
3,500 % fällig am				6,500 % fällig am 18.01.2053				20.000 20.453 0,28				4,125 % fällig am 15.04.2026				15.100 14.754 0,20																							
17.06.2025 (f)	10.100	10.864	0,15	Summe Saudi-Arabien				63.680 0,86				4,194 % fällig am 01.04.2031				1.400 1.305 0,02																							
				STAATSEMISSIONEN				SINGAPUR				Unternehmensanleihen und Wechsel				4,703 % fällig am 05.08.2027				1.200 1.183 0,01																			
				Russia Government International Bond				5,250 % fällig am				23.06.2047 ^				14.200 5.041 0,07				6,442 % fällig am 11.08.2028				3.200 3.325 0,04															
				23.06.2047 ^				14.200 5.041 0,07				SLOWENIEN				Unternehmensanleihen und Wechsel				6,537 % fällig am 12.08.2033				5.500 5.873 0,08															
				Summe Russland				7.093 0,10				STAATSEMISSIONEN				Summe Slowenien				15.936 0,21				Summe Schweiz				27.101 0,36											
				Summe Südafrika				26.846 0,36				TÜRKEI				STAATSEMISSIONEN				Türkey Government International Bond				4,875 % fällig am 16.04.2043				33.067 24.232 0,32											
				NON-AGENCY-MBS				EMF-NL Prime BV				4,785 % fällig am 17.04.2041				18 19 0,00				5,750 % fällig am 11.05.2047				58.300 45.861 0,62															
				Eurosail BV				5,485 % fällig am 17.10.2040				22 24 0,00				UKRAINE				Unternehmensanleihen und Wechsel				NPC Ukrenergo				6,875 % fällig am 09.11.2028				1.000 272 0,00							
				Summe Niederlande				207.602 2,79				NIGERIA				STAATSEMISSIONEN				Nigeria Government International Bond				7,625 % fällig am 28.11.2047				\$ 17.700 14.089 0,19											
				NIGERIA				STAATSEMISSIONEN				Nigeria Government International Bond				7,750 % fällig am 16.02.2032				23.600 21.281 0,29				Summe Nigeria				35.370 0,48											
				OMAN				STAATSEMISSIONEN				Oman Government International Bond				6,750 % fällig am 17.01.2048				21.300 22.340 0,30				Summe Türkei				70.093 0,94											
				PANAMA				STAATSEMISSIONEN				Panama Government International Bond				6,700 % fällig am 26.01.2036				20.600 20.466 0,27				Summe Türkei				70.093 0,94											
				PERU				Unternehmensanleihen und Wechsel				Credicorp Capital Sociedad Titulizadora S.A.				10,100 % fällig am				15.12.2043				PEN 68.400 18.639 0,25				Summe Ukraine				37.563 0,51							
				PERU				Unternehmensanleihen und Wechsel				Credicorp Capital Sociedad Titulizadora S.A.				10,100 % fällig am				15.12.2043				PEN 68.400 18.639 0,25				Summe Ukraine				37.563 0,51							
				PERU				Unternehmensanleihen und Wechsel				Credicorp Capital Sociedad Titulizadora S.A.				10,100 % fällig am				15.12.2043				PEN 68.400 18.639 0,25				Summe Ukraine				37.563 0,51							

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust				5,620 % fällig am 25.03.2037	\$ 1.069	\$ 360	0,01	Structured Asset Investment Loan Trust			
4,470 % fällig am 25.01.2037	\$ 473	\$ 250	0,00	5,630 % fällig am 25.09.2037	753	743	0,01	5,620 % fällig am 25.09.2036	\$ 89	\$ 87	0,00
4,724 % fällig am 25.11.2036	7.700	7.770	0,10	5,670 % fällig am 25.01.2037	1.006	355	0,01	5,770 % fällig am 25.06.2036	20	19	0,00
5,660 % fällig am 25.03.2047	302	300	0,00	5,890 % fällig am 25.01.2037	1.200	424	0,01	6,070 % fällig am 25.01.2036	77	75	0,00
5,710 % fällig am 25.08.2036	172	169	0,00	7,345 % fällig am 25.03.2035	487	478	0,01	6,145 % fällig am 25.11.2035	7.202	6.244	0,08
5,730 % fällig am 25.03.2037	105	102	0,00	Option One Mortgage Loan Trust				6,235 % fällig am 25.08.2035	3.913	3.753	0,05
5,730 % fällig am 25.06.2037	45	45	0,00	5,610 % fällig am 25.01.2037	147	84	0,00	6,370 % fällig am 25.09.2034	43	41	0,00
5,750 % fällig am 25.01.2037	43	42	0,00	5,640 % fällig am 25.05.2037	127	68	0,00	6,400 % fällig am 25.01.2035	227	220	0,00
5,770 % fällig am 25.03.2037	4.349	3.998	0,05	5,650 % fällig am 25.04.2037	444	212	0,00	6,595 % fällig am 25.07.2033	20	20	0,00
5,875 % fällig am 25.07.2036	141	137	0,00	5,720 % fällig am 25.07.2037	2.232	1.421	0,02	6,850 % fällig am 25.04.2033	11	11	0,00
Lehman ABS Mortgage Loan Trust				5,750 % fällig am 25.07.2036	13.419	7.546	0,10	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust			
5,560 % fällig am 25.06.2037	241	154	0,00	6,010 % fällig am 25.01.2036	400	364	0,01	5,700 % fällig am 25.01.2037	2.025	1.204	0,02
5,670 % fällig am 25.06.2037	123	79	0,00	6,040 % fällig am 25.01.2036	5.043	3.626	0,05	5,810 % fällig am 25.12.2036	70	65	0,00
Long Beach Mortgage Loan Trust				6,235 % fällig am 25.08.2035	350	335	0,00	5,810 % fällig am 25.12.2036	90	88	0,00
5,650 % fällig am 25.09.2036	14.012	3.888	0,05	Option One Mortgage Loan Trust Asset-Backed Certificates				5,890 % fällig am 25.02.2037	124	120	0,00
6,010 % fällig am 25.05.2046	2.479	751	0,01	6,160 % fällig am 25.11.2035	384	362	0,01	6,370 % fällig am 25.08.2037	30	29	0,00
6,070 % fällig am 25.02.2036	11.128	8.920	0,12	Owinit Mortgage Loan Trust				Structured Asset Securities Corp. Trust			
6,115 % fällig am 25.11.2035	20	20	0,00	6,370 % fällig am 25.10.2036	122	116	0,00	6,160 % fällig am 25.09.2035	150	140	0,00
6,520 % fällig am 25.06.2035	249	240	0,00	Park Place Securities, Inc.				Truman Capital Mortgage Loan Trust			
6,745 % fällig am 25.02.2035	1.762	1.720	0,02	6,205 % fällig am 25.09.2035	164	160	0,00	5,730 % fällig am 25.03.2036	300	297	0,00
MASTR Asset-Backed Securities Trust				Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust			
5,670 % fällig am 25.08.2036	4.923	1.523	0,02	6,205 % fällig am 25.08.2035	316	308	0,00	5,620 % fällig am 25.01.2037	1.455	1.227	0,02
5,690 % fällig am 25.08.2036	1.888	728	0,01	6,205 % fällig am 25.09.2035	5.162	4.982	0,07	Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust			
5,740 % fällig am 25.08.2036	3.260	1.285	0,02	6,265 % fällig am 25.07.2035	72	71	0,00	5,950 % fällig am 25.05.2036	630	473	0,01
5,770 % fällig am 25.03.2036	996	900	0,01	6,295 % fällig am 25.07.2035	400	360	0,01	Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust			
5,830 % fällig am 25.02.2036	325	124	0,00	6,520 % fällig am 25.10.2034	233	228	0,00	5,965 % fällig am 25.05.2036	1.288	1.284	0,02
5,950 % fällig am 25.03.2036	982	603	0,01	6,595 % fällig am 25.03.2035	222	216	0,00	Wells Fargo Home Equity Trust Mortgage Pass-Through Certificates			
6,220 % fällig am 25.10.2035	280	262	0,00	6,715 % fällig am 25.01.2036	1.282	1.262	0,02	6,210 % fällig am 25.04.2034	139	134	0,00
6,250 % fällig am 25.02.2034	435	438	0,01	7,270 % fällig am 25.12.2034	395	389	0,01				
6,370 % fällig am 25.04.2034	284	265	0,00	People's Choice Home Loan Securities Trust							
6,370 % fällig am 25.10.2035	1.325	1.172	0,02	6,820 % fällig am 25.01.2035	388	372	0,01				
MASTR Specialized Loan Trust				People's Financial Realty Mortgage Securities Trust							
6,595 % fällig am 25.11.2035	133	126	0,00	5,610 % fällig am 25.09.2036	981	252	0,00				
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust							
4,471 % fällig am 25.11.2037	2.770	973	0,01	5,680 % fällig am 25.01.2037	334	321	0,00				
5,770 % fällig am 25.08.2037	2.672	1.382	0,02	5,730 % fällig am 25.11.2036	0	0	0,00				
6,190 % fällig am 25.05.2036	49	48	0,00	6,055 % fällig am 25.02.2036	31	30	0,00				
6,370 % fällig am 25.02.2047	103	61	0,00	RAAC Trust							
6,520 % fällig am 25.04.2035	88	83	0,00	6,070 % fällig am 25.06.2044	47	40	0,00				
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				6,070 % fällig am 25.09.2045	72	70	0,00				
5,540 % fällig am 25.10.2036	65	28	0,00	6,170 % fällig am 25.11.2046	152	142	0,00				
5,600 % fällig am 25.11.2036	297	134	0,00	6,670 % fällig am 25.10.2045	0	0	0,00				
5,600 % fällig am 25.01.2037	864	384	0,01	6,970 % fällig am 25.09.2047	388	372	0,01				
5,610 % fällig am 25.10.2036	1.887	815	0,01	Renaissance Home Equity Loan Trust							
5,610 % fällig am 25.11.2036	184	86	0,00	5,340 % fällig am 25.01.2037	1.247	423	0,01				
5,610 % fällig am 25.05.2037	3.203	2.343	0,03	Residential Asset Mortgage Products Trust							
5,620 % fällig am 25.10.2036	170	89	0,00	6,110 % fällig am 25.01.2036	388	358	0,01				
5,620 % fällig am 25.11.2036	2.863	1.630	0,02	Residential Asset Securities Corp. Trust							
5,670 % fällig am 25.09.2036	3	1	0,00	5,730 % fällig am 25.11.2036	233	214	0,00				
5,690 % fällig am 25.11.2036	230	107	0,00	5,810 % fällig am 25.11.2036	62	58	0,00				
5,720 % fällig am 25.03.2037	896	384	0,01	6,030 % fällig am 25.04.2036	25	25	0,00				
5,790 % fällig am 25.09.2036	1.161	497	0,01	6,070 % fällig am 25.02.2036	124	122	0,00				
6,050 % fällig am 25.01.2035	686	684	0,01	6,100 % fällig am 25.12.2035	41	41	0,00				
6,090 % fällig am 25.12.2035	114	110	0,00	6,130 % fällig am 25.11.2035	10	10	0,00				
6,175 % fällig am 25.12.2034	78	73	0,00	6,130 % fällig am 25.12.2035	144	128	0,00				
6,175 % fällig am 25.01.2035	1.380	1.330	0,02	6,310 % fällig am 25.12.2034	4	4	0,00				
6,265 % fällig am 25.03.2034	569	569	0,01	Saxon Asset Securities Trust							
6,325 % fällig am 25.03.2034	340	340	0,01	5,770 % fällig am 25.05.2047	6.212	4.347	0,06				
6,340 % fällig am 25.09.2035	4.318	3.512	0,05	5,870 % fällig am 25.09.2047	11.523	10.529	0,14				
6,460 % fällig am 25.06.2035	834	815	0,01	5,935 % fällig am 25.03.2036	1.465	1.401	0,02				
6,720 % fällig am 25.07.2037	400	337	0,00	Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust							
9,270 % fällig am 25.02.2047	676	551	0,01	5,650 % fällig am 25.07.2036	240	83	0,00				
Morgan Stanley Capital, Inc. Trust				5,750 % fällig am 25.07.2036	688	563	0,01				
5,830 % fällig am 25.03.2036	92	73	0,00	5,970 % fällig am 25.03.2036	1.215	744	0,01				
Morgan Stanley Dean Witter Capital, Inc. Trust				5,970 % fällig am 25.05.2036	248	130	0,00				
6,820 % fällig am 25.02.2033	204	206	0,00	6,010 % fällig am 25.03.2036	105	94	0,00				
Morgan Stanley Home Equity Loan Trust				6,130 % fällig am 25.08.2035	108	86	0,00				
5,570 % fällig am 25.12.2036	1.401	680	0,01	SG Mortgage Securities Trust							
5,700 % fällig am 25.04.2037	2.315	1.206	0,02	5,680 % fällig am 25.10.2036	1.500	1.068	0,01				
5,790 % fällig am 25.04.2036	66	47	0,00	Soundview Home Loan Trust							
5,820 % fällig am 25.04.2037	15.810	8.255	0,11	5,590 % fällig am 25.11.2036	33	10	0,00				
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				5,935 % fällig am 25.06.2036	15.508	12.919	0,17				
6,000 % fällig am 25.02.2037	52	29	0,00	5,950 % fällig am 25.07.2036	200	174	0,00				
6,000 % fällig am 25.04.2037	9.877	3.514	0,05	Specialty Underwriting & Residential Finance Trust							
7,049 % fällig am 25.11.2036	220	78	0,00	4,074 % fällig am 25.02.2037	477	173	0,00				
New Century Home Equity Loan Trust				5,740 % fällig am 25.02.2037	114	79	0,00				
5,830 % fällig am 25.05.2036	6	6	0,00	5,770 % fällig am 25.11.2037	626	343	0,01				
6,190 % fällig am 25.03.2035	167	164	0,00								
NovaStar Mortgage Funding Trust											
5,570 % fällig am 25.03.2037	853	287	0,00								

STAMMAKTIE ENERGIE

AKTIEN	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Constellation Oil Services Holding S.A. 'B' (c)(i)	844.339	91	0,00

UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Alaska Airlines Pass-Through Trust			
4,800 % fällig am 15.02.2029	\$ 2.386	2.322	0,03
Ally Financial, Inc.			
8,000 % fällig am 01.11.2031	12.575	13.784	0,19
AMC Networks, Inc.			
4,250 % fällig am 15.02.2029	750	573	0,01
American Airlines Pass-Through Trust			
3,000 % fällig am 15.04.2030	739	668	0,01
3,150 % fällig am 15.08.2033	2.946	2.583	0,03
3,200 % fällig am 15.12.2029	3.575	3.260	0,04
3,350 % fällig am 15.04.2031	2.599	2.350	0,03
3,375 % fällig am 01.11.2028	3.624	3.324	0,04
3,575 % fällig am 15.07.2029	2.134	1.992	0,03
3,650 % fällig am 15.12.2029	4.047	3.623	0,05
3,650 % fällig am 15.08.2030	4.118</		

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
5,930 % fällig am 01.05.2060	\$ 10.000	\$ 10.373	0,14	4,125 % fällig am 17.08.2027	\$ 6.100	\$ 5.780	0,08	NuStar Logistics LP			
Booz Allen Hamilton, Inc.				4,271 % fällig am 09.01.2027	1.700	1.631	0,02	5,625 % fällig am 28.04.2027	\$ 20.400	\$ 20.331	0,27
3,875 % fällig am 01.09.2028	1.200	1.132	0,02	4,389 % fällig am 08.01.2026	1.800	1.751	0,02	Occidental Petroleum Corp.			
British Airways Pass-Through Trust				4,535 % fällig am 06.03.2025	£ 2.800	3.520	0,05	6,625 % fällig am 01.09.2030	20.900	22.253	0,30
2,900 % fällig am 15.09.2036	1.202	1.031	0,01	4,542 % fällig am 01.08.2026	\$ 1.900	1.841	0,02	8,875 % fällig am 15.07.2030	2.915	3.415	0,05
4,250 % fällig am 15.05.2034	2.301	2.148	0,03	5,125 % fällig am 16.06.2025	1.525	1.507	0,02	Omega Healthcare Investors, Inc.			
Broadcom, Inc.				5,584 % fällig am 18.03.2024	4.600	4.594	0,06	4,750 % fällig am 15.01.2028	200	193	0,00
2,450 % fällig am 15.02.2031	8.900	7.616	0,10	7,350 % fällig am 04.11.2027	1.100	1.161	0,02	OneMain Finance Corp.			
3,187 % fällig am 15.11.2036	2.600	2.108	0,03	Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC				6,875 % fällig am 15.03.2025	11.800	11.954	0,16
4,926 % fällig am 15.05.2037	1.242	1.203	0,02	5,500 % fällig am 01.05.2028	19.600	18.864	0,25	7,125 % fällig am 15.03.2026	3.458	3.525	0,05
Cantor Fitzgerald LP				6,500 % fällig am 01.10.2025	13.461	13.430	0,18	Organon & Co.			
7,200 % fällig am 12.12.2028	4.875	5.001	0,07	Freedom Mortgage Corp.				2,875 % fällig am 30.04.2028	€ 41.400	42.124	0,57
Centene Corp.				6,625 % fällig am 15.01.2027	13.100	12.516	0,17	Pacific Gas & Electric Co.			
3,000 % fällig am 15.10.2030	5.000	4.337	0,06	7,625 % fällig am 01.05.2026	23.900	23.606	0,32	2,100 % fällig am 01.08.2027	\$ 300	271	0,00
4,625 % fällig am 15.12.2029	3.500	3.360	0,05	General Motors Co.				2,500 % fällig am 01.02.2031	1.300	1.074	0,01
Charter Communications Operating LLC				6,800 % fällig am 01.10.2027 (i)	700	743	0,01	3,150 % fällig am 01.01.2026	8.400	8.060	0,11
3,850 % fällig am 01.04.2061	11.300	7.052	0,09	Genesis Energy LP				3,300 % fällig am 15.03.2027	3.100	2.901	0,04
4,200 % fällig am 15.03.2028	4.300	4.134	0,06	8,875 % fällig am 15.04.2030	1.400	1.449	0,02	3,300 % fällig am 01.12.2027	2.900	2.709	0,04
5,375 % fällig am 01.04.2038	3.800	3.432	0,05	Global Atlantic Fin Co.				3,300 % fällig am 01.08.2040	25.900	18.998	0,26
Chesapeake Energy Corp.				4,400 % fällig am 15.10.2029	11.620	10.711	0,14	3,400 % fällig am 15.08.2024	1.900	1.869	0,02
5,500 % fällig am 01.02.2026	1.500	1.488	0,02	GLP Capital LP				3,450 % fällig am 01.07.2025	2.250	2.179	0,03
Citigroup, Inc.				5,750 % fällig am 01.06.2028	3.700	3.736	0,05	3,500 % fällig am 15.06.2025	2.000	1.939	0,03
2,572 % fällig am 03.06.2031 (i)	6.900	5.898	0,08	GN Bondco LLC				3,750 % fällig am 01.07.2028	2.350	2.203	0,03
Cloud Software Group, Inc.				9,500 % fällig am 15.10.2031	7.700	7.528	0,10	3,950 % fällig am 01.12.2047	800	587	0,01
6,500 % fällig am 31.03.2029	4.000	3.813	0,05	Goldman Sachs Group, Inc.				4,200 % fällig am 01.06.2041	1.100	882	0,01
CommScope, Inc.				2,615 % fällig am 22.04.2032	5.000	4.199	0,06	4,250 % fällig am 15.03.2046	2.000	1.543	0,02
4,750 % fällig am 01.09.2029	9.100	6.118	0,08	Gray Oak Pipeline LLC				4,450 % fällig am 15.04.2042	3.500	2.833	0,04
Community Health Systems, Inc.				3,450 % fällig am 15.10.2027	6.900	6.425	0,09	4,500 % fällig am 01.07.2040	9.396	7.961	0,11
6,000 % fällig am 15.01.2029	2.200	1.983	0,03	GTCR W-2 Merger Sub LLC				4,600 % fällig am 15.06.2043	3.600	2.972	0,04
8,000 % fällig am 15.03.2026	2.124	2.119	0,03	7,500 % fällig am 15.01.2031	4.125	4.362	0,06	4,650 % fällig am 01.08.2028	100	96	0,00
Coty, Inc.				HAT Holdings LLC				Plains All American Pipeline LP			
3,875 % fällig am 15.04.2026	€ 16.400	18.126	0,24	8,000 % fällig am 15.06.2027	3.300	3.441	0,05	5,150 % fällig am 01.06.2042	12.177	11.036	0,15
Credit Acceptance Corp.				HCA, Inc.				6,650 % fällig am 15.01.2037	6.790	7.278	0,10
9,250 % fällig am 15.12.2028	\$ 5.000	5.336	0,07	3,500 % fällig am 15.07.2051	5.000	3.527	0,05	Rio Oil Finance Trust			
Credit Suisse AG AT1 Claim				5,500 % fällig am 01.06.2033	1.600	1.626	0,02	9,750 % fällig am 06.01.2027	1.330	1.386	0,02
Crown Castle, Inc.				5,900 % fällig am 01.06.2053	1.775	1.822	0,02	RLJ Lodging Trust LP			
2,100 % fällig am 01.04.2031	6.500	5.298	0,07	IQVIA, Inc.				3,750 % fällig am 01.07.2026	1.600	1.517	0,02
2,250 % fällig am 15.01.2031	4.000	3.315	0,04	5,700 % fällig am 15.05.2028	2.000	2.040	0,03	Rockies Express Pipeline LLC			
2,500 % fällig am 15.07.2031	5.000	4.173	0,06	JetBlue Pass-Through Trust				3,600 % fällig am 15.05.2025	100	97	0,00
5,000 % fällig am 11.01.2028	6.500	6.480	0,09	2,750 % fällig am 15.11.2033	817	691	0,01	4,800 % fällig am 15.05.2030	14.400	13.195	0,18
CVS Health Corp.				4,000 % fällig am 15.05.2034	9.162	8.410	0,11	4,950 % fällig am 15.07.2029	5.000	4.787	0,06
3,250 % fällig am 15.08.2029	8.330	7.767	0,10	JPMorgan Chase & Co.				Sabine Pass Liquefaction LLC			
DAE Funding LLC				4,586 % fällig am 26.04.2033	5.000	4.832	0,06	5,625 % fällig am 01.03.2025	40.625	40.731	0,54
1,550 % fällig am 01.08.2024	15.800	15.396	0,21	Kennedy-Wilson, Inc.				Santander Holdings USA, Inc.			
1,625 % fällig am 15.02.2024	13.500	13.428	0,18	4,750 % fällig am 01.02.2030	24.300	19.727	0,26	3,450 % fällig am 02.06.2025	7.900	7.681	0,10
2,625 % fällig am 20.03.2025	7.700	7.395	0,10	Las Vegas Sands Corp.				Sirius XM Radio, Inc.			
3,375 % fällig am 20.03.2028	8.700	8.030	0,11	3,200 % fällig am 08.08.2024	5.610	5.505	0,07	3,125 % fällig am 01.09.2026	4.300	4.044	0,05
Dell International LLC				3,500 % fällig am 18.08.2026	6.500	6.200	0,08	4,125 % fällig am 01.07.2030	3.000	2.677	0,04
8,100 % fällig am 15.07.2036	2.337	2.877	0,04	3,900 % fällig am 08.08.2029	3.100	2.860	0,04	Sitio Royalties Operating Partnership LP			
DISH DBS Corp.				LifePoint Health, Inc.				7,875 % fällig am 01.11.2028	2.000	2.074	0,03
5,750 % fällig am 01.12.2028	7.100	5.676	0,08	11,000 % fällig am 15.10.2030	13.350	14.076	0,19	Spirit AeroSystems, Inc.			
Edison International				Marriott International, Inc.				9,375 % fällig am 30.11.2029	900	986	0,01
5,750 % fällig am 15.06.2027	100	102	0,00	4,625 % fällig am 15.06.2030	900	884	0,01	9,750 % fällig am 15.11.2030	3.100	3.336	0,04
El Paso Natural Gas Co. LLC				Marvell Technology, Inc.				Spirit Airlines Pass-Through Trust			
8,375 % fällig am 15.06.2032	1.000	1.168	0,02	5,750 % fällig am 15.02.2029	2.300	2.378	0,03	4,100 % fällig am 01.10.2029	282	259	0,00
Elevance Health, Inc.				Mattel, Inc.				Sprint Capital Corp.			
4,750 % fällig am 15.02.2033	2.400	2.402	0,03	3,375 % fällig am 01.04.2026	2.800	2.665	0,04	8,750 % fällig am 15.03.2032	12.000	14.825	0,20
Energy Transfer LP				McAfee Corp.				Sprint LLC			
4,950 % fällig am 15.05.2028	14.763	14.703	0,20	7,375 % fällig am 15.02.2030	2.000	1.829	0,02	7,625 % fällig am 01.03.2026	1.125	1.176	0,02
5,950 % fällig am 01.10.2043	200	198	0,00	Medline Borrower LP				Standard Industries, Inc.			
6,050 % fällig am 01.06.2041	3.811	3.841	0,05	3,875 % fällig am 01.04.2029	6.000	5.432	0,07	2,250 % fällig am 21.11.2026	€ 37.000	38.776	0,52
6,100 % fällig am 15.02.2042	800	805	0,01	5,250 % fällig am 01.10.2029	6.000	5.664	0,08	4,750 % fällig am 15.01.2028	\$ 3.450	3.324	0,04
6,500 % fällig am 01.02.2042	7.140	7.554	0,10	Midwest Connector Capital Co. LLC				Synchrony Financial			
6,625 % fällig am 15.10.2036	800	863	0,01	3,900 % fällig am 01.04.2024	1.300	1.293	0,02	5,150 % fällig am 19.03.2029	300	292	0,00
7,500 % fällig am 01.07.2038	12.865	14.913	0,20	Morgan Stanley				T-Mobile USA, Inc.			
EQT Corp.				5,250 % fällig am 21.04.2034	5.000	5.002	0,07	4,950 % fällig am 15.03.2028	1.000	1.014	0,01
6,125 % fällig am 01.02.2025	28.205	28.348	0,38	National Fuel Gas Co.				5,650 % fällig am 15.01.2053	2.000	2.084	0,03
Fidelity National Financial, Inc.				2,950 % fällig am 01.03.2031	1.017	853	0,01	Tallgrass Energy Partners LP			
3,400 % fällig am 15.06.2030	200	178	0,00	Netflix, Inc.				5,500 % fällig am 15.01.2028	3.400	3.217	0,04
First Student Bidco, Inc.				NextEra Energy Operating Partners LP				6,000 % fällig am 31.12.2030	7.450	6.936	0,09
4,000 % fällig am 31.07.2029	1.400	1.215	0,02	7,250 % fällig am 15.01.2029	2.650	2.776	0,04	Tennessee Gas Pipeline Co. LLC			
Ford Motor Credit Co. LLC				NGPL PipeCo LLC				8,375 % fällig am 15.06.2032	1.351	1.577	0,02
2,386 % fällig am 17.02.2026	€ 4.200	4.516	0,06	7,768 % fällig am 15.12.2037	21.356	23.815	0,32	Time Warner Cable LLC			
2,700 % fällig am 10.08.2026	\$ 13.600	12.602	0,17	Noble Finance LLC				4,500 % fällig am 15.09.2042	1.200	943	0,01
2,748 % fällig am 14.06.2024	£ 6.500	8.176	0,11	8,000 % fällig am 15.04.2030	3.050	3.176	0,04	6,750 % fällig am 15.06.2039	1.700	1.688	0,02
3,250 % fällig am 15.09.2025	€ 4.000	4.367	0,06					TransDigm, Inc.			
3,815 % fällig am 02.11.2027	\$ 1.200	1.121	0,01					7,125 % fällig am 01.12.2031	7.375	7.738	0,10

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	
US-SCHATZOBLIGATIONEN				KURZFRISTIGE INSTRUMENTE				PIMCO Funds: Global				
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				ARGENTINISCHE SCHATZWECHSEL				PIMCO Funds: Global Investors Series plc - US Short-Term Fund (g)				
5,000 % fällig am 01.01.2054	\$ 185.800	\$ 183.843	2,47	(34,368) % fällig am 20.05.2024 (d)(e)	ARS 2.067	\$ 3	0,00		34.226.990	\$ 346.377	4,65	
5,500 % fällig am 01.02.2054	205.600	206.532	2,78	UNGARISCHE SCHATZWECHSEL				PIMCO Select Funds				
6,000 % fällig am 01.02.2054	209.900	213.139	2,86	10,900 % fällig am 04.01.2024 (d)(e)	HUF 11.991.000	34.634	0,47	plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (g)	8.884.015	88.526	1,19	
6,500 % fällig am 01.02.2054	309.650	317.306	4,27	Summe kurzfristige Instrumente		34.637	0,47			470.418	6,32	
		935.984	12,58	Summe übertragbare Wertpapiere		\$ 6.280.493	84,41	BÖRSENGEHANDELTE FONDS				
U.S. Treasury Bonds				AKTIEN				PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (g)				
4,000 % fällig am 15.11.2042	98.500	95.757	1,29	INVESTMENTFONDS					2.698.640	269.108	3,62	
				ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN				Summe Investmentfonds		\$ 739.526	9,94	
Summe USA		2.699.124	36,27	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (g)								
VENEZUELA UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Asia Strategic Interest Bond Fund (g)								
Petroleos de Venezuela S.A.				3.514.066		32.470	0,44					
6,000 % fällig am 16.05.2034	8.400	966	0,01	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Asia Strategic Interest Bond Fund (g)								
				329.154		3.045	0,04					
STAATSEMISSIONEN				Venezuela Government International Bond								
Venezuela Government International Bond				6,000 % fällig am 09.12.2020 ^	2.651	371	0,01					
				7,000 % fällig am 31.03.2048 ^	16.792	2.569	0,03					
				9,250 % fällig am 07.05.2038 ^	7.813	1.364	0,02					
						4.304	0,06					
Summe Venezuela		5.270	0,07									

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft ⁽¹⁾	% des Netto- vermögens
BSN	4,980 %	28.12.2023	03.01.2024	CAD 110.000	Canada Government International Bond 1,500 % fällig am 01.12.2031	\$ (84.905)	\$ 83.422	\$ 83.512	1,12
CEW	4,960	27.12.2023	03.01.2024	200.000	Province of Ontario 3,500 % fällig am 02.06.2024	(155.333)	151.676	151.866	2,04
	4,980	11.12.2023	03.01.2024	1.000.000	Province of Ontario 2,800 % - 3,650 % fällig am 02.06.2033 - 02.06.2048	(674.322)	758.380	761.518	10,20
					Province of Quebec 3,100 % - 3,250 % fällig am 01.09.2032 - 01.12.2051	(127.655)			
DEU	5,480	02.01.2024	03.01.2024	\$ 81.300	U.S. Treasury Notes 1,750 % fällig am 31.01.2029	(83.024)	81.300	81.312	1,09
	5,510	02.01.2024	03.01.2024	100	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,750 % fällig am 15.02.2042	(103)	100	100	0,00
FICC	2,600	29.12.2023	02.01.2024	42.525	U.S. Treasury Notes 4,875 % fällig am 30.11.2025	(43.376)	42.525	42.534	0,57
	5,330	29.12.2023	02.01.2024	62.000	U.S. Treasury Notes 1,375 % fällig am 31.12.2028	(63.240)	62.000	62.000	0,83
IND	5,215	18.12.2023	03.01.2024	£ 33.000	United Kingdom Inflation-Linked Gilt 3,750 % fällig am 22.10.2053	(43.772)	42.068	42.144	0,57
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (1.275.730)	\$ 1.221.471	\$ 1.224.986	16,42

(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
Australia Government 10-Year Bond March Futures	Long	03/2024	156	\$ 355	0,01
Euro-Bobl March Futures	Short	03/2024	648	(4)	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Long	03/2024	1.311	6.291	0,08
Euro-Schatz March Futures	Short	03/2024	4.548	(3.124)	(0,04)
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Long	03/2024	3.590	6.821	0,09
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03/2024	5.643	12.633	0,17
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03/2024	4.100	15.578	0,21
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Long	03/2024	2.350	27.868	0,38
United Kingdom Long Gilt March Futures	Long	03/2024	207	1.814	0,02
				\$ 68.232	0,92
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 68.232	0,92

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

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

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2024	\$ 18.200	\$ 49	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2026	12.800	(110)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2028	4.400	69	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2026	500	10	0,00
Boeing Co.	1,000	20.06.2027	1.200	17	0,00
Carnival Corp.	1,000	20.12.2028	6.200	778	0,01
Cellnex Telecom S.A.	5,000	20.12.2030	€ 12.400	734	0,01
Charter Communications, Inc.	5,000	20.12.2027	\$ 21.000	675	0,01
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.12.2024	600	1	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2025	1.300	27	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2026	800	36	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2027	6.900	248	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2024	14.300	358	0,01
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	35.000	330	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2026	4.300	35	0,00
General Motors Co.	5,000	20.06.2026	4.200	(378)	(0,01)
Glencore Finance Europe Ltd.	5,000	20.12.2025	€ 20.900	(2.705)	(0,04)
Glencore Finance Europe Ltd.	5,000	20.12.2027	26.000	(3.048)	(0,04)
Marks & Spencer PLC	1,000	20.12.2024	18.600	1.082	0,02
Marks & Spencer PLC	1,000	20.12.2028	11.000	853	0,01
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2024	40.600	252	0,00
T-Mobile USA, Inc.	5,000	20.06.2028	\$ 1.400	14	0,00
Volkswagen International Finance NV	1,000	20.12.2026	€ 5.200	(43)	0,00
Volkswagen International Finance NV	1,000	20.06.2027	8.300	341	0,01
				\$ (375)	(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-41 5-Year Index	5,000 %	20.12.2028	\$ 569.844	\$ 29.055	0,40
CDX.IG-40 5-Year Index	1,000	20.06.2028	2.900	26	0,00
CDX.IG-41 5-Year Index	1,000	20.12.2028	245.700	1.743	0,02
				\$ 30.824	0,42

ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,500 %	16.09.2025	£ 21.100	\$ 1.978	0,03
Zahlung ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,250	20.03.2054	4.600	766	0,01
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	5,000	20.03.2029	45.700	(3.329)	(0,04)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	15.06.2032	¥ 12.250.000	1.092	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.12.2028	\$ 1.200	55	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	0,880	03.03.2024	CAD 273.400	(4.814)	(0,06)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	2,500	19.06.2029	91.700	(6.553)	(0,09)
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,750	20.12.2025	80.700	1.089	0,01
Zahlung ⁽³⁾	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,750	20.12.2033	AUD 103.000	1.515	0,02
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,520	07.07.2027	€ 127.500	(3.611)	(0,05)
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	20.03.2054	38.500	(350)	0,00
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.03.2034	83.700	92	0,00
					\$ (12.070)	(0,16)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ 18.379	0,25

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

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

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

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Fund (Forts.)

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

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

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Brazil Government International Bond	1,000 %	20.12.2028	\$ 23.600	\$ (466)	\$ 143	\$ (323)	(0,01)
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2028	22.000	(1.915)	1.155	(760)	(0,01)
BPS	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2028	23.700	(458)	134	(324)	(0,01)
BRC	Indonesia Government International Bond	1,000	20.06.2031	61.600	(2.646)	2.486	(160)	0,00
	Intrum AB	5,000	20.12.2024	€ 1.200	113	(123)	(10)	0,00
DUB	Eskom Holdings SOC Ltd.	4,650	30.06.2029	\$ 5.000	0	434	434	0,01
GST	ADLER Real Estate AG	5,000	20.12.2026	€ 7.400	(46)	(1.407)	(1.453)	(0,02)
	Intrum AB	5,000	20.12.2024	19.600	1.957	(2.124)	(167)	0,00
JPM	Intrum AB	5,000	20.12.2024	1.000	92	(101)	(9)	0,00
MYC	Intrum AB	5,000	20.12.2024	3.300	350	(378)	(28)	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2028	\$ 22.400	(1.302)	528	(774)	(0,01)
MYI	Intrum AB	5,000	20.12.2024	€ 12.600	604	(711)	(107)	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2028	\$ 26.700	(1.555)	633	(922)	(0,01)
					\$ (5.272)	\$ 669	\$ (4.603)	(0,06)

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

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	01.2024	AUD 2.316	\$ 1.533	\$ 0	\$ (47)	\$ (47)	0,00
BOA	01.2024	CAD 4.322	3.191	0	(87)	(87)	0,00
	01.2024	£ 15.291	19.390	0	(103)	(103)	0,00
	01.2024	¥ 234.997	1.592	0	(76)	(76)	0,00
	01.2024	PEN 63.643	17.151	0	(28)	(28)	0,00
	02.2024	\$ 220	CNY 1.558	0	0	0	0,00
	03.2024	INR 6.822	\$ 82	0	0	0	0,00
BPS	01.2024	CAD 1.049.447	774.869	0	(21.028)	(21.028)	(0,28)
	01.2024	€ 1.572.882	1.730.859	0	(7.026)	(7.026)	(0,10)
	01.2024	£ 32.260	40.921	0	(206)	(206)	0,00
	01.2024	HUF 4.952.122	14.094	0	(216)	(216)	0,00
	01.2024	PEN 4.992	1.340	0	(7)	(7)	0,00
	01.2024	\$ 1.086	AUD 1.597	3	0	3	0,00
	01.2024	14.007	CAD 18.582	87	0	87	0,00
	01.2024	7.542	€ 6.843	40	(21)	19	0,00
	01.2024	5	HUF 1.882	0	0	0	0,00
	01.2024	1.104	ZAR 20.474	14	0	14	0,00
	02.2024	391	CNY 2.778	1	0	1	0,00
	03.2024	CNH 43	\$ 6	0	0	0	0,00
	03.2024	INR 23.695	283	0	0	0	0,00
BRC	01.2024	CAD 8.484	6.346	0	(89)	(89)	0,00
	01.2024	£ 497	631	0	(2)	(2)	0,00
	01.2024	\$ 6.834	CAD 9.283	207	0	207	0,00
	01.2024	1.888	€ 1.727	20	0	20	0,00
	01.2024	761	PLN 3.326	85	0	85	0,00
	04.2024	7.095	TRY 229.806	0	(97)	(97)	0,00
CBK	01.2024	CAD 358	\$ 264	0	(8)	(8)	0,00
	01.2024	£ 2.450	3.080	0	(43)	(43)	0,00
	01.2024	HUF 1.010.007	2.883	0	(35)	(35)	0,00
	01.2024	NOK 1.680	157	0	(8)	(8)	0,00
	01.2024	TRY 89	3	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 1.017	AUD 1.513	15	0	15	0,00
	01.2024	1.133	CAD 1.533	29	0	29	0,00
	01.2024	3.266	€ 3.023	74	0	74	0,00
DUB	01.2024	CAD 200.190	\$ 150.899	0	(924)	(924)	(0,01)
GLM	01.2024	11.430	8.411	0	(258)	(258)	(0,01)
	01.2024	£ 38.015	48.546	89	(4)	85	0,00
	01.2024	MXN 73.023	4.163	0	(130)	(130)	0,00
	02.2024	TRY 92	3	0	0	0	0,00
JPM	01.2024	HUF 5.364.791	15.274	0	(229)	(229)	0,00
	03.2024	INR 7.102	85	0	0	0	0,00
	03.2024	SGD 477	359	0	(3)	(3)	0,00
MBC	01.2024	AUD 1.574	1.044	0	(31)	(31)	0,00
	01.2024	CAD 651	481	0	(13)	(13)	0,00
	01.2024	HUF 205.761	585	0	(10)	(10)	0,00
	01.2024	\$ 47.273	€ 43.376	654	0	654	0,01
MYI	01.2024	AUD 11	\$ 8	0	0	0	0,00
	01.2024	CAD 114.090	86.255	0	(270)	(270)	(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	£ 88	\$ 112	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2024	HUF 418.814	1.190	0	(20)	(20)	0,00
	01.2024	¥ 89.277	606	0	(28)	(28)	0,00
	01.2024	MXN 1.200	71	0	0	0	0,00
	01.2024	SGD 959	727	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 2	AUD 3	0	0	0	0,00
	01.2024	2.009	€ 1.824	9	(3)	6	0,00
	01.2024	3.695	£ 2.894	0	(6)	(6)	0,00
	02.2024	230	CNY 1.627	0	0	0	0,00
RBC	04.2024	MXN 106	\$ 6	0	0	0	0,00
SCX	01.2024	CAD 863	636	0	(19)	(19)	0,00
	01.2024	\$ 1.761	CAD 2.324	2	0	2	0,00
	03.2024	INR 15.462	\$ 185	0	0	0	0,00
TOR	01.2024	¥ 146.800	1.001	0	(41)	(41)	0,00
	01.2024	MXN 78	4	0	0	0	0,00
UAG	01.2024	AUD 878	583	0	(17)	(17)	0,00
	01.2024	£ 173.965	220.151	0	(1.627)	(1.627)	(0,02)
	01.2024	SEK 2.168	210	0	(5)	(5)	0,00
				\$ 1.329	\$ (32.765)	\$ (31.436)	(0,42)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 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	01.2024	\$ 14.485	AUD 21.845	\$ 424	0	\$ 424	0,01
BOA	01.2024	1.006	1.520	32	0	32	0,00
BPS	01.2024	AUD 368	\$ 246	0	(5)	(5)	0,00
	01.2024	\$ 147	AUD 219	2	0	2	0,00
BRC	01.2024	AUD 22	\$ 15	0	(1)	(1)	0,00
CBK	01.2024	6	4	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 32	AUD 48	1	0	1	0,00
GLM	01.2024	AUD 5	\$ 4	0	0	0	0,00
MBC	01.2024	19	13	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 5.626	AUD 8.486	166	0	166	0,00
RYL	01.2024	24	36	0	0	0	0,00
UAG	01.2024	6.978	10.517	200	0	200	0,00
				\$ 825	\$ (6)	\$ 819	0,01

Zum 31. Dezember 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
BPS	01.2024	CAD 430	\$ 316	\$ 0	(10)	(10)	0,00
BRC	01.2024	\$ 98.124	CAD 133.436	3.082	0	3.082	0,04
CBK	01.2024	CAD 157	\$ 118	0	(1)	(1)	0,00
GLM	01.2024	200	147	0	(4)	(4)	0,00
	01.2024	\$ 109.098	CAD 148.259	3.351	0	3.351	0,04
MBC	01.2024	14.943	20.222	395	0	395	0,01
MYI	01.2024	11.947	15.753	0	0	0	0,00
UAG	01.2024	109.717	148.825	3.161	0	3.161	0,04
				\$ 9.989	\$ (15)	\$ 9.974	0,13

Zum 31. Dezember 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	01.2024	CHF 13	\$ 16	\$ 0	0	\$ 0	0,00
	01.2024	\$ 175	CHF 151	4	0	4	0,00
BRC	01.2024	CHF 25	\$ 29	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	\$ 1.283	CHF 1.119	47	0	47	0,00
CBK	01.2024	CHF 43	\$ 50	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	\$ 8.717	CHF 7.595	311	0	311	0,00
GLM	01.2024	CHF 151	\$ 173	0	(7)	(7)	0,00
	01.2024	\$ 9.797	CHF 8.585	408	0	408	0,01
MYI	01.2024	CHF 136	\$ 156	0	(6)	(6)	0,00
	01.2024	\$ 9.729	CHF 8.493	367	0	367	0,00
SCX	01.2024	CHF 38	\$ 45	0	0	0	0,00
				\$ 1.137	\$ (15)	\$ 1.122	0,01

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Fund (Forts.)

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Investor EUR (Hedged) ausschüttend, Administrative EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) ausschüttend, Class T EUR (Hedged) thesaurierend, Class T EUR (Hedged) ausschüttend, Class W EUR (Hedged) thesaurierend und Class W EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	01.2024	€ 56.744	\$ 61.407	\$ 2	\$ (1.293)	\$ (1.291)	(0,02)
	01.2024	\$ 997.328	€ 906.033	3.751	0	3.751	0,05
BRC	01.2024	995.833	905.484	4.640	0	4.640	0,06
CBK	01.2024	€ 16.591	\$ 18.239	17	(109)	(92)	0,00
MBC	01.2024	1.826	1.980	0	(38)	(38)	0,00
	01.2024	\$ 881.967	€ 806.608	9.256	0	9.256	0,13
SCX	01.2024	129.008	118.226	1.620	0	1.620	0,02
				\$ 19.286	\$ (1.440)	\$ 17.846	0,24

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilklassen 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	01.2024	£ 7	\$ 9	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2024	\$ 59.359	£ 46.849	366	0	366	0,00
BPS	01.2024	£ 195	\$ 246	0	(3)	(3)	0,00
	01.2024	\$ 268.768	£ 212.698	2.388	0	2.388	0,03
BRC	01.2024	974	770	8	0	8	0,00
CBK	01.2024	£ 20.260	\$ 25.648	0	(181)	(181)	0,00
	01.2024	\$ 545	£ 433	7	0	7	0,00
GLM	01.2024	£ 15	\$ 19	0	0	0	0,00
MBC	01.2024	2.961	3.770	0	(5)	(5)	0,00
	01.2024	\$ 976	£ 774	11	0	11	0,00
MYI	01.2024	£ 54	\$ 67	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	\$ 86	£ 67	0	0	0	0,00
SCX	01.2024	333.799	263.898	2.629	0	2.629	0,04
SSB	01.2024	£ 76	\$ 96	0	(1)	(1)	0,00
UAG	01.2024	10	12	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 333.775	£ 263.735	2.445	0	2.445	0,03
				\$ 7.854	\$ (191)	\$ 7.663	0,10

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilklasse 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	01.2024	\$ 393	¥ 57.969	\$ 19	\$ 0	\$ 19	0,00
BPS	01.2024	849	124.592	35	0	35	0,00
GLM	01.2024	654	96.198	28	0	28	0,00
MYI	01.2024	519	76.469	24	0	24	0,00
				\$ 106	\$ 0	\$ 106	0,00

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilklasse 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
BOA	02.2024	\$ 71	MXN 1.200	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BPS	01.2024	MXN 131.113	\$ 7.732	0	(8)	(8)	0,00
	02.2024	\$ 7.697	MXN 131.113	9	0	9	0,00
BRC	01.2024	224	3.871	5	0	5	0,00
CBK	01.2024	MXN 131.113	\$ 7.736	0	(4)	(4)	0,00
	01.2024	\$ 239	MXN 4.201	9	0	9	0,00
	02.2024	7.701	131.113	5	0	5	0,00
GLM	01.2024	MXN 61.150	\$ 3.540	0	(70)	(70)	0,00
MBC	01.2024	6.600	386	0	(4)	(4)	0,00
	01.2024	\$ 9.286	MXN 159.781	146	0	146	0,00
MYI	01.2024	MXN 20.955	\$ 1.233	0	(4)	(4)	0,00
	01.2024	\$ 8.248	MXN 142.218	147	0	147	0,00
RBC	01.2024	974	16.893	23	0	23	0,00
SCX	01.2024	MXN 131.113	\$ 7.734	0	(6)	(6)	0,00
	01.2024	\$ 8.996	MXN 155.081	158	0	158	0,01
	02.2024	7.699	131.113	7	0	7	0,00
				\$ 509	\$ (96)	\$ 413	0,01

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilklassen Institutional SEK (Hedged) thesaurierend und Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2024	\$ 4.917	SEK 51.286	\$ 173	\$ 0	\$ 173	0,01
CBK	01.2024	708	7.390	26	0	26	0,00
GLM	01.2024	274	2.782	2	0	2	0,00
SCX	01.2024	5.413	56.221	167	0	167	0,00
UAG	01.2024	5.468	56.437	133	0	133	0,00
				\$ 501	\$ 0	\$ 501	0,01

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilklassen Institutional SGD (Hedged) ausschüttend, Administrative SGD (Hedged) ausschüttend, Class E SGD (Hedged) ausschüttend und Class W SGD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	01.2024	\$ 17.707	SGD 23.614	\$ 199	\$ 0	\$ 199	0,00
BOA	01.2024	21.213	28.300	248	0	248	0,01
GLM	01.2024	SGD 1.240	\$ 925	0	(15)	(15)	0,00
	01.2024	\$ 325	SGD 433	4	0	4	0,00
JPM	01.2024	4.924	6.568	56	0	56	0,00
MBC	01.2024	SGD 85	\$ 64	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	\$ 2.040	SGD 2.729	29	0	29	0,00
	02.2024	705	930	2	(1)	1	0,00
MYI	01.2024	19.516	26.034	225	0	225	0,00
	02.2024	SGD 299	\$ 227	0	0	0	0,00
UAG	01.2024	\$ 128	SGD 171	1	0	1	0,00
				\$ 764	\$ (17)	\$ 747	0,01

Summe Freiverkehrsfinauzderivate

\$ 3.152 0,04

Summe Anlagen

\$ 8.331.253 111,98

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (891.455) (11,98)

Nettovermögen

\$ 7.439.798 100,00

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) 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 Teilfonds verbunden.

(h) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(i) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,18 %):

Emittentenbeschreibung	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Altice France S.A, 11,500 % fällig am 01.02.2027	20.12.2023	\$ 5.184	\$ 5.420	0,07
Citigroup. Inc, 2,572 % fällig am 03.06.2031	26.05.2020	6.900	5.898	0,08
Constellation Oil Services Holding S.A, 'B'	10.06.2022	92	91	0,00
Corestate Capital Holding S.A,	22.08.2023	0	0	0,00
Deutsche Bank AG 3,729 % fällig am 14.01.2032	12.08.2022 - 16.08.2022	2.348	2.432	0,03
DrillCo Holding Lux S.A,	08.06.2023	8.869	11.011	0,15
General Motors Co, 6,800 % fällig am 01.10.2027	07.05.2020	699	743	0,01
Intelsat Emergence S.A,	24.02.2020 - 29.10.2021	16.083	5.257	0,07
		\$ 40.175	\$ 30.852	0,41

(j) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 51.497 (31. Dezember 2022: USD 6.805) und Barmittel in Höhe von USD 35.459 (31. Dezember 2022: USD 4.245) wurden zum 31. Dezember 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 2.346 (31. Dezember 2022: USD 277) wurden zum 31. Dezember 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von USD 146.278 (31. Dezember 2022: USD 268.487) wurden zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 29.812 (31. Dezember 2022: USD 9.202) wurden zum 31. Dezember 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Fund (Forts.)

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 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	\$ 6.229.045	\$ 51.448	\$ 6.280.493
Investmentfonds	470.418	269.108	0	739.526
Pensionsgeschäfte	0	1.221.471	0	1.221.471
Finanzderivate ⁽³⁾	5.332	83.997	434	89.763
Summen	\$ 475.750	\$ 7.803.621	\$ 51.882	\$ 8.331.253

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 6.595.189	\$ 25.428	\$ 6.620.617
Investmentfonds	609.289	267.341	0	876.630
Pensionsgeschäfte	0	1.746.323	0	1.746.323
Finanzderivate ⁽³⁾	69	(18.207)	0	(18.138)
Summen	\$ 609.358	\$ 8.590.646	\$ 25.428	\$ 9.225.432

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

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

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BPS	2,000 %	28.09.2023	TBD ⁽¹⁾	€ (1.134)	\$ (1.261)	(0,02)
BRC	0,500	20.09.2023	TBD ⁽¹⁾	(14.151)	(15.723)	(0,21)
	3,250	20.09.2023	TBD ⁽¹⁾	(3.218)	(3.576)	(0,05)
	3,250	30.11.2023	TBD ⁽¹⁾	(2.611)	(2.893)	(0,04)
	3,550	20.09.2023	TBD ⁽¹⁾	(663)	(737)	(0,01)
JML	(1,000)	14.11.2023	TBD ⁽¹⁾	(436)	(481)	(0,01)
	0,500	06.07.2023	TBD ⁽¹⁾	(3.575)	(3.982)	(0,05)
	0,500	30.10.2023	TBD ⁽¹⁾	(1.291)	(1.428)	(0,02)
	3,000	08.06.2023	TBD ⁽¹⁾	(2.124)	(2.380)	(0,03)
	3,000	12.06.2023	TBD ⁽¹⁾	(1.273)	(1.426)	(0,02)
	3,000	29.11.2023	TBD ⁽¹⁾	(4.222)	(4.674)	(0,06)
MYI	0,500	02.08.2023	TBD ⁽¹⁾	(8.240)	(9.162)	(0,12)
	0,500	07.08.2023	TBD ⁽¹⁾	(1.757)	(1.953)	(0,03)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (49.676)	(0,67)

⁽¹⁾ Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
AZD	\$ 576	\$ (650)	\$ (74)	\$ 58	\$ 0	\$ 58
BOA	(539)	420	(119)	941	(920)	21
BPS	(23.811)	26.170	2.359	650	(800)	(150)
BRC	7.734	(12.990)	(5.256)	(2.633)	2.650	17
CBK	104	0	104	(1.931)	1.730	(201)
DUB	(490)	280	(210)	k. A.	k. A.	k. A.
FBF	k. A.	k. A.	k. A.	(104)	260	156
GLM	3.394	(3.020)	374	233	(250)	(17)
GST	(1.620)	1.522	(98)	(2.878)	2.952	74
JPM	(185)	0	(185)	2.534	(3.820)	(1.286)
MBC	10.556	(15.430)	(4.874)	27.060	(25.160)	1.900
MYC	(802)	790	(12)	(152)	260	108
MYI	(595)	630	35	(196)	260	64
RBC	23	0	23	(385)	430	45
SCX	4.558	(5.960)	(1.402)	561	(330)	231
SSB	(1)	0	(1)	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	(41)	0	(41)	(772)	660	(112)
UAG	4.291	(3.950)	341	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. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	53,89	48,23
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	30,36	25,74
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,16	1,67
Investmentfonds	9,94	10,02
Pensionsgeschäfte	16,42	19,95
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,92	(0,32)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,25	(0,15)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,04	0,27
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,67)	(0,08)

* Gemäß der Liste der Märkte, die in Anhang 1 zum Prospekt aufgeführt sind und die Kriterien für gemäß OGAW-Vorschriften geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Albanien	0,24	0,18
Angola	0,20	k. A.
Argentinien	0,69	0,52
Australien	0,12	0,07
Weißrussland	k. A.	0,03
Bermuda	1,14	0,72
Brasilien	0,07	0,00
Kanada	0,67	0,29
Cayman-Inseln	2,20	2,14
Chile	0,09	0,08
China	0,01	0,03
Kolumbien	0,78	0,42
Costa Rica	0,07	k. A.
Zypern	0,11	0,17
Dänemark	0,19	0,14
Dominikanische Republik	0,52	0,38
Ecuador	0,39	0,25
Ägypten	0,56	0,56
Finnland	0,06	0,08
Frankreich	2,38	3,16
Deutschland	2,31	3,24
Ghana	0,17	0,06
Guatemala	0,21	k. A.
Guernsey, Kanalinseln	0,23	0,54
Hongkong	0,08	0,98
Ungarn	0,42	k. A.
Indien	k. A.	0,02
Indonesien	1,04	0,60
International	0,12	k. A.
Irland	6,81	6,34
Israel	0,09	0,11
Italien	3,37	3,95
Elfenbeinküste	0,17	0,12
Japan	0,30	0,92
Jersey, Kanalinseln	1,16	1,02
Jordanien	0,05	k. A.
Kasachstan	0,14	k. A.
Luxemburg	2,73	3,92
Mazedonien	0,10	0,08
Mauritius	k. A.	0,08
Mexiko	2,20	1,79
Multinational	0,18	0,33
Niederlande	2,79	3,82
Nigeria	0,48	0,41
Oman	0,30	0,31
Panama	0,38	0,25
Peru	0,51	k. A.
Philippinen	0,03	k. A.
Portugal	0,18	0,14
Katar	k. A.	0,12
Rumänien	0,69	0,07
Russland	0,10	0,29
Saudi-Arabien	0,86	k. A.
Senegal	0,04	k. A.
Serbien	0,23	0,07
Singapur	0,18	0,15
Slowenien	0,21	0,16
Südafrika	0,36	0,09
Spanien	0,64	0,97
Sri Lanka	0,15	0,08
Schweden	0,46	0,37
Schweiz	0,36	1,22
Türkei	0,94	0,70
Ukraine	0,31	0,22
Vereinigte Arabische Emirate	0,15	0,13

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Großbritannien	4,88	7,14
USA	36,27	22,65
Venezuela	0,07	0,03
Jungferninseln (Britisch)	k. A.	0,06
Kurzfristige Instrumente	0,47	2,87
Investmentfonds	9,94	10,02
Pensionsgeschäfte	16,42	19,95
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,92	(0,32)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,01)	(0,12)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,42	0,18
Zinsswaps	(0,16)	(0,21)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,06)	(0,02)
Devisenterminkontrakte	(0,42)	(0,76)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,52	1,05
Sonstige Aktiva und Passiva	(11,98)	(5,41)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
--------------	-------------	-------------------	-----------------------

ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE			
ANGOLA			
STAATSEMISSIONEN			
Angolan Government International Bond			
8,000 % fällig am 26.11.2029	\$ 500	\$ 446	0,11
9,125 % fällig am 26.11.2049	600	491	0,12
Summe Angola		937	0,23

ARGENTINIEN			
STAATSEMISSIONEN			
Argentina Government International Bond			
3,500 % fällig am 09.07.2041	7.422	2.535	0,62
3,625 % fällig am 09.07.2035	1.252	427	0,10
Provincia de Buenos Aires			
129,126 % fällig am 12.04.2025 (a)	ARS 610	1	0,00
Summe Argentinien		2.963	0,72

AUSTRALIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Santos Finance Ltd.			
6,875 % fällig am 19.09.2033	\$ 500	531	0,13

BERMUDA			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Aircastle Ltd.			
2,850 % fällig am 26.01.2028	1.100	982	0,24
5,250 % fällig am 11.08.2025	1.250	1.233	0,30
NCL Corp. Ltd.			
8,375 % fällig am 01.02.2028	500	530	0,13
Valaris Ltd.			
8,375 % fällig am 30.04.2030	300	308	0,07
Summe Bermuda		3.053	0,74

BRASILIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd.			
0,000 % fällig am 29.01.2024 (d)(f)	2.332	80	0,02

KANADA			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Air Canada Pass-Through Trust			
5,250 % fällig am 01.10.2030	436	428	0,11
B.C. Unlimited Liability Co.			
4,375 % fällig am 15.01.2028	700	669	0,16
Bausch & Lomb Escrow Corp.			
8,375 % fällig am 01.10.2028	300	317	0,08
Fairfax Financial Holdings Ltd.			
2,750 % fällig am 29.03.2028 €	2.000	2.112	0,51
goeasy Ltd.			
9,250 % fällig am 01.12.2028 \$	400	427	0,10
Open Text Corp.			
3,875 % fällig am 15.02.2028	700	651	0,16
Summe Kanada		4.604	1,12

CAYMAN-INSELN			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
CIFC Funding Ltd.			
6,640 % fällig am 24.04.2031	988	988	0,24
6,710 % fällig am 24.04.2030	1.993	1.989	0,48
Vibrant CLO Ltd.			
6,717 % fällig am 15.09.2030	176	176	0,05
		3.153	0,77

WANDELANLEIHEN & WECHSEL			
Sunac China Holdings Ltd.			
1,000 % fällig am 30.09.2032	510	40	0,01

UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Avolon Holdings Funding Ltd.			
2,125 % fällig am 21.02.2026	500	464	0,11
2,528 % fällig am 18.11.2027	1.627	1.443	0,35
Diamond Foreign Asset Co.			
8,500 % fällig am 01.10.2030	500	512	0,12

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
--------------	-------------	-------------------	-----------------------

Gaci First Investment Co.			
4,750 % fällig am 14.02.2030	\$ 2.000	\$ 2.003	0,49
5,125 % fällig am 14.02.2053	800	726	0,18
Kaisa Group Holdings Ltd.			
9,375 % fällig am 30.06.2024 ^	1.100	40	0,01
9,750 % fällig am 28.09.2023 ^	3.000	110	0,03
10,500 % fällig am 15.01.2025 ^	2.200	80	0,02
10,875 % fällig am 23.07.2023 ^	400	13	0,00
11,250 % fällig am 16.04.2025 ^	1.500	49	0,01
11,650 % fällig am 01.06.2026 ^	1.000	34	0,01
11,700 % fällig am 11.11.2025 ^	400	14	0,00

Lima Metro Line Finance Ltd.			
5,875 % fällig am 05.07.2034	400	396	0,10
Melco Resorts Finance Ltd.			
4,875 % fällig am 06.06.2025	700	680	0,16
5,375 % fällig am 04.12.2029	500	442	0,11
Sands China Ltd.			
3,500 % fällig am 08.08.2031	900	755	0,18
Seagate HDD Cayman			
4,125 % fällig am 15.01.2031	325	291	0,07
9,625 % fällig am 01.12.2032	460	526	0,13
Spirit Loyalty Cayman Ltd.			
8,000 % fällig am 20.09.2025	300	216	0,05
Sunac China Holdings Ltd.			
6,000 % fällig am 30.09.2026	583	61	0,02
6,250 % fällig am 30.09.2027	583	46	0,01
6,500 % fällig am 30.09.2027	1.166	92	0,02
6,750 % fällig am 30.09.2028	1.749	79	0,02
7,000 % fällig am 30.09.2029	1.749	95	0,02
7,250 % fällig am 30.09.2030	821	32	0,01
Trafford Centre Finance Ltd.			
6,064 % fällig am 28.07.2038	£ 300	308	0,07
Summe Cayman-Inseln		9.507	2,30
		12.700	3,08

CHINA			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Yango Justice International Ltd.			
7,500 % fällig am 15.04.2024 ^	\$ 2.600	14	0,00
7,500 % fällig am 17.02.2025 ^	1.900	19	0,01
7,875 % fällig am 04.09.2024 ^	1.900	11	0,00
Summe China		44	0,01

KOLUMBIEN			
STAATSEMISSIONEN			
Colombia Government International Bond			
4,500 % fällig am 15.03.2029	1.000	940	0,23
5,000 % fällig am 15.06.2045	3.300	2.572	0,62
8,000 % fällig am 14.11.2035	400	438	0,11
Summe Kolumbien		3.950	0,96

COSTA RICA			
STAATSEMISSIONEN			
Costa Rica Government International Bond			
7,300 % fällig am 13.11.2054	300	326	0,08

DÄNEMARK			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
TDC Net A/S			
5,056 % fällig am 31.05.2028	€ 800	920	0,22

DOMINIKANISCHE REPUBLIK			
STAATSEMISSIONEN			
Dominican Republic Government International Bond			
6,500 % fällig am 15.02.2048	\$ 2.600	2.493	0,60

ECUADOR			
STAATSEMISSIONEN			
Ecuador Government International Bond			
0,000 % fällig am 31.07.2030 (d)	1.416	408	0,10
2,500 % fällig am 31.07.2040	1.026	328	0,08
6,000 % fällig am 31.07.2030	1.914	896	0,22
Summe Ecuador		1.632	0,40

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
--------------	-------------	-------------------	-----------------------

ÄGYPTEN			
STAATSEMISSIONEN			
Egypt Government International Bond			
6,375 % fällig am 11.04.2031	€ 1.300	\$ 927	0,22
7,500 % fällig am 16.02.2061	\$ 3.000	1.762	0,43
Summe Ägypten		2.689	0,65

FINNLAND			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			

Balder Finland Oyj			
1,375 % fällig am 24.05.2030	€ 200	161	0,04
2,000 % fällig am 18.01.2031	100	81	0,02
Nokia Oyj			
6,625 % fällig am 15.05.2039	\$ 600	595	0,14
Summe Finnland		837	0,20

FRANKREICH			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Altice France S.A.			
3,375 % fällig am 15.01.2028	€ 100	88	0,02
4,000 % fällig am 15.07.2029	900	779	0,19
4,250 % fällig am 15.10.2029	600	529	0,13
5,500 % fällig am 15.10.2029	\$ 1.600	1.256	0,31
BNP Paribas S.A.			
1,904 % fällig am 30.09.2028	2.800	2.490	0,60
Electricite de France S.A.			
9,125 % fällig am 15.03.2033 (f)	900	1.007	0,24
Loxam S.A.S.			
2,875 % fällig am 15.04.2026	€ 200	215	0,05
Renault S.A.			
2,375 % fällig am 25.05.2026	600	643	0,16
TDF Infrastructure SASU			
1,750 % fällig am 01.12.2029	1.800	1.740	0,42
Ubisoft Entertainment S.A.			
0,878 % fällig am 24.11.2027	400	377	0,09
Summe Frankreich		9.124	2,21

DEUTSCHLAND			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Deutsche Bank AG			
5,882 % fällig am 08.07.2031	\$ 1.700	1.651	0,40
IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK)			
3,750 % fällig am 15.09.2026 (b)	€ 1.550	1.693	0,41
INEOS Styrolution Ludwigshafen GmbH			
2,250 % fällig am 16.01.2027	2.400	2.454	0,59
ZF Finance GmbH			
2,750 % fällig am 25.05.2027	1.200	1.265	0,31
Summe Deutschland		7.063	1,71

KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG			
SCUR-Alpha 1503 GmbH			
10,883 % fällig am 29.03.2030	\$ 496	458	0,11
Summe Deutschland		7.521	1,82

GHANA			
STAATSEMISSIONEN			
Ghana Government International Bond			
7,750 % fällig am 07.04.2029 ^	800	352	0,09
8,125 % fällig am 26.03.2032 ^	400	177	0,04
8,750 % fällig am 11.03.2061 ^	300	130	0,03
8,950 % fällig am 26.03.2051 ^	200	87	0,02
Summe Ghana		746	0,18

GUATEMALA			
STAATSEMISSIONEN			
Guatemala Government International Bond			
7,050 % fällig am 04.10.2032	1.000	1.065	0,26

GUERNSEY, KANALINSELN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Globalworth Real Estate Investments Ltd.			
3,000 % fällig am 29.03.2025	€ 394	399	0,10

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Duration Hedged Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
HONGKONG				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Corestate Capital Holding S.A. (8,000 % bar oder 9,000 % PIK)			
Fortune Star BVI Ltd.				Mundys SpA	€ 3.775	\$ 3.841	0,93	Corestate Capital Holding S.A. (8,000 % bar oder 9,000 % PIK)			
3,950 % fällig am 02.10.2026	€ 600	\$ 424	0,10	Nexi SpA				8,000 % fällig am 31.12.2026	€ 756	\$ 438	0,10
UNGARN				ELFENBEINKÜSTE				CPI Property Group S.A.			
STAATSEMISSIONEN				STAATSEMISSIONEN				1,500 % fällig am 27.01.2031			
Hungary Government International Bond	1.400	1.657	0,40	Telecom Italia SpA	500	615	0,15	1,750 % fällig am 14.01.2030	650	410	0,10
5,375 % fällig am 12.09.2033				UniCredit SpA				Cromwell Ereit Lux Finco SARL			
Magyar Export-Import Bank				7,296 % fällig am 02.04.2034	\$ 900	926	0,22	2,125 % fällig am 19.11.2025	400	417	0,10
6,000 % fällig am 16.05.2029	500	587	0,14	Summe Italien		11.788	2,86	FORESEA Holding S.A.			
Summe Ungarn		2.244	0,54	JAPAN				7,500 % fällig am 15.06.2030	\$ 638	591	0,14
INDONESIEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				4,250 % fällig am 06.04.2024			
Pertamina Persero PT				Ivory Coast Government International Bond	1.928	1.826	0,44	Greensaif Pipelines Bidco SARL			
6,500 % fällig am 07.11.2048	\$ 1.700	1.904	0,46	5,750 % fällig am 31.12.2032				6,129 % fällig am 23.02.2038	\$ 1.100	1.149	0,28
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara				JERSEY, KANALINSELN				Intelsat Jackson Holdings S.A.			
1,875 % fällig am 05.11.2031	€ 500	450	0,11	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				6,500 % fällig am 15.03.2030			
6,150 % fällig am 21.05.2048	\$ 1.000	1.027	0,25	Nissan Motor Co. Ltd.				Logicor Financing SARL	€ 1.000	1.053	0,25
Summe Indonesien		3.381	0,82	4,345 % fällig am 17.09.2027	1.500	1.436	0,35	Tierra Mojada Luxembourg SARL			
IRLAND				AKTIEN				5,750 % fällig am 01.12.2040			
FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				LUXEMBURG				Summe Jersey, Kanalinseln			
STAAATSEMISSIONEN				STAAATSEMISSIONEN				6,264 1,52			
Indonesia Government International Bond	€ 1.000	877	0,21	AA Bond Co. Ltd.	£ 2.200	2.665	0,65	Adient Global Holdings Ltd.	€ 45	49	0,01
1,100 % fällig am 12.03.2033				5,500 % fällig am 31.07.2050				Corsair International Ltd.			
1,400 % fällig am 30.10.2031	700	657	0,16	Adient Global Holdings Ltd.				8,802 % fällig am 28.01.2027	1.600	1.768	0,43
Summe Indonesien		1.534	0,37	Corsair International Ltd.				9,152 % fällig am 28.01.2029	600	663	0,16
IRLAND				KASACHSTAN				G City Europe Ltd.			
FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				4,250 % fällig am 11.09.2025			
STAAATSEMISSIONEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Summe Jersey, Kanalinseln			
Aurium CLO DAC	299	327	0,08	KazMunayGas National Co. JSC	\$ 200	199	0,05	Summe Jersey, Kanalinseln		6.264	1,52
4,695 % fällig am 16.01.2031				5,375 % fällig am 24.04.2030				MEXIKO			
Bain Capital Euro CLO DAC	1.967	2.147	0,52	5,750 % fällig am 19.04.2047	200	176	0,04	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
4,733 % fällig am 20.01.2032				6,375 % fällig am 24.10.2048	400	377	0,09	STAAATSEMISSIONEN			
GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC	200	219	0,05	Summe Kasachstan		752	0,18	STAAATSEMISSIONEN			
4,893 % fällig am 20.01.2032				LUXEMBURG				Mexico Government International Bond			
Harvest CLO DAC				STAAATSEMISSIONEN				3,771 % fällig am 24.05.2061			
4,815 % fällig am 15.01.2032	2.500	2.726	0,66	STAAATSEMISSIONEN				4,500 % fällig am 31.01.2050			
Laurelin DAC				STAAATSEMISSIONEN				5,400 % fällig am 09.02.2028			
4,713 % fällig am 20.10.2031	1.045	1.143	0,28	STAAATSEMISSIONEN				Summe Mexiko			
Palmerston Park CLO DAC	199	219	0,05	STAAATSEMISSIONEN				9,493 2,30			
4,625 % fällig am 18.04.2030				STAAATSEMISSIONEN				STAAATSEMISSIONEN			
Sculptor European CLO DAC	800	871	0,21	STAAATSEMISSIONEN				Mexico Government International Bond			
4,755 % fällig am 14.01.2032				STAAATSEMISSIONEN				3,771 % fällig am 24.05.2061			
Toro European CLO DAC				STAAATSEMISSIONEN				4,500 % fällig am 31.01.2050			
4,812 % fällig am 15.02.2034	750	817	0,20	STAAATSEMISSIONEN				5,400 % fällig am 09.02.2028			
4,908 % fällig am 12.01.2032	300	329	0,08	STAAATSEMISSIONEN				Summe Mexiko			
Summe Irland		8.798	2,13	STAAATSEMISSIONEN				9,493 2,30			
ISRAEL				STAAATSEMISSIONEN				STAAATSEMISSIONEN			
STAAATSEMISSIONEN				STAAATSEMISSIONEN				STAAATSEMISSIONEN			
Israel Government International Bond	€ 400	452	0,11	STAAATSEMISSIONEN				STAAATSEMISSIONEN			
5,000 % fällig am 30.10.2026				STAAATSEMISSIONEN				STAAATSEMISSIONEN			
ITALIEN				STAAATSEMISSIONEN				STAAATSEMISSIONEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				STAAATSEMISSIONEN				STAAATSEMISSIONEN			
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	900	971	0,23	STAAATSEMISSIONEN				STAAATSEMISSIONEN			
2,625 % fällig am 28.04.2025				STAAATSEMISSIONEN				STAAATSEMISSIONEN			
8,000 % fällig am 22.01.2030	1.800	2.006	0,49	STAAATSEMISSIONEN				STAAATSEMISSIONEN			
Intesa Sanpaolo SpA				STAAATSEMISSIONEN				STAAATSEMISSIONEN			
5,148 % fällig am 10.06.2030	£ 100	116	0,03	STAAATSEMISSIONEN				STAAATSEMISSIONEN			
5,500 % fällig am 01.03.2028	€ 750	770	0,19	STAAATSEMISSIONEN				STAAATSEMISSIONEN			
ITALIEN				STAAATSEMISSIONEN				STAAATSEMISSIONEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				STAAATSEMISSIONEN				STAAATSEMISSIONEN			
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA				STAAATSEMISSIONEN				STAAATSEMISSIONEN			
2,625 % fällig am 28.04.2025				STAAATSEMISSIONEN				STAAATSEMISSIONEN			
8,000 % fällig am 22.01.2030				STAAATSEMISSIONEN				STAAATSEMISSIONEN			
Intesa Sanpaolo SpA				STAAATSEMISSIONEN				STAAATSEMISSIONEN			
5,148 % fällig am 10.06.2030				STAAATSEMISSIONEN				STAAATSEMISSIONEN			
5,500 % fällig am 01.03.2028				STAAATSEMISSIONEN				STAAATSEMISSIONEN			
ITALIEN				STAAATSEMISSIONEN				STAAATSEMISSIONEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				STAAATSEMISSIONEN				STAAATSEMISSIONEN			
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA				STAAATSEMISSIONEN				STAAATSEMISSIONEN			
2,625 % fällig am 28.04.2025				STAAATSEMISSIONEN				STAAATSEMISSIONEN			
8,000 % fällig am 22.01.2030				STAAATSEMISSIONEN				STAAATSEMISSIONEN			
Intesa Sanpaolo SpA				STAAATSEMISSIONEN				STAAATSEMISSIONEN			
5,148 % fällig am 10.06.2030				STAAATSEMISSIONEN				STAAATSEMISSIONEN			
5,500 % fällig am 01.03.2028				STAAATSEMISSIONEN				STAAATSEMISSIONEN			

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
United Group BV			
5,250 % fällig am 01.02.2030	€ 300	\$ 315	0,08
Volkswagen International Finance NV			
3,500 % fällig am 17.06.2025 (f)	900	968	0,23
ZF Europe Finance BV			
2,000 % fällig am 23.02.2026	100	106	0,03
Summe Niederlande		11.535	2,79

NIGERIA			
STAATSEMISSIONEN			
Nigeria Government International Bond			
7,696 % fällig am 23.02.2038	\$ 400	329	0,08
7,875 % fällig am 16.02.2032	1.400	1.263	0,31
Summe Nigeria		1.592	0,39

OMAN			
STAATSEMISSIONEN			
Oman Government International Bond			
6,750 % fällig am 17.01.2048	1.000	1.049	0,25

PANAMA			
STAATSEMISSIONEN			
Panama Government International Bond			
6,853 % fällig am 28.03.2054	1.550	1.454	0,35

PERU			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Credicorp Capital Sociedad Titulizadora S.A.			
10,100 % fällig am 15.12.2043 PEN	3.900	1.063	0,26

STAATSEMISSIONEN			
Peru Government International Bond			
8,750 % fällig am 21.11.2033	\$ 1.000	1.261	0,30
Summe Peru		2.324	0,56

RUMÄNIEN			
STAATSEMISSIONEN			
Romania Government International Bond			
2,000 % fällig am 14.04.2033	€ 600	498	0,12
2,875 % fällig am 13.04.2042	600	450	0,11
5,000 % fällig am 27.09.2026	2.000	2.271	0,55
6,375 % fällig am 18.09.2033	600	702	0,17
Summe Rumänien		3.921	0,95

RUSSLAND			
STAATSEMISSIONEN			
Russia Government International Bond			
5,250 % fällig am 23.06.2047 ^	\$ 200	71	0,02

SAUDI-ARABIEN			
STAATSEMISSIONEN			
Saudi Arabia Government International Bond			
3,450 % fällig am 02.02.2061	1.400	988	0,24
4,500 % fällig am 26.10.2046	1.200	1.065	0,26
4,875 % fällig am 18.07.2033	2.500	2.556	0,62
Summe Saudi-Arabien		4.609	1,12

SENEGAL			
STAATSEMISSIONEN			
Senegal Government International Bond			
5,375 % fällig am 08.06.2037	€ 200	164	0,04

SERBIEN			
STAATSEMISSIONEN			
Serbia Government International Bond			
1,500 % fällig am 26.06.2029	800	747	0,18
6,500 % fällig am 26.09.2033	\$ 1.000	1.029	0,25
Summe Serbien		1.776	0,43

SLOWENIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Nova Kreditna Banka Maribor d.d.			
1,875 % fällig am 27.01.2025	€ 1.000	1.100	0,27

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Nova Ljubljanska Banka d.d.			
3,400 % fällig am 05.02.2030	€ 600	\$ 575	0,14
Summe Slowenien		1.675	0,41

SÜDAFRIKA			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
AngloGold Ashanti Holdings PLC			
3,750 % fällig am 01.10.2030	\$ 200	174	0,04
Sasol Financing USA LLC			
6,500 % fällig am 27.09.2028	600	572	0,14
Summe Südafrika		746	0,18

STAATSEMISSIONEN			
South Africa Government International Bond			
5,650 % fällig am 27.09.2047	1.200	963	0,23
Summe Südafrika		1.709	0,41

SPANIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.			
6,000 % fällig am 15.01.2026			
(f)(h)	€ 800	880	0,21
6,138 % fällig am 14.09.2028	\$ 600	617	0,15
Lorca Telecom Bondco S.A.			
4,000 % fällig am 18.09.2027	€ 300	324	0,08
Summe Spanien		1.821	0,44

SRI LANKA			
STAATSEMISSIONEN			
Sri Lanka Government International Bond			
7,550 % fällig am 28.03.2030 ^	\$ 525	265	0,07
7,850 % fällig am 14.03.2029 ^	600	303	0,07
Summe Sri Lanka		568	0,14

SCHWEDEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Volvo Car AB			
4,250 % fällig am 31.05.2028	€ 500	559	0,14
(j)			

SCHWEIZ			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
UBS Group AG			
4,282 % fällig am 09.01.2028	\$ 700	679	0,16

TÜRKEI			
STAATSEMISSIONEN			
Turkey Government International Bond			
4,875 % fällig am 16.04.2043	1.200	879	0,21
5,750 % fällig am 11.05.2047	3.525	2.773	0,67
Summe Türkei		3.652	0,88

UKRAINE			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
NPC Ukrenergo			
6,875 % fällig am 09.11.2028	800	217	0,05

STAATSEMISSIONEN			
Ukraine Government International Bond			
4,375 % fällig am 27.01.2032	€ 4.400	1.011	0,25
6,750 % fällig am 20.06.2028	200	54	0,01
8,994 % fällig am 01.02.2026	\$ 300	90	0,02
Summe Ukraine		1.155	0,28
		1.372	0,33

VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
DAE Sukuk Diftc Ltd.			
3,750 % fällig am 15.02.2026	900	866	0,21

GROSSBRITANNIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
AGPS BondCo PLC			
4,625 % fällig am 14.01.2026	€ 100	39	0,01
5,000 % fällig am 27.04.2027	500	186	0,05

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
5,500 % fällig am 13.11.2026	€ 500	\$ 195	0,05

Bellis Acquisition Co. PLC			
3,250 % fällig am 16.02.2026	£ 500	593	0,14
Greene King Finance PLC			
5,106 % fällig am 15.03.2034	257	318	0,08

HSBC Holdings PLC			
2,804 % fällig am 24.05.2032	\$ 300	251	0,06
2,848 % fällig am 04.06.2031	200	172	0,04
3,973 % fällig am 22.05.2030	600	561	0,14
4,041 % fällig am 13.03.2028	300	289	0,07
5,210 % fällig am 11.08.2028	1.600	1.599	0,39

John Lewis PLC			
4,250 % fällig am 18.12.2034	£ 400	371	0,09
6,125 % fällig am 21.01.2025	300	382	0,09
Lloyds Banking Group PLC			
4,976 % fällig am 11.08.2033	\$ 400	390	0,09

Market Bidco Finco PLC			
4,750 % fällig am 04.11.2027	€ 1.500	1.490	0,36
Mitchells & Butlers Finance PLC			
5,789 % fällig am 15.12.2030	£ 178	210	0,05
6,135 % fällig am 15.12.2030	\$ 713	662	0,16
6,469 % fällig am 15.09.2032	£ 332	386	0,09

NatWest Group PLC			
6,000 % fällig am 29.12.2025	\$ 1.700	1.648	0,40
(f)(h)			
Pinnacle Bidco PLC			
10,000 % fällig am 11.10.2028	£ 600	797	0,19

Santander UK Group Holdings PLC			
3,823 % fällig am 03.11.2028	\$ 1.500	1.411	0,34
6,750 % fällig am 24.06.2024	£ 700	893	0,22
(f)(h)			

SW Finance PLC			
7,375 % fällig am 12.12.2041	300	411	0,10

Virgin Media Secured Finance PLC			
4,250 % fällig am 15.01.2030	2.800	3.130	0,76

Virgin Money UK PLC			
4,000 % fällig am 03.09.2027	1.400	1.694	0,41

Vmed Q2 UK Financing PLC			
3,250 % fällig am 31.01.2031	€ 400	408	0,10
Summe Großbritannien		18.486	4,48

NON-AGENCY-MBS			
Towd Point Mortgage Funding PLC			
6,365 % fällig am 20.10.2051	£ 1.340	1.710	0,41
Summe Großbritannien		20.196	4,89

USA			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			

Aames Mortgage Investment Trust			
6,250 % fällig am 25.10.2035	\$ 88	86	0,02

Accredited Mortgage Loan Trust			
6,190 % fällig am 25.09.2035	22	22	0,01

ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust			
5,840 % fällig am 25.02.2037	2.416	1.022	0,25
6,070 % fällig am 25.02.2036	58	57	0,01

Ameriquet Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates			
5,940 % fällig am 25.11.2035	50	48	0,01
8,845 % fällig am 25.11.2032	450	446	0,11

Argent Securities Trust			
5,790 % fällig am 25.05.2036	559	137	0,03

Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust			
5,401 % fällig am 25.06.2035	472	462	0,11
7,270 % fällig am 25.07.2034	21	22	0,01

Carrington Mortgage Loan Trust			
5,730 % fällig am 25.02.2037	682	628	0,15
6,520 % fällig am 25.05.2035	244	235	0,06

Countrywide Asset-Backed Certificates			
6,570 % fällig am 25.05.2047	741	583	0,14

Countrywide Asset-Backed Certificates Trust			
3,508 % fällig am 25.03.2036	56	54	0,01
5,650 % fällig am 25.11.2047	524	500	0,12
5,950 % fällig am 25.02.2037	1.600	1.451	0,35
5,995 % fällig am 25.08.2036	1.961	1.896	0,46
6,310 % fällig am 25.10.2047	1.753	1.677	0,41
6,520 % fällig am 25.11.2034	38	38	0,01
7,045 % fällig am 25.11.2034	117	116	0,03

Countrywide Asset-Backed Certificates, Inc.			
6,030 % fällig am 25.04.2034	176	162	0,04

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Duration Hedged Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.				STAMMAKTIE				2,700 % fällig am 10.08.2026	\$ 700	\$ 649	0,16
5,077 % fällig am 25.01.2032	\$ 3	\$ 3	0,00	ENERGIE				3,375 % fällig am 13.11.2025	300	287	0,07
Ellington Loan Acquisition Trust				Constellation Oil Services				Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC			
6,520 % fällig am 25.05.2037	310	301	0,07	Holding S.A. 'B' (c)(i)	161.700	\$ 18	0,00	5,500 % fällig am 01.05.2028	1.400	1.347	0,33
First Franklin Mortgage Loan Trust								6,500 % fällig am 01.10.2025	1.237	1.234	0,30
6,745 % fällig am 25.07.2034	103	101	0,02					Freedom Mortgage Corp.			
Fremont Home Loan Trust				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				6,625 % fällig am 15.01.2027	1.100	1.051	0,25
6,010 % fällig am 25.04.2036	279	256	0,06	Alaska Airlines Pass-Through Trust				Global Atlantic Fin Co.			
6,400 % fällig am 25.06.2035	700	605	0,15	4,800 % fällig am 15.02.2029	\$ 459	447	0,11	4,400 % fällig am 15.10.2029	1.000	922	0,22
GSAA Home Equity Trust				AMC Networks, Inc.				GLP Capital LP			
5,590 % fällig am 25.11.2036	74	17	0,00	4,250 % fällig am 15.02.2029	100	76	0,02	5,750 % fällig am 01.06.2028	300	303	0,07
GSAMP Trust				American Airlines Pass-Through Trust				GN Bondco LLC			
5,520 % fällig am 25.12.2046	24	12	0,00	3,000 % fällig am 15.04.2030	67	61	0,01	9,500 % fällig am 15.10.2031	500	489	0,12
5,560 % fällig am 25.01.2037	40	23	0,01	3,150 % fällig am 15.08.2033	81	71	0,02	Goldman Sachs Group, Inc.			
5,950 % fällig am 25.06.2036	188	99	0,02	3,200 % fällig am 15.12.2029	540	492	0,12	2,615 % fällig am 22.04.2032	700	588	0,14
5,950 % fällig am 25.08.2036	558	435	0,11	3,350 % fällig am 15.04.2031	211	191	0,05	GTCR W-2 Merger Sub LLC			
6,205 % fällig am 25.09.2035	71	69	0,02	3,375 % fällig am 01.11.2028	345	317	0,08	7,500 % fällig am 15.01.2031	500	529	0,13
Home Equity Asset Trust				3,575 % fällig am 15.07.2029	267	249	0,06	Haleon U.S. Capital LLC			
6,565 % fällig am 25.05.2035	51	50	0,01	3,650 % fällig am 15.12.2029	67	60	0,01	3,375 % fällig am 24.03.2029	600	568	0,14
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust				3,650 % fällig am 15.08.2030	206	191	0,05	HCA, Inc.			
5,850 % fällig am 25.06.2036	17	17	0,00	3,700 % fällig am 01.04.2028	53	49	0,01	5,500 % fällig am 01.06.2033	1.000	1.016	0,25
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust				American Tower Corp.				IQVIA, Inc.			
4,258 % fällig am 25.07.2036	133	130	0,03	3,950 % fällig am 15.03.2029	700	669	0,16	5,700 % fällig am 15.05.2028	600	612	0,15
5,660 % fällig am 25.03.2047	53	52	0,01	5,900 % fällig am 15.11.2033	800	848	0,21	JPMorgan Chase & Co.			
5,730 % fällig am 25.06.2037	23	23	0,01	Amgen, Inc.				4,586 % fällig am 26.04.2033	1.000	966	0,23
5,770 % fällig am 25.07.2036	633	269	0,07	5,650 % fällig am 02.03.2053	600	632	0,15	Kinder Morgan Energy Partners LP			
5,770 % fällig am 25.03.2037	400	368	0,09	AT&T, Inc.				6,500 % fällig am 01.02.2037	400	422	0,10
Long Beach Mortgage Loan Trust				3,800 % fällig am 01.12.2057	800	595	0,14	6,950 % fällig am 15.01.2038	200	220	0,05
6,010 % fällig am 25.05.2046	551	167	0,04	Aviation Capital Group LLC				Las Vegas Sands Corp.			
6,070 % fällig am 25.02.2036	880	705	0,17	3,500 % fällig am 01.11.2027	600	553	0,13	3,200 % fällig am 08.08.2024	500	491	0,12
MASTR Asset-Backed Securities Trust				5,500 % fällig am 15.12.2024	800	796	0,19	3,500 % fällig am 18.08.2026	600	572	0,14
5,670 % fällig am 25.08.2036	3.669	1.135	0,27	Bank of America Corp.				3,900 % fällig am 08.08.2029	300	277	0,07
5,770 % fällig am 25.03.2036	990	895	0,22	4,571 % fällig am 27.04.2033	1.000	954	0,23	LifePoint Health, Inc.			
6,220 % fällig am 25.12.2034	11	11	0,00	BAT Capital Corp.				11,000 % fällig am 15.10.2030	600	633	0,15
6,250 % fällig am 25.02.2034	435	438	0,11	3,557 % fällig am 15.08.2027	27	26	0,01	Marvell Technology, Inc.			
6,370 % fällig am 25.04.2034	83	77	0,02	Boeing Co.				5,750 % fällig am 15.02.2029	500	517	0,13
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				3,950 % fällig am 01.08.2059	500	383	0,09	Medline Borrower LP			
5,610 % fällig am 25.05.2037	188	138	0,03	5,705 % fällig am 01.05.2040	500	517	0,13	3,875 % fällig am 01.04.2029	500	453	0,11
5,790 % fällig am 25.09.2036	232	99	0,02	Booz Allen Hamilton, Inc.				5,250 % fällig am 01.10.2029	500	472	0,11
6,050 % fällig am 25.01.2035	560	558	0,14	3,875 % fällig am 01.09.2028	500	471	0,11	Midwest Connector Capital Co. LLC			
6,175 % fällig am 25.01.2035	290	279	0,07	British Airways Pass-Through Trust				3,900 % fällig am 01.04.2024	100	99	0,02
9,270 % fällig am 25.02.2047	113	92	0,02	4,250 % fällig am 15.05.2034	100	93	0,02	Morgan Stanley			
New Century Home Equity Loan Trust				Broadcom, Inc.				5,250 % fällig am 21.04.2034	700	700	0,17
8,470 % fällig am 25.01.2033	172	146	0,04	3,137 % fällig am 15.11.2035	508	417	0,10	National Fuel Gas Co.			
NovaStar Mortgage Funding Trust				3,187 % fällig am 15.11.2036	1.015	823	0,20	5,200 % fällig am 15.07.2025	200	199	0,05
5,630 % fällig am 25.09.2037	161	158	0,04	Cantor Fitzgerald LP				NCR Atleos Corp.			
Option One Mortgage Loan Trust				7,200 % fällig am 12.12.2028	400	410	0,10	9,500 % fällig am 01.04.2029	600	638	0,15
5,690 % fällig am 25.01.2037	245	139	0,03	Charter Communications Operating LLC				Netflix, Inc.			
Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				3,850 % fällig am 01.04.2061	1.200	749	0,18	4,875 % fällig am 15.06.2030	1.400	1.419	0,34
6,520 % fällig am 25.09.2034	15	15	0,00	Community Health Systems, Inc.				Newell Brands, Inc.			
7,270 % fällig am 25.12.2034	461	454	0,11	8,000 % fällig am 15.03.2026	149	149	0,04	6,500 % fällig am 01.04.2046	400	333	0,08
Renaissance Home Equity Loan Trust				Coty, Inc.				NextEra Energy Operating Partners LP			
5,340 % fällig am 25.01.2037	1.336	453	0,11	6,625 % fällig am 15.07.2030	1.000	1.028	0,25	7,250 % fällig am 15.01.2029	400	419	0,10
Residential Asset Securities Corp. Trust				Credit Acceptance Corp.				NGPL PipeCo LLC			
6,160 % fällig am 25.11.2035	47	47	0,01	9,250 % fällig am 15.12.2028	400	427	0,10	7,768 % fällig am 15.12.2037	1.400	1.561	0,38
6,175 % fällig am 25.09.2035	609	572	0,14	Crown Castle, Inc.				Noble Finance LLC			
6,355 % fällig am 25.01.2034	22	22	0,01	2,100 % fällig am 01.04.2031	700	571	0,14	8,000 % fällig am 15.04.2030	450	469	0,11
Saxon Asset Securities Trust				2,250 % fällig am 15.01.2031	800	663	0,16	NuStar Logistics LP			
5,935 % fällig am 25.03.2036	285	272	0,07	5,000 % fällig am 11.01.2028	700	698	0,17	5,625 % fällig am 28.04.2027	600	598	0,15
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust				CVS Health Corp.				Occidental Petroleum Corp.			
5,650 % fällig am 25.07.2036	85	29	0,01	3,250 % fällig am 15.08.2029	500	466	0,11	6,625 % fällig am 01.09.2030	700	745	0,18
6,145 % fällig am 25.01.2035	18	16	0,00	DAE Funding LLC				7,875 % fällig am 15.09.2031	1.700	1.936	0,47
Soundview Home Loan Trust				DISH DBS Corp.				OneMain Finance Corp.			
5,935 % fällig am 25.06.2036	4.824	4.018	0,97	5,750 % fällig am 01.12.2028	600	480	0,12	9,000 % fällig am 15.01.2029	500	529	0,13
Structured Asset Investment Loan Trust				Elevance Health, Inc.				Organon & Co.			
5,850 % fällig am 25.03.2036	71	69	0,02	4,750 % fällig am 15.02.2033	600	600	0,15	2,875 % fällig am 30.04.2028	€ 3.100	3.154	0,76
6,100 % fällig am 25.11.2035	258	248	0,06	Energy Transfer LP				Pacific Gas & Electric Co.			
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				7,500 % fällig am 01.07.2038	2.000	2.318	0,56	3,300 % fällig am 15.03.2027	\$ 100	94	0,02
6,470 % fällig am 25.08.2037	91	90	0,02	EnLink Midstream LLC				3,300 % fällig am 01.08.2040	1.800	1.320	0,32
Structured Asset Securities Corp. Trust				5,375 % fällig am 01.06.2029	300	294	0,07	3,750 % fällig am 01.07.2028	200	187	0,05
6,160 % fällig am 25.09.2035	199	187	0,05	EQT Corp.				4,450 % fällig am 15.04.2042	100	81	0,02
Truman Capital Mortgage Loan Trust				3,625 % fällig am 15.05.2031	400	358	0,09	4,500 % fällig am 01.07.2040	850	720	0,17
5,730 % fällig am 25.03.2036	300	297	0,07	Ford Motor Credit Co. LLC				4,600 % fällig am 15.06.2043	200	165	0,04
WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust				2,330 % fällig am 25.11.2025	€ 1.500	1.611	0,39	4,650 % fällig am 01.08.2028	300	288	0,07
5,620 % fällig am 25.01.2037	165	139	0,03	2,386 % fällig am 17.02.2026	300	323	0,08	Plains All American Pipeline LP			
		24.437	5,92					5,150 % fällig am 01.06.2042	1.500	1.359	0,33
								6,650 % fällig am 15.01.2037	200	214	0,05

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	
PRA Group, Inc.				NON-AGENCY-MBS				US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				
8,375 % fällig am 01.02.2028 \$	700	\$ 674	0,16	Banc of America Alternative Loan Trust				Uniform Mortgage-Backed Security				
3,750 % fällig am 01.07.2026	200	190	0,05	5,870 % fällig am 25.01.2037 \$	79	\$ 59	0,01	5,500 % fällig am 01.12.2052 \$	919	\$ 925	0,22	
Rockies Express Pipeline LLC				Banc of America Funding Trust				Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				
4,800 % fällig am 15.05.2030	700	641	0,16	5,061 % fällig am 20.01.2047	41	35	0,01	5,000 % fällig am 01.02.2054	9.200	9.106	2,21	
4,950 % fällig am 15.07.2029	300	287	0,07	BCAP LLC Trust				5,500 % fällig am 01.02.2054	11.100	11.150	2,70	
San Diego Gas & Electric Co.				6,250 % fällig am 26.08.2036	1.925	850	0,21	6,000 % fällig am 01.02.2054	13.600	13.810	3,34	
4,950 % fällig am 15.08.2028	600	613	0,15	Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust				6,500 % fällig am 01.02.2054	20.900	21.417	5,19	
Sirius XM Radio, Inc.				7,660 % fällig am 25.02.2036	88	75	0,02			56.408	13,66	
4,125 % fällig am 01.07.2030	400	357	0,09	Citigroup Mortgage Loan Trust				US-SCHATZOBIGATIONEN				
Sitio Royalties Operating Partnership LP				3,772 % fällig am 25.10.2046	19	17	0,00	U.S. Treasury Bonds				
7,875 % fällig am 01.11.2028	450	467	0,11	7,780 % fällig am 25.10.2035	58	56	0,01	3,875 % fällig am 15.05.2043	4.100	3.910	0,95	
Southern California Edison Co.				Countrywide Alternative Loan Trust				4,375 % fällig am 15.08.2043	2.900	2.961	0,72	
4,000 % fällig am 01.04.2047	200	163	0,04	5,870 % fällig am 25.07.2036	3	1	0,00			6.871	1,67	
Spirit AeroSystems, Inc.				5,892 % fällig am 20.05.2046	269	227	0,06	Summe USA			174.030	42,15
9,375 % fällig am 30.11.2029	100	110	0,03	5,970 % fällig am 25.04.2036	537	218	0,05	VENEZUELA				
9,750 % fällig am 15.11.2030	400	430	0,10	6,000 % fällig am 25.05.2036	133	71	0,02	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Sprint Capital Corp.				6,000 % fällig am 25.02.2037	850	362	0,09	Petroleos de Venezuela S.A.				
6,875 % fällig am 15.11.2028	1.385	1.502	0,36	6,000 % fällig am 25.04.2037	195	109	0,03	6,000 % fällig am 16.05.2034	1.600	184	0,04	
Standard Industries, Inc.				6,492 % fällig am 25.01.2036	10	9	0,00	STAATSEMISSIONEN				
2,250 % fällig am 21.11.2026 €	1.800	1.886	0,46	Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				Venezuela Government International Bond				
T-Mobile USA, Inc.				4,377 % fällig am 25.03.2037	8	7	0,00	6,000 % fällig am 09.12.2020 ^	241	34	0,01	
2,550 % fällig am 15.02.2031 \$	400	345	0,08	5,972 % fällig am 25.04.2046	17	5	0,00	7,000 % fällig am 31.03.2048 ^	1.528	234	0,06	
4,950 % fällig am 15.03.2028	500	507	0,12	6,000 % fällig am 25.12.2036	334	136	0,03	7,750 % fällig am 13.10.2029 ^	1.900	270	0,06	
Tallgrass Energy Partners LP				6,000 % fällig am 25.07.2037	66	24	0,01			538	0,13	
5,500 % fällig am 15.01.2028	500	473	0,11	6,010 % fällig am 25.04.2046	1.715	497	0,12	Summe Venezuela			722	0,17
6,000 % fällig am 31.12.2030	300	279	0,07	6,500 % fällig am 25.11.2036	103	35	0,01	KURZFRISTIGE INSTRUMENTE				
Time Warner Cable LLC				Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.				ARGENTINISCHE SCHATZWECHSEL				
5,875 % fällig am 15.11.2040	500	453	0,11	6,500 % fällig am 25.04.2033	0	0	0,00	(34,368) % fällig am 20.05.2024 (d)(e)	ARS 2.951	5	0,00	
TransDigm, Inc.				Credit Suisse Mortgage Capital Certificates				UNGARISCHE SCHATZWECHSEL				
7,125 % fällig am 01.12.2031	400	420	0,10	3,500 % fällig am 26.04.2038	72	70	0,02	10,900 % fällig am 04.01.2024 (d)(e)	HUF 664.000	1.918	0,46	
U.S. Acute Care Solutions LLC				4,817 % fällig am 27.09.2035	91	77	0,02	Summe kurzfristige Instrumente			1.923	0,46
6,375 % fällig am 01.03.2026	75	63	0,02	First Horizon Mortgage Pass-Through Trust				Summe übertragbare Wertpapiere			\$ 363.886	88,14
U.S. Airways Pass-Through Trust				5,967 % fällig am 25.09.2035	12	11	0,00	AKTIEN				
3,950 % fällig am 15.05.2027	152	145	0,04	HarborView Mortgage Loan Trust				INVESTMENTFONDS				
United Airlines Pass-Through Trust				5,910 % fällig am 19.05.2035	147	134	0,03	ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN				
2,900 % fällig am 01.11.2029	83	72	0,02	5,950 % fällig am 19.06.2035	3	3	0,00	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - US Short-Term Fund (g)	2.699.973	27.324	6,62	
3,450 % fällig am 01.06.2029	127	118	0,03	6,012 % fällig am 20.10.2045	286	253	0,06	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (g)	1.281.816	12.773	3,09	
3,450 % fällig am 07.01.2030	137	122	0,03	6,090 % fällig am 19.11.2035	3	2	0,00			40.097	9,71	
3,500 % fällig am 01.09.2031	152	139	0,03	HSI Asset Securitization Corp. Trust				BÖRSENGEHANDELTE FONDS				
4,150 % fällig am 11.10.2025	242	241	0,06	5,910 % fällig am 25.11.2035	1.341	1.271	0,31	PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (g)	5.570	555	0,14	
5,875 % fällig am 15.04.2029	2.135	2.164	0,52	IndyMac Mortgage Loan Trust				Summe Investmentfonds			\$ 40.652	9,85
Venture Global Calcasieu Pass LLC				3,088 % fällig am 25.06.2037	10	9	0,00					
6,250 % fällig am 15.01.2030	1.000	996	0,24	4,259 % fällig am 25.12.2036	2	2	0,00					
Venture Global LNG, Inc.				5,830 % fällig am 25.07.2047	53	36	0,01					
8,125 % fällig am 01.06.2028	2.200	2.224	0,54	Lehman Mortgage Trust								
Verizon Communications, Inc.				6,000 % fällig am 25.09.2037	100	93	0,02					
2,355 % fällig am 15.03.2032	2.200	1.831	0,44	Luminent Mortgage Trust								
VICI Properties LP				5,870 % fällig am 25.10.2046	638	560	0,14					
3,500 % fällig am 15.02.2025	200	195	0,05	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust								
3,875 % fällig am 15.02.2029	250	230	0,06	4,347 % fällig am 25.05.2036	3	3	0,00					
4,500 % fällig am 15.01.2028	250	239	0,06	6,130 % fällig am 25.11.2029	1	1	0,00					
Walgreens Boots Alliance, Inc.				Morgan Stanley Mortgage Loan Trust								
3,600 % fällig am 20.11.2025 £	300	365	0,09	4,768 % fällig am 25.03.2036	29	18	0,01					
Wells Fargo & Co.				Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust								
5,574 % fällig am 25.07.2029 \$	850	868	0,21	5,470 % fällig am 25.08.2035	0	0	0,00					
WMG Acquisition Corp.				Residential Accredited Loans, Inc. Trust								
3,000 % fällig am 15.02.2031	1.100	944	0,23	5,870 % fällig am 25.05.2047	58	51	0,01					
XPO, Inc.				Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust								
6,250 % fällig am 01.06.2028	500	507	0,12	5,910 % fällig am 25.06.2037	174	141	0,03					
		74.785	18,11	Structured Asset Mortgage Investments Trust								
				5,870 % fällig am 25.05.2036	432	340	0,08					
				5,890 % fällig am 25.09.2047	526	437	0,11					
				SunTrust Alternative Loan Trust								
				5,750 % fällig am 25.12.2035	1	1	0,00					
				Thornburg Mortgage Securities Trust								
				6,720 % fällig am 25.06.2037	10	9	0,00					
				WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust								
				6,212 % fällig am 25.11.2042	5	5	0,00					
				Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust								
				4,052 % fällig am 25.09.2036	125	37	0,01					
						6.357	1,54					

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Duration Hedged Fund (Forts.)

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- vermö-gens
BPS	5,470 %	02.01.2024	03.01.2024	\$ 32.200	U.S. Treasury Notes 1,250 % fällig am 15.08.2031	\$ (32.903)	\$ 32.200	\$ 32.205	7,80
	5,510	02.01.2024	03.01.2024	100	U.S. Treasury Notes 2,125 % fällig am 15.05.2025	(102)	100	100	0,02
BSN	5,340	29.12.2023	02.01.2024	34.900	U.S. Treasury Notes 2,625 % fällig am 31.07.2029	(35.656)	34.900	34.921	8,46
FICC	2,600	29.12.2023	02.01.2024	2.352	U.S. Treasury Notes 4,875 % fällig am 30.11.2025	(2.399)	2.352	2.353	0,57
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (71.060)	\$ 69.552	\$ 69.579	16,85

⁽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 March Futures	Long	03.2024	8	\$ 17	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Long	03.2024	25	114	0,03
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Long	03.2024	160	343	0,08
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Short	03.2024	8	(1)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2024	479	1.837	0,45
U.S. Treasury 10-Year Ultra March Futures	Short	03.2024	115	(662)	(0,16)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Long	03.2024	103	1.332	0,32
United Kingdom Long Gilt March Futures	Long	03.2024	13	116	0,03
				\$ 3.096	0,75
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 3.096	0,75

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

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

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2026	\$ 1.900	\$ (15)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2028	300	5	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2026	500	6	0,00
Carnival Corp.	1,000	20.12.2028	400	50	0,01
Charter Communications, Inc.	5,000	20.12.2027	1.000	33	0,01
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2027	1.000	42	0,01
Glencore Finance Europe Ltd.	5,000	20.12.2025	€ 2.400	(309)	(0,08)
Marks & Spencer PLC	1,000	20.12.2024	2.600	150	0,04
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2024	4.000	26	0,01
				\$ (12)	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-41 5-Year Index	5,000 %	20.12.2028	\$ 33.165	\$ 1.783	0,43

ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt	Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS		4,250 %	20.03.2054	£ 500	\$ (111)	(0,03)
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS		4,500	20.03.2034	900	(104)	(0,03)
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS		5,000	20.03.2029	2.800	(204)	(0,05)
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS		5,500	20.03.2026	4.000	(101)	(0,02)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS		0,050	15.12.2031	¥ 940.000	69	0,02
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		1,000	15.06.2027	\$ 67.100	(146)	(0,04)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		1,000	16.12.2030	22.300	3.695	0,89
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		1,250	17.06.2025	33.800	3.204	0,78
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		1,750	15.06.2032	20.600	(62)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		1,750	15.06.2052	14.000	517	0,13
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		2,750	21.06.2053	23.300	1.900	0,46
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,000	21.06.2033	43.600	2.052	0,50
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,250	21.06.2028	82.000	599	0,15
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,500	21.06.2026	27.700	(287)	(0,07)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,500	20.06.2054	1.900	(5)	0,00

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750 %	21.06.2025	\$ 27.900	\$ 553	0,13
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2029	6.400	5	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,000	18.12.2026	13.700	145	0,03
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,750	20.12.2025	CAD 1.200	16	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,750	20.12.2033	AUD 7.600	112	0,03
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	20.03.2054	€ 3.600	(220)	(0,05)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.03.2034	2.100	2	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,250	20.03.2029	22.900	(926)	(0,22)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,500	20.03.2026	23.000	(408)	(0,10)
					\$ 10.295	2,49
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ 12.066	2,92

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

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

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

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BOA	Brazil Government International Bond	1,000 %	20.12.2028	\$ 1.400	\$ (28)	\$ 9	\$ (19)	(0,01)
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2028	2.000	(174)	105	(69)	(0,02)
BPS	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2028	1.300	(25)	7	(18)	0,00
BRC	Indonesia Government International Bond	1,000	20.06.2031	5.500	(236)	222	(14)	0,00
GST	ADLER Real Estate AG	5,000	20.12.2026	€ 700	(4)	(134)	(138)	(0,03)
MYC	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2028	\$ 2.200	(128)	52	(76)	(0,02)
					\$ (595)	\$ 261	\$ (334)	(0,08)

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	01.2024	£ 511	\$ 649	\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	0,00	
	01.2024	PEN 3.534	952	0	(1)	(1)	0,00	
BPS	01.2024	€ 2.231	2.424	0	(41)	(41)	(0,01)	
	01.2024	£ 1.950	2.473	0	(12)	(12)	0,00	
	01.2024	HUF 133.784	381	0	(5)	(5)	0,00	
	01.2024	¥ 28.700	195	0	(9)	(9)	0,00	
	01.2024	\$ 814	£ 643	6	0	6	0,00	
	01.2024	3	HUF 1.017	0	0	0	0,00	
BRC	01.2024	£ 144	\$ 181	0	(3)	(3)	0,00	
	01.2024	\$ 5.300	€ 4.848	56	0	56	0,01	
	04.2024	450	TRY 14.577	0	(6)	(6)	0,00	
CBK	01.2024	HUF 9.566	\$ 27	0	0	0	0,00	
	01.2024	\$ 1.101	€ 1.019	25	0	25	0,01	
	02.2024	BRL 1.403	\$ 274	0	(15)	(15)	(0,01)	
GLM	01.2024	£ 163	208	0	0	0	0,00	
	01.2024	PEN 380	102	0	(1)	(1)	0,00	
	01.2024	\$ 99	MXN 1.736	3	0	3	0,00	
JPM	01.2024	HUF 498.012	\$ 1.417	0	(22)	(22)	(0,01)	
MBC	01.2024	AUD 32	21	0	(1)	(1)	0,00	
	01.2024	\$ 1.902	€ 1.746	28	0	28	0,01	
MYI	01.2024	€ 21	\$ 24	0	0	0	0,00	
	01.2024	HUF 21.372	61	0	(1)	(1)	0,00	
	01.2024	\$ 334	€ 302	0	0	0	0,00	
	01.2024	1.027	£ 804	0	(2)	(2)	0,00	
RYL	01.2024	£ 177	\$ 223	0	(3)	(3)	0,00	
UAG	01.2024	€ 75.288	82.814	0	(372)	(372)	(0,09)	
	01.2024	£ 10.592	13.404	0	(99)	(99)	(0,03)	
					\$ 118	\$ (595)	\$ (477)	(0,12)

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Duration Hedged Fund (Forts.)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend II, Class E EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	01.2024	€ 1.788	\$ 1.954	\$ 0	\$ (22)	\$ (22)	(0,01)
	01.2024	\$ 2.105	€ 1.926	24	0	24	0,01
CBK	01.2024	€ 3.556	\$ 3.851	1	(79)	(78)	(0,02)
	01.2024	\$ 86	€ 80	2	0	2	0,00
DUB	01.2024	€ 8.839	\$ 9.534	0	(232)	(232)	(0,06)
MBC	01.2024	707	766	0	(15)	(15)	0,00
	01.2024	\$ 34.607	€ 31.475	171	0	171	0,04
MYI	01.2024	34.608	31.487	182	0	182	0,05
UAG	01.2024	33.198	30.181	149	0	149	0,04
				\$ 529	\$ (348)	\$ 181	0,05

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2024	\$ 8.497	£ 6.699	\$ 43	\$ 0	\$ 43	0,01
BPS	01.2024	27.777	21.943	196	0	196	0,05
BRC	01.2024	374	296	3	0	3	0,00
CBK	01.2024	£ 115	\$ 146	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	\$ 39	£ 31	0	0	0	0,00
GLM	01.2024	£ 111	\$ 141	0	0	0	0,00
MBC	01.2024	804	1.024	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	\$ 2.284	£ 1.801	12	0	12	0,00
MYI	01.2024	£ 74	\$ 93	0	(1)	(1)	0,00
SCX	01.2024	\$ 81.647	£ 64.550	643	0	643	0,16
SSB	01.2024	£ 38	\$ 48	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	\$ 81.452	£ 64.550	839	0	839	0,20
UAG	01.2024	£ 29.548	\$ 37.404	0	(265)	(265)	(0,06)
	01.2024	\$ 81.636	£ 64.507	600	0	600	0,14
				\$ 2.336	\$ (269)	\$ 2.067	0,50
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 1.437	0,35
Summe Anlagen						\$ 490.689	118,86
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ (77.850)	(18,86)
Nettovermögen						\$ 412.839	100,00

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
 (b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.
 (c) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.
 (d) Nullkuponwertpapier.
 (e) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
 (f) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
 (g) Mit dem Teilfonds verbunden.
 (h) Bedingt wandelbares Wertpapier.
 (i) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,17 %):

Emittentenbeschreibung	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Constellation Oil Services Holding S.A. 'B'	10.06.2022	\$ 18	\$ 18	0,00
Corestate Capital Holding S.A.	22.08.2023	0	0	0,00
DrillCo Holding Lux S.A.	08.06.2023	1.233	1.535	0,37
Intelsat Emergence S.A.	24.02.2020 - 01.05.2020	1.289	411	0,10
		\$ 2.540	\$ 1.964	0,47

(j) Wertpapiere mit einem Gesamtwert von USD 559 (31. Dezember 2022: USD null) wurde zum 31. Dezember 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 20.224 (31. Dezember 2022: USD 19.045) wurden zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 290 (31. Dezember 2022: USD 1.278) wurden zum 31. Dezember 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 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	\$ 360.156	\$ 3.725	\$ 363.886
Investmentfonds	40.097	555	0	40.652
Pensionsgeschäfte	0	69.552	0	69.552
Finanzderivate ⁽³⁾	247	16.352	0	16.599
Summen	\$ 40.349	\$ 446.615	\$ 3.725	\$ 490.689

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

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

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
JML	0,500 %	30.10.2023	TBD ⁽¹⁾	€ (478)	\$ (529)	(0,13)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (529)	(0,13)

⁽¹⁾ Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	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	(48)	0	(48)	(31)	0	(31)
BPS	119	0	119	104	0	104
BRC	36	0	36	(270)	208	(62)
CBK	(67)	0	(67)	1.636	(1.510)	126
DUB	(232)	290	58	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	2	0	2	(204)	270	66
GST	(138)	0	(138)	(179)	0	(179)
JPM	(22)	0	(22)	27	(80)	(53)
MBC	194	(390)	(196)	(1.015)	800	(215)
MYC	(76)	0	(76)	k. A.	k. A.	k. A.
MYI	178	(390)	(212)	4	(28)	(24)
RYL	(3)	0	(3)	k. A.	k. A.	k. A.
SCX	643	(910)	(267)	1.547	(1.450)	97
SSB	838	(730)	108	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	k. A.	k. A.	k. A.	65	(120)	(55)
UAG	13	0	13	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. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Duration Hedged Fund (Forts.)

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	49,72	38,87
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	38,05	30,57
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,37	1,69
Investmentfonds	9,85	9,88
Pensionsgeschäfte	16,85	18,21
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,75	0,25
Zentral abgerechnete Finanzderivate	2,92	1,95
Freiverkehrsfinanzderivate	0,35	0,30
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,13)	k. A.

*Gemäß der Liste der Märkte, die in Anhang 1 zum Prospekt aufgeführt sind und die Kriterien für gemäß OGAW-Vorschriften geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Angola	0,23	k. A.
Argentinien	0,72	0,45
Australien	0,13	k. A.
Weißrussland	k. A.	0,05
Bermuda	0,74	0,54
Brasilien	0,02	0,00
Kanada	1,12	0,42
Cayman-Inseln	3,08	2,11
Chile	k. A.	0,09
China	0,01	0,08
Kolumbien	0,96	0,40
Costa Rica	0,08	k. A.
Zypern	k. A.	0,17
Dänemark	0,22	0,15
Dominikanische Republik	0,60	0,38
Ecuador	0,40	0,24
Ägypten	0,65	0,59
Finnland	0,20	0,09
Frankreich	2,21	3,32
Deutschland	1,82	3,45
Ghana	0,18	0,06
Guatemala	0,26	k. A.
Guernsey, Kanalinseln	0,10	0,43
Hongkong	0,10	1,08
Ungarn	0,54	k. A.
Indien	k. A.	0,05
Indonesien	1,19	0,45
Irland	2,88	2,38
Israel	0,11	k. A.
Italien	2,86	4,15
Elfenbeinküste	0,44	k. A.
Japan	0,35	1,11
Jersey, Kanalinseln	1,52	1,16
Kasachstan	0,18	k. A.
Luxemburg	4,17	5,22
Mazedonien	0,08	0,05
Mauritius	k. A.	0,13
Mexiko	2,30	1,67
Multinational	k. A.	0,42
Niederlande	2,79	3,96
Nigeria	0,39	0,44
Oman	0,25	0,27
Panama	0,35	k. A.
Peru	0,56	k. A.
Katar	k. A.	0,22
Rumänien	0,95	0,14
Russland	0,02	0,14
Saudi-Arabien	1,12	k. A.
Senegal	0,04	k. A.
Serbien	0,43	k. A.
Slowenien	0,41	0,27
Südafrika	0,41	0,07
Spanien	0,44	0,62
Sri Lanka	0,14	0,09
Schweden	0,14	0,35
Schweiz	0,16	0,58
Türkei	0,88	0,85
Ukraine	0,33	0,20
Vereinigte Arabische Emirate	0,21	0,15
Großbritannien	4,89	4,30
USA	42,15	22,26
Venezuela	0,17	0,07
Jungfernseln (Britisch)	k. A.	0,08
Kurzfristige Instrumente	0,46	5,18

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Investmentfonds	9,85	9,88
Pensionsgeschäfte	16,85	18,21
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,75	0,25
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	(0,12)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,43	0,23
Zinsswaps	2,49	1,84
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,08)	(0,01)
Devisenterminkontrakte	(0,12)	(0,46)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,55	0,77
Sonstige Aktiva und Passiva	(18,86)	(1,72)
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income ESG Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE			
ARGENTINIEN			
STAATSEMISSIONEN			
Argentina Government International Bond			
3,500 % fällig am 09.07.2041	\$ 900	\$ 308	0,53
BERMUDA			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
NCL Corp. Ltd.			
8,375 % fällig am 01.02.2028	200	212	0,37
BRASILIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Banco BTG Pactual S.A.			
2,750 % fällig am 11.01.2026	100	94	0,16
STAATSEMISSIONEN			
Brazil Government International Bond			
5,000 % fällig am 27.01.2045	200	164	0,29
6,250 % fällig am 18.03.2031	200	208	0,36
		372	0,65
Summe Brasilien		466	0,81
KANADA			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Air Canada Pass-Through Trust			
5,250 % fällig am 01.10.2030	374	367	0,64
CAYMAN-INSELN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Avolon Holdings Funding Ltd.			
2,528 % fällig am 18.11.2027	100	89	0,16
Seagate HDD Cayman			
3,125 % fällig am 15.07.2029	50	41	0,07
5,750 % fällig am 01.12.2034	200	192	0,33
Summe Cayman-Inseln		322	0,56
CHILE			
STAATSEMISSIONEN			
Chile Government International Bond			
3,100 % fällig am 07.05.2041	300	229	0,40
KOLUMBIEN			
STAATSEMISSIONEN			
Colombia Government International Bond			
5,000 % fällig am 15.06.2045	300	234	0,41
7,500 % fällig am 02.02.2034	300	317	0,55
Summe Kolumbien		551	0,96
COSTA RICA			
STAATSEMISSIONEN			
Costa Rica Government International Bond			
5,625 % fällig am 30.04.2043	150	138	0,24
DÄNEMARK			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
TDC Net A/S			
5,618 % fällig am 06.02.2030	€ 300	343	0,59
DOMINIKANISCHE REPUBLIK			
STAATSEMISSIONEN			
Dominican Republic Government International Bond			
4,500 % fällig am 30.01.2030	\$ 100	92	0,16
6,500 % fällig am 15.02.2048	200	192	0,33
Summe Dominikanische Republik		284	0,49
ECUADOR			
STAATSEMISSIONEN			
Ecuador Government International Bond			
3,500 % fällig am 31.07.2035	400	144	0,25
6,000 % fällig am 31.07.2030	228	107	0,18
Summe Ecuador		251	0,43

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÄGYPTEN			
STAATSEMISSIONEN			
Egypt Government International Bond			
6,375 % fällig am 11.04.2031	€ 400	\$ 285	0,50
EL SALVADOR			
STAATSEMISSIONEN			
El Salvador Government International Bond			
7,650 % fällig am 15.06.2035	\$ 150	118	0,20
FRANKREICH			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Altice France S.A.			
5,125 % fällig am 15.07.2029	300	234	0,41
11,500 % fällig am 01.02.2027 (a)(g)	€ 150	167	0,29
AXA S.A.			
5,500 % fällig am 11.07.2043	100	119	0,21
BNP Paribas S.A.			
8,500 % fällig am 14.08.2028 (d)(f)	\$ 200	210	0,37
Cerba Healthcare SACA			
3,500 % fällig am 31.05.2028	€ 200	185	0,32
Crown European Holdings S.A.			
2,875 % fällig am 01.02.2026	100	109	0,19
Electricite de France S.A.			
9,125 % fällig am 15.03.2033 (d)	\$ 125	140	0,24
Forvia SE			
2,375 % fällig am 15.06.2029	€ 200	202	0,35
JCDecaux SE			
5,000 % fällig am 11.01.2029	100	116	0,20
Loxam S.A.S.			
4,500 % fällig am 15.02.2027	100	111	0,19
Societe Generale S.A.			
6,691 % fällig am 10.01.2034	\$ 200	211	0,37
Vilmorin & Cie S.A.			
1,375 % fällig am 26.03.2028	€ 100	93	0,16
Summe Frankreich		1.897	3,30
DEUTSCHLAND			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Deutsche Bank AG			
1,625 % fällig am 20.01.2027	100	104	0,18
1,875 % fällig am 23.02.2028	100	104	0,18
3,742 % fällig am 07.01.2033	\$ 200	164	0,28
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide			
1,875 % fällig am 31.03.2028	€ 50	52	0,09
Schaeffler AG			
3,375 % fällig am 12.10.2028	100	107	0,19
ZF Finance GmbH			
2,000 % fällig am 06.05.2027	100	103	0,18
Summe Deutschland		634	1,10
GHANA			
STAATSEMISSIONEN			
Ghana Government International Bond			
7,875 % fällig am 11.02.2035 ^	\$ 350	154	0,27
HONGKONG			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Lenovo Group Ltd.			
6,536 % fällig am 27.07.2032	200	213	0,37
UNGARN			
STAATSEMISSIONEN			
Hungary Government International Bond			
2,125 % fällig am 22.09.2031	200	162	0,28
6,750 % fällig am 25.09.2052	200	224	0,39
Summe Ungarn		386	0,67
INDIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
ReNew Power Pvt Ltd.			
5,875 % fällig am 05.03.2027	275	263	0,46

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
INDONESIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia			
4,700 % fällig am 06.06.2032	\$ 500	\$ 505	0,88
IRLAND			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
AIB Group PLC			
5,250 % fällig am 23.10.2031	€ 100	120	0,21
Bank of Ireland Group PLC			
6,253 % fällig am 16.09.2026	\$ 200	202	0,35
GE Capital UK Funding Unlimited Co.			
5,875 % fällig am 18.01.2033	£ 50	69	0,12
Perrigo Finance Unlimited Co.			
4,650 % fällig am 15.06.2030	\$ 200	182	0,32
Summe Irland		573	1,00
ITALIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Intesa Sanpaolo SpA			
8,248 % fällig am 21.11.2033	50	54	0,10
Mundys SpA			
1,875 % fällig am 12.02.2028	€ 200	203	0,35
Nexi SpA			
2,125 % fällig am 30.04.2029	100	98	0,17
Telecom Italia SpA			
1,625 % fällig am 18.01.2029	100	96	0,17
7,875 % fällig am 31.07.2028	100	123	0,21
Summe Italien		574	1,00
ELFENBEINKÜSTE			
STAATSEMISSIONEN			
Ivory Coast Government International Bond			
6,125 % fällig am 15.06.2033	\$ 100	92	0,16
JAPAN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.			
5,475 % fällig am 22.02.2031	200	205	0,36
Mizuho Financial Group, Inc.			
3,490 % fällig am 05.09.2027	€ 300	333	0,58
Norinchukin Bank			
5,430 % fällig am 09.03.2028	\$ 200	204	0,35
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.			
2,472 % fällig am 14.01.2029	100	89	0,15
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.			
5,500 % fällig am 09.03.2028	200	205	0,36
Summe Japan		1.036	1,80
KASACHSTAN			
STAATSEMISSIONEN			
Kazakhstan Government International Bond			
6,500 % fällig am 21.07.2045	200	229	0,40
LIBERIA			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Royal Caribbean Cruises Ltd.			
4,250 % fällig am 01.07.2026	350	338	0,59
LUXEMBURG			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Altice Financing S.A.			
5,750 % fällig am 15.08.2029	200	178	0,31
Logicor Financing SARL			
1,625 % fällig am 17.01.2030	€ 200	189	0,33
Summe Luxemburg		367	0,64
MEXIKO			
STAATSEMISSIONEN			
Mexico Government International Bond			
4,875 % fällig am 19.05.2033	\$ 200	193	0,34
5,750 % fällig am 12.10.2110	175	157	0,27
Summe Mexiko		350	0,61

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
MAROKKO				PHILIPPINEN				GROSSBRITANNIEN			
STAATSEMISSIONEN				STAATSEMISSIONEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Morocco Government International Bond				Philippines Government International Bond				Atlantica Sustainable Infrastructure PLC			
3,000 % fällig am 15.12.2032	\$ 200	\$ 165	0,29	5,500 % fällig am 17.01.2048	\$ 250	\$ 264	0,46	4,125 % fällig am 15.06.2028	\$ 250	\$ 235	0,41
MULTINATIONAL				POLEN				Barclays PLC			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				STAATSEMISSIONEN				7,437 % fällig am 02.11.2033			
Allied Universal Holdco LLC				Poland Government International Bond				Berkeley Group PLC			
3,625 % fällig am 01.06.2028	€ 100	97	0,17	4,875 % fällig am 04.10.2033	125	127	0,22	2,500 % fällig am 11.08.2031	£ 100	99	0,17
American Airlines, Inc.				RUMÄNIEN				HSBC Holdings PLC			
5,750 % fällig am 20.04.2029	\$ 300	293	0,51	STAATSEMISSIONEN				3,973 % fällig am 22.05.2030			
Ardagh Packaging Finance PLC				Romania Government International Bond				Land Securities Capital Markets PLC			
2,125 % fällig am 15.08.2026	€ 200	198	0,34	1,750 % fällig am 13.07.2030	€ 100	89	0,16	4,875 % fällig am 15.09.2034	£ 100	131	0,23
NXP BV				6,625 % fällig am 27.09.2029	75	89	0,15	Lloyds Banking Group PLC			
5,350 % fällig am 01.03.2026	\$ 50	50	0,09	7,625 % fällig am 17.01.2053	\$ 200	225	0,39	7,500 % fällig am 27.06.2024	\$ 50	50	0,09
Summe multinational		638	1,11	Summe Rumänien		403	0,70	(d)(f)			
NIEDERLANDE				SENEGAL				Marks & Spencer PLC			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				STAATSEMISSIONEN				4,500 % fällig am 10.07.2027			
AerCap Holdings NV				Senegal Government International Bond				National Grid PLC			
5,875 % fällig am 10.10.2079	200	198	0,34	4,750 % fällig am 13.03.2028	€ 100	102	0,18	3,875 % fällig am 16.01.2029	€ 300	341	0,59
Citycon Treasury BV				SERBIEN				NatWest Group PLC			
1,625 % fällig am 12.03.2028	€ 100	89	0,15	STAATSEMISSIONEN				0,780 % fällig am 26.02.2030			
Cooperatieve Rabobank UA				Serbia Government International Bond				Standard Chartered PLC			
3,758 % fällig am 06.04.2033	\$ 300	269	0,47	1,650 % fällig am 03.03.2033	200	164	0,28	0,800 % fällig am 17.11.2029	200	193	0,34
CTP NV				SINGAPUR				6,301 % fällig am 09.01.2029			
1,250 % fällig am 21.06.2029	€ 100	92	0,16	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				\$ 50			
Digital Dutch Finco BV				Flex Ltd.				Virgin Media Secured Finance PLC			
1,000 % fällig am 15.01.2032	200	176	0,31	4,875 % fällig am 15.06.2029	\$ 50	49	0,09	4,125 % fällig am 15.08.2030	£ 100	110	0,19
Enel Finance International NV				SÜDAFRIKA				4,250 % fällig am 15.01.2030			
2,250 % fällig am 12.07.2031	\$ 350	285	0,50	STAATSEMISSIONEN				Vmed O2 UK Financing PLC			
ING Groep NV				South Africa Government International Bond				4,500 % fällig am 15.07.2031	200	221	0,38
4,125 % fällig am 24.08.2033	€ 100	111	0,19	4,850 % fällig am 30.09.2029	60	56	0,10	Vodafone Group PLC			
JDE Peet's NV				5,650 % fällig am 27.09.2047	60	48	0,08	5,125 % fällig am 04.06.2081	\$ 300	227	0,39
2,250 % fällig am 24.09.2031	\$ 50	40	0,07	5,750 % fällig am 30.09.2049	300	241	0,42	Weir Group PLC			
NE Property BV				Summe Südafrika		345	0,60	2,200 % fällig am 13.05.2026	200	186	0,32
3,375 % fällig am 14.07.2027	€ 100	104	0,18	SPANIEN				Summe Großbritannien			
Prosus NV				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				2,777			
3,061 % fällig am 13.07.2031	\$ 200	162	0,28	Abertis Infraestructuras S.A.				118	26	0,05	
Sensata Technologies BV				3,375 % fällig am 27.11.2026	£ 100	122	0,21	118	26	0,05	
4,000 % fällig am 15.04.2029	300	279	0,49	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.				118	26	0,05	
Universal Music Group NV				6,138 % fällig am 14.09.2028	\$ 200	206	0,36	118	26	0,05	
4,000 % fällig am 13.06.2031	€ 100	116	0,20	Banco de Sabadell S.A.				118	26	0,05	
Wabtec Transportation Netherlands BV				0,875 % fällig am 16.06.2028	€ 100	100	0,17	118	26	0,05	
1,250 % fällig am 03.12.2027	50	51	0,09	CaixaBank S.A.				118	26	0,05	
Summe Niederlande		1.972	3,43	3,750 % fällig am 07.09.2029	100	113	0,20	118	26	0,05	
OMAN				SRI LANKA				USA			
STAATSEMISSIONEN				STAATSEMISSIONEN				FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
Oman Government International Bond				Sri Lanka Government International Bond				GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust			
6,750 % fällig am 17.01.2048	\$ 200	210	0,36	6,750 % fällig am 18.04.2028 ^	\$ 200	101	0,18	5,520 % fällig am 22.02.2055	94	92	0,16
PANAMA				SCHWEDEN				Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				5,770 % fällig am 25.08.2036			
Carnival Corp.				EQT AB				26	26	0,05	
4,000 % fällig am 01.08.2028	100	93	0,16	0,875 % fällig am 14.05.2031	€ 300	265	0,46	118	26	0,05	
STAATSEMISSIONEN				SCHWEIZ				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Panama Government International Bond				UBS Group AG				26	26	0,05	
6,200 % fällig am 26.01.2036	700	696	1,21	3,091 % fällig am 14.05.2032	\$ 250	213	0,37	26	26	0,05	
Summe Panama		789	1,37	USA				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
PARAGUAY				SRI LANKA				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
STAATSEMISSIONEN				STAATSEMISSIONEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Paraguay Government International Bond				Sri Lanka Government International Bond				AES Corp.			
5,400 % fällig am 30.03.2050	100	89	0,15	6,750 % fällig am 18.04.2028 ^	\$ 200	101	0,18	2,450 % fällig am 15.01.2031	250	210	0,36
PERU				SRI LANKA				5,450 % fällig am 01.06.2028			
STAATSEMISSIONEN				STAATSEMISSIONEN				150			
Peru Government International Bond				Sri Lanka Government International Bond				Albertsons Cos., Inc.			
3,000 % fällig am 15.01.2034	200	170	0,29	6,750 % fällig am 18.04.2028 ^	\$ 200	101	0,18	3,500 % fällig am 15.03.2029	100	91	0,16
3,300 % fällig am 11.03.2041	300	234	0,41	Summe Sri Lanka		1.138	1,98	Ally Financial, Inc.			
Summe Peru		404	0,70	Summe Sri Lanka		1.138	1,98	8,000 % fällig am 01.11.2031	140	153	0,27

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income ESG Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Builders FirstSource, Inc. 4,250 % fällig am 01.02.2032	\$ 200	\$ 181	0,31	JPMorgan Chase & Co. 2,580 % fällig am 22.04.2032	\$ 600	\$ 508	0,88	T-Mobile USA, Inc. 2,250 % fällig am 15.02.2026	\$ 100	\$ 95	0,16
Cable One, Inc. 4,000 % fällig am 15.11.2030	100	81	0,14	Kilroy Realty LP 2,650 % fällig am 15.11.2033	200	152	0,26	TEGNA, Inc. 5,000 % fällig am 15.09.2029	200	183	0,32
Catalent Pharma Solutions, Inc. 2,375 % fällig am 01.03.2028	€ 100	96	0,17	Kraft Heinz Foods Co. 3,750 % fällig am 01.04.2030	50	48	0,08	Tenet Healthcare Corp. 4,625 % fällig am 15.06.2028	350	334	0,58
CCO Holdings LLC 4,500 % fällig am 01.05.2032	\$ 275	236	0,41	6,500 % fällig am 09.02.2040	100	112	0,19	TerraForm Power Operating LLC 5,000 % fällig am 31.01.2028	200	194	0,34
CenterPoint Energy Houston Electric LLC 5,300 % fällig am 01.04.2053	200	209	0,36	Lamb Weston Holdings, Inc. 4,375 % fällig am 31.01.2032	200	183	0,32	Topaz Solar Farms LLC 5,750 % fällig am 30.09.2039	192	191	0,33
Charter Communications Operating LLC 3,850 % fällig am 01.04.2061	100	62	0,11	Level 3 Financing, Inc. 3,625 % fällig am 15.01.2029	50	26	0,05	TopBuild Corp. 3,625 % fällig am 15.03.2029	250	227	0,39
3,950 % fällig am 30.06.2062	200	126	0,22	LPL Holdings, Inc. 4,000 % fällig am 15.03.2029	50	46	0,08	Travel + Leisure Co. 4,625 % fällig am 01.03.2030	250	224	0,39
Chobani LLC 4,625 % fällig am 15.11.2028	300	281	0,49	Marvell Technology, Inc. 4,875 % fällig am 22.06.2028	50	50	0,09	Twilio, Inc. 3,625 % fällig am 15.03.2029	200	183	0,32
Clearway Energy Operating LLC 3,750 % fällig am 15.02.2031	275	243	0,42	Moody's Corp. 2,000 % fällig am 19.08.2031	250	208	0,36	Uber Technologies, Inc. 4,500 % fällig am 15.08.2029	200	191	0,33
Comcast Corp. 4,650 % fällig am 15.02.2033	200	201	0,35	Morgan Stanley 5,123 % fällig am 01.02.2029	330	332	0,58	United Airlines Pass-Through Trust 5,875 % fällig am 15.04.2029	65	66	0,11
CommScope, Inc. 4,750 % fällig am 01.09.2029	200	134	0,23	MPH Acquisition Holdings LLC 5,750 % fällig am 01.11.2028	100	81	0,14	United Airlines, Inc. 4,625 % fällig am 15.04.2029	200	187	0,32
Community Health Systems, Inc. 4,750 % fällig am 15.02.2031	200	157	0,27	MSCI, Inc. 3,625 % fällig am 01.09.2030	50	45	0,08	United Rentals North America, Inc. 3,875 % fällig am 15.02.2031	200	182	0,32
Coty, Inc. 5,000 % fällig am 15.04.2026	157	155	0,27	National Rural Utilities Cooperative Finance Corp. 1,350 % fällig am 15.03.2031	200	157	0,27	Verizon Communications, Inc. 1,500 % fällig am 18.09.2030	50	41	0,07
Covanta Holding Corp. 4,875 % fällig am 01.12.2029	200	175	0,30	NCR Voyix Corp. 5,125 % fällig am 15.04.2029	200	190	0,33	2,850 % fällig am 03.09.2041	300	222	0,39
Credit Acceptance Corp. 6,625 % fällig am 15.03.2026	200	200	0,35	Netflix, Inc. 4,875 % fällig am 15.06.2030	300	304	0,53	VMware LLC 2,200 % fällig am 15.08.2031	200	166	0,29
Crocs, Inc. 4,250 % fällig am 15.03.2029	50	45	0,08	Newell Brands, Inc. 6,500 % fällig am 01.04.2046	240	200	0,35	4,500 % fällig am 15.05.2025	50	49	0,09
Crown Castle, Inc. 2,500 % fällig am 15.07.2031	300	250	0,43	OneMain Finance Corp. 3,500 % fällig am 15.01.2027	250	231	0,40	Wells Fargo & Co. 4,540 % fällig am 15.08.2026	100	99	0,17
3,100 % fällig am 15.11.2029	50	45	0,08	Open Text Holdings, Inc. 4,125 % fällig am 15.02.2030	100	91	0,16	Wisconsin Power & Light Co. 4,950 % fällig am 01.04.2033	200	201	0,35
CVS Health Corp. 3,750 % fällig am 01.04.2030	300	282	0,49	Organon & Co. 2,875 % fällig am 30.04.2028	€ 300	305	0,53	WGM Acquisition Corp. 2,250 % fällig am 15.08.2031	€ 400	389	0,68
Dell International LLC 3,375 % fällig am 15.12.2041	100	76	0,13	Pacific Gas & Electric Co. 6,700 % fällig am 01.04.2053	\$ 225	245	0,43	Yum! Brands, Inc. 4,625 % fällig am 31.01.2032	\$ 100	94	0,16
6,020 % fällig am 15.06.2026	27	28	0,05	Park Intermediate Holdings LLC 4,875 % fällig am 15.05.2029	100	93	0,16	ZF North America Capital, Inc. 7,125 % fällig am 14.04.2030	200	213	0,37
DISH DBS Corp. 5,250 % fällig am 01.12.2026	100	86	0,15	PennyMac Financial Services, Inc. 7,875 % fällig am 15.12.2029	100	103	0,18			20,775	36,10
DISH Network Corp. 11,750 % fällig am 15.11.2027	50	52	0,09	PNC Financial Services Group, Inc. 2,200 % fällig am 01.11.2024	300	292	0,51	NON-AGENCY-MBS			
Edgewell Personal Care Co. 5,500 % fällig am 01.06.2028	50	49	0,09	Post Holdings, Inc. 5,500 % fällig am 15.12.2029	150	145	0,25	Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust 6,310 % fällig am 19.09.2044	27	24	0,04
Elanco Animal Health, Inc. 6,650 % fällig am 28.08.2028	200	208	0,36	Prime Security Services Borrower LLC 6,250 % fällig am 15.01.2028	250	249	0,43	US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Embecka Corp. 5,000 % fällig am 15.02.2030	200	170	0,30	Quanta Services, Inc. 2,350 % fällig am 15.01.2032	200	166	0,29	Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.03.2053	996	966	1,68
Equinix, Inc. 2,500 % fällig am 15.05.2031	150	127	0,22	Ritchie Bros Holdings, Inc. 7,750 % fällig am 15.03.2031	50	53	0,09	5,000 % fällig am 01.04.2053	1.757	1.739	3,02
Ford Motor Co. 3,250 % fällig am 12.02.2032	275	229	0,40	Rocket Mortgage LLC 4,000 % fällig am 15.10.2033	200	170	0,30	5,500 % fällig am 01.11.2052	1.138	1.143	1,98
Frontier Communications Holdings LLC 8,750 % fällig am 15.05.2030	48	49	0,09	San Diego Gas & Electric Co. 4,950 % fällig am 15.08.2028	75	77	0,13	- 01.05.2053	100	102	0,18
Goldman Sachs Group, Inc. 3,102 % fällig am 24.02.2033	100	86	0,15	Santander Holdings USA, Inc. 5,807 % fällig am 09.09.2026	200	201	0,35	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2054	800	804	1,40
Haleon U.S. Capital LLC 3,375 % fällig am 24.03.2029	350	331	0,57	SBA Communications Corp. 3,125 % fällig am 01.02.2029	500	450	0,78	6,000 % fällig am 01.02.2054	1.000	1.015	1,76
HAT Holdings LLC 3,375 % fällig am 15.06.2026	50	47	0,08	Scripps Escrow, Inc. 3,875 % fällig am 15.01.2029	100	89	0,15	6,500 % fällig am 01.02.2054	1.500	1.537	2,67
8,000 % fällig am 15.06.2027	100	104	0,18	Sirius XM Radio, Inc. 3,875 % fällig am 01.09.2031	150	128	0,22			7,306	12,69
HCA, Inc. 4,125 % fällig am 15.06.2029	350	335	0,58	SLM Corp. 3,125 % fällig am 02.11.2026	150	140	0,24	US-SCHATZOBIGATIONEN			
Hilton Domestic Operating Co., Inc. 3,625 % fällig am 15.02.2032	200	175	0,30	Solar Star Funding LLC 5,375 % fällig am 30.06.2035	272	270	0,47	U.S. Treasury Bonds 3,875 % fällig am 15.05.2043	500	477	0,83
Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC 4,875 % fällig am 01.07.2031	200	177	0,31	Southern California Edison Co. 2,500 % fällig am 01.06.2031	500	429	0,75	4,000 % fällig am 15.11.2042	175	170	0,29
Host Hotels & Resorts LP 2,900 % fällig am 15.12.2031	250	210	0,36	Sprint Capital Corp. 8,750 % fällig am 15.03.2032	400	494	0,86			647	1,12
Ingevity Corp. 3,875 % fällig am 01.11.2028	50	45	0,08	Standard Industries, Inc. 4,375 % fällig am 15.07.2030	200	184	0,32	Summe USA		28,870	50,16
IQVIA, Inc. 2,250 % fällig am 15.01.2028	€ 250	260	0,45					URUGUAY STAATSEMISSIONEN			
								Uruguay Government International Bond 5,100 % fällig am 18.06.2050	300	302	0,52

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income ESG Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	5,000 %	20.03.2029	£ 100	\$ (8)	(0,01)
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	5,500	20.03.2026	200	(6)	(0,01)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	15.06.2032	¥ 10.000	1	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,850	20.09.2033	70.000	(4)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,000	18.12.2026	\$ 3.800	41	0,06
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,750	20.12.2025	CAD 300	4	0,01
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,750	20.12.2033	AUD 1.000	15	0,03
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	20.03.2054	€ 300	1	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.03.2034	800	1	0,00
					\$ 60	0,10
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ 66	0,11

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

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

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

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Gezahlte/ (erhaltene) Abschluss- prämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BOA	Brazil Government International Bond	1,000 %	20.06.2028	\$ 300	\$ (17)	\$ 15	\$ (2)	(0,01)
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2028	200	(17)	10	(7)	(0,01)
BRC	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2027	100	(17)	12	(5)	(0,01)
GST	Indonesia Government International Bond	1,000	20.12.2028	400	0	5	5	0,01
MYC	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2028	200	(36)	24	(12)	(0,02)
					\$ (87)	\$ 66	\$ (21)	(0,04)

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEWISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens	
BOA	01.2024	£ 34	\$ 43	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00	
BRC	01.2024	€ 274	299	0	(4)	(4)	(0,01)	
	01.2024	£ 44	56	0	0	0	0,00	
			1,05					
CBK	04.2024	\$ 33	TRY 3	0	(1)	(1)	0,00	
GLM	01.2024	HUF 19.697	\$ 56	0	(1)	(1)	0,00	
MBC	01.2024	AUD 14	9	0	0	0	0,00	
			7,45					
	01.2024	€ 6.776	0	0	(37)	(37)	(0,07)	
	01.2024	HUF 26.516	75	0	(1)	(1)	0,00	
	01.2024	¥ 2.100	15	0	0	0	0,00	
MYI	01.2024	HUF 35.185	100	0	(2)	(2)	0,00	
SCX	01.2024	\$ 401	€ 367	5	(1)	4	0,01	
			1,31					
UAG	01.2024	4	HUF 2	0	0	0	0,00	
	01.2024	£ 683	\$ 864	0	(6)	(6)	(0,01)	
					\$ 5	\$ (53)	\$ (48)	(0,08)

ABGESICHERTE DEWISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 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 Netto- vermögens
BRC	01.2024	€ 131	\$ 142	\$ 0	\$ (3)	\$ (3)	(0,01)
	01.2024	\$ 1.870	€ 1.713	23	0	23	0,04
CBK	01.2024	€ 118	\$ 129	0	(1)	(1)	0,00
MBC	01.2024	32	35	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	\$ 15.203	€ 13.827	75	0	75	0,13
MYI	01.2024	€ 96	\$ 104	0	(1)	(1)	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	01.2024	\$ 15.071	€ 13.712	\$ 79	\$ 0	\$ 79	0,14
SCX	01.2024	€ 240	\$ 264	0	(2)	(2)	0,00
	01.2024	\$ 442	€ 404	5	0	5	0,01
UAG	01.2024	13.283	12.076	60	0	60	0,10
				\$ 242	\$ (8)	\$ 234	0,41

Zum 31. Dezember 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	01.2024	\$ 5	£ 4	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BRC	01.2024	11	8	0	0	0	0,00
SCX	01.2024	84	66	1	0	1	0,00
SSB	01.2024	67	53	1	0	1	0,00
UAG	01.2024	84	66	1	0	1	0,00
				\$ 3	\$ 0	\$ 3	0,00

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 168 0,29

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.02.2054	\$ 1.000	\$ (970)	(1,69)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (970)	(1,69)
Summe Anlagen		\$ 58.721	102,01
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (1.158)	(2,01)
Nettovermögen		\$ 57.563	100,00

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) 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 Teilfonds verbunden.

(f) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(g) Eingeschränkte Wertpapiere: (31. Dezember 2022: null):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits- datum	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Altice France S.A.	11,500 %	01.02.2027	20.12.2023	\$ 160	\$ 167	0,29

Barmittel in Höhe von USD 367 (31. Dezember 2022: USD 113) wurden zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 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	\$ 51.082	\$ 24	\$ 51.106
Investmentfonds	5.470	0	0	5.470
Pensionsgeschäfte	0	3.000	0	3.000
Finanzderivate ⁽³⁾	19	96	0	115
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(970)	0	(970)
Summen	\$ 5.489	\$ 53.208	\$ 24	\$ 58.721

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income ESG Fund (Forts.)

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 9.978	\$ 0	\$ 9.978
Finanzderivate ⁽³⁾	41	(54)	0	(13)
Summen	\$ 41	\$ 9.924	\$ 0	\$ 9.965

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

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

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

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ (9)	\$ 0	\$ (9)	\$ 1	\$ 0	\$ 1
BRC	10	0	10	k. A.	k. A.	k. A.
CBK	(2)	0	(2)	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	k. A.	k. A.	k. A.	2	0	2
GST	5	0	5	k. A.	k. A.	k. A.
MBC	36	0	36	k. A.	k. A.	k. A.
MYC	(12)	0	(12)	k. A.	k. A.	k. A.
MYI	80	0	80	k. A.	k. A.	k. A.
SCX	4	0	4	(57)	0	(57)
SSB	1	0	1	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	55	0	55	k. A.	k. A.	k. A.

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

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	54,77	61,68
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	34,03	39,58
Investmentfonds	9,50	k. A.
Pensionsgeschäfte	5,21	k. A.
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,21)	0,31
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,11	0,10
Freiverkehrsfinanzderivate	0,29	(0,54)
Leerverkaufte Wertpapiere	(1,69)	k. A.

* Gemäß der Liste der Märkte, die in Anhang 1 zum Prospekt aufgeführt sind und die Kriterien für gemäß OGAW-Vorschriften geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Argentinien	0,53	0,58
Bermuda	0,37	k. A.
Brasilien	0,81	3,50
Kanada	0,64	0,72
Cayman-Inseln	0,56	1,75
Chile	0,40	1,46
Kolumbien	0,96	1,39
Costa Rica	0,24	k. A.
Dänemark	0,59	1,07
Dominikanische Republik	0,49	1,68
Ecuador	0,43	0,47
Ägypten	0,50	k. A.
El Salvador	0,20	k. A.
Finnland	k. A.	1,03
Frankreich	3,30	6,29
Deutschland	1,10	3,73
Ghana	0,27	k. A.
Guernsey, Kanalinseln	k. A.	0,95
Hongkong	0,37	k. A.
Ungarn	0,67	k. A.
Indien	0,46	1,95
Indonesien	0,88	k. A.
Irland	1,00	1,24
Italien	1,00	0,88
Elfenbeinküste	0,16	0,77

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Japan	1,80	1,71
Jersey, Kanalinseln	k. A.	0,91
Kasachstan	0,40	k. A.
Liberia	0,59	k. A.
Luxemburg	0,64	1,95
Mexiko	0,61	0,86
Marokko	0,29	1,40
Mehrere Länder	k. A.	1,01
Multinational	1,11	0,49
Niederlande	3,43	2,45
Oman	0,36	1,91
Panama	1,37	1,06
Paraguay	0,15	k. A.
Peru	0,70	0,74
Philippinen	0,46	k. A.
Polen	0,22	k. A.
Rumänien	0,70	0,76
Senegal	0,18	k. A.
Serbien	0,28	k. A.
Singapur	0,09	0,96
Südafrika	0,60	k. A.
Spanien	1,98	3,85
Sri Lanka	0,18	k. A.
Schweden	0,46	0,75
Schweiz	0,37	k. A.
Großbritannien	4,82	7,18
Vereinigte Staaten	50,16	27,59
Uruguay	0,52	k. A.
Kurzfristige Instrumente	0,40	16,22
Investmentfonds	9,50	k. A.
Pensionsgeschäfte	5,21	k. A.
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,21)	0,31
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,01	k. A.
Zinsswaps	0,10	0,10
Freiverkehrsfinanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	(0,04)	k. A.
Devisenterminkontrakte	(0,08)	(0,61)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,41	0,07
Leerverkaufte Wertpapiere	(1,69)	k. A.
Sonstige Aktiva und Passiva	(2,01)	(1,13)
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Dynamic Bond Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE			
American Airlines, Inc. 10,427 % fällig am 20.04.2028	\$ 810	\$ 833	0,03	Banco Santander S.A. 4,375 % fällig am 14.01.2026 (h)(j)	€ 3.200	\$ 3.263	0,09	Digital Dutch Finco BV 1,500 % fällig am 15.03.2030	€ 1.100	\$ 1.059	0,03
BCP Modular Services Holdings Ltd. 8,350 % fällig am 15.12.2028	€ 4.900	5.189	0,15	Bank of America Corp. 2,687 % fällig am 22.04.2032	\$ 200	169	0,00	DVI Deutsche Vermoegens- & Immobilienverwaltungs GmbH 2,500 % fällig am 25.01.2027	3.500	3.330	0,10
Carnival Corp. 8,357 % fällig am 08.08.2027	\$ 2.886	2.896	0,09	Bank of Ireland Group PLC 7,500 % fällig am 19.05.2025 (h)(j)	€ 3.700	4.149	0,12	EQT AB 2,375 % fällig am 06.04.2028	1.200	1.254	0,04
Charter Communications Operating LLC 7,133 % fällig am 01.02.2027	186	186	0,01	Barclays PLC 2,645 % fällig am 24.06.2031	\$ 900	760	0,02	Equinix, Inc. 0,250 % fällig am 15.03.2027	1.500	1.509	0,04
Delos Aircraft DAC 7,348 % fällig am 31.10.2027	1.840	1.850	0,05	3,330 % fällig am 24.11.2042	3.600	2.663	0,08	3,900 % fällig am 15.04.2032	\$ 300	279	0,01
Hertz Corp. 8,720 % fällig am 30.06.2028	2.779	2.775	0,08	3,375 % fällig am 02.04.2025	€ 1.100	1.212	0,03	Fairfax Financial Holdings Ltd. 4,625 % fällig am 29.04.2030	2.500	2.405	0,07
Hilton Domestic Operating Co., Inc. 7,455 % fällig am 08.11.2030	4.774	4.796	0,14	4,337 % fällig am 10.01.2028	\$ 300	292	0,01	Federation des Caisses Desjardins du Quebec 5,860 % fällig am 30.11.2026	€ 1.700	2.167	0,06
IRB Holding Corp. 8,456 % fällig am 15.12.2027	1.799	1.805	0,05	4,972 % fällig am 16.05.2029	300	295	0,01	Ford Motor Credit Co. LLC 2,330 % fällig am 25.11.2025	€ 200	215	0,01
LifePoint Health, Inc. 11,168 % fällig am 16.11.2028	4.201	4.196	0,12	5,304 % fällig am 09.08.2026	2.500	2.491	0,07	2,700 % fällig am 10.08.2026	\$ 3.900	3.614	0,10
MPH Acquisition Holdings LLC 9,900 % fällig am 01.09.2028	4.399	4.253	0,12	5,501 % fällig am 09.08.2028	600	603	0,02	2,748 % fällig am 14.06.2024	€ 2.300	2.893	0,08
Nouryon Finance BV 8,182 % fällig am 03.04.2028	€ 5.476	6.064	0,18	6,375 % fällig am 15.12.2025 (h)(j)	€ 1.700	2.067	0,06	2,900 % fällig am 16.02.2028	\$ 1.800	1.617	0,05
United Airlines, Inc. 9,220 % fällig am 21.04.2028	\$ 1.161	1.167	0,03	7,125 % fällig am 15.06.2025 (h)(j)	900	1.119	0,03	3,021 % fällig am 06.03.2024	€ 900	991	0,03
		36.010	1,05	7,385 % fällig am 02.11.2028	\$ 2.500	2.673	0,08	3,250 % fällig am 15.09.2025	100	109	0,00
				7,437 % fällig am 02.11.2033	2.700	3.025	0,09	4,535 % fällig am 06.03.2025	€ 200	251	0,01
				8,000 % fällig am 15.06.2024 (h)(j)	400	398	0,01	G City Europe Ltd. 4,250 % fällig am 11.09.2025	€ 1.200	1.221	0,04
				Bevco Lux SARL 1,000 % fällig am 16.01.2030	€ 4.400	4.078	0,12	Globalworth Real Estate Investments Ltd. 2,950 % fällig am 29.07.2026	1.300	1.185	0,03
				BGC Group, Inc. 4,375 % fällig am 15.12.2025	\$ 1.100	1.056	0,03	3,000 % fällig am 29.03.2025	3.100	3.137	0,09
				Blue Owl Capital Corp. 2,875 % fällig am 11.06.2028	1.900	1.670	0,05	Goldman Sachs Group, Inc. 1,875 % fällig am 16.12.2030	€ 2.500	2.659	0,08
				Blue Owl Finance LLC 3,125 % fällig am 10.06.2031	4.500	3.713	0,11	2,615 % fällig am 22.04.2032	\$ 200	168	0,00
				BNP Paribas S.A. 1,904 % fällig am 30.09.2028	7.800	6.936	0,20	3,615 % fällig am 15.03.2028	2.000	1.919	0,06
				2,125 % fällig am 23.01.2027	€ 2.400	2.577	0,07	3,691 % fällig am 05.06.2028	300	287	0,01
				BNP S.A. 2,125 % fällig am 13.10.2046 (j)	3.800	3.418	0,10	5,798 % fällig am 10.08.2026	4.200	4.243	0,12
				Brown & Brown, Inc. 4,200 % fällig am 15.09.2024	\$ 7.500	7.422	0,22	HSBC Holdings PLC 1,750 % fällig am 24.07.2027	€ 3.200	3.750	0,11
				CaixaBank S.A. 6,750 % fällig am 13.06.2024 (h)(j)	€ 1.000	1.106	0,03	2,357 % fällig am 18.08.2031	\$ 2.200	1.824	0,05
				CapitalLand Ascendas REIT 0,750 % fällig am 23.06.2028	3.200	3.032	0,09	2,804 % fällig am 24.05.2032	800	668	0,02
				CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund 0,500 % fällig am 27.01.2028	2.000	1.957	0,06	2,871 % fällig am 22.11.2032	5.000	4.157	0,12
				0,900 % fällig am 12.10.2029	2.300	2.116	0,06	3,973 % fällig am 22.05.2030	4.700	4.394	0,13
				Constellation Insurance, Inc. 6,800 % fällig am 24.01.2030	\$ 3.500	3.321	0,10	4,583 % fällig am 19.06.2029	4.170	4.047	0,12
				Cooperative Rabobank UA 4,375 % fällig am 29.06.2027 (h)(j)	€ 1.800	1.867	0,05	4,750 % fällig am 04.07.2029	€ 2.200	2.204	0,06
				5,500 % fällig am 05.10.2026	\$ 3.000	3.071	0,09	5,210 % fällig am 11.08.2028	\$ 2.600	2.599	0,08
				Covertry Building Society 2,625 % fällig am 07.12.2026	€ 1.100	1.202	0,03	6,375 % fällig am 30.03.2025 (h)(j)	500	494	0,01
				CPI Property Group S.A. 1,500 % fällig am 27.01.2031	800	467	0,01	ING Groep NV 5,750 % fällig am 16.11.2026 (h)(j)	900	841	0,02
				1,625 % fällig am 23.04.2027	6.650	5.415	0,16	Intesa Sanpaolo SpA 0,750 % fällig am 16.03.2028	€ 3.100	3.086	0,09
				2,750 % fällig am 12.05.2026	1.100	1.017	0,03	3,250 % fällig am 23.09.2024	\$ 5.800	5.696	0,17
				4,875 % fällig am 16.07.2025 (h)	2.200	723	0,02	4,000 % fällig am 23.09.2029	400	364	0,01
				Credit Suisse AG 0,250 % fällig am 01.09.2028	3.700	3.558	0,10	5,148 % fällig am 10.06.2030	€ 1.400	1.619	0,05
				0,495 % fällig am 02.02.2024	\$ 1.800	1.792	0,05	JAB Holdings BV 2,200 % fällig am 23.11.2030	\$ 1.638	1.319	0,04
				7,500 % fällig am 15.02.2028	300	329	0,01	JPMorgan Chase & Co. 2,595 % fällig am 24.02.2026	6.400	6.201	0,18
				Credit Suisse AG AT1 Claim 10,500	1.260	0,04	4,005 % fällig am 23.04.2029	4.500	4.333	0,13	
				Cromwell Ereit Lux Finco SARL 2,125 % fällig am 19.11.2025	€ 3.100	3.233	0,09	JPMorgan Chase Bank N.A. 5,110 % fällig am 08.12.2026	2.100	2.120	0,06
				Crown Castle, Inc. 3,100 % fällig am 15.11.2029	\$ 250	224	0,01	Kennedy-Wilson, Inc. 4,750 % fällig am 01.02.2030	3.000	2.435	0,07
				3,800 % fällig am 15.02.2028	2.250	2.139	0,06	Lazard Group LLC 4,375 % fällig am 11.03.2029	15.300	14.821	0,43
				CTP NV 0,625 % fällig am 27.09.2026	€ 1.800	1.790	0,05	Legal & General Group PLC 5,625 % fällig am 24.03.2031 (h)(j)	€ 800	868	0,03
				1,250 % fällig am 21.06.2029	5.100	4.677	0,14	LFS Topco LLC 5,875 % fällig am 15.10.2026	\$ 1.500	1.382	0,04
				1,500 % fällig am 27.09.2031	1.700	1.467	0,04	Lloyds Banking Group PLC 4,375 % fällig am 22.03.2028	900	881	0,03
				Deutsche Bank AG 0,898 % fällig am 28.05.2024 (k)	\$ 1.900	1.866	0,05	4,947 % fällig am 27.06.2025 (h)(j)	€ 1.100	1.188	0,03
				1,375 % fällig am 17.02.2032	€ 4.600	4.183	0,12	4,976 % fällig am 11.08.2033	\$ 2.900	2.827	0,08
				1,625 % fällig am 20.01.2027	1.900	1.974	0,06	Logicor Financing SARL 0,625 % fällig am 17.11.2025	€ 300	309	0,01
				2,625 % fällig am 16.12.2024	€ 1.200	1.483	0,04	1,500 % fällig am 13.07.2026	2.300	2.383	0,07
				3,035 % fällig am 28.05.2032 (k)	\$ 800	669	0,02	1,625 % fällig am 17.01.2030	900	853	0,02
				3,742 % fällig am 07.01.2033	1.200	986	0,03	2,000 % fällig am 17.01.2034	1.000	867	0,03
				3,875 % fällig am 12.02.2024	€ 3.500	4.451	0,13	2,750 % fällig am 15.01.2030	€ 900	946	0,03
								Mizuho Financial Group, Inc. 0,470 % fällig am 06.09.2029	€ 3.000	2.867	0,08
								2,564 % fällig am 13.09.2031	\$ 1.600	1.303	0,04

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Morgan Stanley				7,750 % fällig am 01.03.2029	€ 400	510	0,01	4,908 % fällig am 23.07.2025	\$ 2.970	\$ 2.943	0,09
0,000 % fällig am 02.04.2032 (k)	\$ 3.600	\$ 2.188	0,06	UniCredit SpA	\$ 350	\$ 329	0,01	6,384 % fällig am 23.10.2035	875	889	0,03
Mutuelle Assurance Des Commerçants et Industriels de France et Des Cadres et Sal				2,569 % fällig am 22.09.2026				6,484 % fällig am 23.10.2045	1.100	1.082	0,03
0,625 % fällig am 21.06.2027	€ 1.200	1.203	0,03	VICI Properties LP	1.700	1.658	0,05	6,834 % fällig am 23.10.2055	150	150	0,00
2,125 % fällig am 21.06.2052	3.400	2.904	0,08	3,500 % fällig am 15.02.2025	3.300	3.117	0,09	Cloud Software Group, Inc.	3.800	3.622	0,10
National Bank of Canada				3,750 % fällig am 15.02.2027	2.500	2.280	0,07	6,500 % fällig am 31.03.2029			
3,500 % fällig am 25.04.2028	1.800	2.037	0,06	4,125 % fällig am 15.08.2030	2.300	2.253	0,07	Constellation Oil Services Holding S.A.			
Nationwide Building Society				4,750 % fällig am 15.02.2028				13,500 % fällig am 30.06.2025	314	311	0,01
3,960 % fällig am 18.07.2030	\$ 900	841	0,02	Virgin Money UK PLC	£ 200	244	0,01	Constellation Oil Services Holding S.A. (3,000 % bar oder 4,000 % PIK)			
4,302 % fällig am 08.03.2029	6.800	6.521	0,19	3,375 % fällig am 24.04.2026	£ 200	244	0,01	3,000 % fällig am 31.12.2026			
5,875 % fällig am 20.12.2024 (h)(j)	£ 1.600	2.007	0,06	0,875 % fällig am 20.02.2025	3.200	3.875	0,11	(c)	954	694	0,02
NatWest Group PLC				Wells Fargo & Co.				Coty, Inc.			
2,000 % fällig am 04.03.2025	€ 4.500	4.952	0,14	3,000 % fällig am 22.04.2026	\$ 2.100	2.012	0,06	3,875 % fällig am 15.04.2026	€ 4.200	4.642	0,13
4,892 % fällig am 18.05.2029	\$ 1.700	1.671	0,05	3,526 % fällig am 24.03.2028	2.600	2.482	0,07	4,750 % fällig am 15.01.2029	\$ 2.000	1.909	0,06
5,125 % fällig am 12.05.2027 (h)(j)	£ 200	230	0,01	6,303 % fällig am 23.10.2029	6.100	6.433	0,19	DAE Funding LLC			
NatWest Markets PLC				Wells Fargo Bank N.A.				1,625 % fällig am 15.02.2024	2.500	2.487	0,07
1,000 % fällig am 28.05.2024	€ 1.700	1.856	0,05	5,254 % fällig am 11.12.2026	8.000	8.101	0,23	DISH DBS Corp.			
Nissan Motor Acceptance Co. LLC				Workspace Group PLC				5,250 % fällig am 01.12.2026	1.000	859	0,02
1,850 % fällig am 16.09.2026	\$ 1.600	1.440	0,04	2,250 % fällig am 11.03.2028	£ 2.700	2.956	0,09	5,750 % fällig am 01.12.2028	2.000	1.599	0,05
2,000 % fällig am 09.03.2026	1.400	1.287	0,04	WPC Eurobond BV				DISH Network Corp.			
2,450 % fällig am 15.09.2028	700	600	0,02	1,350 % fällig am 15.04.2028	€ 1.700	1.720	0,05	11,750 % fällig am 15.11.2027	6.400	6.686	0,19
Nova Ljubljanska Banka d.d.						479.883	13,93	Exela Intermediate LLC			
3,400 % fällig am 05.02.2030 (l)	€ 2.500	2.397	0,07	INDUSTRIEWERTE				11,500 % fällig am 15.04.2026	953	171	0,00
3,650 % fällig am 19.11.2029	2.900	2.821	0,08	AA Bond Co. Ltd.				Expedia Group, Inc.			
Nuveen Finance LLC				3,250 % fällig am 31.07.2050	£ 2.300	2.495	0,07	2,950 % fällig am 15.03.2031	540	476	0,01
4,125 % fällig am 01.11.2024	\$ 500	493	0,01	Accor S.A.				6,250 % fällig am 01.05.2025	2.069	2.090	0,06
Park Aerospace Holdings Ltd.				2,375 % fällig am 29.11.2028	€ 3.500	3.696	0,11	Ford Motor Co.			
5,500 % fällig am 15.02.2024	28	28	0,00	Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.				3,250 % fällig am 12.02.2032	1.300	1.082	0,03
PRA Group, Inc.				3,100 % fällig am 02.02.2031	\$ 5.000	3.820	0,11	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide	€ 1.900	2.044	0,06
7,375 % fällig am 01.09.2025	1.100	1.095	0,03	3,375 % fällig am 24.07.2024	409	401	0,01	Global Payments, Inc.			
Prologis International Funding S.A.				Aeroporti di Roma SpA	€ 3.800	3.631	0,11	5,300 % fällig am 15.08.2029	\$ 1.800	1.813	0,05
3,125 % fällig am 01.06.2031	€ 2.200	2.353	0,07	Air Canada				GN Store Nord A/S			
RLJ Lodging Trust LP				3,875 % fällig am 15.08.2026	\$ 1.300	1.243	0,04	0,875 % fällig am 25.11.2024	€ 3.400	3.600	0,10
3,750 % fällig am 01.07.2026	\$ 1.600	1.517	0,04	Air Canada Pass-Through Trust				Grifols S.A.			
Sagax AB				3,600 % fällig am 15.09.2028	996	938	0,03	3,875 % fällig am 15.10.2028	3.100	3.138	0,09
1,125 % fällig am 30.01.2027	€ 3.800	3.783	0,11	Alaska Airlines Pass-Through Trust				Haleon U.S. Capital LLC			
2,000 % fällig am 17.01.2024	190	210	0,01	4,800 % fällig am 15.02.2029	841	819	0,02	3,375 % fällig am 24.03.2029	\$ 1.850	1.751	0,05
2,250 % fällig am 13.03.2025	2.200	2.366	0,07	Allegiant Travel Co.				Haleon UK Capital PLC			
Sagax Euro MTN NL BV				7,250 % fällig am 15.08.2027	2.600	2.547	0,07	3,125 % fällig am 24.03.2025	3.000	2.931	0,09
0,750 % fällig am 26.01.2028 (l)	2.200	2.080	0,06	Altice France S.A.				HCA, Inc.			
1,000 % fällig am 17.05.2029	1.200	1.086	0,03	4,250 % fällig am 15.10.2029	€ 2.300	2.029	0,06	5,375 % fällig am 01.09.2026	900	905	0,03
Santander UK Group Holdings PLC				5,500 % fällig am 15.10.2029	\$ 2.500	1.963	0,06	Hilton Domestic Operating Co., Inc.			
3,823 % fällig am 03.11.2028	\$ 3.100	2.916	0,08	11,500 % fällig am 01.02.2027 (b)(k)	€ 2.010	2.237	0,06	3,750 % fällig am 01.05.2029	300	278	0,01
6,750 % fällig am 24.06.2024 (h)(j)	£ 400	510	0,01	AMC Networks, Inc.				4,000 % fällig am 01.05.2031	3.200	2.934	0,09
7,482 % fällig am 29.08.2029	5.400	7.492	0,22	4,750 % fällig am 01.08.2025	\$ 1.700	1.657	0,05	Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC			
SELP Finance SARL				American Airlines Pass-Through Trust				5,000 % fällig am 01.06.2029	4.000	3.695	0,11
3,750 % fällig am 10.08.2027	€ 3.300	3.652	0,11	3,000 % fällig am 15.04.2030	403	365	0,01	Holding d'Infrastructures des Metiers de l'Environnement			
Sirius Real Estate Ltd.				3,250 % fällig am 15.04.2030	135	118	0,00	0,125 % fällig am 16.09.2025	€ 1.600	1.663	0,05
1,125 % fällig am 22.06.2026	4.800	4.795	0,14	3,350 % fällig am 15.04.2031	773	699	0,02	0,625 % fällig am 16.09.2028	2.200	2.118	0,06
Societe Generale S.A.				3,375 % fällig am 01.11.2028	920	844	0,02	IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK)			
4,677 % fällig am 15.06.2027	\$ 3.700	3.668	0,11	3,575 % fällig am 15.07.2029	934	872	0,03	3,750 % fällig am 15.09.2026 (c)	3.200	3.495	0,10
Sofina S.A.				3,700 % fällig am 01.04.2028	158	148	0,00	Imperial Brands Finance Netherlands BV			
1,000 % fällig am 23.09.2028	€ 2.900	2.705	0,08	American Airlines, Inc.				1,750 % fällig am 18.03.2033	1.700	1.473	0,04
Spirit Realty LP				5,500 % fällig am 20.04.2026	1.083	1.076	0,03	Intelsat Jackson Holdings S.A.			
4,000 % fällig am 15.07.2029	\$ 400	380	0,01	5,750 % fällig am 20.04.2029	3.900	3.806	0,11	6,500 % fällig am 15.03.2030	\$ 1.406	1.343	0,04
Stichting AK Rabobank Certificaten 6,500 % (h)	€ 1.996	2.214	0,06	Becton Dickinson Euro Finance SARL				JetBlue Pass-Through Trust			
STORE Capital Corp.				1,336 % fällig am 13.08.2041	€ 3.100	2.368	0,07	2,750 % fällig am 15.11.2033	163	138	0,00
4,625 % fällig am 15.03.2029	\$ 200	185	0,01	Boeing Co.				Kraft Heinz Foods Co.			
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.				1,950 % fällig am 01.02.2024	\$ 700	698	0,02	5,000 % fällig am 15.07.2035	73	73	0,00
3,629 % fällig am 06.04.2026	€ 3.300	3.677	0,11	2,750 % fällig am 01.02.2026	5.100	4.883	0,14	Las Vegas Sands Corp.			
Synchrony Financial				British Airways Pass-Through Trust				3,900 % fällig am 08.08.2029	200	185	0,01
4,500 % fällig am 23.07.2025	\$ 800	782	0,02	2,900 % fällig am 15.09.2036	1.480	1.268	0,04	Melco Resorts Finance Ltd.			
5,150 % fällig am 19.03.2029	9.000	8.754	0,25	4,250 % fällig am 15.05.2034	650	607	0,02	5,375 % fällig am 04.12.2029	200	177	0,01
Toronto-Dominion Bank				Broadcom, Inc.				Mileage Plus Holdings LLC			
3,879 % fällig am 13.03.2026	€ 23.400	26.324	0,76	3,137 % fällig am 15.11.2035	4	3	0,00	6,500 % fällig am 20.06.2027	4.620	4.637	0,13
TP ICAP Finance PLC				4,926 % fällig am 15.05.2037	4	4	0,00	MPH Acquisition Holdings LLC			
2,625 % fällig am 18.11.2028	£ 1.200	1.281	0,04	Caesars Entertainment, Inc.				5,500 % fällig am 01.09.2028	3.300	2.959	0,09
5,250 % fällig am 29.05.2026	3.500	4.327	0,13	6,250 % fällig am 01.07.2025	400	401	0,01	Mundys SpA			
UBS Group AG				Carnival Holdings Bermuda Ltd.				1,875 % fällig am 12.02.2028	€ 10.100	10.277	0,30
3,091 % fällig am 14.05.2032	\$ 950	810	0,02	10,375 % fällig am 01.05.2028	2.500	2.723	0,08	Nidec Corp.			
3,869 % fällig am 12.01.2029	4.750	4.482	0,13	CCO Holdings LLC				0,046 % fällig am 30.03.2026	1.100	1.122	0,03
4,194 % fällig am 01.04.2031	2.100	1.957	0,06	5,000 % fällig am 01.02.2028	1.550	1.484	0,04	Nissan Motor Co. Ltd.			
4,375 % fällig am 10.02.2031 (h)(j)	1.300	1.030	0,03	Charter Communications Operating LLC				3,522 % fällig am 17.09.2025	\$ 7.500	7.224	0,21
6,442 % fällig am 11.08.2028	4.750	4.936	0,14	3,500 % fällig am 01.06.2041	2.000	1.415	0,04	4,345 % fällig am 17.09.2027	1.700	1.628	0,05
				3,900 % fällig am 01.06.2052	1.900	1.280	0,04	4,810 % fällig am 17.09.2030	500	468	0,01

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Dynamic Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	
Penske Truck Leasing Co. LP				3,250 % fällig am 01.06.2031	\$ 2.400	\$ 2.081	0,06	1,157 % fällig am 15.04.2042 (a)	\$ 138	\$ 15	0,00	
3,950 % fällig am 10.03.2025	\$ 2.000	\$ 1.965	0,06	3,300 % fällig am 01.12.2027	3.000	2.803	0,08	1,500 % fällig am 25.12.2035 (a)	7.912	349	0,01	
Petroleos Mexicanos				3,500 % fällig am 15.06.2025	200	194	0,01	2,000 % fällig am 25.12.2050 (a)	19.39	3	1,745	0,05
6,700 % fällig am 16.02.2032	4.981	4.139	0,12	3,500 % fällig am 01.08.2050	300	208	0,01	4,000 % fällig am 15.01.2033 - 25.07.2050 (a)	16.49	8	3,259	0,10
10,000 % fällig am 07.02.2033	900	905	0,03	4,300 % fällig am 15.03.2045	500	393	0,01	4,000 % fällig am 01.07.2047	103	100	0,00	
Prosus NV				4,550 % fällig am 01.07.2030	4.100	3.908	0,11	4,575 % fällig am 01.09.2027	0	0	0,00	
3,680 % fällig am 21.01.2030	600	526	0,02	4,950 % fällig am 08.06.2025	1.500	1.491	0,04	5,500 % fällig am 01.04.2027 - 01.01.2040	412	424	0,01	
Sabine Pass Liquefaction LLC				5,450 % fällig am 15.06.2027	200	202	0,01	5,732 % fällig am 25.09.2031	76	76	0,00	
4,200 % fällig am 15.03.2028	4.000	3.920	0,11	6,150 % fällig am 15.01.2033	3.800	3.943	0,12	6,412 % fällig am 25.07.2044	310	288	0,01	
5,000 % fällig am 15.03.2027	800	804	0,02	Southern California Gas Co.				Ginnie Mae				
Sandoz Finance BV				2,950 % fällig am 15.04.2027	1.900	1.803	0,05	2,750 % fällig am 20.11.2029	2	2	0,00	
4,220 % fällig am 17.04.2030	€ 3.200	3.674	0,11	Sprint LLC				3,500 % fällig am 15.07.2045 (I)	10.481	9.767	0,28	
Sands China Ltd.				7,125 % fällig am 15.06.2024	800	804	0,02	3,625 % fällig am 20.09.2031	99	97	0,00	
3,100 % fällig am 08.03.2029	\$ 900	785	0,02	Telecom Italia SpA				4,000 % fällig am 20.10.2042 (a)	3.445	578	0,02	
3,500 % fällig am 08.08.2031	1.100	923	0,03	7,875 % fällig am 31.07.2028	€ 5.900	7.258	0,21	4,000 % fällig am 15.02.2052 (I)	3.988	3.856	0,11	
5,650 % fällig am 08.08.2028	7.800	7.740	0,22			36.176	1,05	4,000 % fällig am 15.03.2052	232	223	0,01	
Sartorius Finance BV				Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		743.778	21,59	4,500 % fällig am 20.10.2045 (a)	2.264	449	0,01	
4,375 % fällig am 14.09.2029	€ 700	802	0,02	WANDELANLEIHEN & WECHSEL				Ginnie Mae, TBA				
4,875 % fällig am 14.09.2035	600	701	0,02	Southwest Airlines Co.				4,000 % fällig am 01.01.2054	3.000	2.869	0,08	
Scripps Escrow, Inc.				1,250 % fällig am 01.05.2025	\$ 7.500	7.607	0,22	Uniform Mortgage-Backed Security				
5,375 % fällig am 15.01.2031	\$ 1.600	1.176	0,03	KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL				3,500 % fällig am 01.04.2037 - 01.12.2047	1.621	1.512	0,05	
Southern Co.				California State General Obligation Bonds, (BABs), (AGM/CR Insured), Series 2010				3,500 % fällig am 01.07.2048 (I)	10.12	8	9,372	0,27
3,700 % fällig am 30.04.2030	400	377	0,01	6,875 % fällig am 01.11.2026	2.345	2.492	0,07	4,000 % fällig am 01.05.2047 - 01.03.2049	1.525	1.469	0,04	
Studio City Finance Ltd.				Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Bonds, Series 2022				4,000 % fällig am 01.04.2048 (I)	7.178	6.924	0,20	
5,000 % fällig am 15.01.2029	600	505	0,01	0,000 % fällig am 01.11.2043	37	20	0,00	4,500 % fällig am 01.04.2028	4	4	0,00	
Syngenta Finance NV				Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Notes, Series 2021				5,500 % fällig am 01.07.2026 - 01.08.2040	432	439	0,01	
3,375 % fällig am 16.04.2026	€ 1.000	1.099	0,03	1,711 % fällig am 01.06.2024	1.900	1.871	0,05	6,000 % fällig am 01.10.2025 - 01.05.2041	231	238	0,01	
T-Mobile USA, Inc.				Illinois State General Obligation Bonds, (BABs), Series 2010				Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				
2,250 % fällig am 15.11.2031	\$ 2.300	1.916	0,06	7,350 % fällig am 01.07.2035	643	699	0,02	2,500 % fällig am 01.01.2054	30.200	25.696	0,75	
3,300 % fällig am 15.02.2051	2.700	1.953	0,06	Tobacco Settlement Finance Authority, West Virginia Revenue Bonds, Series 2007				3,000 % fällig am 01.02.2054	50.300	44.579	1,29	
3,875 % fällig am 15.04.2030	4.200	3.984	0,12	0,000 % fällig am 01.06.2047 (e)	23.300	2.065	0,06	3,500 % fällig am 01.02.2054	119.800	110.029	3,19	
TD SYNEX Corp.				Tobacco Settlement Finance Authority, West Virginia Revenue Bonds, Series 2020				4,000 % fällig am 01.01.2054	160.200	151.626	4,40	
2,375 % fällig am 09.08.2028	5.800	5.011	0,15	3,151 % fällig am 01.06.2032	1.500	1.251	0,04	4,500 % fällig am 01.02.2054	120.300	116.696	3,39	
TDF Infrastructure SASU				3,301 % fällig am 01.06.2033	800	660	0,02	5,000 % fällig am 01.01.2054	1.092.500	1.081.253	31,38	
1,750 % fällig am 01.12.2029	€ 6.400	6.186	0,18			9.058	0,26	5,500 % fällig am 01.02.2054	63.800	64.089	1,86	
Tesco Corporate Treasury Services PLC				US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				6,000 % fällig am 01.02.2054	77.500	78.696	2,29	
0,875 % fällig am 29.05.2026	2.200	2.304	0,07	Fannie Mae				6,500 % fällig am 01.02.2054	68.400	70.091	2,04	
Thales S.A.				0,000 % fällig am 25.09.2060 (a)	12.214	1.310	0,04					
4,125 % fällig am 18.10.2028	1.500	1.732	0,05	0,448 % fällig am 25.12.2056 (a)	3.349	511	0,02	U.S. Treasury Inflation Protected Securities (g)				
United Airlines Pass-Through Trust				0,540 % fällig am 25.07.2042 (a)	18.899	259	0,01	0,625 % fällig am 15.07.2032	77.727	71.056	2,06	
5,875 % fällig am 15.04.2029	\$ 2.782	2.820	0,08	0,598 % fällig am 25.07.2059 (a)	8.501	1.114	0,03	1,125 % fällig am 15.01.2033	71.064	67.276	1,95	
United Airlines, Inc.				0,608 % fällig am 25.11.2046 (a)	5.098	95	0,00	1,375 % fällig am 15.07.2033	66.659	64.679	1,88	
4,625 % fällig am 15.04.2029	200	187	0,01	0,618 % fällig am 25.06.2042 (a)	14.816	160	0,01	U.S. Treasury Notes				
Venture Global Calcasieu Pass LLC				0,648 % fällig am 25.07.2050 (a)	4.049	465	0,01	0,250 % fällig am 31.08.2025	12.200	11.391	0,33	
3,875 % fällig am 01.11.2033	6.400	5.431	0,16	0,698 % fällig am 25.07.2043 (a)	1.046	131	0,00	1,250 % fällig am 31.08.2024 (I)	84.500	82.433	2,39	
6,250 % fällig am 15.01.2030	4.800	4.780	0,14	0,748 % fällig am 25.05.2048 (a)	1.702	213	0,01					
Virgin Media Secured Finance PLC				1,048 % fällig am 25.03.2042 (a)	6.678	765	0,02					
4,250 % fällig am 15.01.2030	£ 4.000	4.472	0,13	1,148 % fällig am 25.11.2035 (a)	60	1	0,00	NON-AGENCY-MBS				
Vmed O2 UK Financing PLC				1,178 % fällig am 25.10.2039 (a)	679	7	0,00	Adjustable Rate Mortgage Trust				
4,500 % fällig am 15.07.2031	2.800	3.096	0,09	2,000 % fällig am 25.11.2050 (a)	6.896	701	0,02	4,515 % fällig am 25.11.2035	246	172	0,01	
Wabtec Transportation Netherlands BV				2,215 % fällig am 25.06.2043 (a)	4.731	294	0,01	4,543 % fällig am 25.10.2035	94	88	0,00	
1,250 % fällig am 03.12.2027	€ 4.600	4.691	0,14	3,795 % fällig am 01.12.2034	2	2	0,00	4,611 % fällig am 25.02.2036	1.270	818	0,02	
WMG Acquisition Corp.				4,000 % fällig am 25.06.2050 (a)	5.438	1.039	0,03	5,407 % fällig am 25.03.2037	5	4	0,00	
2,250 % fällig am 15.08.2031	2.300	2.236	0,06	4,564 % fällig am 01.02.2035	3	3	0,00	5,556 % fällig am 25.01.2036	30	27	0,00	
Wynn Macau Ltd.				4,576 % fällig am 25.03.2036	234	263	0,01	5,813 % fällig am 25.08.2035	23	22	0,00	
5,500 % fällig am 15.01.2026	\$ 400	391	0,01	5,563 % fällig am 25.03.2034	23	23	0,00	5,990 % fällig am 25.01.2036	866	805	0,02	
5,500 % fällig am 01.10.2027	200	189	0,01	5,582 % fällig am 25.11.2031	2	2	0,00	Alba PLC				
		227.719	6,61	5,592 % fällig am 25.02.2032	23	23	0,00	5,509 % fällig am 17.03.2039	£ 889	1.100	0,03	
VERSORGUNGSUNTERNEHMEN				5,622 % fällig am 25.11.2032	6	6	0,00	American Home Mortgage Assets Trust				
AES Corp.				5,802 % fällig am 25.03.2037	17	17	0,00	5,890 % fällig am 25.06.2037	\$ 2.980	2.792	0,08	
2,450 % fällig am 15.01.2031	2.200	1.850	0,05	5,852 % fällig am 25.09.2032	2	2	0,00	5,932 % fällig am 25.11.2046	59	17	0,00	
CK Hutchison Group Telecom Finance S.A.				5,903 % fällig am 18.10.2030	3	3	0,00	6,750 % fällig am 25.11.2046	681	588	0,02	
1,500 % fällig am 17.10.2031	€ 2.500	2.330	0,07	6,129 % fällig am 01.11.2042	10	10	0,00	American Home Mortgage Investment Trust				
2,625 % fällig am 17.10.2034	£ 2.500	2.345	0,07	Freddie Mac				7,549 % fällig am 25.11.2045	216	88	0,00	
Entergy Corp.				0,000 % fällig am 15.08.2042	1.021	733	0,02	Atlas Funding PLC				
2,400 % fällig am 15.06.2031	\$ 300	251	0,01	0,477 % fällig am 15.12.2037 (a)	285	23	0,00	6,348 % fällig am 20.01.2061	£ 1.210	1.550	0,05	
Georgia Power Co.				0,648 % fällig am 25.06.2050 (a)	8.799	1.062	0,03	Banc of America Alternative Loan Trust				
4,700 % fällig am 15.05.2032	1.200	1.196	0,04	0,697 % fällig am 15.07.2047 (a)	127	16	0,00	1,170 % fällig am 25.06.2037 (a)	\$ 614	58	0,00	
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.				0,698 % fällig am 25.06.2050 (a)	11.67	1	1,503	0,04	5,830 % fällig am 25.06.2037	565	422	0,01
4,625 % fällig am 15.07.2027	350	350	0,01					6,000 % fällig am 25.06.2046	234	203	0,01	
ONEOK, Inc.								6,000 % fällig am 25.07.2046	485	411	0,01	
4,350 % fällig am 15.03.2029	100	97	0,00									
Pacific Gas & Electric Co.												
3,000 % fällig am 15.06.2028	2.400	2.189	0,06									
3,150 % fällig am 01.01.2026	500	480	0,01									

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS		
Banc of America Funding Trust				Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed				5,800 % fällig am 25.02.2035	\$	34	\$	28	0,00
3,395 % fällig am 20.10.2046	\$	69	\$	58	0,00			5,930 % fällig am 25.05.2035	35	28	0,00		
4,306 % fällig am 20.06.2037	53	44	0,00	Certificates				6,000 % fällig am 25.09.2037	83	41	0,00		
4,379 % fällig am 20.05.2036	147	126	0,00	5,650 % fällig am 25.05.2036	\$	25	\$	22	0,00				
4,410 % fällig am 20.12.2034	11	8	0,00	Citicorp Mortgage Securities Trust				6,050 % fällig am 25.04.2035	24	22	0,00		
4,732 % fällig am 20.04.2035	768	685	0,02	6,000 % fällig am 25.09.2037	25	24	0,00	6,050 % fällig am 25.04.2035	14	12	0,00		
4,982 % fällig am 20.06.2036	11	9	0,00	Citigroup Global Markets Mortgage Securities, Inc.				6,110 % fällig am 25.03.2035	256	221	0,01		
5,061 % fällig am 20.01.2047	360	308	0,01	5,970 % fällig am 25.05.2032	26	25	0,00	6,130 % fällig am 25.02.2035	3	2	0,00		
5,404 % fällig am 20.11.2034	356	323	0,01	Citigroup Mortgage Loan Trust				6,210 % fällig am 25.02.2035	755	643	0,02		
5,490 % fällig am 20.02.2036	82	76	0,00	3,772 % fällig am 25.10.2046	290	258	0,01	6,500 % fällig am 25.12.2037	1.430	615	0,02		
5,530 % fällig am 25.01.2037	97	84	0,00	4,318 % fällig am 25.03.2034	65	58	0,00	7,884 % fällig am 20.02.2036	23	19	0,00		
5,792 % fällig am 20.02.2047	585	600	0,02	4,504 % fällig am 25.07.2037	8	7	0,00	Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust					
5,852 % fällig am 20.07.2036	3.051	2.982	0,09	5,322 % fällig am 25.08.2035	38	36	0,00	6,500 % fällig am 25.11.2034	13	12	0,00		
5,852 % fällig am 20.12.2046	193	158	0,01	5,720 % fällig am 25.09.2037	77	68	0,00	6,500 % fällig am 25.03.2035	368	360	0,01		
6,270 % fällig am 25.05.2037	568	474	0,01	6,980 % fällig am 25.05.2035	42	41	0,00	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.					
Banc of America Mortgage Trust				7,860 % fällig am 25.11.2035	66	65	0,00	6,000 % fällig am 25.01.2036	480	297	0,01		
3,815 % fällig am 25.02.2035	57	54	0,00	Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				6,050 % fällig am 25.01.2032	25	23	0,00		
4,397 % fällig am 25.05.2035	216	191	0,01	4,429 % fällig am 25.02.2034	7	7	0,00	6,500 % fällig am 25.04.2033	3	3	0,00		
4,578 % fällig am 25.06.2035	44	39	0,00	6,277 % fällig am 25.09.2035	1	1	0,00	Credit Suisse First Boston Mortgage-Backed Pass-through Certificates					
5,033 % fällig am 25.01.2035	24	23	0,00	CitiMortgage Alternative Loan Trust				6,401 % fällig am 25.10.2033	6	6	0,00		
5,750 % fällig am 20.07.2032	0	0	0,00	6,000 % fällig am 25.09.2036	1.444	1.191	0,04	Credit Suisse Mortgage Capital Certificates					
BCAP LLC Trust				6,000 % fällig am 25.01.2037	1.064	868	0,03	3,193 % fällig am 30.11.2037	3.549	3.219	0,09		
3,790 % fällig am 26.11.2036	1.300	1.316	0,04	6,000 % fällig am 25.06.2037	1.545	1.284	0,04	Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust					
4,533 % fällig am 26.03.2037	1.145	1.625	0,05	6,000 % fällig am 25.10.2037	663	588	0,02	6,000 % fällig am 25.02.2037	3.699	1.679	0,05		
5,250 % fällig am 26.02.2036	560	241	0,01	Countrywide Alternative Loan Resecuritization Trust				6,250 % fällig am 25.08.2036	42	17	0,00		
5,250 % fällig am 26.06.2036	12.620	5.321	0,15	6,000 % fällig am 25.05.2036	95	54	0,00	7,000 % fällig am 25.08.2037	371	192	0,01		
5,250 % fällig am 26.04.2037	606	347	0,01	Countrywide Alternative Loan Trust				Credit Suisse Mortgage Capital Trust					
5,250 % fällig am 26.06.2037	126	113	0,00	(a)	1.074	72	0,00	4,146 % fällig am 25.06.2050	1.756	1.499	0,04		
5,810 % fällig am 25.01.2037	1.821	1.692	0,05	5,000 % fällig am 25.03.2035	5	4	0,00	Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust					
5,830 % fällig am 25.03.2037	701	603	0,02	5,500 % fällig am 25.04.2035	118	82	0,00	5,610 % fällig am 25.07.2047	366	336	0,01		
6,770 % fällig am 25.09.2047	861	744	0,02	5,500 % fällig am 25.09.2035	230	139	0,00	5,770 % fällig am 25.03.2037	227	203	0,01		
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust				5,500 % fällig am 25.11.2035	169	100	0,00	5,770 % fällig am 25.09.2047	663	564	0,02		
3,250 % fällig am 25.02.2033	1	0	0,00	5,500 % fällig am 25.12.2035	4.250	2.472	0,07	5,800 % fällig am 25.08.2037	1.353	1.071	0,03		
3,877 % fällig am 25.05.2047	558	500	0,01	5,500 % fällig am 25.01.2036	20	12	0,00	Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust					
3,974 % fällig am 25.09.2034	249	229	0,01	5,500 % fällig am 25.05.2036	398	310	0,01	5,660 % fällig am 19.10.2036	595	491	0,01		
4,746 % fällig am 25.07.2034	42	39	0,00	5,652 % fällig am 20.02.2047	304	235	0,01	6,046 % fällig am 19.07.2044	174	159	0,00		
4,828 % fällig am 25.04.2033	5	5	0,00	5,662 % fällig am 20.03.2047	4.848	3.971	0,12	Dutch Property Finance BV					
4,892 % fällig am 25.01.2035	248	236	0,01	5,667 % fällig am 20.12.2046	10.496	9.031	0,26	4,602 % fällig am 28.07.2054	€	1.184	1.307	0,04	
5,030 % fällig am 25.08.2035	45	41	0,00	5,670 % fällig am 25.04.2047	184	173	0,01	EMF-NL Prime BV					
5,224 % fällig am 25.11.2034	35	32	0,00	5,750 % fällig am 25.02.2035	134	93	0,00	4,785 % fällig am 17.04.2041	1.011	1.073	0,03		
5,308 % fällig am 25.04.2033	3	3	0,00	5,750 % fällig am 25.07.2035	660	416	0,01	European Loan Conduit DAC					
5,710 % fällig am 25.11.2034	37	31	0,00	5,750 % fällig am 25.05.2036	433	173	0,01	4,994 % fällig am 17.02.2030	4.109	4.480	0,13		
5,820 % fällig am 25.01.2034	33	33	0,00	5,750 % fällig am 25.03.2037	378	208	0,01	Eurosail BV					
6,055 % fällig am 25.08.2033	93	89	0,00	5,750 % fällig am 25.06.2037	640	568	0,02	5,485 % fällig am 17.10.2040	59	65	0,00		
6,136 % fällig am 25.01.2035	34	31	0,00	5,750 % fällig am 25.04.2047	1.175	1.034	0,03	Eurosail PLC					
6,239 % fällig am 25.01.2035	18	17	0,00	5,752 % fällig am 20.09.2046	566	414	0,01	4,208 % fällig am 13.03.2045	3.632	3.785	0,11		
Bear Stearns ALT-A Trust				5,790 % fällig am 25.09.2047	541	489	0,01	5,589 % fällig am 13.03.2045	£	7.250	8.717	0,25	
3,250 % fällig am 25.02.2034	8	7	0,00	5,810 % fällig am 25.05.2047	548	467	0,01	5,819 % fällig am 10.06.2044	4.816	6.000	0,17		
3,905 % fällig am 25.04.2035	44	38	0,00	5,830 % fällig am 25.05.2047	754	642	0,02	6,289 % fällig am 13.06.2045	10.049	12.435	0,36		
3,971 % fällig am 25.05.2036	486	238	0,01	5,840 % fällig am 25.02.2037	1.936	682	0,02	First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust					
4,189 % fällig am 25.09.2035	3.846	1.648	0,05	5,850 % fällig am 25.07.2046	290	286	0,01	5,029 % fällig am 25.01.2036	\$	313	165	0,01	
4,196 % fällig am 25.11.2036	1.120	502	0,02	5,850 % fällig am 25.09.2046	16	15	0,00	5,754 % fällig am 25.09.2034	31	29	0,00		
4,228 % fällig am 25.11.2036	3.112	1.722	0,05	5,892 % fällig am 20.03.2046	48	39	0,00	First Horizon Mortgage Pass-Through Trust					
4,240 % fällig am 25.03.2036	222	177	0,01	5,892 % fällig am 20.05.2046	289	244	0,01	5,464 % fällig am 25.08.2035	24	17	0,00		
4,488 % fällig am 25.05.2035	284	267	0,01	5,950 % fällig am 25.01.2037	2.053	1.675	0,05	Friary PLC					
4,816 % fällig am 25.09.2034	83	76	0,00	6,000 % fällig am 25.10.2035	1.264	902	0,03	5,940 % fällig am 21.11.2067	£	513	655	0,02	
5,679 % fällig am 25.01.2034	40	35	0,00	6,000 % fällig am 25.04.2036	782	385	0,01	GMAC Mortgage Corp. Loan Trust					
5,790 % fällig am 25.02.2034	127	118	0,00	6,000 % fällig am 25.07.2036	535	195	0,01	3,357 % fällig am 19.04.2036	\$	45	35	0,00	
5,810 % fällig am 25.08.2036	176	162	0,01	6,000 % fällig am 25.08.2036	119	71	0,00	Great Hall Mortgages PLC					
5,870 % fällig am 25.02.2034	630	570	0,02	6,000 % fällig am 25.12.2036	1.240	523	0,02	5,812 % fällig am 18.06.2039	11	11	0,00		
5,910 % fällig am 25.04.2036	399	352	0,01	6,000 % fällig am 25.02.2037	226	99	0,00	GreenPoint Mortgage Funding Trust					
5,950 % fällig am 25.02.2036	283	250	0,01	6,000 % fällig am 25.03.2037	287	110	0,00	6,010 % fällig am 25.11.2045	137	120	0,00		
Bear Stearns Mortgage Funding Trust				6,000 % fällig am 25.04.2037	554	268	0,01	6,090 % fällig am 25.10.2045	12	11	0,00		
5,650 % fällig am 25.06.2037	574	529	0,02	6,000 % fällig am 25.05.2037	92	45	0,00	GSR Mortgage Loan Trust					
Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust				6,000 % fällig am 25.08.2037	643	334	0,01	1,180 % fällig am 25.01.2037	(a)	3.066	296	0,01	
3,993 % fällig am 26.12.2046	420	317	0,01	6,012 % fällig am 25.12.2035	2.077	1.723	0,05	4,511 % fällig am 25.11.2035	52	46	0,00		
Canada Square Funding PLC				6,030 % fällig am 25.02.2037	718	579	0,02	4,836 % fällig am 25.09.2035	127	120	0,00		
6,070 % fällig am 17.01.2059	£	2.064	£	6,050 % fällig am 25.02.2036	1.651	1.459	0,04	4,976 % fällig am 25.11.2035	90	50	0,00		
Charter Mortgage Funding PLC				6,112 % fällig am 20.11.2035	20	17	0,00	5,750 % fällig am 25.03.2036	9	8	0,00		
5,796 % fällig am 16.01.2057	1.185	1.511	0,04	6,370 % fällig am 25.12.2036	639	230	0,01	5,750 % fällig am 25.01.2037	18	11	0,00		
Chase Mortgage Finance Trust				6,500 % fällig am 25.08.2032	39	38	0,00	6,000 % fällig am 25.03.2032	0	0	0,00		
3,847 % fällig am 25.03.2037	\$	316	\$	6,500 % fällig am 25.09.2037	554	215	0,01	6,000 % fällig am 25.11.2035	828	325	0,01		
4,114 % fällig am 25.03.2037	26	24	0,00	Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				6,000 % fällig am 25.03.2037	47	26	0,00		
5,342 % fällig am 25.02.2037	13	13	0,00	3,673 % fällig am 20.05.2036	629	587	0,02	6,000 % fällig am 25.05.2037	118	85	0,00		
ChaseFlex Trust				3,695 % fällig am 25.04.2035	28	20	0,00	6,500 % fällig am 25.09.2036	79	38	0,00		
6,070 % fällig am 25.07.2037	11	9	0,00	4,039 % fällig am 20.05.2036	340	313	0,01	HarborView Mortgage Loan Trust					
ChaseFlex Trust Multi-Class Mortgage Pass-Through Certificates Trust				4,110 % fällig am 20.02.2036	455	400	0,01	3,685 % fällig am 19.10.2033	27	23	0,00		
4,204 % fällig am 25.08.2037	540	423	0,01	4,241 % fällig am 20.07.2034	73	67	0,00	4,935 % fällig am 19.06.2045					

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS			
Accunia European CLO DAC				BNPP AM Euro CLO DAC				Delta Funding Home Equity Loan Trust						
4,895 % fällig am 15.10.2030	€ 1.539	\$ 1.699	0,05	4,615 % fällig am 15.10.2031	€ 1.477	\$ 1.611	0,05	6,296 % fällig am 15.09.2029	\$ 4	\$ 4	0,00			
4,915 % fällig am 15.07.2030	2.556	2.821	0,08	4,822 % fällig am 22.07.2032	5.800	6.324	0,18	Dryden Euro CLO DAC						
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust				Bosphorus CLO DAC				4,625 % fällig am 15.04.2033 € 8.854 9.638 0,28						
5,710 % fällig am 25.08.2036	\$ 1.521	371	0,01	4,745 % fällig am 15.12.2030	813	890	0,03	4,862 % fällig am 15.05.2034	5.790	6.299	0,18			
6,295 % fällig am 25.12.2045	951	721	0,02	4,960 % fällig am 12.12.2032	3.400	3.711	0,11	4,965 % fällig am 17.01.2033	5.000	5.441	0,16			
Ameriqwest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				Cairn CLO BV				EMC Mortgage Loan Trust						
5,940 % fällig am 25.11.2035	2.714	2.639	0,08	4,745 % fällig am 15.10.2031	5.296	5.755	0,17	6,210 % fällig am 25.05.2040	\$ 92	91	0,00			
6,340 % fällig am 25.01.2036	600	567	0,02	Cairn CLO DAC				Euro-Galaxy CLO DAC						
6,490 % fällig am 25.09.2034	1.085	1.068	0,03	4,552 % fällig am 30.04.2031	2.082	2.273	0,07	4,589 % fällig am 24.04.2034	€ 3.796	4.120	0,12			
AMMC CLO Ltd.				4,618 % fällig am 31.01.2030				3.632	3.976	0,12	Fieldstone Mortgage Investment Trust			
6,894 % fällig am 02.11.2030	1.677	1.679	0,05	Carlyle Euro CLO DAC				5,777 % fällig am 25.11.2036	\$ 1.129	654	0,02			
Amortizing Residential Collateral Trust				4,632 % fällig am 15.08.2030				1.282	1.403	0,04	6,137 % fällig am 25.04.2047	3.741	2.622	0,08
6,170 % fällig am 25.10.2031	20	19	0,00	4,665 % fällig am 15.01.2031	6.445	7.051	0,20	First Franklin Mortgage Loan Trust						
Amresco Residential Securities Corp. Mortgage Loan Trust				Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC				5,750 % fällig am 25.12.2036 1.104 451 0,01						
6,410 % fällig am 25.06.2029	6	5	0,00	4,925 % fällig am 16.01.2033	5.600	6.091	0,18	6,070 % fällig am 25.07.2035	1.762	1.735	0,05			
Aqueduct European CLO DAC				Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.				6,190 % fällig am 25.11.2035 1.260 1.164 0,03						
4,633 % fällig am 20.07.2030	€ 1.905	2.089	0,06	4,752 % fällig am 15.11.2031	11.079	12.070	0,35	First NLC Trust						
Ares European CLO DAC				Carrington Mortgage Loan Trust				5,650 % fällig am 25.08.2037 6.819 3.390 0,10						
4,843 % fällig am 20.04.2032	2.900	3.153	0,09	5,630 % fällig am 25.10.2036	\$ 2.427	2.356	0,07	Fremont Home Loan Trust						
5,122 % fällig am 21.10.2033	8.500	9.294	0,27	5,720 % fällig am 25.10.2036	900	698	0,02	5,600 % fällig am 25.11.2036	1.844	639	0,02			
Argent Securities Trust				5,950 % fällig am 25.06.2036				966	917	0,03	5,605 % fällig am 25.10.2036	3.295	2.893	0,08
5,620 % fällig am 25.09.2036	\$ 2.005	644	0,02	6,370 % fällig am 25.05.2034	388	384	0,01	5,670 % fällig am 25.08.2036	606	195	0,01			
5,690 % fällig am 25.05.2036	534	130	0,00	Centex Home Equity Loan Trust				5,750 % fällig am 25.02.2037 7.004 5.363 0,16						
5,770 % fällig am 25.06.2036	1.662	441	0,01	6,400 % fällig am 25.09.2034	291	282	0,01	5,810 % fällig am 25.02.2037	1.640	551	0,02			
5,770 % fällig am 25.07.2036	5.570	4.854	0,14	CIT Mortgage Loan Trust				5,970 % fällig am 25.05.2036 1.283 749 0,02						
5,790 % fällig am 25.05.2036	3.577	873	0,03	6,970 % fällig am 25.10.2037	10.423	10.315	0,30	6,085 % fällig am 25.11.2035	5.788	5.075	0,15			
Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				Citigroup Mortgage Loan Trust				6,340 % fällig am 25.05.2034 1.457 1.373 0,04						
5,950 % fällig am 25.05.2035	1.907	1.608	0,05	5,640 % fällig am 25.07.2045	1.302	898	0,03	GE-WMC Mortgage Securities Trust						
Armada Euro CLO DAC				5,670 % fällig am 25.05.2037				3.912	2.564	0,07	5,770 % fällig am 25.08.2036 10.090 4.196 0,12			
4,685 % fällig am 15.07.2031	€ 1.542	1.685	0,05	5,790 % fällig am 25.12.2036	242	158	0,00	GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC						
Asset-Backed Funding Certificates Trust				5,970 % fällig am 25.08.2036				2.531	2.469	0,07	4,893 % fällig am 20.01.2032 € 2.900 3.171 0,09			
5,580 % fällig am 25.01.2037	\$ 982	563	0,02	5,990 % fällig am 25.09.2036	659	566	0,02	5,013 % fällig am 20.07.2034 3.000 3.256 0,09						
5,630 % fällig am 25.01.2037	401	230	0,01	7,250 % fällig am 25.05.2036	519	270	0,01	Greystone Commercial Real Estate Notes Ltd.						
6,170 % fällig am 25.06.2034	685	671	0,02	Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates				6,656 % fällig am 15.09.2037 \$ 1.561 1.559 0,05						
6,520 % fällig am 25.03.2034	345	330	0,01	6,415 % fällig am 25.10.2034	284	273	0,01	GSAA Home Equity Trust						
Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust				Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				5,590 % fällig am 25.05.2036 641 152 0,00						
6,565 % fällig am 25.02.2035	730	749	0,02	5,730 % fällig am 25.03.2037	403	348	0,01	5,610 % fällig am 25.03.2036	2.524	864	0,03			
Aurium CLO DAC				Clarinda Park CLO DAC				5,985 % fällig am 25.06.2036 6.244 1.658 0,05						
4,695 % fällig am 16.01.2031	€ 10.376	11.338	0,33	4,902 % fällig am 15.02.2034	€ 7.550	8.192	0,24	6,070 % fällig am 25.05.2047	107	65	0,00			
4,966 % fällig am 23.03.2032	10.000	10.962	0,32	Contego CLO DAC				6,370 % fällig am 25.08.2037 76 72 0,00						
Avoca CLO DAC				4,642 % fällig am 23.01.2030				4.186	4.558	0,13	6,502 % fällig am 25.11.2036	42	16	0,00
4,655 % fällig am 15.07.2030	2.886	3.172	0,09	Countrywide Asset-Backed Certificates				GSAMP Trust						
4,798 % fällig am 12.01.2031	2.073	2.271	0,07	6,150 % fällig am 25.12.2036	\$ 87	67	0,00	5,540 % fällig am 25.12.2036	326	154	0,00			
4,855 % fällig am 15.04.2033	3.500	3.801	0,11	Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				5,670 % fällig am 25.11.2036 2.804 1.332 0,04						
Avoca Static CLO DAC				4,434 % fällig am 25.10.2032				711	706	0,02	5,790 % fällig am 25.04.2036	34	21	0,00
5,690 % fällig am 15.10.2030	500	552	0,02	4,512 % fällig am 25.07.2036	2.589	2.333	0,07	5,990 % fällig am 25.06.2036	2.226	2.130	0,06			
Barings CLO Ltd.				5,610 % fällig am 25.06.2035				410	359	0,01	6,010 % fällig am 25.04.2036	533	337	0,01
6,605 % fällig am 15.04.2031	\$ 4.777	4.773	0,14	5,610 % fällig am 25.07.2037	1.170	1.064	0,03	Harvest CLO DAC						
6,667 % fällig am 20.01.2031	4.998	4.995	0,14	5,610 % fällig am 25.08.2037	152	137	0,00	4,566 % fällig am 26.06.2030 € 8.601 9.398 0,27						
Barings Euro CLO DAC				5,650 % fällig am 25.11.2047				33	37	0,00	Home Equity Asset Trust			
4,836 % fällig am 25.11.2029	€ 1.008	1.112	0,03	5,670 % fällig am 25.09.2037	618	548	0,02	6,565 % fällig am 25.05.2035 \$ 127 125 0,00						
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				5,670 % fällig am 25.06.2047				4.868	4.355	0,13	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust			
4,724 % fällig am 25.07.2036	\$ 18	18	0,00	5,680 % fällig am 25.05.2047	1.827	1.615	0,05	5,630 % fällig am 25.07.2037 771 416 0,01						
5,031 % fällig am 25.11.2035	731	710	0,02	5,690 % fällig am 25.09.2037	230	234	0,01	5,690 % fällig am 25.04.2037	855	648	0,02			
5,236 % fällig am 25.06.2043	42	38	0,00	5,859 % fällig am 25.10.2046	7	8	0,00	5,710 % fällig am 25.04.2037	864	559	0,02			
5,500 % fällig am 25.08.2036	13	13	0,00	5,910 % fällig am 25.09.2047	1.615	1.556	0,05	HSI Asset Securitization Corp. Trust						
5,639 % fällig am 25.08.2034	42	40	0,00	5,930 % fällig am 25.05.2037	219	208	0,01	5,660 % fällig am 25.01.2037 842 586 0,02						
5,700 % fällig am 25.02.2037	3.784	3.538	0,10	6,095 % fällig am 25.08.2035	95	91	0,00	5,690 % fällig am 25.12.2036	4.196	1.118	0,03			
5,770 % fällig am 25.11.2036	1.060	1.029	0,03	6,565 % fällig am 25.04.2036	300	284	0,01	5,910 % fällig am 25.12.2036	3.810	1.009	0,03			
6,100 % fällig am 25.02.2036	1.180	1.177	0,03	7,195 % fällig am 25.05.2035	646	636	0,02	5,995 % fällig am 25.02.2036	7.100	5.869	0,17			
6,325 % fällig am 25.07.2034	1.411	1.365	0,04	7,420 % fällig am 25.08.2035	1.485	1.329	0,04	6,250 % fällig am 25.01.2036	3.968	3.276	0,09			
6,520 % fällig am 25.08.2037	89	78	0,00	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.				IXIS Real Estate Capital Trust						
Belle Haven ABS CDO Ltd.				5,077 % fällig am 25.01.2032				2	2	0,00	5,930 % fällig am 25.01.2037 272 97 0,00			
5,156 % fällig am 03.11.2044	11.399	3.486	0,10	Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC				JPMorgan Mortgage Acquisition Trust						
Black Diamond CLO DAC				3,072 % fällig am 25.12.2036				554	456	0,01	4,470 % fällig am 25.01.2037 815 431 0,01			
4,853 % fällig am 20.01.2032	€ 786	863	0,02	Credit-Based Asset Servicing & Securitization Mortgage Loan Trust				5,730 % fällig am 25.06.2037 26 26 0,00						
4,982 % fällig am 15.05.2032	5.374	5.861	0,17	3,319 % fällig am 25.03.2037	9.313	3.474	0,10	5,770 % fällig am 25.07.2036	633	269	0,01			
Blackrock European CLO DAC				3,201 % fällig am 25.01.2037				143	45	0,00	5,875 % fällig am 25.07.2036	2.333	2.268	0,07
4,585 % fällig am 15.10.2031	3.044	3.310	0,10	3,311 % fällig am 25.01.2037	139	44	0,00	Jubilee CLO DAC						
BlueMountain CLO Ltd.				3,400 % fällig am 25.07.2036				1.854	1.706	0,05	4,615 % fällig am 15.04.2031 € 3.100 3.374 0,10			
6,735 % fällig am 15.07.2031	\$ 3.863	3.859	0,11	CSAB Mortgage-Backed Trust				Lehman XS Trust						
BlueMountain Fuji EUR CLO DAC				6,220 % fällig am 25.09.2036				3.409	1.026	0,03	4,719 % fällig am 25.06.2036 \$ 724 682 0,02			
1,050 % fällig am 15.01.2031	€ 497	519	0,02	CVC Cordatus Loan Fund DAC				5,790 % fällig am 25.05.2036 1.792 1.548 0,04						
4,685 % fällig am 15.01.2031	9.436	10.310	0,30	4,555 % fällig am 15.09.2031	€ 2.987	3.250	0,09	Long Beach Mortgage Loan Trust						
4,795 % fällig am 15.04.2034	2.200	2.385	0,07	4,652 % fällig am 21.07.2030	12.253	13.383	0,39	5,690 % fällig am 25.11.2036 9.165 2.841 0,08						
				4,852 % fällig am 26.08.2032	500	546	0,02	5,910 % fällig am 25.02.2036 1.447 1.405 0,04						
								6,070 % fällig am 25.02.2036 259 207 0,01						

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Dynamic Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
6,115 % fällig am 25.11.2035	\$ 238		0,01	OZLM DAC				Symphony CLO Ltd.			
6,385 % fällig am 25.08.2035	700	619	0,02	4,723 % fällig am 24.08.2030	€ 2.677	\$ 2.929	0,08	6,535 % fällig am 15.04.2028	\$ 70	\$ 70	0,00
Madison Park Euro Funding DAC				Palmer Square European Loan Funding DAC				Tikehau CLO DAC			
4,715 % fällig am 15.01.2032	€ 9.800	10.668	0,31	4,695 % fällig am 15.07.2031	7.578	8.268	0,24	4,844 % fällig am 04.08.2034	€ 500	546	0,02
Madison Park Funding Ltd.				4,745 % fällig am 15.04.2031	4.261	4.641	0,13	Toro European CLO DAC			
6,405 % fällig am 15.04.2029	\$ 3.721	3.707	0,11	5,938 % fällig am 12.04.2032	8.949	9.916	0,29	4,885 % fällig am 15.07.2030	157	173	0,01
Man GLG Euro CLO DAC				Palmerston Park CLO DAC				4,908 % fällig am 12.01.2032	6.200	6.795	0,20
4,615 % fällig am 15.12.2031	€ 3.232	3.529	0,10	4,625 % fällig am 18.04.2030	1.196	1.315	0,04	Triaxx Prime CDO Ltd.			
4,835 % fällig am 15.01.2030	184	203	0,01	Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				5,715 % fällig am 02.10.2039	\$ 1.842	11	0,00
Massachusetts Educational Financing Authority				6,790 % fällig am 25.01.2036	\$ 1.700	1.581	0,05	Voya Euro CLO DAC			
6,590 % fällig am 25.04.2038	\$ 397	397	0,01	People's Choice Home Loan Securities Trust				4,715 % fällig am 15.10.2030	€ 1.907	2.087	0,06
MASTR Specialized Loan Trust				6,415 % fällig am 25.05.2035	2.440	2.225	0,06	WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust			
6,170 % fällig am 25.05.2037	71	66	0,00	6,820 % fällig am 25.01.2035	330	316	0,01	5,620 % fällig am 25.01.2037	\$ 9.655	4.523	0,13
6,210 % fällig am 25.01.2037	1.162	475	0,01	Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust				5,695 % fällig am 25.05.2037	3.041	2.819	0,08
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				5,680 % fällig am 25.01.2037	790	760	0,02	Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust			
5,730 % fällig am 25.03.2037	2.214	1.972	0,06	RAAC Trust				5,770 % fällig am 25.05.2036	787	586	0,02
5,790 % fällig am 25.03.2037	780	696	0,02	6,070 % fällig am 25.06.2044	110	93	0,00	5,950 % fällig am 25.05.2036	644	483	0,01
5,810 % fällig am 25.07.2037	55	24	0,00	6,230 % fällig am 25.10.2046	1.249	1.197	0,03	Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust			
5,950 % fällig am 25.08.2037	11.580	6.042	0,18	6,325 % fällig am 25.03.2037	19	19	0,00	6,070 % fällig am 25.04.2037	2.967	2.020	0,06
5,990 % fällig am 25.04.2037	1.403	693	0,02	6,670 % fällig am 25.10.2045	0	0	0,00	7,195 % fällig am 25.11.2035	5.487	5.447	0,16
5,990 % fällig am 25.05.2037	1.035	599	0,02	Red & Black Auto Germany				Willow Park CLO DAC			
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				4,393 % fällig am 15.09.2031	€ 1.672	1.854	0,05	4,805 % fällig am 15.01.2031	€ 667	732	0,02
5,530 % fällig am 25.12.2036	1.106	562	0,02	Regatta Funding Ltd.							
5,600 % fällig am 25.10.2036	645	561	0,02	6,734 % fällig am 17.07.2031	\$ 957	958	0,03				
5,610 % fällig am 25.10.2036	26	11	0,00	Renaissance Home Equity Loan Trust							
5,610 % fällig am 25.11.2036	689	322	0,01	3,269 % fällig am 25.09.2037	700	474	0,01				
5,610 % fällig am 25.05.2037	2.858	2.424	0,07	5,612 % fällig am 25.04.2037	3.152	854	0,02				
5,620 % fällig am 25.10.2036	6.516	3.404	0,10	6,170 % fällig am 25.08.2032	10	9	0,00				
5,620 % fällig am 25.11.2036	1.062	605	0,02	Residential Asset Mortgage Products Trust							
5,620 % fällig am 25.12.2036	226	115	0,00	6,210 % fällig am 25.05.2037	2.379	2.120	0,06				
5,650 % fällig am 25.03.2037	1.055	452	0,01	Residential Asset Securities Corp. Trust							
5,690 % fällig am 25.10.2036	1.048	453	0,01	5,810 % fällig am 25.11.2036	1.783	1.666	0,05				
5,700 % fällig am 25.10.2036	3.853	2.020	0,06	5,810 % fällig am 25.04.2037	2.470	2.336	0,07				
5,720 % fällig am 25.07.2036	717	630	0,02	5,990 % fällig am 25.07.2036	849	764	0,02				
5,720 % fällig am 25.03.2037	527	226	0,01	6,010 % fällig am 25.07.2036	1.209	1.056	0,03				
5,770 % fällig am 25.06.2036	14	12	0,00	Saxon Asset Securities Trust							
5,770 % fällig am 25.07.2036	1.499	560	0,02	5,640 % fällig am 25.10.2046	223	216	0,01				
5,770 % fällig am 25.09.2036	65	23	0,00	Sculptor European CLO DAC							
6,250 % fällig am 25.01.2035	923	900	0,03	4,755 % fällig am 14.01.2032	€ 11.100	12.086	0,35				
6,520 % fällig am 25.09.2033	58	58	0,00	Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust							
6,720 % fällig am 25.07.2037	2.100	1.769	0,05	5,790 % fällig am 25.10.2036	\$ 9.599	3.233	0,09				
Morgan Stanley Capital, Inc. Trust				6,130 % fällig am 25.08.2035	1.806	1.443	0,04				
5,830 % fällig am 25.03.2036	1.040	823	0,02	6,235 % fällig am 25.02.2034	191	189	0,01				
Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital Trust				6,430 % fällig am 25.01.2036	223	202	0,01				
5,770 % fällig am 25.07.2036	1.570	632	0,02	SG Mortgage Securities Trust							
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				5,680 % fällig am 25.10.2036	1.800	1.282	0,04				
6,465 % fällig am 25.09.2046	1.035	345	0,01	Sierra Madre Funding Ltd.							
Navient Student Loan Trust				5,854 % fällig am 07.09.2039	1.840	1.295	0,04				
6,502 % fällig am 27.12.2066	3.456	3.445	0,10	5,874 % fällig am 07.09.2039	10.557	7.445	0,22				
New Century Home Equity Loan Trust				Soundview Home Loan Trust							
6,190 % fällig am 25.03.2035	552	543	0,02	5,550 % fällig am 25.06.2037	565	373	0,01				
Newcastle Investment Trust				5,590 % fällig am 25.11.2036	265	80	0,00				
0,000 % fällig am 01.05.2033	1.139	1.121	0,03	5,640 % fällig am 25.07.2037	737	630	0,02				
Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust				5,640 % fällig am 25.08.2037	2.119	1.789	0,05				
5,620 % fällig am 25.07.2036	1.633	1.510	0,04	5,680 % fällig am 25.06.2037	2.620	1.730	0,05				
6,130 % fällig am 25.10.2036	2.138	477	0,01	5,750 % fällig am 25.06.2037	3.775	2.493	0,07				
6,270 % fällig am 25.02.2037	573	168	0,00	6,030 % fällig am 25.10.2036	353	343	0,01				
6,355 % fällig am 25.09.2035	3	2	0,00	6,370 % fällig am 25.10.2037	4.797	3.768	0,11				
NovaStar Mortgage Funding Trust				Specialty Underwriting & Residential Finance Trust							
5,630 % fällig am 25.09.2037	454	448	0,01	4,074 % fällig am 25.02.2037	1.478	535	0,02				
5,670 % fällig am 25.09.2037	581	562	0,02	5,076 % fällig am 25.12.2036	861	821	0,02				
5,810 % fällig am 25.11.2036	2.105	635	0,02	5,770 % fällig am 25.09.2037	465	152	0,00				
5,890 % fällig am 25.01.2037	1.371	484	0,01	St. Paul's CLO DAC							
7,345 % fällig am 25.03.2035	705	694	0,02	4,715 % fällig am 15.01.2032	€ 1.291	1.412	0,04				
OCP Euro CLO DAC				Structured Asset Investment Loan Trust							
4,785 % fällig am 15.01.2032	€ 3.003	3.301	0,10	6,445 % fällig am 25.01.2035	\$ 4.321	3.908	0,11				
4,882 % fällig am 22.09.2034	6.800	7.405	0,21	6,595 % fällig am 25.01.2035	418	346	0,01				
5,873 % fällig am 20.01.2033	10.000	11.047	0,32	7,045 % fällig am 25.01.2035	456	351	0,01				
Octagon Investment Partners Ltd.				7,195 % fällig am 25.01.2035	329	145	0,00				
6,625 % fällig am 15.04.2031	\$ 806	806	0,02	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust							
Option One Mortgage Loan Trust				5,625 % fällig am 25.09.2036	7.059	4.383	0,13				
5,610 % fällig am 25.01.2037	815	509	0,01	5,650 % fällig am 25.01.2037	818	477	0,01				
5,610 % fällig am 25.02.2037	800	519	0,02	5,970 % fällig am 25.11.2037	1.978	1.807	0,05				
5,610 % fällig am 25.03.2037	136	120	0,00	6,475 % fällig am 25.11.2035	6.700	6.597	0,19				
5,690 % fällig am 25.04.2037	4.427	3.036	0,09	6,957 % fällig am 25.04.2035	49	48	0,00				
5,690 % fällig am 25.05.2037	3.568	2.114	0,06	Structured Asset Securities Corp. Trust							
Ownit Mortgage Loan Trust				6,160 % fällig am 25.09.2035	3.690	3.463	0,10				
5,757 % fällig am 25.05.2037	620	477	0,01								
OZLM Ltd.											
6,682 % fällig am 16.05.2030	2.603	2.600	0,08								

AKTIEN

STAMMAKTION KOMMUNIKATIONSDIENSTE

Intelsat Emergence S.A. (d)(k)	19.367	552	0,02
--------------------------------	--------	-----	------

ENERGIE

Constellation Oil Services Holding S.A. 'B' (d)(k)	1.038.200	112	0,00
--	-----------	-----	------

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Dynamic Bond Fund (Forts.)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

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

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AES Corp.	5,000 %	20.12.2025	\$ 500	\$ (53)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2024	5.300	32	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2026	2.700	(24)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2028	300	5	0,00
Boeing Co.	1,000	20.06.2026	100	2	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2024	€ 7.000	41	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	\$ 4.300	25	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2026	400	3	0,00
Tesco PLC	1,000	20.06.2028	€ 4.300	85	0,00
				\$ 116	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF⁽²⁾

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-33 5-Year Index	(1,000) %	20.06.2025	\$ 87	\$ (6)	0,00
CDX.HY-40 5-Year Index	(5,000)	20.06.2028	7.920	(451)	(0,01)
				\$ (457)	(0,01)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽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	(6)	0,00
CDX.IG-41 5-Year Index	1,000	20.12.2028	3.200	22	0,00
iTraxx Crossover 40 5-Year Index	5,000	20.12.2028	€ 14.400	734	0,02
				\$ 749	0,02

ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	5,000 %	20.03.2029	£ 37.900	\$ (2.690)	(0,08)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,700	19.09.2028	\$ 62.000	1.309	0,04
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,725	19.09.2028	59.800	1.273	0,04
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	21.12.2052	24.100	1.882	0,05
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,827	03.07.2028	85.800	(6.742)	(0,20)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,842	19.09.2053	12.500	(567)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,857	15.07.2032	29.320	(3.609)	(0,11)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,874	19.09.2053	11.700	(575)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,999	03.07.2053	17.500	3.644	0,11
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	27.10.2028	38.000	(2.857)	(0,08)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	10.12.2029	40	5	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,060	27.10.2053	7.600	1.785	0,05
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,250	20.06.2028	104.830	294	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,841	31.10.2024	3.700	(54)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,973	27.10.2024	3.700	(50)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,000	21.06.2033	31.200	183	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,018	24.10.2024	3.700	(50)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,080	23.02.2053	2.500	(136)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,140	25.10.2024	3.700	(43)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,190	25.10.2024	3.700	(42)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,225	25.10.2024	3.700	(40)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,470	22.02.2030	9.600	(124)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	11.12.2024	10.800	(84)	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	02.01.2034	3.200	(63)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,800	10.03.2028	7.400	(13)	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,810	02.01.2034	3.200	(79)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,842	26.12.2033	3.200	(86)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,854	29.12.2033	6.000	(169)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,950	19.12.2033	5.800	(207)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,030	15.12.2033	3.400	(143)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,155	02.10.2033	22.900	1.312	0,04
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,170	03.10.2033	17.000	997	0,03
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,628	02.01.2026	BRL 537.000	(14)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,231	04.01.2027	13.900	(69)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,073	04.01.2027	136.700	149	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,078	04.01.2027	126.600	142	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,115	04.01.2027	82.400	93	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		11,126 %	04.01.2027	BRL 114.100	\$ 137	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		11,144	04.01.2027	271.000	2.179	0,06
Erhalt	1-Year BRL-CDI		11,219	04.01.2027	577.900	(3.704)	(0,11)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		11,494	04.01.2027	145.000	654	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI		11,821	02.01.2025	128.000	(36)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		11,846	04.01.2027	76.300	460	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI		11,856	02.01.2025	129.000	(19)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		11,900	04.01.2027	68.000	432	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI		12,535	04.01.2027	185.800	1.921	0,06
Erhalt ⁽⁴⁾	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS		3,500	01.06.2032	CAD 20.900	(332)	(0,01)
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS		4,000	21.06.2025	387.200	532	0,02
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month AUD-BBR-BBSW		4,750	20.12.2033	AUD 412.900	7.536	0,22
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		0,650	12.04.2027	€ 6.700	(433)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		0,650	11.05.2027	5.800	(350)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		0,700	11.04.2027	3.400	(215)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		1,000	13.05.2027	7.200	(357)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		1,000	18.05.2027	3.500	(172)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		2,250	28.04.2024	8.800	41	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		2,250	03.05.2024	9.000	42	0,00
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR		3,000	20.03.2034	41.200	2.596	0,07
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		6,160	16.09.2027	PLN 93.100	(1.367)	(0,04)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		6,210	26.04.2027	116.600	(2.519)	(0,07)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		6,240	23.09.2027	78.600	(1.220)	(0,04)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		6,270	20.09.2027	89.800	(1.415)	(0,04)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		6,280	26.09.2027	26.700	(426)	(0,01)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		6,310	19.09.2027	94.800	(1.529)	(0,04)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		6,985	11.10.2027	113.000	(2.563)	(0,07)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		7,156	13.10.2027	58.300	(1.416)	(0,04)
						\$ (6.981)	(0,20)
						\$ (6.573)	(0,19)

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

- (1) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückzahlungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (2) Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückzahlungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (3) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.
- (4) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

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	3,288 %	19.01.2024	300	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,738	19.01.2024	300	(1)	(1)	0,00
BPS	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,494	08.01.2024	2.300	(11)	(17)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,545	16.01.2024	1.500	(7)	(19)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,994	08.01.2024	2.300	(11)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,995	16.01.2024	1.500	(7)	0	0,00
CBK	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,235	22.01.2024	5.800	(24)	(18)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,685	22.01.2024	5.800	(24)	(17)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,310	18.01.2024	2.000	(8)	(6)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,700	18.01.2024	2.000	(8)	(6)	0,00
FAR	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,489	08.01.2024	3.200	(15)	(23)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,550	16.01.2024	3.700	(16)	(48)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,989	08.01.2024	3.200	(15)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,000	16.01.2024	3.700	(16)	(1)	0,00
GLM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,215	22.01.2024	2.600	(10)	(7)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,285	19.01.2024	1.800	(7)	(7)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300	16.01.2024	5.000	(21)	(17)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,560	05.01.2024	4.300	(22)	(45)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,594	05.01.2024	4.300	(21)	(55)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,648	04.01.2024	5.000	(23)	(81)	(0,01)
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,665	22.01.2024	2.600	(10)	(9)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,735	19.01.2024	1.800	(7)	(4)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	16.01.2024	5.000	(21)	(7)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,010	05.01.2024	4.300	(22)	0	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Dynamic Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
JPM	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,044 %	05.01.2024	4.300	\$ (21)	\$ 0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,170	29.01.2024	2.000	(9)	(6)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,205	22.01.2024	2.700	(11)	(7)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	18.01.2024	600	(3)	(3)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,600	12.01.2024	1.700	(8)	(27)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,620	29.01.2024	2.000	(9)	(10)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,655	22.01.2024	2.700	(11)	(9)	0,00
MYC	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	18.01.2024	600	(3)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,050	12.01.2024	1.700	(8)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,455	08.01.2024	6.000	(29)	(34)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,475	08.01.2024	2.600	(12)	(17)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,600	12.01.2024	1.000	(5)	(16)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,670	04.01.2024	6.100	(29)	(110)	(0,01)
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,955	08.01.2024	6.000	(29)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,975	08.01.2024	2.600	(12)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,050	12.01.2024	1.000	(5)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,120	04.01.2024	6.100	(29)	0	0,00
UAG	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,344	18.01.2024	600	(3)	(3)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,744	18.01.2024	600	(3)	(1)	0,00
							\$ (567)	\$ (633)	(0,02)

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
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)	742	56	0,01
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2024	300	(36)	37	1	0,00
HUS	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2024	300	(9)	10	1	0,00
MYC	California State General Obligation Bonds, Series 2003	1,000	20.09.2024	2.900	23	(5)	18	0,00
					\$ (716)	\$ 796	\$ 80	0,01

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
GST	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500 %	17.11.2059	\$ 800	\$ (24)	\$ 24	\$ 0	0,00
MYC	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	11.000	(379)	378	(1)	0,00
UAG	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	10.900	(378)	377	(1)	0,00
					\$ (781)	\$ 779	\$ (2)	0,00

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

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	01.2024	\$ 10.041	AUD 15.157	\$ 304	\$ 0	\$ 304	0,01
	03.2024	CNH 69.844	\$ 9.690	0	(175)	(175)	(0,01)
BOA	01.2024	COP 10.548.516	2.758	38	0	38	0,00
	01.2024	£ 4.705	5.976	0	(22)	(22)	0,00
	01.2024	HUF 285.073	774	0	(48)	(48)	0,00
	01.2024	NZD 1.020	621	0	(24)	(24)	0,00
	01.2024	PLN 14.241	3.365	0	(256)	(256)	(0,01)
	01.2024	\$ 2.623	COP 10.548.516	97	0	97	0,00
	01.2024	1.079	£ 853	9	0	9	0,00
	01.2024	4.146	HUF 1.452.759	40	0	40	0,00
	01.2024	42.843	¥ 6.322.296	2.030	0	2.030	0,06
	01.2024	199	MXN 3.391	0	0	0	0,00
	01.2024	2.811	PLN 11.745	175	0	175	0,01
	02.2024	824	CNY 5.825	0	(1)	(1)	0,00
	03.2024	CNH 98.304	\$ 13.573	0	(312)	(312)	(0,01)
	03.2024	IDR 33.744.797	2.146	0	(42)	(42)	0,00
	03.2024	\$ 2.718	COP 10.548.516	4	(37)	(37)	0,00
03.2024	342	IDR 5.344.547	0	0	4	0,00	
03.2024	6.548	INR 547.937	14	0	14	0,00	
BPS	06.2024	KRW 1.879.223	\$ 1.445	0	(18)	(18)	0,00
	01.2024	AUD 1.128	746	0	(24)	(24)	0,00
	01.2024	BRL 232.898	48.249	304	0	304	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	€ 618.007	\$ 680.282	\$ 0	\$ (2.555)	\$ (2.555)	(0,07)
	01.2024	£ 17.939	22.754	0	(115)	(115)	0,00
	01.2024	HUF 722.771	2.057	0	(32)	(32)	0,00
	01.2024	KRW 591.201	450	0	(7)	(7)	0,00
	01.2024	\$ 8.815	AUD 13.198	192	0	192	0,01
	01.2024	400	BRL 1.966	5	0	5	0,00
	01.2024	1.390	CAD 1.890	44	0	44	0,00
	01.2024	4	HUF 1.514	0	0	0	0,00
	01.2024	1.150	IDR 17.787.756	4	0	4	0,00
	01.2024	6	KRW 7.894	0	0	0	0,00
	01.2024	8.209	ZAR 152.186	102	0	102	0,00
	02.2024	TWD 528.566	\$ 16.599	0	(870)	(870)	(0,03)
	02.2024	\$ 1.463	CNY 10.388	5	0	5	0,00
	03.2024	CNH 68.032	\$ 9.453	0	(156)	(156)	(0,01)
	03.2024	TWD 503	16	0	0	0	0,00
	03.2024	\$ 105	CNH 760	2	0	2	0,00
	03.2024	2.776	IDR 42.544.938	0	(17)	(17)	0,00
	03.2024	22.754	INR 1.903.238	38	0	38	0,00
	04.2024	48.249	BRL 235.248	0	(218)	(218)	(0,01)
	06.2024	KRW 8.086.540	\$ 6.190	0	(105)	(105)	0,00
BRC	01.2024	1.356.915	1.050	2	0	2	0,00
	01.2024	PLN 222.164	50.809	0	(5.673)	(5.673)	(0,17)
	01.2024	\$ 3.976	TRY 118.431	2	(7)	(5)	0,00
	01.2024	993	ZAR 18.486	17	0	17	0,00
	02.2024	5.347	TRY 163.011	0	(34)	(34)	0,00
	03.2024	700	IDR 10.876.829	6	0	6	0,00
	03.2024	7.935	TRY 249.645	0	(91)	(91)	0,00
	04.2024	11.895	383.083	0	(167)	(167)	(0,01)
BSH	06.2024	KRW 8.327.056	\$ 6.380	0	(102)	(102)	0,00
CBK	01.2024	BRL 286.000	57.383	0	(1.494)	(1.494)	(0,04)
	01.2024	AUD 877	584	0	(15)	(15)	0,00
	01.2024	£ 502	636	0	(4)	(4)	0,00
	01.2024	HUF 144.811	413	0	(6)	(6)	0,00
	01.2024	IDR 15.428.538	1.002	1	0	1	0,00
	01.2024	MXN 238.137	13.507	0	(492)	(492)	(0,01)
	01.2024	PLN 9.204	2.294	0	(46)	(46)	0,00
	01.2024	\$ 2.984	AUD 4.438	45	0	45	0,00
	01.2024	70.134	BRL 341.480	165	0	165	0,00
	01.2024	4.672	£ 3.720	70	0	70	0,00
	01.2024	3.537	MXN 64.972	283	0	283	0,01
	01.2024	4.624	PLN 19.508	336	0	336	0,01
	01.2024	ZAR 222.403	\$ 11.701	0	(447)	(447)	(0,01)
	03.2024	PEN 22.378	5.943	0	(87)	(87)	0,00
	03.2024	\$ 1.002	IDR 15.432.497	0	(2)	(2)	0,00
	03.2024	169	ILS 617	2	0	2	0,00
	04.2024	BRL 344.938	\$ 70.134	0	(292)	(292)	(0,01)
	06.2024	KRW 63.684	49	0	0	0	0,00
DUB	01.2024	£ 250.000	313.124	0	(5.577)	(5.577)	(0,16)
	01.2024	KRW 779.820	600	0	(2)	(2)	0,00
	01.2024	\$ 551	PLN 2.149	0	(4)	(4)	0,00
	01.2024	ZAR 118	\$ 6	0	0	0	0,00
	03.2024	CNH 46.786	6.493	0	(115)	(115)	0,00
	03.2024	SGD 23.590	17.821	0	(126)	(126)	0,00
	03.2024	\$ 294	IDR 4.597.112	4	0	4	0,00
	06.2024	KRW 9.002.272	\$ 6.916	0	(91)	(91)	0,00
GLM	01.2024	AUD 2.591	1.737	0	(31)	(31)	0,00
	01.2024	CAD 112.748	82.967	0	(2.548)	(2.548)	(0,07)
	01.2024	£ 50.000	63.874	134	0	134	0,00
	01.2024	¥ 147.100	1.003	0	(41)	(41)	0,00
	01.2024	MXN 15.344	885	0	(17)	(17)	0,00
	01.2024	\$ 52.295	BRL 253.700	0	(68)	(68)	0,00
	01.2024	46.412	MXN 814.004	1.440	0	1.440	0,04
	01.2024	ZAR 11.398	\$ 599	0	(24)	(24)	0,00
	02.2024	BRL 242	50	0	0	0	0,00
	02.2024	\$ 43.115	BRL 220.212	2.144	0	2.144	0,06
	03.2024	CNH 30.420	\$ 4.216	0	(81)	(81)	0,00
	03.2024	\$ 946	IDR 14.580.607	0	0	0	0,00
	03.2024	1.655	TRY 51.977	0	(19)	(19)	0,00
	07.2024	BRL 266.600	\$ 53.825	0	(95)	(95)	0,00
JPM	01.2024	77.391	15.617	27	(342)	(315)	(0,01)
	01.2024	HUF 1.491.165	4.249	0	(60)	(60)	0,00
	01.2024	MXN 9.574	556	0	(7)	(7)	0,00
	01.2024	PLN 4.198	1.066	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	\$ 1.150	IDR 17.695.050	0	(2)	(2)	0,00
	01.2024	451	KRW 583.270	0	0	0	0,00
	01.2024	889	PLN 3.831	85	0	85	0,00
	02.2024	TWD 65.952	\$ 2.059	0	(121)	(121)	0,00
	02.2024	\$ 7.713	BRL 37.828	62	0	62	0,00
	02.2024	2.831	TRY 86.403	0	(16)	(16)	0,00
	03.2024	IDR 103.073.387	\$ 6.649	0	(35)	(35)	0,00
	03.2024	TWD 988.719	31.801	0	(961)	(961)	(0,03)
	03.2024	\$ 6.823	INR 570.453	8	0	8	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Dynamic Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	04.2024	\$ 4.293	BRL 20.930	\$ 0	\$ (19)	\$ (19)	0,00
MBC	06.2024	KRW 8.619.753	\$ 6.651	1	(60)	(59)	0,00
	01.2024	AUD 1.149	\$ 761	0	(23)	(23)	0,00
	01.2024	£ 184	233	0	(2)	(2)	0,00
	01.2024	HUF 974.913	2.653	0	(158)	(158)	(0,01)
	01.2024	\$ 4.094	AUD 6.174	120	0	120	0,00
	01.2024	1.669	£ 1.316	9	0	9	0,00
	03.2024	CNH 733	\$ 101	0	(2)	(2)	0,00
	03.2024	TWD 2.337	74	0	(3)	(3)	0,00
MYI	01.2024	£ 1.814	2.316	4	0	4	0,00
	01.2024	HUF 104.499	297	0	(5)	(5)	0,00
	01.2024	PLN 4.532	1.131	0	(21)	(21)	0,00
	01.2024	\$ 48	€ 44	0	0	0	0,00
	01.2024	1.041	£ 815	0	(2)	(2)	0,00
	01.2024	16.290	¥ 2.401.622	756	0	756	0,02
	01.2024	377	PLN 1.557	19	0	19	0,00
	01.2024	2.919	ZAR 53.622	10	0	10	0,00
	02.2024	859	CNY 6.082	1	0	1	0,00
	03.2024	CNH 66.650	\$ 9.242	0	(172)	(172)	(0,01)
	03.2024	\$ 24.182	IDR 372.343.242	7	(44)	(37)	0,00
RBC	06.2024	KRW 5.253.050	\$ 4.039	0	(50)	(50)	0,00
RYL	04.2024	\$ 66	MXN 1.167	2	0	2	0,00
SCX	01.2024	AUD 578	\$ 389	0	(6)	(6)	0,00
	01.2024	ZAR 36.919	1.946	0	(70)	(70)	0,00
	03.2024	CNH 65.434	9.038	0	(204)	(204)	(0,01)
	03.2024	HKD 6.415	823	0	0	0	0,00
	03.2024	IDR 16.448.116	1.048	0	(19)	(19)	0,00
	03.2024	\$ 1.925	IDR 30.198.460	33	0	33	0,00
	03.2024	14.851	INR 1.241.945	22	0	22	0,00
SSB	06.2024	KRW 4.294.240	\$ 3.308	0	(35)	(35)	0,00
TOR	01.2024	\$ 4.719	CLP 4.171.754	54	0	54	0,00
	01.2024	26.925	¥ 3.949.489	1.107	0	1.107	0,03
	03.2024	CNH 31.645	\$ 4.383	0	(87)	(87)	0,00
	03.2024	IDR 14.852.726	941	0	(22)	(22)	0,00
UAG	01.2024	DKK 1.796	264	0	(3)	(3)	0,00
	01.2024	£ 97.497	123.385	0	(909)	(909)	(0,03)
	01.2024	\$ 3.311	AUD 4.991	95	0	95	0,00
	01.2024	171	HUF 62.783	10	0	10	0,00
	01.2024	540	MXN 9.555	22	0	22	0,00
	01.2024	ZAR 314.929	\$ 16.498	0	(700)	(700)	(0,02)
				\$ 10.512	\$ (26.993)	\$ (16.481)	(0,48)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 31. Dezember 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	01.2024	\$ 5.873	AUD 8.857	\$ 172	\$ 0	\$ 172	0,01
BOA	01.2024	743	1.124	24	0	24	0,00
BPS	01.2024	AUD 438	\$ 290	0	(9)	(9)	0,00
	01.2024	\$ 96	AUD 141	0	0	0	0,00
BRC	01.2024	AUD 91	\$ 60	0	(2)	(2)	0,00
CBK	01.2024	263	174	0	(5)	(5)	0,00
	01.2024	\$ 93	AUD 138	1	0	1	0,00
GLM	01.2024	AUD 33	\$ 22	0	(1)	(1)	0,00
MBC	01.2024	\$ 1.909	AUD 2.879	56	0	56	0,00
RYL	01.2024	AUD 22	\$ 15	0	0	0	0,00
UAG	01.2024	\$ 2.824	AUD 4.256	81	0	81	0,00
				\$ 334	\$ (17)	\$ 317	0,01

Zum 31. Dezember 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	01.2024	\$ 51	CAD 69	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
BRC	01.2024	2.587	3.517	81	0	81	0,01
CBK	01.2024	2.615	3.553	80	0	80	0,00
MBC	01.2024	54	73	2	0	2	0,00
MYI	01.2024	11	15	0	0	0	0,00
UAG	01.2024	2.577	3.496	74	0	74	0,00
				\$ 238	\$ 0	\$ 238	0,01

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	01.2024	\$ 105	CHF 90	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
BRC	01.2024	119	103	4	0	4	0,00
CBK	01.2024	197	170	6	0	6	0,00
GLM	01.2024	3.867	3.388	162	0	162	0,01
MYI	01.2024	3.891	3.396	147	0	147	0,00
UAG	01.2024	3.810	3.324	142	0	142	0,00
				\$ 462	\$ 0	\$ 462	0,01

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilklassen 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	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	01.2024	€ 2.954	\$ 3.205	\$ 1	\$ (59)	\$ (58)	(0,01)
	01.2024	\$ 4.209	€ 3.847	42	0	42	0,00
BRC	01.2024	57.689	52.455	269	0	269	0,01
CBK	01.2024	€ 1.431	\$ 1.573	0	(8)	(8)	0,00
MBC	01.2024	839	916	0	(11)	(11)	0,00
MYI	01.2024	\$ 58.786	€ 53.484	309	0	309	0,01
NGF	01.2024	16.461	15.070	190	0	190	0,01
UAG	01.2024	58.831	53.484	264	0	264	0,01
				\$ 1.075	\$ (78)	\$ 997	0,03

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend und Class E GBP (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2024	\$ 66.070	£ 52.086	\$ 331	\$ 0	\$ 331	0,01
BPS	01.2024	210.490	166.187	1.375	(4)	1.371	0,04
BRC	01.2024	2.858	2.261	24	0	24	0,00
CBK	01.2024	£ 992	\$ 1.256	0	(10)	(10)	0,00
	01.2024	\$ 3.054	£ 2.417	27	0	27	0,00
GLM	01.2024	2.134	1.675	2	0	2	0,00
MBC	01.2024	£ 219	\$ 279	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 29.557	£ 23.338	196	0	196	0,01
MYI	01.2024	1.345	1.061	8	(1)	7	0,00
RYL	01.2024	531.940	420.290	3.863	0	3.863	0,11
SCX	01.2024	855.958	676.711	6.742	0	6.742	0,19
SSB	01.2024	20.072	15.907	207	0	207	0,01
UAG	01.2024	837.107	661.447	6.134	0	6.134	0,18
				\$ 18.909	\$ (15)	\$ 18.894	0,55

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilklasse Institutional NOK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2024	\$ 86	NOK 918	\$ 4	\$ 0	\$ 4	0,00
BPS	01.2024	2	23	0	0	0	0,00
CBK	01.2024	96	1.027	5	0	5	0,00
RYL	01.2024	NOK 22	\$ 2	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 2	NOK 24	0	0	0	0,00
UAG	01.2024	140	1.489	7	0	7	0,00
				\$ 16	\$ 0	\$ 16	0,00

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilklasse Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2024	SEK 34	\$ 3	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2024	\$ 1.751	SEK 18.262	62	0	62	0,00
BRC	01.2024	SEK 81	\$ 8	0	0	0	0,00
CBK	01.2024	66	6	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 80	SEK 822	2	0	2	0,00
GLM	01.2024	SEK 8	\$ 1	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 29	SEK 307	1	0	1	0,00
MBC	01.2024	SEK 45	\$ 4	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 0	SEK 2	0	0	0	0,00
SCX	01.2024	1.730	17.967	53	0	53	0,00
UAG	01.2024	SEK 29	\$ 3	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 1.750	SEK 18.062	42	0	42	0,00
				\$ 160	\$ 0	\$ 160	0,00
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 4.048	0,12

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Dynamic Bond Fund (Forts.)

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000\$)	MARKT- WERT (000\$)	% DES NETTO- VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,000 % fällig am 01.01.2054	\$ 4.000	\$ (3.270)	(0,10)
2,000 % fällig am 01.02.2054	96.900	(79.307)	(2,30)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (82.577)	(2,40)
Summe Anlagen		\$ 5.124.109	148,72
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (1.678.536)	(48,72)
Nettovermögen		\$ 3.445.573	100,00

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.

(b) Wertpapier per Emissionstermin.

(c) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(d) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(e) Nullkuponwertpapier.

(f) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(g) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

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

(i) Mit dem Teilfonds verbunden.

(j) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(k) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,24 %):

Emittentenbeschreibung	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Altice France S.A, 11,500 % fällig am 01.02.2027	20.12.2023	\$ 2.140	\$ 2.237	0,06
Constellation Oil Services Holding S.A. - Exp. 10. Juni 2071	10.06.2022	0	0	0,00
Constellation Oil Services Holding S.A. 'B'	10.06.2022	113	112	0,00
Deutsche Bank AG 0,898 % fällig am 28.05.2024	25.05.2021	1.900	1.866	0,05
Deutsche Bank AG 3,035 % fällig am 28.05.2032	25.05.2021	800	669	0,02
Intelsat Emergence S.A.	05.09.2018	2.000	552	0,02
Morgan Stanley 0,000 % fällig am 02.04.2032	29.07.2022	2.512	2.188	0,06
		\$ 9.465	\$ 7.624	0,21

(l) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 35.754 (31. Dezember 2022: USD 2.041) wurden zum 31. Dezember 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 69.247 (31. Dezember 2022: USD 45.907) wurden zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 21.652 (31. Dezember 2022: USD 48.797) wurden zum 31. Dezember 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 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	\$ 44	\$ 4.172.220	\$ 3.743	\$ 4.176.007
Investmentfonds	213.446	124.057	0	337.503
Pensionsgeschäfte	0	734.416	0	734.416
Finanzderivate ⁽³⁾	(5.514)	(35.726)	0	(41.240)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(82.577)	0	(82.577)
Summen	\$ 207.976	\$ 4.912.390	\$ 3.743	\$ 5.124.109

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

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

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettvermögens
BPS	3,200 %	28.09.2023	TBD ⁽¹⁾	€ (482)	\$ (537)	(0,01)
JML	(1,000)	14.11.2023	TBD ⁽¹⁾	(174)	(192)	(0,01)
MBC	3,100	06.11.2023	TBD ⁽¹⁾	(563)	(625)	(0,02)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (1.354)	(0,04)

(1) Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
AZD	\$ 301	\$ (350)	\$ (49)	\$ 36	\$ 0	\$ 36
BOA	2.067	(2.059)	8	(3.100)	3.170	70
BPS	(2.092)	5.240	3.148	(3.900)	3.880	(20)
BRC	(5.671)	5.892	221	(359)	320	(39)
BSH	(1.494)	1.850	356	k. A.	k. A.	k. A.
CBK	(437)	270	(167)	4.410	(4.530)	(120)
CLY	k. A.	k. A.	k. A.	(250)	0	(250)
DUB	(5.911)	6.570	659	24	(100)	(76)
FAR	(72)	0	(72)	(1.982)	1.690	(292)
GLM	726	(670)	56	(17.283)	17.179	(104)
GST	60	0	60	(48)	208	160
HUS	1	0	1	k. A.	k. A.	k. A.
JPM	(1.504)	1.540	36	(2.303)	310	(1.993)
MBC	184	0	184	2.683	(3.440)	(757)
MYC	(160)	290	130	(2.059)	1.970	(89)
MYI	966	(1.160)	(194)	1.202	(910)	292
NGF	190	0	190	k. A.	k. A.	k. A.
RBC	2	0	2	(86)	60	(26)
RYL	3.857	(4.790)	(933)	(76)	0	(76)
SAL	k. A.	k. A.	k. A.	(40)	0	(40)
SCX	6.522	(8.040)	(1.518)	(8.642)	8.280	(362)
SSB	261	(290)	(29)	(2.124)	1.540	(584)
TOR	998	(930)	68	(12.777)	9.630	(3.147)
UAG	5.254	0	5.254	(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. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	45,63	30,35
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	75,48	46,36
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,09	1,16
Investmentfonds	9,80	10,00
Pensionsgeschäfte	21,31	32,89
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(1,12)	0,08
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,19)	(1,19)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,12	(1,36)
Leerverkaufte Wertpapiere	(2,40)	(2,36)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,04)	(0,06)

* Gemäß der Liste der Märkte, die in Anhang 1 zum Prospekt aufgeführt sind und die Kriterien für gemäß OGAW-Vorschriften geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	1,05	1,91
Unternehmensanleihen und Wechsel	21,59	22,11
Wandelanleihen & Wechsel	0,22	0,40
Kommunalanleihen und Wechsel	0,26	0,35
US-Regierungsbehörden	52,17	8,36
US-Schatzobligationen	8,61	2,61
Non-Agency-MBS	7,47	8,21
Forderungsbesicherte Wertpapiere	16,91	18,00
Staatsemissionen	5,72	3,20
Stammaktien	0,08	0,05
Bezugsrechte	k. A.	0,00
Optionsscheine	0,00	0,00
Vorzugswertpapiere	0,03	0,17
Kurzfristige Instrumente	7,09	12,50
Investmentfonds	9,80	10,00
Pensionsgeschäfte	21,31	32,89
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(1,12)	0,08
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	k. A.	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,00	(0,03)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,01)	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,02	0,03
Zinsswaps	(0,20)	(1,19)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	k. A.	0,34
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	(0,02)	(0,95)
Optionen auf Wertpapiere	k. A.	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,01	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,00	0,00
Zinsswaps	k. A.	0,02
Devisenterminkontrakte	(0,48)	(1,05)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,61	0,29
Leerverkaufte Wertpapiere	(2,40)	(2,36)
Sonstige Aktiva und Passiva	(48,72)	(15,93)
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Dynamic Multi-Asset Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Tudor Rose Mortgages				CVC Cordatus Loan Fund DAC				4,695 % fällig am 15.07.2031	€ 2.684	€ 2.684	0,08
5,820 % fällig am 20.06.2048	£ 1.441	€ 1.654	0,05	4,555 % fällig am 15.09.2031	€ 2.689	€ 2.648	0,08	4,745 % fällig am 15.04.2031	1.469	1.449	0,04
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				4,615 % fällig am 15.10.2031	8.681	8.565	0,26	Palmerston Park CLO DAC			
3,787 % fällig am 25.02.2037	\$ 32	26	0,00	4,652 % fällig am 21.07.2030	4.440	4.390	0,13	4,625 % fällig am 18.04.2030	598	595	0,02
6,060 % fällig am 25.08.2046	7.811	5.723	0,18	Dryden Euro CLO DAC				PBD Germany Auto Lease Master S.A., Compartment			
6,270 % fällig am 25.06.2044	282	234	0,01	4,625 % fällig am 15.04.2033	4.974	4.902	0,15	4,576 % fällig am 26.11.2030	5.888	5.899	0,18
		147.541	4,52	4,862 % fällig am 15.05.2034	5.889	5.800	0,18	Renaissance Home Equity Loan Trust			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				Ellington Loan Acquisition Trust				5,285 % fällig am 25.01.2037	\$ 227	69	0,00
Accredited Mortgage Loan Trust				6,570 % fällig am 25.05.2037	\$ 85	75	0,00	5,545 % fällig am 25.01.2037	334	106	0,00
6,340 % fällig am 25.09.2035	2.800	2.369	0,07	Euro-Galaxy CLO DAC				Residential Asset Securities Corp. Trust			
Accunia European CLO DAC				4,589 % fällig am 24.04.2034	€ 3.696	3.631	0,11	6,150 % fällig am 25.05.2037	1.033	916	0,03
4,895 % fällig am 15.10.2030	€ 445	445	0,01	First Franklin Mortgage Loan Trust				Saxon Asset Securities Trust			
4,915 % fällig am 15.07.2030	852	851	0,03	6,175 % fällig am 25.11.2036	\$ 6.491	5.638	0,17	5,905 % fällig am 25.09.2036	7.500	6.384	0,20
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust				Fremont Home Loan Trust				Segovia European CLO DAC			
5,770 % fällig am 25.04.2036	\$ 199	174	0,01	5,610 % fällig am 25.01.2037	381	170	0,01	4,873 % fällig am 20.07.2032	€ 4.100	4.048	0,12
5,770 % fällig am 25.07.2036	232	69	0,00	FTA Santander Consumo				Silver Arrow Merfina SRL			
Adagio CLO DAC				4,773 % fällig am 21.03.2036	€ 1.986	1.991	0,06	4,559 % fällig am 20.07.2033	6.321	6.331	0,19
4,685 % fällig am 15.10.2031	€ 2.500	2.466	0,08	GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC				Silver Arrow S.A.			
Aqueduct European CLO DAC				4,893 % fällig am 20.01.2032	900	891	0,03	4,533 % fällig am 15.09.2027	88	88	0,00
4,633 % fällig am 20.07.2030	2.477	2.459	0,08	Griffith Park CLO DAC				Soundview Home Loan Trust			
Ares European CLO DAC				4,704 % fällig am 21.11.2031	16.032	15.779	0,48	5,620 % fällig am 25.03.2037	\$ 52	44	0,00
4,625 % fällig am 15.10.2030	2.848	2.828	0,09	GSAA Home Equity Trust				5,640 % fällig am 25.07.2037	716	554	0,02
4,745 % fällig am 15.10.2031	6.317	6.257	0,19	5,570 % fällig am 25.12.2046	\$ 925	404	0,01	5,640 % fällig am 25.08.2037	818	626	0,02
Armada Euro CLO DAC				5,985 % fällig am 25.06.2036	1.129	271	0,01	5,970 % fällig am 25.10.2036	146	124	0,00
4,685 % fällig am 15.07.2031	6.266	6.200	0,19	Harvest CLO DAC				6,370 % fällig am 25.10.2037	1.847	1.313	0,04
Aurium CLO DAC				1,040 % fällig am 15.07.2031	€ 500	474	0,01	Tikehau CLO DAC			
4,635 % fällig am 16.04.2030	594	588	0,02	4,566 % fällig am 26.06.2030	2.646	2.618	0,08	4,844 % fällig am 04.08.2034	€ 2.300	2.273	0,07
Avoca CLO DAC				4,605 % fällig am 15.10.2031	4.299	4.227	0,13	Toro European CLO DAC			
4,655 % fällig am 15.07.2030	978	973	0,03	4,673 % fällig am 20.10.2031	7.281	7.174	0,22	4,812 % fällig am 15.02.2034	5.300	5.228	0,16
4,785 % fällig am 15.10.2032	1.900	1.877	0,06	4,725 % fällig am 15.07.2031	4.000	3.943	0,12	4,908 % fällig am 12.01.2032	1.700	1.687	0,05
Bain Capital Euro CLO DAC				4,815 % fällig am 15.01.2032	19.900	19.647	0,60			295.891	9,07
4,733 % fällig am 20.01.2032	2.853	2.818	0,09	Hill FL BV				STAATSEMISSIONEN			
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				4,544 % fällig am 18.05.2030	8.745	8.772	0,27	Agence Francaise de Developpement			
6,520 % fällig am 25.08.2037	\$ 157	123	0,00	Invesco Euro CLO DAC				0,375 % fällig am 30.04.2024	2.100	2.076	0,06
Black Diamond CLO DAC				4,615 % fällig am 15.07.2031	500	492	0,02	Bpifrance Financement S.A.			
4,853 % fällig am 20.01.2032	€ 1.209	1.202	0,04	JPMorgan Mortgage Acquisition Trust				4,000 % fällig am 30.01.2026	£ 2.400	2.743	0,08
4,982 % fällig am 15.05.2032	2.931	2.894	0,09	5,680 % fällig am 25.10.2036	\$ 67	60	0,00	Caisse des Depots et Consignations			
Blackrock European CLO DAC				5,770 % fällig am 25.03.2037	12.800	10.653	0,33	3,375 % fällig am 25.11.2030	€ 4.500	4.724	0,14
4,585 % fällig am 15.10.2031	4.910	4.833	0,15	Jubilee CLO DAC				Caisse Francaise de Financement Local			
BlueMountain Fuji EUR CLO DAC				4,565 % fällig am 15.04.2030	€ 1.284	1.272	0,04	3,625 % fällig am 17.01.2029	700	729	0,02
1,050 % fällig am 15.01.2031	397	376	0,01	4,575 % fällig am 15.04.2030	3.589	3.568	0,11	Development Bank of Japan, Inc.			
4,615 % fällig am 15.07.2030	1.036	1.032	0,03	4,615 % fällig am 15.04.2031	4.300	4.230	0,13	4,500 % fällig am 06.06.2025	£ 1.100	1.262	0,04
4,685 % fällig am 15.01.2031	3.079	3.045	0,09	Koromo Italy SRL				Export Development Canada			
4,875 % fällig am 15.01.2033	1.000	985	0,03	4,676 % fällig am 26.02.2035	2.100	2.106	0,06	4,000 % fällig am 19.02.2026	12.500	14.345	0,44
BNPP AM Euro CLO DAC				Laurelin DAC				France Government International Bond			
4,565 % fällig am 15.04.2031	300	295	0,01	4,713 % fällig am 20.10.2031	4.465	4.421	0,14	0,000 % fällig am 25.03.2024	€ 10.150	10.068	0,31
4,615 % fällig am 15.10.2031	246	243	0,01	Madison Park Euro Funding DAC				(b)			
Cairn CLO DAC				4,765 % fällig am 15.07.2032	3.200	3.157	0,10	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro			
4,552 % fällig am 30.04.2031	3.501	3.460	0,11	Man GLG Euro CLO DAC				0,000 % fällig am 15.01.2024	19.800	19.777	0,61
4,618 % fällig am 31.01.2030	591	586	0,02	4,615 % fällig am 15.12.2031	4.063	4.016	0,12	(b)			
4,745 % fällig am 15.10.2031	3.698	3.637	0,11	4,645 % fällig am 15.10.2030	1.175	1.167	0,04	4,500 % fällig am 01.03.2024	30.000	30.032	0,92
Carlyle Euro CLO DAC				4,835 % fällig am 15.01.2030	262	262	0,01	Romania Government International Bond			
4,632 % fällig am 15.08.2030	160	159	0,01	Marlay Park CLO DAC				5,000 % fällig am 27.09.2026	26.000	26.729	0,82
4,665 % fällig am 15.01.2031	4.958	4.910	0,15	4,705 % fällig am 15.10.2030	815	809	0,03	Serbia Government International Bond			
4,892 % fällig am 15.08.2032	1.450	1.431	0,04	MASTR Asset-Backed Securities Trust				6,250 % fällig am 26.05.2028	\$ 300	279	0,01
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC				6,250 % fällig am 25.02.2034	\$ 1.139	1.037	0,03	SNCF Reseau			
4,925 % fällig am 16.01.2033	1.000	985	0,03	Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				4,500 % fällig am 30.01.2024	€ 119.300	119.333	3,66
4,752 % fällig am 15.11.2031	3.643	3.593	0,11	5,720 % fällig am 25.07.2036	127	101	0,00	Stockholms Lans Landsting			
Carrington Mortgage Loan Trust				5,770 % fällig am 25.07.2036	256	87	0,00	0,750 % fällig am 26.02.2025	7.000	6.802	0,21
6,070 % fällig am 25.01.2036	\$ 8.850	7.693	0,24	Morgan Stanley Home Equity Loan Trust				Ville de Paris			
CIT Mortgage Loan Trust				5,570 % fällig am 25.04.2037	98	46	0,00	0,010 % fällig am 02.01.2024	16.550	16.543	0,51
6,970 % fällig am 25.10.2037	397	356	0,01	NovaStar Mortgage Funding Trust					255.442	7,83	
Citigroup Mortgage Loan Trust				5,670 % fällig am 25.09.2037	117	102	0,00	AKTIEN			
4,215 % fällig am 25.10.2037	738	572	0,02	Oak Hill European Credit Partners DAC				STAMMAKTEN			
7,250 % fällig am 25.05.2036	104	49	0,00	4,723 % fällig am 20.01.2032	€ 820	812	0,03	KOMMUNIKATIONSDIENSTE			
Contego CLO BV				4,733 % fällig am 20.10.2031	8.179	8.089	0,25	Alphabet, Inc. 'A' (a)	96.100	12.152	0,37
4,735 % fällig am 15.10.2030	€ 998	989	0,03	OCP Euro CLO DAC				LUXUSGÜTER			
Contego CLO DAC				4,882 % fällig am 22.09.2034	5.200	5.126	0,16	Airbnb, Inc. 'A' (a)	41.060	5.060	0,15
4,642 % fällig am 23.01.2030	2.292	2.260	0,07	5,873 % fällig am 20.01.2033	20.900	20.901	0,64	Best Buy Co., Inc.	58.300	4.131	0,13
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				Option One Mortgage Loan Trust				Booking Holdings, Inc. (a)	1.738	5.581	0,17
5,610 % fällig am 25.08.2037	\$ 536	481	0,01	5,610 % fällig am 25.03.2037	\$ 160	128	0,00	Luminar Technologies, Inc. (a)	679.800	2.074	0,06
5,690 % fällig am 25.09.2037	49	45	0,00	5,690 % fällig am 25.04.2037	472	292	0,01	QuantumScape Corp. (a)	78.600	495	0,02
5,720 % fällig am 25.02.2036	101	86	0,00	5,690 % fällig am 25.05.2037	343	184	0,01				
				6,250 % fällig am 25.11.2034	106	92	0,00				
				Palmer Square European Loan Funding DAC							
				4,685 % fällig am 15.10.2031	€ 3.650	3.592	0,11				

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	
ENERGIE								FRANZÖSISCHE SCHATZWECHSEL				
Exxon Mobil Corp.	110.100	€ 9.965	0,31	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	544.809	€ 9.455	0,29	3,827 % fällig am				
Neste Oyj	394.100	12.691	0,39	Teradyne, Inc.	111.200	10.924	0,34	02.05.2024 (b)(c)	€ 25.000	€ 24.702	0,76	
		22.656	0,70	Trimble, Inc. (a)	144.100	6.940	0,21	3,842 % fällig am				
GESUNDHEITSWESEN								28.02.2024 (b)(c)	18.970	18.863	0,58	
Centene Corp. (a)	183.600	12.334	0,38	Unimicron Technology Corp.	513.100	2.654	0,08			43.565	1,34	
Elevance Health, Inc.	25.970	11.086	0,34	United Microelectronics Corp.	3.749.819	5.784	0,18	DEUTSCHE SCHATZWECHSEL				
Humana, Inc.	12.135	5.029	0,15			234.641	7,19	3,630 % fällig am				
Incyte Corp. (a)	91.900	5.224	0,16					20.03.2024 (b)(c)	6.030	5.984	0,18	
Regeneron Pharmaceuticals, Inc. (a)	15.070	11.982	0,37	BAUSTOFFE				JAPANISCHE SCHATZWECHSEL				
Vertex Pharmaceuticals, Inc. (a)	34.360	12.657	0,39	Calix Ltd. (a)	1.188.128	2.514	0,08	(0,257) % fällig am				
		58.312	1,79	Canfor Corp. (a)	504.023	6.177	0,19	04.04.2024 (b)(c)	¥14.150.000	90.908	2,79	
INDUSTRIEWERTE								(0,238) % fällig am				
ABB Ltd.	363.540	14.601	0,45	CF Industries Holdings, Inc.	149.600	10.766	0,33	15.01.2024 (b)(c)	6.442.000	41.367	1,27	
Aker Carbon Capture ASA (a)	6.124.174	7.397	0,23	DS Smith PLC	1.808.600	6.407	0,20	(0,226) % fällig am				
Ballard Power Systems, Inc. (a)	489.000	1.648	0,05	Hanwha Solutions Corp. (a)	190.574	5.244	0,16	15.01.2024 (b)(c)	2.778.000	17.839	0,55	
Fastenal Co.	104.400	6.121	0,19	Holmen AB 'B'	377.300	14.438	0,44	(0,174) % fällig am				
FuelCell Energy, Inc. (a)	1.446.800	2.096	0,06	LG Chem Ltd.	14.750	5.136	0,16	18.03.2024 (b)(c)	2.042.000	13.117	0,40	
Hitachi Zosen Corp.	2.829.100	16.975	0,52	Nucor Corp.	69.600	10.966	0,33	(0,156) % fällig am				
Industrie De Nora SpA	99.276	1.561	0,05	Steel Dynamics, Inc.	113.500	12.134	0,37	18.03.2024 (b)(c)	328.000	2.107	0,06	
ITM Power PLC (a)	2.154.624	1.480	0,04	Stora Enso Oyj 'R'	739.500	9.281	0,28			165.338	5,07	
NEL ASA (a)	7.840.925	4.796	0,15	thyssenkrupp AG	768.400	4.842	0,15	SCHWEIZER SCHATZWECHSEL				
Paychex, Inc.	50.900	5.488	0,17	Umicore S.A.	156.400	3.897	0,12	1,636 % fällig am				
PowerCell Sweden AB (a)	198.703	826	0,02	UPM-Kymmene Oyj	426.900	14.587	0,45	22.02.2024 (b)(c)	CHF 8.800	9.445	0,29	
Rexel S.A.	428.900	10.663	0,33	West Fraser Timber Co. Ltd.	78.800	6.133	0,19	1,697 % fällig am				
Rockwell Automation, Inc.	14.740	4.143	0,13			112.522	3,45	14.03.2024 (b)(c)	30.000	32.168	0,99	
Schneider Electric SE	69.500	12.673	0,39							41.613	1,28	
Sensata Technologies Holding PLC	199.676	6.791	0,21	VORZUGSWERTPAPIERE				BRITISCHE SCHATZWECHSEL				
Siemens AG (a)	60.700	10.316	0,31	Hanwha Solutions Corp.	4.662	85	0,00	5,265 % fällig am				
Valmet Oyj	318.300	8.338	0,25	0,000 %	4.662	85	0,00	05.02.2024 (b)(c)	£ 25.000	28.712	0,88	
Vestas Wind Systems A/S	714.100	20.468	0,63	REAL ESTATE INVESTMENT TRUSTS				18.03.2024 (b)(c)	20.000	22.831	0,70	
		136.381	4,18	Weyerhaeuser Co.	182.500	5.744	0,18	5,280 % fällig am				
INFORMATIONSTECHNOLOGIE								11.03.2024 (b)(c)	26.100	29.825	0,91	
Applied Materials, Inc.	79.700	11.693	0,36	KURZFRISTIGE INSTRUMENTE				11.03.2024 (b)(c)	26.100	29.825	0,91	
Arista Networks, Inc. (a)	40.300	8.592	0,26	COMMERCIAL PAPER				11.03.2024 (b)(c)	26.100	29.825	0,91	
Canadian Solar, Inc. (a)	157.400	3.737	0,11	Bpifrance				11.03.2024	€ 10.000	9.921	0,30	
Chipbond Technology Corp.	581.908	1.240	0,04	3,974 % fällig am								
Cisco Systems, Inc.	220.500	10.084	0,31	11.03.2024	€ 10.000	9.921	0,30					
Delta Electronics, Inc.	728.112	6.722	0,21	Fidelity National Information Services, Inc.	4.086	12.483	0,38					
Elan Microelectronics Corp.	529.109	2.533	0,08	4,086 % fällig am								
Enphase Energy, Inc. (a)	147.500	17.644	0,54	10.01.2024	12.500	12.483	0,38					
EPAM Systems, Inc. (a)	48.250	12.988	0,40	Fiserv, Inc.	4.076	14.909	0,46					
First Solar, Inc. (a)	97.000	15.128	0,46	4,076 % fällig am								
Flex Ltd. (a)	360.300	9.935	0,30	22.02.2024	15.000	14.909	0,46					
Globalwafers Co. Ltd.	185.309	3.201	0,10	Oesterreichische Kontrollbank AG	3.990	64.831	1,99					
Keysight Technologies, Inc. (a)	77.700	11.190	0,34	3,990 % fällig am								
KLA Corp.	23.720	12.482	0,38	22.01.2024	65.000	64.831	1,99					
Lam Research Corp.	17.450	12.373	0,38	3,995 % fällig am								
MediaTek, Inc.	96.008	2.870	0,09	02.04.2024	16.250	16.084	0,49					
Nanya Technology Corp.	881.907	2.026	0,06	Nederland Holding BV	4.339	13.265	0,41					
NetApp, Inc.	132.800	10.599	0,33	4,339 % fällig am								
Novatek Microelectronics Corp.	175.204	2.668	0,08	22.01.2024	13.300	13.265	0,41					
QUALCOMM, Inc.	95.200	12.464	0,38			131.493	4,03					
Realtek Semiconductor Corp.	205.407	2.851	0,09	ÖSTERREICHISCHE SCHATZWECHSEL				INVESTMENTFONDS				
Samsung Electronics Co. Ltd.	211.200	11.605	0,36	3,892 % fällig am				ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN				
SMA Solar Technology AG (a)	99.102	6.014	0,18	25.01.2024 (b)(c)	700	699	0,02	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Capital Securities Fund (f)				
SolarEdge Technologies, Inc. (a)	97.300	8.245	0,25	3,935 % fällig am				2.064.482	21.025	0,65		
				25.04.2024 (b)(c)	1.300	1.285	0,04	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Income Fund (f)				
						1.984	0,06	8.473.317	106.770	3,26		
				SCHATZWECHSEL DES EUROPÄISCHEN STABILITÄTSMECHANISMUS				PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (f)				
				3,855 % fällig am				3.189.591	31.589	0,97		
				23.05.2024 (b)(c)	10.000	9.858	0,30			159.384	4,88	
				SCHATZWECHSEL DER EUROPÄISCHEN UNION				BÖRSENGEHANDELTE FONDS				
				3,707 % fällig am				PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (f)				
				12.01.2024 (b)(c)	730	730	0,03	1.536.500	149.880	4,60		
				3,717 % fällig am				PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF (f)				
				12.01.2024 (b)(c)	730	729	0,02	310.100	3.401	0,10		
						1.459	0,05			153.281	4,70	
								Summe Investmentfonds				
								€ 312.665 9,58				
								Summe kurzfristige Instrumente				
								€ 3.381.141 103,66				
								Summe übertragbare Wertpapiere				
								€ 3.381.141 103,66				

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Dynamic Multi-Asset Fund (Forts.)

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	3,500 %	29.12.2023	02.01.2024	€ 256.700	Belgium Government International Bond 3,300 % fällig am 22.06.2054	€ (253.574)	€ 256.700	€ 256.800	7,86
CEW	3,700	29.12.2023	02.01.2024	70.000	Europäische Union 2,000 % fällig am 04.10.2027	(72.014)	70.000	70.029	2,15
FICC	2,600	29.12.2023	02.01.2024	\$ 35.513	U.S. Treasury Notes 4,875 % fällig am 30.11.2025	(32.792)	32.149	32.156	0,99
Summe Pensionsgeschäfte						€ (358.380)	€ 358.849	€ 358.985	11,00

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Australia Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2024	7.529	€ 15.471	0,47
Canada Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2024	1.614	6.000	0,18
E-mini Russell 2000 Index March Futures	Long	03.2024	1.120	5.161	0,16
E-mini S&P 500 Index March Futures	Long	03.2024	2.422	17.720	0,54
Euro STOXX 50 March Futures	Long	03.2024	728	(215)	(0,01)
Euro-BTP Italy Government Bond March Futures	Long	03.2024	900	4.055	0,12
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Long	03.2024	2.467	10.715	0,33
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2024	1.916	3.142	0,10
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2024	1.696	5.849	0,18
U.S. Treasury 10-Year Ultra March Futures	Short	03.2024	1.707	(7.989)	(0,24)
United Kingdom Long Gilt March Futures	Long	03.2024	606	4.795	0,15
				€ 64.704	1,98

OPTIONSKAUF

FUTURE-ÄHNLICHE OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Anzahl der Kontrakte	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
Put - EUREX Euro-Bund March 2024 Futures	€ 118,000	23.02.2024	200	€ 2	€ 2	0,00

OPTIONEN AUF INDIZES

Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Anzahl der Kontrakte	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
Put - CBOE S&P 500 Index	€ 4.250,000	19.01.2024	361	€ 3.832	€ 47	0,00
Put - CBOE S&P 500 Index	4.400,000	15.03.2024	231	1.270	478	0,02
Put - EUREX EURO STOXX 50 Index	3.900,000	19.01.2024	1.636	1.281	19	0,00
Put - EUREX EURO STOXX 50 Index	4.050,000	19.01.2024	1.695	1.336	31	0,00
				€ 7.719	€ 575	0,02

VERKAUFSoPTIONEN

OPTIONEN AUF INDIZES

Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
Put - CBOE S&P 500 Index	€ 4.000,000	19.01.2024	361	€ (2.002)	€ (28)	0,00
Call - CBOE S&P 500 Index	4.650,000	19.01.2024	361	(1.021)	(4.743)	(0,14)
Put - CBOE S&P 500 Index	4.200,000	15.03.2024	231	(698)	(260)	(0,01)
Call - CBOE S&P 500 Index	4.900,000	15.03.2024	231	(454)	(1.236)	(0,04)
Put - EUREX EURO STOXX 50 Index	3.700,000	19.01.2024	1.636	(707)	(10)	0,00
Put - EUREX EURO STOXX 50 Index	3.850,000	19.01.2024	1.695	(709)	(17)	0,00
Call - EUREX EURO STOXX 50 Index	4.300,000	19.01.2024	1.636	(661)	(3.821)	(0,12)
Call - EUREX EURO STOXX 50 Index	4.450,000	19.01.2024	1.695	(656)	(1.694)	(0,05)
				€ (6.908)	€ (11.809)	(0,36)

Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate

€ 53.472 1,64

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

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

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2026	\$ 500	€ (3)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2027	100	2	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2028	1.000	13	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2028	200	2	0,00
				€ 14	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-41 5-Year Index	1,000 %	20.12.2028	\$ 1.069.500	€ 6.577	0,20

ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt	Erhalt	variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	5,000 %		20.03.2029	£	235.600	€ 15.294	0,47
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,750		21.06.2053	\$	110.400	2.612	0,08
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,000		21.06.2030		324.500	2.612	0,08
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,250		20.12.2053		30.500	674	0,02
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500		20.12.2030		174.400	(449)	(0,02)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,250		16.06.2031	CAD	82.272	(4.287)	(0,13)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,900		18.12.2029		181	(17)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,547		09.03.2033	£	17.200	604	0,02
							€ 17.043	0,52
							€ 23.634	0,72

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

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

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

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

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

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

TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Erhalt	IXUTR Index	27.667	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 88.529	02.10.2024	€ 0	€ (347)	€ (347)	(0,01)
BPS	Zahlung	EURO STOXX Banks Index	448.000	3,909 %	€ 53.034	23.10.2024	0	273	273	0,01
	Erhalt	EURO STOXX Insurance Index	148.400	4,009	51.918	23.10.2024	0	(284)	(284)	(0,01)
JPM	Zahlung	SPSIHOTR Index	700	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 8.620	20.03.2024	0	30	30	0,00
RBC	Zahlung	SPSIHOTR Index	1.544	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	19.014	01.05.2024	0	67	67	0,00
							€ 0	€ (261)	€ (261)	(0,01)

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	01.2024	€ 1.556	AUD 2.522	€ 2	€ 0	€ 2	0,00
	01.2024	¥ 5.286	€ 34	0	0	0	0,00
BOA	01.2024	COP 83.766.468	\$ 21.900	274	0	274	0,01
	01.2024	€ 5.060	AUD 8.346	95	0	95	0,00
	01.2024	1.605	CAD 2.366	19	0	19	0,00
	01.2024	2.178	£ 1.877	0	(13)	(13)	0,00
	01.2024	HUF 41.835	\$ 113	0	(7)	(7)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Dynamic Multi-Asset Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens	
	01.2024	¥	9.220.000	€	59.477	€	197	0,01
	01.2024	\$	20.826	COP	83.766.468	€	698	0,02
	02.2024		66	CNY	469		0	0,00
	03.2024		88	CNH	636		2	0,00
	03.2024		21.584	COP	83.766.468		0	(0,01)
	03.2024		13.958	INR	1.167.988		26	0,00
BPS	01.2024	AUD	49.533	€	29.838		(757)	(0,02)
	01.2024	€	3.766	AUD	6.123		17	0,00
	01.2024		5.165	£	4.469		(14)	0,00
	01.2024		1.047	¥	168.100		32	0,00
	01.2024		56.835	\$	62.145		(593)	(0,02)
	01.2024	£	26.534	€	30.864		249	0,01
	01.2024	\$	111.258		101.490		795	0,02
	01.2024		26.248	ZAR	486.601		294	0,01
	02.2024	TWD	494.528	\$	15.558		(710)	(0,02)
	02.2024	\$	118	CNY	836		0	0,00
	03.2024	TWD	3.796.556	\$	120.530		(4.755)	(0,15)
	03.2024	\$	48.503	INR	4.056.958		73	0,00
BRC	06.2024	KRW	4.881.735	\$	3.737		(57)	0,00
	01.2024	€	14.477	AUD	23.681		150	0,00
	01.2024		2.643	CAD	3.873		15	0,00
	01.2024		2.601	£	2.256		(1)	0,00
	01.2024		114.693	\$	123.964		(2.499)	(0,08)
	01.2024	NOK	3.090	€	263		(12)	0,00
	01.2024	\$	67.071	MXN	1.176.720		1.906	0,06
	01.2024		1.279	PLN	5.594		129	0,00
	01.2024		396	TRY	12.048		6	0,00
	02.2024		1.397		42.630		(6)	0,00
	03.2024		7.012		220.261		(74)	0,00
	04.2024		7.756		249.935		(94)	0,00
CBK	06.2024	KRW	5.031.803	\$	3.855		(55)	0,00
	01.2024	DKK	96.571	€	12.958		2	0,00
	01.2024	MXN	2.124.639	\$	121.190		(3.360)	(0,10)
	03.2024	ILS	436.268		119.827		(1.448)	(0,04)
	03.2024	TWD	172.157		5.448		(231)	(0,01)
DUB	03.2024	\$	80.416	PEN	302.813		1.061	0,03
	01.2024	€	49.167	NOK	564.530		1.151	0,03
	03.2024	SGD	20	\$	15		0	0,00
	04.2024	¥	14.150.000	€	91.229		(584)	(0,02)
GLM	06.2024	KRW	5.439.816	\$	4.179		(50)	0,00
	01.2024	CHF	20.990	€	21.821		(763)	(0,02)
	01.2024	DKK	19.056		2.557		0	0,00
	01.2024	€	2.859	\$	3.087		(65)	0,00
	01.2024	HUF	7.802.845		22.332		(139)	0,00
	01.2024	¥	4.103.826	€	25.420		(944)	(0,03)
	01.2024	NOK	117.693		10.035		(455)	(0,01)
	01.2024	SEK	196.329		17.273		(362)	(0,01)
	01.2024	\$	36.821		33.691		367	0,01
	02.2024		74.362	BRL	379.806		3.344	0,10
JPM	03.2024		1.614	TRY	50.700		(16)	0,00
	03.2024	TWD	82.687	\$	2.617		(111)	0,00
	03.2024	\$	118	CNH	850		2	0,00
	03.2024		14.545	INR	1.215.982		15	0,00
	03.2024		11.000	TWD	341.994		300	0,01
MBC	06.2024	KRW	4.859.238	\$	3.747		(32)	0,00
	01.2024	AUD	9.781	€	5.982		(59)	0,00
	01.2024	€	1.502	CAD	2.206		12	0,00
	01.2024		3.288	£	2.828		(25)	0,00
	01.2024		29.506	\$	32.308		(266)	(0,01)
	01.2024	\$	57.590	COP	232.669.704		2.004	0,06
	01.2024		90.356	HUF	33.148.534		4.676	0,14
MYI	03.2024		53	TWD	1.674		2	0,00
	01.2024	CHF	29.742	€	31.515		(486)	(0,02)
	01.2024	€	1.844	CAD	2.720		23	0,00
	01.2024		3.735	£	3.222		(18)	0,00
	01.2024		24.844	\$	27.254		(179)	(0,01)
	01.2024	£	454	€	522		(1)	0,00
	01.2024	\$	118.894		108.912		1.306	0,04
	02.2024		69	CNY	490		0	0,00
RYL	06.2024	KRW	3.128.221	\$	2.405		(27)	0,00
	01.2024	€	1.421	CAD	2.085		10	0,00
	03.2024	£	99.008	€	114.991		1.008	0,03
SCX	01.2024	CAD	144.651		96.932		(2.363)	(0,07)
	01.2024	€	3.362	AUD	5.457		9	0,00
	01.2024		9.110	¥	1.415.500		(16)	0,00
	01.2024	£	234.045	€	269.565		(477)	(0,01)
	01.2024	\$	36.412	MXN	639.308		1.060	0,03
	03.2024	HKD	322.019	\$	41.311		(1)	0,00
	03.2024	TWD	2.197.626		69.622		(2.885)	(0,09)
	03.2024	\$	31.656	INR	2.647.341		43	0,00
SSB	06.2024	KRW	2.594.887	\$	1.999		(19)	0,00
	01.2024	\$	85.471	CLP	75.558.232		891	0,03

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
UAG	01.2024	€ 1.987	AUD 3.275	€ 36	€ 0	€ 36	0,00
	01.2024	\$ 786.212	€ 714.761	3.196	0	3.196	0,10
	01.2024	5.458	MXN 95.896	163	0	163	0,01
	01.2024	41.653	ZAR 795.113	1.599	0	1.599	0,05
	03.2024	¥ 2.370.000	€ 15.488	140	0	140	0,00
				€ 27.412	€ (25.291)	€ 2.121	0,06

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilsklassen BM Retail AUD (Hedged) ausschüttend II und M Retail AUD (Hedged) ausschüttend II die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	01.2024	€ 86	AUD 142	€ 1	€ 0	€ 1	0,00
MYI	01.2024	12	19	0	0	0	0,00
SCX	01.2024	87	144	2	0	2	0,00
UAG	01.2024	100	164	2	0	2	0,00
				€ 5	€ 0	€ 5	0,00

Zum 31. Dezember 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	01.2024	€ 709	CHF 676	€ 19	€ 0	€ 19	0,00
BRC	01.2024	33	32	1	0	1	0,00
CBK	01.2024	751	721	24	0	24	0,00
GLM	01.2024	812	782	28	0	28	0,00
RYL	01.2024	CHF 16	€ 17	0	0	0	0,00
	01.2024	€ 54	CHF 51	1	0	1	0,00
UAG	01.2024	182	173	4	0	4	0,00
				€ 77	€ 0	€ 77	0,00

Zum 31. Dezember 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	01.2024	£ 313	€ 365	€ 4	€ 0	€ 4	0,00
BPS	01.2024	37	42	0	0	0	0,00
BRC	01.2024	€ 76.107	£ 65.629	0	(385)	(385)	(0,01)
DUB	01.2024	£ 406	€ 473	4	0	4	0,00
GLM	01.2024	€ 83.327	£ 72.073	0	(169)	(169)	(0,01)
JPM	01.2024	155.732	134.965	0	(9)	(9)	0,00
MYI	01.2024	£ 6.749	€ 7.868	82	0	82	0,00
NGF	01.2024	52	60	0	0	0	0,00
RYL	01.2024	€ 10.341	£ 8.907	1	(65)	(64)	0,00
	01.2024	£ 1.662	€ 1.923	5	0	5	0,00
SCX	01.2024	€ 154.899	£ 134.488	275	0	275	0,01
	01.2024	£ 376	€ 438	4	0	4	0,00
SSB	01.2024	537	626	6	0	6	0,00
				€ 381	€ (628)	€ (247)	(0,01)

Zum 31. Dezember 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	01.2024	€ 1.298	ILS 5.270	€ 27	€ 0	€ 27	0,00
CBK	01.2024	1.298	5.270	26	0	26	0,00
	01.2024	ILS 44	€ 11	0	0	0	0,00
GLM	01.2024	€ 8	ILS 34	0	0	0	0,00
MBC	01.2024	26	106	0	0	0	0,00
MYI	01.2024	1.326	5.388	28	0	28	0,01
				€ 81	€ 0	€ 81	0,01

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Dynamic Multi-Asset Fund (Forts.)

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) thesaurierend und M Retail 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	02.2024	SGD 64	€ 44	€ 0	€ 0	€ 0	0,00
GLM	01.2024	€ 20.115	SGD 29.303	0	(4)	(4)	0,00
MBC	01.2024	20.116	29.303	0	(5)	(5)	0,00
	01.2024	SGD 444	€ 305	0	0	0	0,00
RYL	01.2024	€ 20.116	SGD 29.303	0	(5)	(5)	0,00
	01.2024	SGD 174	€ 119	0	(1)	(1)	0,00
SOG	01.2024	€ 404	SGD 588	0	0	0	0,00
				€ 0	€ (15)	€ (15)	0,00

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional USD (Hedged) thesaurierend, Institutional USD (Hedged) ausschüttend II, Investor USD (Hedged) thesaurierend, BM Retail USD (Hedged) ausschüttend II, Class E USD (Hedged) thesaurierend, Class E USD (Hedged) ausschüttend, Class E USD (Hedged) ausschüttend II, H Institutional USD (Hedged) thesaurierend, M Retail USD (Hedged) ausschüttend II und Class T USD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	01.2024	€ 1.213	\$ 1.329	€ 0	€ (11)	€ (11)	0,00
	01.2024	\$ 5.730	€ 5.192	18	(12)	6	0,00
BPS	01.2024	€ 88.974	\$ 97.940	0	(333)	(333)	(0,01)
BRC	01.2024	88.974	97.852	0	(413)	(413)	(0,01)
	01.2024	\$ 254	€ 234	4	0	4	0,00
GLM	01.2024	1.093	991	2	0	2	0,00
IND	01.2024	2.552	2.321	12	(1)	11	0,00
MBC	01.2024	€ 77.741	\$ 85.004	0	(808)	(808)	(0,02)
	01.2024	\$ 792	€ 727	10	0	10	0,00
MYI	01.2024	398	369	8	0	8	0,00
RYL	01.2024	1.082	991	12	0	12	0,00
SCX	01.2024	198	184	4	0	4	0,00
UAG	01.2024	€ 12.874	\$ 14.033	0	(174)	(174)	(0,01)
				€ 70	€ (1.752)	€ (1.682)	(0,05)
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						€ 79	0,00
Summe Anlagen						€ 4.129.840	126,60
Sonstige Aktiva und Passiva						€ (867.795)	(26,60)
Nettovermögen						€ 3.262.045	100,00

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

- (a) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.
- (b) Nullkuponwertpapier.
- (c) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (d) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (e) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (f) Mit dem Teilfonds verbunden.
- (g) Bedingt wandelbares Wertpapier.

Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von EUR null (31. Dezember 2022: EUR 17.831) wurden zum 31. Dezember 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von EUR 160.662 (31. Dezember 2022: Barmittel in Höhe von EUR 68.086) wurden zum 31. Dezember 2023 als Sicherheit für Leerverkäufe und Optionen gemäß Prime Brokerage-Vereinbarungen und Vereinbarungen, die börsennotierte Aktienoptionsgeschäfte regeln, verpfändet.

Barmittel in Höhe von EUR 139.157 (31. Dezember 2022: EUR 287.910) wurden zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von EUR 20.700 (31. Dezember 2022: EUR 38.420) wurden zum 31. Dezember 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 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	€ 350.997	€ 3.029.852	€ 292	€ 3.381.141
Investmentfonds	309.264	3.401	0	312.665
Pensionsgeschäfte	0	358.849	0	358.849
Finanzderivate ⁽³⁾	63.704	13.481	0	77.185
Summen	€ 723.965	€ 3.405.583	€ 292	€ 4.129.840

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

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

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

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate €	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet €	Netto- engagement ⁽¹⁾ €	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate €	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet €	Netto- engagement ⁽¹⁾ €
AZD	(2)	0	(2)	50	0	50
BOA	686	(2.500)	(1.814)	3.446	(3.570)	(124)
BPS	(5.743)	7.890	2.147	4.322	(10.200)	(5.878)
BRC	(1.298)	2.490	1.192	(7.900)	5.060	(2.840)
CBK	(3.926)	3.590	(336)	10.257	(9.740)	517
CLY	k. A.	k. A.	k. A.	(8)	0	(8)
DUB	521	(750)	(229)	12.986	(12.970)	16
GLM	824	(730)	94	(7.033)	6.920	(113)
GST	k. A.	k. A.	k. A.	(2)	0	(2)
IND	11	0	11	k. A.	k. A.	k. A.
JPM	195	1.160	1.355	7.259	(7.080)	179
MBC	5.541	(5.910)	(369)	36.023	(33.640)	2.383
MEI	k. A.	k. A.	k. A.	80	(4.040)	(3.960)
MYI	738	(1.120)	(382)	(126)	0	(126)
RBC	67	2.220	2.287	(3.115)	2.470	(645)
RYL	966	(1.220)	(254)	(7.748)	7.780	32
SCX	(4.364)	3.350	(1.014)	(15.297)	14.720	(577)
SOG	k. A.	k. A.	k. A.	(1.445)	1.300	(145)
SSB	897	0	897	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	4.966	(8.660)	(3.694)	(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. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	62,16	65,24
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	40,00	15,48
Sonstige übertragbare Wertpapiere	1,50	0,05
Investmentfonds	9,58	9,86
Pensionsgeschäfte	11,00	2,44
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	1,64	0,48
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,72	(1,15)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,00	0,61
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	k. A.	(0,35)

* Gemäß der Liste der Märkte, die in Anhang 1 zum Prospekt aufgeführt sind und die Kriterien für gemäß OGAW-Vorschriften geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	10,67	3,28
Wandelanleihen & Wechsel	0,32	0,26
US-Regierungsbehörden	32,95	k. A.
US-Schatzobligationen	3,22	k. A.
Non-Agency-MBS	4,52	1,78
Forderungsbesicherte Wertpapiere	9,07	6,77
Staatsemissionen	7,83	0,72
Stammaktien	18,21	39,19
Bezugsrechte	k. A.	0,00
Vorzugswertpapiere	0,00	k. A.
Real Estate Investment Trusts	0,18	0,26
Kurzfristige Instrumente	16,69	28,51
Investmentfonds	9,58	9,86
Pensionsgeschäfte	11,00	2,44
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	1,98	0,51
Optionskauf		
Future-ähnliche Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	0,00	k. A.
Optionen auf Indizes	0,02	0,00
Verkaufsoptionen		
Optionen auf Indizes	(0,36)	(0,03)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,20	0,30
Zinsswaps	0,52	(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-Kommunalemissionen – Schutzkauf	k. A.	0,00
Total Return Swaps auf Indizes	(0,01)	0,01
Devisenterminkontrakte	0,06	1,12
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,05)	(0,57)
Sonstige Aktiva und Passiva	(26,60)	6,99
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				
ARGENTINIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Autonomous City of Buenos Aires				
113,333 % fällig am 29.03.2024 (a)	ARS	0 \$	0	0,00
122,642 % fällig am 22.02.2028 (a)		52.420	46	0,00
Summe Argentinien			46	0,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES
ASERBAIDISCHAN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
SOCAR Turkey Enerji AS Via Steas Funding DAC				
7,230 % fällig am 17.03.2026	\$	2.900	2.878	0,10
BRASILIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Banco BTG Pactual S.A.				
8,300 % fällig am 15.08.2024	BRL	228.000	46.068	1,60
Banco do Brasil S.A.				
8,500 % fällig am 29.07.2026	MXN	222.000	12.336	0,43
Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd.				
0,000 % fällig am 29.01.2024 (e)(h)	\$	485	17	0,00
OI S.A.				
0,000 % fällig am 25.02.2035	BRL	4.559	495	0,02
Vale S.A.				
0,000 % (h)		99.420	7.250	0,25
Summe Brasilien			66.166	2,30

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES
CAYMAN-INSELN				
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
Betony CLO Ltd.				
6,732 % fällig am 30.04.2031	\$	938	939	0,03
Dryden Senior Loan Fund				
6,852 % fällig am 15.08.2030		879	879	0,03
Madison Park Funding Ltd.				
6,608 % fällig am 19.04.2030		740	739	0,03
Voya CLO Ltd.				
6,608 % fällig am 19.04.2031		880	879	0,03
Wind River CLO Ltd.				
6,707 % fällig am 18.07.2031		905	905	0,03
			4.341	0,15

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Fish Pond Re Ltd.				
9,363 % fällig am 08.01.2027 (b)		1.000	1.001	0,03
Interoceania Finance Ltd.				
0,000 % fällig am 30.11.2025 (e)		177	165	0,01
Kaisa Group Holdings Ltd.				
9,750 % fällig am 28.09.2023 ^		8.000	292	0,01
10,500 % fällig am 15.01.2025 ^		1.900	69	0,00
10,875 % fällig am 23.07.2023 ^		500	16	0,00
11,700 % fällig am 11.11.2025 ^		1.900	69	0,00
Peru Payroll Deduction Finance Ltd.				
0,000 % fällig am 01.11.2029 (e)		3.135	2.596	0,09
Poinsettia Finance Ltd.				
6,625 % fällig am 17.06.2031 (k)		7.332	6.226	0,22
Suci Second Investment Co.				
6,000 % fällig am 25.10.2028 (k)		6.300	6.666	0,23
			17.100	0,59
Summe Cayman-Inseln			21.441	0,74

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES
CHILE				
STAATSEMISSIONEN				
Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos				
2,300 % fällig am 01.10.2028	CLP	2.145.000	2.152	0,07

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES
CHILE				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Flourish Century				
6,600 % fällig am 04.02.2022 ^ (j)	\$	2.800	256	0,01
STAATSEMISSIONEN				
China Government International Bond				
2,600 % fällig am 01.09.2032	CNY	201.010	28.347	0,99
2,620 % fällig am 25.09.2029		308.300	43.765	1,52
2,750 % fällig am 17.02.2032		59.200	8.444	0,29
3,020 % fällig am 27.05.2031		144.590	21.043	0,73
3,120 % fällig am 25.10.2052		48.980	7.208	0,25
3,270 % fällig am 19.11.2030		23.300	3.450	0,12
3,280 % fällig am 03.12.2027		164.010	23.996	0,83
3,810 % fällig am 14.09.2050		89.400	14.723	0,51
			150.976	5,24
Summe China			151.232	5,25

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES
CHINA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Flourish Century				
6,600 % fällig am 04.02.2022 ^ (j)	\$	2.800	256	0,01
STAATSEMISSIONEN				
China Government International Bond				
2,600 % fällig am 01.09.2032	CNY	201.010	28.347	0,99
2,620 % fällig am 25.09.2029		308.300	43.765	1,52
2,750 % fällig am 17.02.2032		59.200	8.444	0,29
3,020 % fällig am 27.05.2031		144.590	21.043	0,73
3,120 % fällig am 25.10.2052		48.980	7.208	0,25
3,270 % fällig am 19.11.2030		23.300	3.450	0,12
3,280 % fällig am 03.12.2027		164.010	23.996	0,83
3,810 % fällig am 14.09.2050		89.400	14.723	0,51
			150.976	5,24
Summe China			151.232	5,25

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES
KOLUMBIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Empresas Publicas de Medellin ESP				
7,625 % fällig am 10.09.2024	COP	7.839.000	1.949	0,07
STAATSEMISSIONEN				
Colombia Government International Bond				
1,000 % fällig am 18.09.2030		49.317.600	11.613	0,40
1,000 % fällig am 26.03.2031		103.093.300	22.986	0,80
1,000 % fällig am 30.06.2032		19.544.000	4.236	0,15
1,000 % fällig am 09.02.2033		24.621.000	7.580	0,26
9,850 % fällig am 28.06.2027		25.455.000	6.377	0,22
Colombian TES				
3,750 % fällig am 25.02.2037		0	0	0,00
7,000 % fällig am 30.06.2032		22.623.200	4.899	0,17
7,250 % fällig am 18.10.2034		15.089.000	3.213	0,11
7,250 % fällig am 26.10.2050		16.745.900	3.149	0,11
7,750 % fällig am 18.09.2030		38.980.000	9.172	0,32
9,250 % fällig am 28.05.2042		48.560.700	11.413	0,40
13,250 % fällig am 09.02.2033		68.580.500	21.104	0,73
			105.742	3,67
Summe Kolumbien			107.691	3,74

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES
TSCHECHISCHE REPUBLIK				
STAATSEMISSIONEN				
Czech Republic Government International Bond				
0,950 % fällig am 15.05.2030	CZK	511.840	\$19.375	0,67
1,200 % fällig am 13.03.2031		381.000	14.396	0,50
1,750 % fällig am 23.06.2032		593.600	22.878	0,79
2,000 % fällig am 13.10.2033		297.100	11.442	0,40
2,500 % fällig am 25.08.2028		693.500	29.442	1,02
2,750 % fällig am 23.07.2029		98.200	4.173	0,15
3,500 % fällig am 30.05.2035		146.600	6.395	0,22
4,200 % fällig am 04.12.2036		65.000	3.028	0,11
5,000 % fällig am 30.09.2030		277.000	13.329	0,46
Summe Tschechische Republik			124.458	4,32

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES
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

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES
DOMINIKANISCHE REPUBLIK				
STAATSEMISSIONEN				
Dominican Republic Central Bank Notes				
12,000 % fällig am 03.10.2025	DOP	310.500	5.454	0,19
13,000 % fällig am 05.12.2025		1.128.200	20.378	0,71
13,000 % fällig am 30.01.2026		461.900	8.365	0,29
Dominican Republic Government International Bond				
9,750 % fällig am 05.06.2026		100.500	1.733	0,06
11,250 % fällig am 15.09.2035		1.512.200	28.181	0,98
13,625 % fällig am 03.02.2033		1.051.400	22.092	0,76
13,625 % fällig am 10.02.2034		483.800	10.080	0,35
Summe Dominikanische Republik			96.283	3,34

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES
ECUADOR				
STAATSEMISSIONEN				
Ecuador Government International Bond				
0,000 % fällig am 31.07.2030 (e)	\$	130	37	0,00
2,500 % fällig am 31.07.2040		540	173	0,01
3,500 % fällig am 31.07.2035		7.081	2.546	0,09
6,000 % fällig am 31.07.2030 (k)		15.470	7.240	0,25
6,000 % fällig am 31.07.2030		200	93	0,00
Summe Ecuador			10.089	0,35

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES
ÄGYPTEN				
STAATSEMISSIONEN				
Egypt Government International Bond				
7,600 % fällig am 01.03.2029 (k)		2.900	2.222	0,08
7,625 % fällig am 29.05.2032 (k)		5.900	4.115	0,14
Summe Ägypten			6.337	0,22

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES
UNGARN				
STAATSEMISSIONEN				
Hungary Government International Bond				
4,500 % fällig am 23.03.2028	HUF	1.272.700	3.508	0,12
4,750 % fällig am 24.11.2032		2.337.900	6.245	0,22
6,125 % fällig am 22.05.2028 (k)	\$	4.900	5.103	0,18
6,750 % fällig am 22.10.2028	HUF	7.055.900	21.197	0,74

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 (1,000) %	Fälligkeitsdatum 20.12.2028	Nennbetrag ⁽²⁾ \$ 684.300	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) \$ (2.199)	% des Nettovermögens (0,08)
CDX.IG-41 5-Year Index					

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,320 %	20.10.2033	£ 800	\$ 89	0,00
Zahlung ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	5,000	20.03.2029	168.200	3.094	0,11
Zahlung ⁽³⁾	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,500	20.03.2029	INR 1.978.230	60	0,00
Erhalt ⁽³⁾	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,500	20.03.2034	1.369.700	(77)	0,00
Zahlung	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,600	20.12.2033	859.590	237	0,01
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,621	20.12.2028	1.148.310	(209)	(0,01)
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,625	20.12.2025	3.168.130	(189)	(0,01)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,232	05.10.2025	¥ 41.960.000	(550)	(0,02)
Erhalt ⁽³⁾	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,350	21.03.2026	40.895.000	(692)	(0,02)
Erhalt	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	3,322	20.12.2028	SGD 11.820	(96)	0,00
Zahlung ⁽³⁾	1-Day THB-THORON Compounded-OIS	2,250	20.03.2026	THB 2.103.541	(18)	0,00
Zahlung ⁽³⁾	1-Day THB-THORON Compounded-OIS	2,500	20.03.2026	7.375.510	836	0,03
Erhalt ⁽³⁾	1-Day THB-THORON Compounded-OIS	2,500	20.03.2029	871.019	16	0,00
Erhalt ⁽³⁾	1-Day THB-THORON Compounded-OIS	2,750	20.03.2029	2.901.970	(1.122)	(0,04)
Zahlung	1-Day THB-THORON Compounded-OIS	2,770	20.12.2028	214.600	125	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,250	21.06.2028	\$ 26.400	847	0,03
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,250	20.12.2053	4.000	(465)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2030	3.900	(186)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2033	23.660	2.029	0,07
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2033	8.400	(500)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2035	3.800	132	0,00
Erhalt ⁽³⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,684	03.01.2034	2.400	(33)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,730	03.08.2033	2.800	50	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,735	07.08.2033	3.100	59	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.12.2028	82.800	(2.675)	(0,09)
Zahlung ⁽³⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2029	86.900	373	0,01
Erhalt ⁽³⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	02.01.2034	2.400	(47)	0,00
Erhalt ⁽³⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,810	02.01.2034	2.200	(54)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,830	12.10.2053	1.200	118	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,842	26.12.2033	1.800	(48)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,854	29.12.2033	4.700	(132)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,870	17.10.2053	2.000	212	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,880	16.10.2053	500	54	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,950	19.12.2033	3.600	(129)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,030	04.10.2033	900	42	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,030	15.12.2033	3.000	(126)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,150	12.10.2033	3.200	184	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,155	02.10.2033	5.700	327	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,165	27.09.2033	5.200	302	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,170	03.10.2033	7.000	410	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,175	10.10.2033	4.000	236	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,220	20.10.2033	2.400	152	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,230	23.10.2033	1.900	122	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	22.11.2033	4.600	(273)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,255	23.10.2033	2.200	146	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,435	01.11.2033	2.300	190	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,450	31.10.2033	2.600	217	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,450	01.11.2033	4.200	353	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	4,870	02.01.2024	BRL 242.300	(5.019)	(0,17)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,680	02.01.2024	19.200	(341)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	6,151	04.01.2027	528.200	(10.028)	(0,35)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	8,075	02.01.2024	120.000	2.039	0,07
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,630	04.01.2027	85.900	(1)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,830	02.01.2026	540.400	341	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,076	04.01.2027	325.100	(54)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,164	02.01.2026	14.390	2	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,512	04.01.2027	115.000	388	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,529	02.01.2026	178.300	(404)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,583	02.01.2029	67.500	(298)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,602	04.01.2027	259.100	564	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,691	02.01.2026	193.000	596	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,751	02.01.2026	73.100	241	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,768	04.01.2027	59.800	(266)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,792	04.01.2027	356.400	1.537	0,05
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,811	02.01.2025	542.910	(88)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,872	04.01.2027	135.200	(663)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,064	04.01.2027	259.100	1.473	0,05
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,169	04.01.2027	96.950	1.077	0,04
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,439	02.01.2029	80.100	293	0,01

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum		Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,040 %	01.04.2024	BRL	1.275.900	\$ (81)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,260	01.04.2024		1.117.600	(74)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,350	01.07.2024		288.000	(101)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,490	01.07.2024		312.400	(199)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	13,080	01.07.2024		542.300	1.019	0,03
Zahlung ⁽³⁾	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,250	20.03.2029	CNY	516.220	91	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,405	20.12.2028		118.100	109	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,115	01.02.2031	COP	14.558.000	171	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,120	01.02.2031		10.388.000	123	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,155	15.01.2031		5.060.000	66	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	5,675	18.06.2031		20.000.000	472	0,02
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,380	21.01.2029		9.688.000	35	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,590	17.07.2033		66.033.000	231	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,680	17.07.2028		111.053.000	(141)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,705	26.03.2031		62.868.510	(194)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,020	04.12.2030		24.925.400	(166)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,215	14.11.2028		81.386.200	(376)	(0,01)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,820	05.06.2028		50.580.700	255	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,050	03.10.2028		21.836.600	284	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,300	26.03.2031		35.440.700	(883)	(0,03)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,490	30.06.2032		6.936.040	203	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,790	20.01.2028		45.916.600	797	0,03
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,800	17.01.2028		54.120.000	936	0,03
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,820	27.02.2033		9.049.540	(315)	(0,01)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,130	25.01.2028		42.970.500	887	0,03
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,400	21.11.2029		3.111.360	(106)	0,00
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	3,590	18.05.2028	ILS	28.600	(283)	(0,01)
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	3,792	06.11.2028		38.100	(60)	0,00
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	3,580	20.12.2033	KRW	8.804.430	303	0,01
Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	3,700	20.12.2025		35.867.400	(194)	(0,01)
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	3,820	20.12.2028		40.181.300	1.191	0,04
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,205	22.04.2027	ZAR	178.200	182	0,01
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,210	22.04.2027		137.000	138	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,565	22.03.2026		300.200	62	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,808	28.11.2025		272.900	17	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,070	30.11.2028		83.300	(10)	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,120	13.03.2028		4.890	2	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,140	16.11.2028		268.100	(77)	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,185	31.07.2026		106.600	(60)	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,195	21.12.2026		505.800	(321)	(0,01)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,276	28.02.2028		263.600	209	0,01
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,410	13.07.2025		312.500	(12)	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,410	10.11.2028		260.400	(236)	(0,01)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,440	02.11.2028		366.800	330	0,01
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,500	21.12.2026		330.800	357	0,01
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,530	31.01.2030		120.000	(72)	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,548	31.01.2030		120.000	(78)	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,650	31.10.2028		82.100	120	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,650	31.01.2030		64.630	(60)	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,670	21.12.2026		363.400	482	0,02
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,695	31.01.2030		141.100	(148)	(0,01)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,700	31.01.2030		140.400	(149)	(0,01)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,735	31.01.2030		110.200	(127)	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,820	31.01.2030		95.300	(132)	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	9,220	28.11.2033		86.100	17	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	9,290	26.05.2028		221.400	(187)	(0,01)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	9,455	31.01.2030		41.200	128	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	9,470	31.01.2030		400.000	1.261	0,04
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	10,150	18.05.2033		121.800	501	0,02
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,390	30.12.2028	AUD	74.740	1.067	0,04
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,750	20.12.2028		264.690	4.361	0,15
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,420	01.09.2030	CLP	1.005.150	82	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	4,410	01.09.2030		2.839.400	119	0,00
Erhalt ⁽³⁾	6-Month CLP-CHILIBOR	4,640	01.10.2028		4.335.000	9	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,030	20.03.2033		5.309.140	3	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,160	01.10.2028		6.310.500	(63)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,175	01.10.2028		9.739.070	(105)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,175	29.11.2033		2.062.000	28	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,220	01.10.2028		4.896.800	(69)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,230	17.11.2033		721.200	20	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,240	01.09.2030		3.103.000	(46)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,260	17.11.2028		4.919.000	(110)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,300	18.05.2033		2.475.470	(79)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,310	16.11.2028		3.386.800	87	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,320	16.11.2028		1.693.500	45	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,350	01.09.2030		4.575.000	(106)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,360	18.05.2033		2.594.000	(98)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,400	01.04.2033		3.613.700	(123)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,400	16.11.2033		4.525.900	180	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,500	13.11.2028		4.865.500	(111)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,550	01.10.2028		3.722.930	(85)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,690	01.09.2030		598.400	(31)	0,00

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		5,780 %	03.10.2028	CLP 4.803.000	\$ (205)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		5,790	06.10.2033	8.590.000	(622)	(0,02)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		5,820	01.09.2030	1.514.470	(87)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		5,855	05.10.2033	8.427.000	(638)	(0,02)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		5,870	11.10.2033	4.522.700	(355)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		5,890	29.11.2025	7.606.200	(60)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		5,920	02.10.2028	1.891.000	(93)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		5,940	20.10.2033	1.991.300	(171)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		5,990	20.10.2033	18.919.110	(1.701)	(0,06)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		6,000	02.10.2028	3.721.000	(199)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		6,146	30.10.2032	32.521.400	(3.296)	(0,11)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		6,235	26.10.2033	5.823.100	(660)	(0,02)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR		4,070	23.11.2028	CZK 255.900	(17)	0,00
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR		4,388	15.11.2028	257.400	(300)	(0,01)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR		4,611	06.06.2028	441.490	1.023	0,04
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR		2,750	20.03.2054	€ 12.700	(1.445)	(0,05)
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR		2,760	03.01.2029	4.000	(60)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		2,880	19.12.2028	4.900	(99)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		2,890	22.12.2033	5.200	(177)	(0,01)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		2,910	29.12.2033	3.000	(110)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		2,920	13.12.2028	8.600	(188)	(0,01)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		2,950	29.12.2028	3.300	(81)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		2,970	15.12.2033	4.300	(178)	(0,01)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		2,990	08.12.2033	3.700	(160)	(0,01)
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR		3,000	20.03.2034	37.600	2.139	0,07
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		3,063	06.12.2033	3.600	(181)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		3,100	20.09.2030	40.700	1.777	0,06
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		3,128	04.12.2033	2.500	(140)	(0,01)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		3,148	20.11.2033	3.200	(183)	(0,01)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		3,179	29.11.2028	3.200	(109)	0,00
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR		3,250	20.03.2029	38.400	601	0,02
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		3,255	22.11.2028	800	(30)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		3,270	08.11.2028	6.800	(254)	(0,01)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		3,280	22.11.2033	2.200	(154)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		3,300	03.10.2033	20.600	1.642	0,06
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		3,305	27.11.2033	500	(36)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		3,329	27.10.2033	29.300	2.182	0,08
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		3,370	09.10.2028	1.500	68	0,00
Zahlung	6-Month HUF-BBR		1,500	19.06.2024	HUF 5.281.500	(300)	(0,01)
Zahlung	6-Month HUF-BBR		1,760	21.01.2030	1.296.900	235	0,01
Zahlung	6-Month HUF-BBR		2,420	02.08.2026	3.964.700	(1.588)	(0,06)
Zahlung	6-Month HUF-BBR		2,680	29.06.2031	1.938.800	(576)	(0,02)
Zahlung	6-Month HUF-BBR		4,790	17.01.2027	7.857.000	(999)	(0,04)
Zahlung	6-Month HUF-BBR		7,330	06.11.2028	1.824.800	129	0,00
Zahlung	6-Month HUF-BBR		7,610	03.11.2028	2.414.000	478	0,02
Zahlung	6-Month HUF-BBR		8,670	23.05.2029	1.828.200	933	0,03
Erhalt	6-Month HUF-BBR		8,700	16.01.2028	1.002.200	(333)	(0,01)
Zahlung	6-Month HUF-BBR		8,740	28.04.2028	1.920.800	556	0,02
Zahlung	6-Month HUF-BBR		9,230	26.08.2032	1.440.400	884	0,03
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR		0,925	16.10.2030	PLN 1.500	(44)	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		1,460	28.05.2026	67.700	(281)	(0,01)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		2,585	14.10.2029	15.200	289	0,01
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		2,920	13.12.2031	3.800	97	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		4,075	07.03.2027	37.000	22	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR		4,560	06.11.2028	25.600	120	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		4,680	03.11.2028	14.200	(67)	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		4,710	25.05.2027	73.900	(380)	(0,01)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		4,735	09.10.2028	62.400	(206)	(0,01)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		4,740	25.10.2033	46.000	(244)	(0,01)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR		4,885	30.11.2033	17.800	121	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		4,910	25.07.2027	29.920	(49)	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		5,220	30.11.2025	75.900	(51)	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		5,220	20.03.2033	4.100	(86)	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		5,310	21.03.2033	40.800	(771)	(0,03)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		5,870	22.04.2027	1.000	(18)	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		5,960	25.04.2027	67.900	(1.274)	(0,04)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		6,456	25.05.2027	20.800	(487)	(0,02)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		6,480	25.05.2027	45.100	(1.069)	(0,04)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		6,560	25.05.2027	15.800	(386)	(0,01)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		6,830	19.08.2024	52.600	(79)	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		6,890	22.08.2024	119.500	(200)	(0,01)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		7,310	30.06.2027	15.300	(483)	(0,02)
Erhalt	28-Day MXN-TIE		8,035	31.05.2029	MXN 42.010	55	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE		8,300	16.06.2028	437.770	(203)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIE		8,400	23.11.2034	10.100	4	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIE		8,700	17.11.2033	79.700	(76)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIE		8,720	01.03.2029	228.800	(80)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIE		8,828	16.11.2033	304.500	(445)	(0,02)
Erhalt	28-Day MXN-TIE		9,295	30.10.2028	291.300	(357)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIE		9,440	04.03.2027	485.300	309	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIE		9,620	21.09.2033	311.500	1.053	0,04

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	10,055 %	04.03.2027	MXN 248.000	\$ 412	0,01	
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	10,090	04.03.2027	130.800	225	0,01	
						\$ (1.875)	(0,06)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						\$ (4.074)	(0,14)

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

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

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

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

OPTIONSKAUF

DEVIENOPTIENEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens	
BOA	Call - OTC USD versus INR	INR 92,600	16.06.2025	2.200	\$ 132	\$ 10	0,00	
	Put - OTC USD versus INR	92,600	16.06.2025	2.200	132	180	0,01	
GLM	Call - OTC USD versus JPY	¥ 167,000	05.11.2024	9.422	482	167	0,00	
JPM	Put - OTC EUR versus PLN	PLN 4,400	22.08.2024	3.065	768	1.785	0,06	
MYI	Put - OTC GBP versus USD	\$ 1,160	12.06.2024	109.508	435	234	0,01	
						\$ 1.949	\$ 2.376	0,08

VERKAUFSOPTIONEN

DEVIENOPTIENEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens	
BOA	Call - OTC USD versus BRL	BRL 4,923	26.06.2024	17.100	\$ (706)	\$ (655)	(0,02)	
	Put - OTC USD versus BRL	4,923	26.06.2024	17.100	(706)	(607)	(0,02)	
	Call - OTC USD versus MXN	MXN 17,449	26.06.2024	17.100	(591)	(576)	(0,02)	
	Put - OTC USD versus MXN	17,449	26.06.2024	17.100	(591)	(593)	(0,02)	
CBK	Call - OTC USD versus BRL	BRL 4,968	20.06.2024	51.900	(2.155)	(1.747)	(0,06)	
	Put - OTC USD versus BRL	4,968	20.06.2024	51.900	(2.155)	(2.085)	(0,07)	
	Call - OTC USD versus MXN	MXN 17,450	01.07.2024	15.800	(551)	(546)	(0,02)	
	Put - OTC USD versus MXN	17,450	01.07.2024	15.800	(551)	(548)	(0,02)	
DUB	Call - OTC USD versus TRY	TRY 40,385	28.10.2024	3.287	(330)	(220)	(0,01)	
	Put - OTC USD versus TRY	40,385	28.10.2024	3.287	(330)	(354)	(0,01)	
GLM	Call - OTC USD versus TRY	40,250	30.10.2024	3.318	(333)	(228)	(0,01)	
	Put - OTC USD versus TRY	40,250	30.10.2024	3.318	(333)	(349)	(0,01)	
	Call - OTC USD versus TRY	39,800	31.10.2024	1.664	(167)	(121)	0,00	
	Put - OTC USD versus TRY	39,800	31.10.2024	1.664	(167)	(161)	(0,01)	
	Call - OTC USD versus TRY	40,930	07.11.2024	1.705	(161)	(115)	0,00	
	Put - OTC USD versus TRY	40,930	07.11.2024	1.705	(161)	(195)	(0,01)	
	Call - OTC USD versus TRY	41,150	07.11.2024	1.705	(161)	(113)	0,00	
	Put - OTC USD versus TRY	41,150	07.11.2024	1.705	(161)	(202)	(0,01)	
	Call - OTC USD versus TRY	41,160	11.11.2024	1.701	(161)	(115)	0,00	
	Put - OTC USD versus TRY	41,160	11.11.2024	1.701	(161)	(199)	(0,01)	
	Put - OTC USD versus TWD	TWD 31,000	04.03.2024	7.469	(104)	(217)	(0,01)	
JPM	Call - OTC USD versus IDR	IDR 14.950,000	06.06.2024	7.776	(263)	(311)	(0,01)	
	Put - OTC USD versus IDR	14.950,000	06.06.2024	7.776	(238)	(52)	0,00	
	Put - OTC USD versus TWD	TWD 31,000	01.03.2024	20.196	(273)	(581)	(0,02)	
MYI	Call - OTC USD versus IDR	IDR 15.370,000	13.08.2024	15.626	(499)	(431)	(0,02)	
	Put - OTC USD versus IDR	15.370,000	13.08.2024	15.626	(499)	(304)	(0,01)	
	Call - OTC USD versus MXN	MXN 19,500	07.03.2024	22.599	(256)	(35)	0,00	
	Call - OTC USD versus MXN	17,449	26.06.2024	23.800	(823)	(803)	(0,03)	
	Put - OTC USD versus MXN	17,449	26.06.2024	23.800	(823)	(824)	(0,03)	
SOG	Put - OTC EUR versus PLN	PLN 4,220	15.03.2024	52.060	(290)	(127)	0,00	
	Call - OTC EUR versus PLN	4,430	15.03.2024	52.060	(355)	(430)	(0,02)	
						\$ (15.055)	\$ (13.844)	(0,48)

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BPS	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,494 %	08.01.2024	900	\$ (4)	\$ (7)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,545	16.01.2024	4.800	(22)	(60)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,994	08.01.2024	900	(4)	0	0,00

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
CBK	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,995 %	16.01.2024	4.800	\$ (22)	\$ (1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,235	22.01.2024	800	(3)	(3)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,685	22.01.2024	800	(3)	(2)	0,00
FAR	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,590	05.01.2024	3.500	(13)	(39)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,960	05.01.2024	3.500	(13)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,273	16.01.2024	5.000	(21)	(14)	0,00
GLM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,550	16.01.2024	2.700	(12)	(35)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,723	16.01.2024	5.000	(21)	(8)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,000	16.01.2024	2.700	(12)	(1)	0,00
GST	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,215	22.01.2024	1.400	(6)	(4)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300	16.01.2024	1.700	(7)	(6)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,648	04.01.2024	2.200	(10)	(36)	0,00
JPM	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,665	22.01.2024	1.400	(6)	(5)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	16.01.2024	1.700	(7)	(2)	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,440	08.01.2024	3.700	(9)	(13)	0,00
MYC	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,860	08.01.2024	3.700	(8)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,170	29.01.2024	2.300	(10)	(7)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,205	22.01.2024	100	0	0	0,00
MYC	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,620	29.01.2024	2.300	(10)	(12)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,655	22.01.2024	100	0	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,490	12.01.2024	3.600	(14)	(28)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,650	04.01.2024	4.300	(16)	(68)	(0,01)
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,890	12.01.2024	3.600	(14)	(2)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,030	04.01.2024	4.300	(16)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,475	08.01.2024	900	(4)	(6)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,600	12.01.2024	1.000	(5)	(16)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,975	08.01.2024	900	(4)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,050	12.01.2024	1.000	(5)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,330	15.01.2024	1.400	(6)	(4)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,740	15.01.2024	1.400	(6)	(2)	0,00
							\$ (313)	\$ (381)	(0,01)

(1) Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
CBK	Turkey Government International Bond	(1,000) %	20.12.2024	\$ 2.700	\$ 165	\$ (177)	\$ (12)	0,00

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
CBK	Petroleos Mexicanos	1,000 %	20.06.2024	\$ 12.000	\$ (371)	\$ 339	\$ (32)	0,00
DUB	Eskom Holdings SOC Ltd.	4,650	30.06.2029	11.200	0	972	972	0,03
GST	Poland Government International Bond	1,000	20.06.2024	3.400	15	1	16	0,00
JPM	Banco do Brasil S.A.	1,000	20.12.2024	6.500	(146)	143	(3)	0,00
					\$ (502)	\$ 1.455	\$ 953	0,03

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

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

(3) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

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
BOA	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS zzgl. 0,053 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month PHP-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	20.06.2025	\$ 107.616	PHP 6.147.000	\$ (561)	\$ (850)	\$ (1.411)	(0,05)

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Erhalt	Zahlung	Fälligkeits- datum	Nennbetrag erhaltener Währung	Nennbetrag gelieferter Währung	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
GLM	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS zzgl. 0,053 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month PHP-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	20.03.2029	\$ 13.274	PHP 737.900	\$ (2)	\$ (134)	\$ (136)	0,00
	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS zzgl. 0,061% basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month IDR-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	20.03.2029	38.086	IDR 596.123.530	(78)	(369)	(447)	(0,02)
	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS zzgl. 0,051% basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month PHP-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	20.03.2029	4.357	PHP 242.866	5	(14)	(9)	0,00
	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS zzgl. 0,053% basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month PHP-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	20.03.2029	4.376	243.240	(1)	(44)	(45)	0,00
	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS zzgl. 0,056 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month PHP-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	20.06.2025	16.657	947.960	(19)	(185)	(204)	(0,01)
JPM	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	1.900	ARS 85.633	0	1.842	1.842	0,07
	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)	4.688	4.673	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)	2.078	2.075	0,07
	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS zzgl. 0,054 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month PHP-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	20.03.2029	13.078	PHP 724.510	3	(200)	(197)	(0,01)
	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS zzgl. 0,056 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month PHP-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	20.06.2025	16.923	963.240	(22)	(186)	(208)	(0,01)
						\$ (693)	\$ 6.626	\$ 5.933	0,21

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 ⁽¹⁾	3-Month MYR-KLIBOR	3,500 %	20.03.2029	MYR 50	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BRC	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,950	20.06.2028	ILS 28.900	0	(392)	(392)	(0,01)
BSH	Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,300	21.06.2029	CLP 3.450.000	0	273	273	0,01

Kontrahent	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
CBK	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,750 %	22.03.2026	CLP 8.000.000	\$ 0	\$ (410)	\$ (410)	(0,01)
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,790	14.03.2026	3.885.000	7	(208)	(201)	(0,01)
	Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	5,960	10.05.2029	COP 27.236.900	0	511	511	0,02
GLM	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,763	24.05.2029	CLP 1.841.700	10	(188)	(178)	(0,01)
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,770	19.03.2026	64.800	0	(3)	(3)	0,00
	Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,708	02.01.2025	BRL 18.800	0	4	4	0,00
	Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,015	20.06.2026	CLP 5.555.000	0	304	304	0,01
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,265	14.06.2029	4.122.200	0	(341)	(341)	(0,01)
GST	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,830	22.05.2029	7.729.900	0	(424)	(424)	(0,02)
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	4,095	01.06.2027	12.230.000	0	(377)	(377)	(0,01)
	Zahlung ⁽¹⁾	6-Month CLP-CHILIBOR	4,319	22.05.2029	19.808.000	0	(127)	(127)	0,00
	Zahlung ⁽¹⁾	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	20.03.2027	MYR 476.920	64	31	95	0,00
	Erhalt ⁽¹⁾	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	20.03.2029	481.150	469	(62)	407	0,01
JPM	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	3,868	20.12.2028	28.100	0	82	82	0,00
MYC	Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,540	04.06.2029	CLP 4.115.000	0	284	284	0,01
	Zahlung	1-Year BRL-CDI	7,800	04.01.2027	BRL 12.200	17	(117)	(100)	0,00
						\$ 567	\$ (1.160)	\$ (593)	(0,02)

⁽¹⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	01.2024	\$ 2.535	AUD 3.828	\$ 77	\$ 0	\$ 77	0,00
	03.2024	CNH 12.314	\$ 1.708	0	(31)	(31)	0,00
BOA	01.2024	CLP 1.964.976	2.256	6	0	6	0,00
	01.2024	DOP 141.594	2.473	48	0	48	0,00
01.2024	£ 381	484	0	(2)	(2)	0,00	
	HUF 7.266.296	19.860	0	(1.080)	(1.080)	(0,04)	
01.2024	KZT 1.731.131	3.636	0	(133)	(133)	0,00	
	PEN 101.314	27.303	0	(45)	(45)	0,00	
01.2024	PLN 18.631	4.355	0	(382)	(382)	(0,01)	
	\$ 384	AUD 581	12	0	12	0,00	
01.2024	4.366	COP 16.699.329	0	(60)	(60)	0,00	
	7.129	HUF 2.629.653	449	0	449	0,02	
01.2024	2.626	¥ 387.559	124	0	124	0,00	
	3.563	KZT 1.657.857	46	0	46	0,00	
01.2024	35.104	MXN 609.593	733	0	733	0,03	
	653	MYR 3.030	9	0	9	0,00	
01.2024	789	NOK 8.386	37	0	37	0,00	
	11.495	PLN 48.125	740	0	740	0,03	
01.2024	1.120	TRY 33.068	0	(3)	(3)	0,00	
	02.2024	CNY 17.120	\$ 2.373	0	(48)	(48)	0,00
02.2024	DOP 311.118	5.381	50	0	50	0,00	
	EGP 7.943	228	41	0	41	0,00	
02.2024	KZT 239.796	495	0	(27)	(27)	0,00	
	\$ 32.113	CNY 226.960	0	(24)	(24)	0,00	
02.2024	8.063	EGP 279.769	0	(480)	(480)	(0,02)	
	927	KES 147.671	2	0	2	0,00	
02.2024	11.245	TRY 353.321	310	0	310	0,01	
	50.569	\$ 6.978	0	(164)	(164)	(0,01)	
03.2024	COP 16.699.329	4.303	58	0	58	0,00	
	DOP 14.158	247	5	0	5	0,00	
03.2024	MYR 116.846	24.720	0	(900)	(900)	(0,03)	
	\$ 24.720	CNH 179.665	657	0	657	0,02	
03.2024	14.783	IDR 235.463.987	486	0	486	0,02	
	483	INR 40.380	1	0	1	0,00	
03.2024	17	PHP 947	0	0	0	0,00	
	MYR 54.906	\$ 11.996	0	(59)	(59)	0,00	
04.2024	\$ 11.970	MYR 55.218	153	0	153	0,01	
	2.167	BRL 10.667	0	(9)	(9)	0,00	
06.2024	625	KES 104.721	6	0	6	0,00	
	3.069	MXN 53.552	2	0	2	0,00	
03.2030	12.534	IDR 246.110.438	1.275	0	1.275	0,04	
	01.2024	BRL 41.740	\$ 8.571	0	(22)	(22)	0,00
01.2024	EGP 26.122	746	0	(30)	(30)	0,00	
	€ 21.976	23.999	0	(282)	(282)	(0,01)	
01.2024	£ 1.452	1.842	0	(9)	(9)	0,00	
	¥ 2.277.500	16.064	0	(127)	(127)	0,00	
01.2024	PEN 3.662	983	0	(5)	(5)	0,00	
	01.2024	PLN 65.363	14.864	0	(1.754)	(1.754)	(0,06)
01.2024	TRY 11	0	0	0	0	0,00	
	\$ 7.168	AUD 10.699	134	0	134	0,00	
01.2024	4.148	CAD 5.624	118	0	118	0,00	
	1.147	EGP 37.804	0	(17)	(17)	0,00	
01.2024	5.399	€ 4.917	50	(16)	34	0,00	
	99.469	HUF 34.908.407	1.129	0	1.129	0,04	
01.2024	58.128	¥ 8.205.000	109	0	109	0,00	
	01.2024	6.215	MXN 113.983	486	0	486	0,02

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	01.2024	\$	18.756	PLN	79.225	\$ 1.386	0,05
	01.2024	ZAR	1.865.846	\$	100.648	0	(0,04)
	02.2024	EGP	44.730		1.153	0	0,00
	02.2024	KZT	451.638		953	0	0,00
	02.2024	TWD	164.941		5.189	0	(0,01)
	02.2024	\$	8.968	CNY	63.615	25	0,00
	03.2024	CLP	2.695.790	\$	3.114	39	0,00
	03.2024	CNH	29.566		4.079	0	0,00
	03.2024	IDR	382.188.319		24.384	26	(0,01)
	03.2024	THB	127.731		3.594	0	(0,01)
	03.2024	TWD	382.317		12.291	0	(0,01)
	03.2024	\$	68.521	CNH	496.297	1.578	0,05
	03.2024		15.590	IDR	243.952.096	230	0,01
	03.2024		1.677	INR	140.257	3	0,00
	03.2024		10.757	PEN	40.195	73	0,00
	12.2024		1.899	EGP	92.680	0	0,00
BRC	01.2024	NZD	12.038	\$	7.406	0	(0,01)
	01.2024	TRY	1.119		37	0	0,00
	01.2024	\$	783	HUF	278.189	19	0,00
	01.2024		9.879	MXN	173.326	310	0,01
	01.2024		4.882	MYR	22.335	0	0,00
	01.2024		124.586	PLN	543.145	13.504	0,46
	01.2024		23.233	TRY	689.977	5	0,00
	02.2024		11.312	RON	51.773	176	0,01
	02.2024		20.990	TRY	650.743	185	0,00
	03.2024		1.015	RSD	108.697	10	0,00
	03.2024		13	THB	452	0	0,00
	03.2024		18.797	TRY	590.201	61	0,00
	04.2024		2.390		77.029	0	(0,01)
BSH	02.2024	CLP	4.347.403	\$	4.901	0	0,00
	02.2024	¥	5.620.000		40.031	0	(0,01)
CBK	01.2024	BRL	54.752		11.245	0	(0,01)
	01.2024	CLP	25.703.966		29.474	98	0,00
	01.2024	COP	335.445.850		83.950	235	(0,09)
	01.2024	EGP	29.698		807	0	(0,01)
	01.2024	HUF	42.548		123	0	0,00
	01.2024	¥	2.217.900		15.590	0	(0,01)
	01.2024	MXN	2.344.810		128.939	0	(0,31)
	01.2024	PLN	45.336		11.257	1	(0,01)
	01.2024	\$	3.724	AUD	5.504	36	0,00
	01.2024		8.533	BRL	41.709	53	0,00
	01.2024		5.379	CAD	7.197	80	0,00
	01.2024		3.614	CHF	3.148	129	0,00
	01.2024		16.902	CLP	14.986.793	258	0,01
	01.2024		41.121	COP	161.929.065	678	0,02
	01.2024		2.806	€	2.594	60	0,00
	01.2024		447	HUF	156.759	5	0,00
	01.2024		15.819	¥	2.233.500	34	0,00
	01.2024		191.264	MXN	3.370.725	6.892	0,24
	01.2024		190	NOK	2.028	10	0,00
	01.2024		6.923	PEN	25.750	28	0,00
	01.2024		8.561	PLN	36.980	841	0,03
	01.2024		3.010	ZAR	56.761	89	0,00
	01.2024		1.219	ZMW	30.108	0	(0,01)
	01.2024	ZAR	593.400	\$	32.183	0	(0,01)
	02.2024	BRL	41.709		8.497	0	(0,01)
	02.2024	EGP	227.732		6.386	500	0,02
	02.2024	RON	72.699		15.779	0	(0,01)
	02.2024	\$	139.492	BRL	705.788	5.568	0,19
	02.2024		26.678	CNY	190.332	233	0,01
	02.2024		3.165	EGP	110.309	0	(0,01)
	02.2024		5.396	RON	24.705	86	0,00
	02.2024		565	UYU	22.441	9	0,00
	02.2024	ZMW	57.765	\$	2.517	275	0,01
	03.2024	CLP	15.048.484		16.902	0	(0,01)
	03.2024	CNH	74.212		10.257	0	(0,01)
	03.2024	EGP	9.371		266	51	0,00
	03.2024	IDR	86.157.354		5.529	0	(0,01)
	03.2024	ILS	1.754		482	0	(0,01)
	03.2024	¥	920.000		6.564	0	(0,01)
	03.2024	PEN	11.511		3.044	0	(0,01)
	03.2024	\$	80.112	BRL	395.801	878	0,03
	03.2024		4.571	EGP	168.891	0	(0,03)
	03.2024		8.960	IDR	138.429.735	18	0,00
	03.2024		30.513	PEN	113.429	90	0,00
	03.2024	ZMW	77.313	\$	3.135	155	0,01
	04.2024	\$	11.245	BRL	55.307	47	0,00
	04.2024		6.074	EGP	230.221	0	(0,03)
	04.2024		2.417	KES	396.910	25	0,00
	04.2024		1.941	TRY	65.210	33	0,00
	06.2024	£	4.181	\$	5.250	0	(0,01)
	06.2024	\$	6.706	BRL	33.312	37	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	\$ 1.956	KES 329.541	\$ 31	\$ 0	\$ 31	0,00
	07.2024	2.819	MXN 49.190	0	(1)	(1)	0,00
	10.2024	7.613	COP 33.207.906	527	0	527	0,02
	12.2024	1.453	EGP 70.419	0	(68)	(68)	0,00
	01.2025	7.613	COP 33.558.104	494	0	494	0,02
	04.2025	7.613	34.144.305	531	0	531	0,02
	10.2025	3.831	18.664.632	508	0	508	0,02
DUB	01.2024	HUF 1.590.298	\$ 4.281	0	(302)	(302)	(0,01)
	01.2024	NGN 384.375	625	244	0	244	0,01
	01.2024	PLN 3.186	797	0	(13)	(13)	0,00
	01.2024	\$ 332	MXN 5.927	16	0	16	0,00
	01.2024	611	PLN 2.394	2	(4)	(2)	0,00
	01.2024	129	ZAR 2.458	5	0	5	0,00
	01.2024	1.184	ZMW 29.553	0	(37)	(37)	0,00
	02.2024	EGP 225.836	\$ 6.512	391	0	391	0,01
	02.2024	\$ 65.325	BRL 320.413	529	0	529	0,02
	02.2024	8.173	EGP 287.242	0	(767)	(767)	(0,03)
	02.2024	2.139	ZMW 50.267	0	(188)	(188)	(0,01)
	03.2024	CNH 19.140	\$ 2.656	111	(47)	(47)	0,00
	03.2024	\$ 5.177	CNH 37.439	111	0	111	0,00
	03.2024	28.169	CZK 629.254	0	(71)	(71)	0,00
	03.2024	1.462	SGD 1.935	10	0	10	0,00
	04.2024	TRY 2.282	\$ 73	3	0	3	0,00
	04.2024	\$ 793	KES 129.656	4	0	4	0,00
	08.2024	€ 20.306	PLN 93.764	1.078	0	1.078	0,04
	10.2024	\$ 1.118	TRY 45.133	48	0	48	0,00
	11.2024	¥ 1.030.144	\$ 7.297	0	(337)	(337)	(0,01)
GLM	01.2024	AUD 6.553	4.394	0	(79)	(79)	0,00
	01.2024	CAD 17.030	12.532	0	(385)	(385)	(0,01)
	01.2024	CHF 10.648	12.151	0	(507)	(507)	(0,02)
	01.2024	COP 66.990.836	15.796	0	(1.496)	(1.496)	(0,05)
	01.2024	DOP 2.163.811	37.841	746	0	746	0,03
	01.2024	EGP 101.314	2.695	0	(334)	(334)	(0,01)
	01.2024	HUF 2.273.778	6.126	0	(427)	(427)	(0,02)
	01.2024	MXN 2.410.262	137.587	2	(4.108)	(4.106)	(0,14)
	01.2024	\$ 17.527	COP 66.990.836	0	(235)	(235)	(0,01)
	01.2024	3.055	EGP 100.557	0	(49)	(49)	0,00
	01.2024	564	HUF 196.745	3	0	3	0,00
	01.2024	11.990	MXN 208.993	296	0	296	0,01
	01.2024	12.927	TRY 389.484	148	0	148	0,01
	01.2024	ZAR 160.293	\$ 9.119	360	0	360	0,01
	02.2024	DOP 963.461	16.744	212	0	212	0,01
	02.2024	EGP 22.626	647	116	0	116	0,00
	02.2024	KZT 397.826	846	0	(20)	(20)	0,00
	02.2024	\$ 907	EGP 32.747	0	(137)	(137)	(0,01)
	02.2024	3.627	KZT 1.683.848	38	0	38	0,00
	02.2024	4.038	TRY 123.409	2	0	2	0,00
	03.2024	CNH 17.421	\$ 2.414	0	(46)	(46)	0,00
	03.2024	DOP 1.515.719	26.498	563	0	563	0,02
	03.2024	IDR 101.964.502	6.576	0	(36)	(36)	0,00
	03.2024	\$ 35.293	CZK 787.923	0	(110)	(110)	0,00
	03.2024	704	TRY 22.094	0	(8)	(8)	0,00
	03.2024	3.557	TWD 110.186	88	0	88	0,00
	04.2024	DOP 143.308	\$ 2.492	50	0	50	0,00
	08.2024	\$ 3.630	COP 15.688.860	249	0	249	0,01
	10.2024	1.128	TRY 45.402	43	0	43	0,00
	11.2024	7.297	¥ 1.031.316	346	0	346	0,01
	11.2024	2.355	TRY 96.033	109	0	109	0,00
	04.2025	15.796	COP 72.164.026	1.417	0	1.417	0,05
IND	01.2024	42.058	€ 38.361	327	0	327	0,01
	01.2024	7.576	ZAR 138.703	0	(3)	(3)	0,00
	06.2024	7.206	TWD 185.403	0	(997)	(997)	(0,03)
JPM	01.2024	BRL 26.149	\$ 5.417	34	0	34	0,00
	01.2024	EGP 65.662	1.817	0	(141)	(141)	(0,01)
	01.2024	PLN 138.195	31.514	0	(3.621)	(3.621)	(0,13)
	01.2024	\$ 5.440	BRL 26.237	0	(39)	(39)	0,00
	01.2024	499	EGP 16.406	0	(8)	(8)	0,00
	01.2024	4.327	HUF 1.521.537	58	0	58	0,00
	01.2024	30.744	MXN 542.237	1.133	0	1.133	0,04
	01.2024	82	NGN 67.814	0	(15)	(15)	0,00
	01.2024	22.023	PLN 92.010	1.370	0	1.370	0,05
	01.2024	18.170	TRY 539.342	0	(49)	(49)	0,00
	01.2024	531	ZAR 10.213	27	0	27	0,00
	01.2024	ZMW 43.329	\$ 1.888	206	0	206	0,01
	02.2024	EGP 144.800	4.035	518	0	518	0,02
	02.2024	KZT 178.766	379	0	(10)	(10)	0,00
	02.2024	\$ 491	EGP 17.695	0	(75)	(75)	0,00
	02.2024	11.121	INR 929.100	18	0	18	0,00
	02.2024	3.050	TRY 93.092	0	(17)	(17)	0,00
	03.2024	AED 29.435	\$ 8.021	1	0	1	0,00
	03.2024	CLP 2.581.710	2.863	0	(82)	(82)	0,00
	03.2024	CNH 171.068	23.599	0	(564)	(564)	(0,02)

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	03.2024	CZK 272.835	\$ 12.145	\$ 0	\$ (37)	\$ (37)	0,00
	03.2024	EGP 71.883		133	0	133	0,00
	03.2024	IDR 61.095.991		0	(27)	(27)	0,00
	03.2024	\$ 3.419	CNH 24.285	11	0	11	0,00
	03.2024	19.589	IDR 304.089.389	130	0	130	0,00
	03.2024	503	INR 42.039	1	0	1	0,00
	03.2024	10.556	TWD 327.284	269	0	269	0,01
	04.2024	KES 802.538	\$ 5.222	282	0	282	0,01
	04.2024	TRY 267.487		350	0	350	0,01
	04.2024	\$ 5.417	BRL 26.412	0	(25)	(25)	0,00
	04.2024	2.684	KES 438.883	19	0	19	0,00
	04.2024	2.330	TRY 69.917	0	(190)	(190)	(0,01)
	06.2024	1.104	IDR 16.560.000	0	(31)	(31)	0,00
	06.2024	354	KRW 458.914	3	0	3	0,00
	08.2024	PLN 93.519	€ 20.306	0	(1.016)	(1.016)	(0,04)
	08.2024	\$ 7.568	COP 32.729.708	525	0	525	0,02
	09.2024	€ 4.640	PLN 22.010	388	0	388	0,01
	09.2024	PLN 10.106	€ 2.231	0	(66)	(66)	0,00
	12.2024	\$ 2.519	EGP 121.881	0	(122)	(122)	0,00
	03.2030	IDR 252.540.875	\$ 12.118	0	(2.052)	(2.052)	(0,07)
	03.2030	\$ 11.598	IDR 246.110.438	2.211	0	2.211	0,08
MBC	01.2024	€ 48.414	\$ 52.644	0	(849)	(849)	(0,03)
	01.2024	HUF 10.922.002		0	(1.921)	(1.921)	(0,07)
	01.2024	¥ 8.557.500		0	(869)	(869)	(0,03)
	01.2024	PLN 18.619		0	(33)	(33)	0,00
	01.2024	\$ 1.191	AUD 1.795	35	0	35	0,00
	01.2024	992	EGP 32.681	0	(15)	(15)	0,00
	01.2024	1.685	€ 1.540	16	0	16	0,00
	01.2024	2.869	PLN 11.534	64	0	64	0,00
	01.2024	1.018	ZAR 18.621	2	(2)	0	0,00
	02.2024	CLP 1.131.755	\$ 1.291	0	(1)	(1)	0,00
	02.2024	CNY 113.835		0	(339)	(339)	(0,01)
	02.2024	¥ 800.000		0	(74)	(74)	0,00
	02.2024	\$ 4.978	CNY 35.262	6	0	6	0,00
	02.2024	1.419	EGP 54.891	10	(129)	(119)	0,00
	03.2024	CNH 266.788	\$ 36.756	0	(926)	(926)	(0,03)
	03.2024	PHP 162.297		0	(29)	(29)	0,00
	03.2024	\$ 9.023	CNH 65.040	163	0	163	0,01
	03.2024	5.188	IDR 81.983.796	129	0	129	0,00
	03.2024	3.114	INR 259.463	0	(7)	(7)	0,00
MYI	01.2024	NGN 317.955	\$ 517	202	0	202	0,01
	01.2024	PLN 9.685		0	(79)	(79)	0,00
	01.2024	TRY 198		0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 3.143	EGP 105.605	0	(102)	(102)	0,00
	01.2024	3.424	€ 3.121	24	0	24	0,00
	01.2024	3.586	£ 2.850	48	0	48	0,00
	01.2024	162	HUF 57.544	4	0	4	0,00
	01.2024	999	¥ 147.220	46	0	46	0,00
	01.2024	138	KZT 64.386	2	0	2	0,00
	01.2024	24.480	MYR 114.235	448	0	448	0,02
	01.2024	3.035	NZD 4.935	90	0	90	0,00
	01.2024	586	PLN 2.391	22	0	22	0,00
	01.2024	12.018	ZAR 221.812	97	0	97	0,00
	02.2024	EGP 21.106	\$ 563	19	0	19	0,00
	02.2024	KZT 585.717		0	(34)	(34)	0,00
	02.2024	\$ 61.942	CNY 438.578	68	0	68	0,00
	02.2024	245	EGP 8.859	0	(37)	(37)	0,00
	02.2024	1.613	KZT 746.819	11	0	11	0,00
	03.2024	CNH 11.751	\$ 1.629	0	(30)	(30)	0,00
	03.2024	IDR 293.030.009		0	(593)	(593)	(0,02)
	03.2024	MXN 28.927		0	(50)	(50)	0,00
	03.2024	THB 137.573		0	(37)	(37)	0,00
	03.2024	\$ 591	EGP 21.199	0	(104)	(104)	0,00
	03.2024	18.305	IDR 286.163.042	272	(20)	252	0,01
	06.2024	£ 4.180	\$ 5.249	0	(82)	(82)	0,00
	06.2024	\$ 10.513	£ 8.361	150	0	150	0,01
	06.2024	123	KRW 159.802	2	0	2	0,00
	06.2024	4.253	MXN 74.208	2	0	2	0,00
	08.2024	2.812	IDR 43.220.440	0	(17)	(17)	0,00
RBC	01.2024	14.290	MXN 245.146	121	0	121	0,00
	04.2024	MXN 3.262	\$ 184	0	(5)	(5)	0,00
RYL	01.2024	AUD 6.545		0	(67)	(67)	0,00
	01.2024	\$ 313	ZAR 5.748	1	0	1	0,00
	03.2024	1.938	THB 67.324	47	0	47	0,00
SCX	01.2024	€ 106	\$ 117	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 8.329	BRL 41.020	116	0	116	0,00
	01.2024	1.039	EGP 34.170	0	(17)	(17)	0,00
	01.2024	88	€ 79	0	0	0	0,00
	01.2024	5.363	MXN 94.168	173	0	173	0,01
	01.2024	55.777	MYR 260.539	1.077	0	1.077	0,04
	01.2024	854	NGN 701.988	0	(159)	(159)	(0,01)
	01.2024	2.797	PEN 10.387	6	0	6	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG		PARI (000S)		MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
BBVA Colombia S.A.					
13,093 % fällig am 28.04.2026	COP	6.344.000	\$	1.730	0,06
13,229 % fällig am 10.05.2026		2.726.000		746	0,03
13,365 % fällig am 04.05.2026		3.966.000		1.065	0,04
14,460 % fällig am 13.01.2024		6.028.200		1.551	0,05
16,412 % fällig am 25.04.2024		225.000		58	0,00
Summe Einlagenzertifikate			\$	48.155	1,67
Summe Anlagen			\$	3.126.143	108,51
Sonstige Aktiva und Passiva			\$	(245.202)	(8,51)
Nettovermögen			\$	2.880.941	100,00

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
 (b) Wertpapier per Emissionstermin.
 (c) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.
 (d) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.
 (e) Nullkuponwertpapier.
 (f) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
 (g) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
 (h) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
 (i) Mit dem Teilfonds verbunden.
 (j) 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		12.064	0,42	
DrillCo Holding Lux S.A.	08.06.2023	158		196	0,01	
Flourish Century 6,600 % fällig am 04.02.2022	25.08.2021	2.759		256	0,01	
			\$	17.819	\$ 12.557	0,44

(k) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 294.989 (31. Dezember 2022: USD 86.429) und Barmittel in Höhe von USD null (31. Dezember 2022: USD 1.840) wurden zum 31. Dezember 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 1.885 (31. Dezember 2022: USD null) wurden zum 31. Dezember 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von USD 55.945 (31. Dezember 2022: USD 21.557) wurden zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 12.200 (31. Dezember 2022: USD 28.320) wurden zum 31. Dezember 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 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	\$ 2.660.342	\$ 183.284	\$ 2.843.626
Investmentfonds	233.751	0	0	233.751
Finanzderivate ⁽³⁾	1.240	(1.601)	972	611
Einlagen bei Kreditinstituten	0	48.155	0	48.155
Summen	\$ 234.991	\$ 2.706.896	\$ 184.256	\$ 3.126.143

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

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

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BPS	4,100 %	19.12.2023	TBD ⁽¹⁾	€ (31.948)	\$ (35.343)	(1,23)
	5,540	27.12.2023	TBD ⁽¹⁾	\$ (4.861)	(4.865)	(0,17)
	5,550	27.12.2023	TBD ⁽¹⁾	(6.379)	(6.384)	(0,22)
	5,700	27.12.2023	TBD ⁽¹⁾	(1.851)	(1.853)	(0,06)
	5,720	27.12.2023	TBD ⁽¹⁾	(12.108)	(12.117)	(0,42)
	5,740	27.12.2023	TBD ⁽¹⁾	(3.509)	(3.512)	(0,12)
BRC	6,000	11.12.2023	TBD ⁽¹⁾	PLN (156.122)	(39.737)	(1,38)
	4,150	19.12.2023	TBD ⁽¹⁾	€ (6.404)	(7.085)	(0,25)
	5,450	27.12.2023	TBD ⁽¹⁾	\$ (1.938)	(1.940)	(0,07)
	5,900	12.12.2022	TBD ⁽¹⁾	PLN (197.832)	(53.716)	(1,87)
	5,900	16.03.2023	TBD ⁽¹⁾	(91.297)	(24.401)	(0,85)
	5,900	31.07.2023	TBD ⁽¹⁾	(193.551)	(50.504)	(1,75)
	5,900	11.12.2023	TBD ⁽¹⁾	(15.022)	(3.820)	(0,13)
JML	5,900	11.12.2023	TBD ⁽¹⁾	(50.037)	(12.725)	(0,44)
MBC	4,750	27.11.2023	TBD ⁽¹⁾	\$ (6.380)	(6.409)	(0,22)
MBC	11,300	08.12.2023	TBD ⁽¹⁾	PLN (66.276)	(16.938)	(0,59)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (281.349)	(9,77)

(1) Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
AZD	\$ 46	\$ 0	\$ 46	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ k. A.
BOA	(2.401)	(1.960)	(4.361)	13.050	(12.520)	530
BPS	382	(1.630)	(1.248)	(16.890)	15.580	(1.310)
BRC	13.436	(14.670)	(1.234)	(1.554)	1.440	(114)
BSH	(528)	470	(58)	(1.101)	0	(1.101)
BSS	k. A.	k. A.	k. A.	0	920	920
CBK	(671)	(4.000)	(4.671)	6.571	(6.325)	246
CKL	k. A.	k. A.	k. A.	(265)	0	(265)
CLY	k. A.	k. A.	k. A.	2.606	0	2.606
DUB	1.073	(1.610)	(537)	50	0	50
FAR	(58)	0	(58)	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	2.281	(2.840)	(559)	10.551	(10.070)	481
GST	587	(490)	97	(180)	190	10
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	6.780	(6.910)	(130)
IND	(673)	500	(173)	(834)	(1.510)	(2.344)
JPM	100	0	100	1.710	(1.280)	430
MBC	(4.769)	5.390	621	5.248	(4.930)	318
MYC	(128)	310	182	(365)	410	45
MYI	(1.841)	560	(1.281)	(4.865)	3.730	(1.135)
RBC	116	0	116	(4.253)	4.420	167
RYL	(19)	0	(19)	274	(260)	14
SCX	(4.266)	4.300	34	1.418	(1.120)	298
SOG	942	(1.390)	(448)	(587)	590	3
SSB	(106)	(280)	(386)	(924)	1.040	116
TOR	(51)	180	129	309	(270)	39
UAG	95	490	585	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. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond Fund (Forts.)

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	80,36	63,67
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	14,63	27,35
Sonstige übertragbare Wertpapiere	3,72	1,33
Investmentfonds	8,11	6,86
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,04	0,04
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,14)	(1,03)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,12	1,10
Einlagenzertifikate	1,67	0,37
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(9,77)	(4,45)

* Gemäß der Liste der Märkte, die in Anhang 1 zum Prospekt aufgeführt sind und die Kriterien für gemäß OGAW-Vorschriften geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Argentinien	0,00	0,16
Aserbaidschan	0,10	0,23
Bahamas	k. A.	0,13
Brasilien	2,30	4,48
Cayman-Inseln	0,74	0,44
Chile	3,98	2,06
China	5,25	5,74
Kolumbien	3,74	3,65
Tschechische Republik	4,32	2,89
Dänemark	0,00	0,00
Dominikanische Republik	3,34	1,30
Ecuador	0,35	k. A.
Ägypten	0,22	k. A.
Ungarn	1,52	0,40
Indonesien	9,03	5,26
International	0,38	k. A.
Irland	0,60	0,83
Israel	1,14	1,75
Elfenbeinküste	0,21	0,38
Jersey, Kanalinseln	0,24	0,51
Kasachstan	k. A.	0,05
Luxemburg	0,02	0,01
Malaysia	8,07	9,11
Mexiko	7,94	8,11
Niederlande	k. A.	0,20
Nigeria	k. A.	0,22
Peru	1,88	2,32
Philippinen	0,10	0,04
Polen	7,51	4,79
Katar	0,62	0,92
Rumänien	2,78	3,99
Russland	0,16	0,26
Serbien	0,11	0,15
Südafrika	12,85	13,70
Südkorea	k. A.	0,18
Supranational	0,57	0,37
Tansania	0,93	0,49
Thailand	8,35	4,23
Türkei	0,76	0,53
Ukraine	0,14	k. A.
Vereinigte Arabische Emirate	1,10	1,60
Großbritannien	0,22	0,58
USA	1,82	2,50
Uruguay	0,38	k. A.
Jungfernseln (Britisch)	k. A.	0,31
Sambia	0,16	k. A.
Kurzfristige Instrumente	4,78	7,48
Investmentfonds	8,11	6,86
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,04	0,04
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,08)	k. A.
Zinsswaps	(0,06)	(1,03)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	0,08	0,13
Verkaufsoptionen		
Devisenoptionen	(0,48)	(0,01)
Zinsswapoptionen	(0,01)	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzkauf	0,00	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,03	(0,14)
Cross-Currency Swaps	0,21	0,42
Zinsswaps	(0,02)	0,19

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Volatilitätsswaps	k. A.	0,00
Devisenterminkontrakte	0,31	0,52
Einlagezertifikate	1,67	0,37
Sonstige Aktiva und Passiva	(8,51)	0,31
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond ESG Fund

BESCHREIBUNG	PARI	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS							
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE																		
CHILE																		
STAATSEMISSIONEN																		
Bonos de la Tesorería de la Republica en Pesos																		
2,300 % fällig am 01.10.2028	CLP	200.000	0,19	4,750 % fällig am 24.11.2032	HUF	2.000	0,00	1,750 % fällig am 25.04.2032	PLN	1.250	0,24							
2,800 % fällig am 01.10.2033		45.000	0,04	6,125 % fällig am 22.05.2028	\$	200	0,20	2,500 % fällig am 25.07.2026 (d)		2.800	0,66							
3,400 % fällig am 01.10.2039		312.710	0,40	6,750 % fällig am 22.10.2028	HUF	22.800	0,07	2,500 % fällig am 25.07.2027		3.190	0,73							
4,700 % fällig am 01.09.2030		35.000	0,04	Summe Ungarn		2.404	2,35	2,750 % fällig am 25.10.2029		6.100	1,36							
5,000 % fällig am 01.10.2028	1.145.000	1.295	1,26	INDONESIEN				3,750 % fällig am 25.05.2027		9.000	2,06							
5,300 % fällig am 01.11.2037	160.000	181	0,18	STAATSEMISSIONEN				6,000 % fällig am 25.10.2033 (d)		6.000	1,61							
5,800 % fällig am 01.10.2034	480.000	567	0,55	Indonesia Government International Bond				7,500 % fällig am 25.07.2028 (d)	1.300	364	0,36							
6,000 % fällig am 01.04.2033	1.325.000	1.596	1,56	6,375 % fällig am 15.08.2028				Summe Polen		7.275	7,10							
7,000 % fällig am 01.05.2034	20.000	26	0,03	6,375 % fällig am 15.04.2032				RUMÄNIEN										
Summe Chile		4.350	4,25	6,375 % fällig am 15.04.2042				STAATSEMISSIONEN										
KOLUMBIEN								Romania Government International Bond										
STAATSEMISSIONEN								4,150 % fällig am 26.01.2028				RON	4.100	847	0,83			
Colombia Government International Bond								4,150 % fällig am 24.10.2030					2.800	553	0,54			
1,000 % fällig am 18.09.2030	COP	97.900	0,02	6,500 % fällig am 15.02.2031				4,250 % fällig am 28.04.2036					5.965	1,09	1,07			
1,000 % fällig am 26.03.2031		204.600	0,05	7,000 % fällig am 15.09.2030				4,750 % fällig am 11.10.2034					1.340	263	0,26			
1,000 % fällig am 30.06.2032		61.000	0,01	7,000 % fällig am 15.02.2033				4,850 % fällig am 22.04.2026					4.400	952	0,93			
8,000 % fällig am 14.11.2035	\$	200	0,22	7,125 % fällig am 15.06.2042				Summe Rumänien					3.714	3,63				
Colombian TES				7,375 % fällig am 15.10.2030				SÜDAFRIKA										
7,000 % fällig am 26.03.2031	COP	16.410.400	3,670	7,500 % fällig am 15.06.2035				STAATSEMISSIONEN										
13,250 % fällig am 09.02.2033		2.259.100	0,68	7,500 % fällig am 15.04.2040				South Africa Government International Bond										
Summe Kolumbien		4.666	4,56	8,250 % fällig am 15.05.2036				2,000 % fällig am 31.01.2025 (c)				ZAR	8.763	469	0,46			
TSSCHECHISCHE REPUBLIK								6,250 % fällig am 31.03.2036					7.100	255	0,25			
STAATSEMISSIONEN								7,000 % fällig am 28.02.2031					14.500	664	0,65			
Czech Republic Government International Bond								8,000 % fällig am 31.01.2030 (d)					77.600	3.906	3,82			
0,050 % fällig am 29.11.2029	CZK	45.100	1,634	8,250 % fällig am 31.03.2032 (d)				8,500 % fällig am 31.01.2037					33.200	1.417	1,37			
0,250 % fällig am 10.02.2027		1.300	0,05	8,500 % fällig am 31.01.2044				8,750 % fällig am 31.01.2048					21.500	872	0,85			
0,950 % fällig am 15.05.2030		30.600	1,158	8,750 % fällig am 28.02.2048				8,875 % fällig am 28.02.2035					3.900	157	0,15			
1,200 % fällig am 13.03.2031		1.200	0,04	9,000 % fällig am 31.01.2040				10,500 % fällig am 21.12.2026 (d)					20.400	870	0,85			
1,500 % fällig am 24.04.2040		400	0,01	Summe Südafrika									35.100	2.009	1,96			
1,750 % fällig am 23.06.2032		20.300	0,76	MALAYSIA				STÄATSEMISSIONEN										
1,950 % fällig am 30.07.2037		200	0,01	Malaysia Government Investment Issue														
2,000 % fällig am 13.10.2033		20.300	0,76	3,422 % fällig am 30.09.2027														
2,400 % fällig am 17.09.2025		4.800	0,20	3,465 % fällig am 15.10.2030														
2,500 % fällig am 25.08.2028		10.300	0,43	3,599 % fällig am 31.07.2028														
4,200 % fällig am 04.12.2036		5.600	0,26	3,990 % fällig am 15.10.2025														
4,900 % fällig am 14.04.2034		1.100	0,05	4,130 % fällig am 09.07.2029														
5,000 % fällig am 30.09.2030		25.100	1,18	4,245 % fällig am 30.09.2030														
Summe Tschechische Republik		6.641	6,48	4,369 % fällig am 31.10.2028														
DOMINIKANISCHE REPUBLIK								4,417 % fällig am 30.09.2041										
STAATSEMISSIONEN								4,662 % fällig am 31.03.2038										
Dominican Republic Central Bank Notes								Summe Malaysia				6.063				5,92		
12,000 % fällig am 03.10.2025	DOP	900	16					MEXIKO										
13,000 % fällig am 05.12.2025		47.400	856					STAATSEMISSIONEN										
13,000 % fällig am 30.01.2026		19.600	355					Mexico Government International Bond										
Dominican Republic Government International Bond								2,750 % fällig am 27.11.2031 (c)				MXN				31.527	1.644	1,60
11,250 % fällig am 15.09.2035		54.700	1,019					7,500 % fällig am 03.06.2027										
13,625 % fällig am 03.02.2033		45.500	956					7,500 % fällig am 26.05.2033										
13,625 % fällig am 10.02.2034		10.500	219					7,750 % fällig am 29.05.2031										
Summe Dominikanische Republik		3.421	3,34					7,750 % fällig am 13.11.2042										
ECUADOR								8,000 % fällig am 24.05.2035										
STAATSEMISSIONEN								8,000 % fällig am 07.11.2047										
Ecuador Government International Bond								8,000 % fällig am 31.07.2053										
3,500 % fällig am 31.07.2035	\$	7	3					8,500 % fällig am 01.03.2029										
6,000 % fällig am 31.07.2030		250	117					8,500 % fällig am 18.11.2038										
Summe Ecuador		120	0,12					Summe Mexiko				8.218				8,02		
DEUTSCHLAND								PERU										
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL								STAATSEMISSIONEN										
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau								Peru Government International Bond										
0,625 % fällig am 25.07.2025	PLN	500	117					5,350 % fällig am 12.08.2040				PEN				200	46	0,04
5,800 % fällig am 19.01.2028	ZAR	2.500	124					6,900 % fällig am 12.08.2037										
Summe Deutschland		241	0,24					7,300 % fällig am 12.08.2033										
UNGARN								Summe Peru				1.977				1,93		
STAATSEMISSIONEN								POLEN										
Hungary Government International Bond								STAATSEMISSIONEN										
4,000 % fällig am 28.04.2051	HUF	205.700	415					Poland Government International Bond										
4,500 % fällig am 27.05.2032		647.900	1.708					1,250 % fällig am 25.10.2030				PLN				159	32	0,03

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
3,450 % fällig am 17.06.2043	THB 30.013	\$ 922	0,90	KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
3,775 % fällig am 25.06.2032	2.667	85	0,08	UNGARISCHE SCHATZWECHSEL			
4,260 % fällig am 12.12.2037	1.710	56	0,06	10,900 % fällig am			
Summe Thailand		8.168	7,98	04.01.2024 (a)(b)	HUF 693.000	\$ 2.001	1,96
TÜRKEI				MALAYSISCHE SCHATZWECHSEL			
STAATSEMISSIONEN				3,289 % fällig am			
Turkey Government International Bond				06.02.2024 (a)(b)	MYR 160	35	0,03
26,200 % fällig am 05.10.2033	TRY 300	11	0,01	U.S. TREASURY BILLS			
URUGUAY				2,070 % fällig am			
STAATSEMISSIONEN				23.01.2024 (a)(b)	\$ 1.700	1.695	1,66
Uruguay Government International Bond				Summe kurzfristige Instrumente		3.731	3,65
3,700 % fällig am 26.06.2037 (c)	UYU 6.276	165	0,16				
3,875 % fällig am 02.07.2040 (c)	5.672	153	0,15	Summe übertragbare Wertpapiere	\$ 83.869	81,89	
8,500 % fällig am 15.03.2028	3.200	79	0,08				
Summe Uruguay		397	0,39				

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	5,450 %	29.12.2023	02.01.2024	\$ 15.600	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,375 % fällig am 15.02.2044	\$ (15.987)	\$ 15.600	\$ 15.609	15,23
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (15.987)	\$ 15.600	\$ 15.609	15,23

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Long	03.2024	9	\$ 17	0,02
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Short	03.2024	1	(1)	0,00
				\$ 16	0,02
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 16	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 variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	5,000 %	20.03.2029	£ 5.900	\$ 109	0,10
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,232	05.10.2025	¥ 1.490.000	(22)	(0,02)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,350	21.03.2026	1.575.000	(21)	(0,02)
Zahlung	1-Day THB-THORON Compounded-OIS	2,500	20.03.2026	THB 12.560	1	0,00
Erhalt	1-Day THB-THORON Compounded-OIS	2,750	20.03.2029	48.200	(6)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2033	\$ 60	3	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2033	25	(1)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.12.2028	1350	21	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.12.2028	200	(9)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2029	2.700	11	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,170	03.10.2033	100	6	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,808	02.01.2026	BRL 18.000	10	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,076	04.01.2027	1.100	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,083	02.01.2026	110	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,386	02.01.2029	100	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,512	04.01.2027	60.300	91	0,09
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,529	02.01.2026	300	(1)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,602	04.01.2027	900	2	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,691	02.01.2026	1.100	3	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,751	02.01.2026	5.800	6	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,768	04.01.2027	200	(1)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,811	02.01.2025	1.310	0	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond ESG Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum		Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,872 %	04.01.2027		500	\$ (2)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,064	04.01.2027	BRL	400	2	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,169	04.01.2027		520	6	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,540	02.01.2024		2.700	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,040	01.04.2024		3.700	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,260	01.04.2024		3.200	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,350	01.07.2024		900	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,490	01.07.2024		900	(1)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,595	01.07.2024		900	1	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	13,080	01.07.2024		1.800	3	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	13,800	02.01.2024		3.400	4	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	13,995	02.01.2024		900	1	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,705	26.03.2031	COP	906.800	(5)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,715	18.09.2030		83.500	0	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,800	30.06.2032		44.500	0	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,190	13.06.2029		180.300	1	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,305	28.04.2028		39.570	0	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,950	24.03.2030		81.280	(1)	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,300	26.03.2031		122.840	(3)	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,370	17.03.2030		47.800	(1)	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,393	21.03.2030		53.400	(1)	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,410	26.03.2031		123.400	(3)	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,423	17.03.2030		100.800	(2)	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,500	19.10.2033		220.600	6	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,930	07.03.2033		34.420	(1)	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,680	22.11.2025	ZAR	600	0	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,070	30.11.2028		3.500	0	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,120	13.03.2028		300	0	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,140	16.11.2028		1.000	0	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,210	21.12.2026		700	0	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,225	31.08.2028		400	1	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,410	10.11.2028		700	(1)	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,650	31.10.2028		200	0	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,735	31.01.2030		300	0	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,820	31.01.2030		37.370	(6)	(0,01)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	9,455	31.01.2030		800	2	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	10,150	18.05.2033		300	1	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,390	30.12.2028	AUD	220	3	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,750	20.12.2028		12.470	121	0,12
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,030	20.03.2033	CLP	5.340	0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,230	17.11.2033		2.480.700	(28)	(0,03)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,260	17.11.2028		8.100	0	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,310	16.11.2028		5.600	0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,320	16.11.2028		736.100	(12)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,400	16.11.2033		13.100	1	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,631	23.08.2028		15.700	0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,690	01.09.2030		1.800	0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,770	21.11.2027		28.300	(1)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,780	03.10.2028		14.200	(1)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,790	06.10.2033		15.000	(1)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,855	05.10.2033		33.000	(3)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,870	11.10.2033		14.200	(1)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,920	02.10.2028		18.000	(1)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,940	20.10.2033		6.100	(1)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,990	20.10.2033		60.410	(6)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,000	02.10.2028		35.000	(2)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,070	28.02.2028		55.800	(3)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,146	30.10.2032		97.000	(10)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,235	26.10.2033		25.300	(3)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,760	03.01.2029	€	100	(2)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,880	19.12.2028		900	(4)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.03.2034		2.080	36	0,03
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	3,250	20.03.2029		1.700	9	0,01
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	3,300	03.10.2033		100	8	0,01
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	3,329	27.10.2033		100	7	0,01
Zahlung	6-Month HUF-BBR	10,570	22.08.2027	HUF	4.800	2	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	4,710	25.05.2027	PLN	600	(3)	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	4,735	09.10.2028		200	(1)	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	4,740	25.10.2033		100	(1)	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	4,910	25.07.2027		170	0	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	5,295	25.01.2028		15.750	(95)	(0,09)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,830	19.08.2024		100	0	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,890	22.08.2024		300	(1)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	8,900	21.05.2027	MXN	1.300	(1)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIE	8,994	03.09.2026		1.490	1	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIE	9,055	03.09.2026		300	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	9,620	21.09.2033		1.300	4	0,00
						\$ 214	0,21
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						\$ 214	0,21

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

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

OPTIONSKAUF

DEVIENOPTIENEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
JPM	Put - OTC EUR versus PLN	PLN 4,400	22.08.2024	9	\$ 2	\$ 5	0,01
MYI	Put - OTC GBP versus USD	\$ 1,160	12.06.2024	3.681	15	8	0,01
SCX	Call - OTC USD versus JPY	¥ 167.000	05.11.2024	28	1	1	(0,01)
					\$ 18	\$ 14	0,01

VERKAUFSOPTIENEN

DEVIENOPTIENEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC USD versus MXN	MXN 17,449	26.06.2024	100	\$ (3)	\$ (3)	(0,01)
	Put - OTC USD versus MXN	17,449	26.06.2024	100	(3)	(3)	(0,01)
CBK	Call - OTC USD versus BRL	BRL 4,968	20.06.2024	100	(4)	(3)	0,00
	Put - OTC USD versus BRL	4,968	20.06.2024	100	(4)	(4)	(0,01)
GLM	Call - OTC USD versus TRY	TRY 40,250	30.10.2024	10	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC USD versus TRY	40,250	30.10.2024	10	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC USD versus TRY	39,800	31.10.2024	5	(1)	0	0,00
	Put - OTC USD versus TRY	39,800	31.10.2024	5	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC USD versus TRY	40,930	07.11.2024	5	0	0	0,00
	Put - OTC USD versus TRY	40,930	07.11.2024	5	0	(1)	0,00
	Call - OTC USD versus TRY	41,150	07.11.2024	5	(1)	0	0,00
	Put - OTC USD versus TRY	41,150	07.11.2024	5	0	(1)	0,00
	Call - OTC USD versus TRY	41,160	11.11.2024	5	(1)	0	0,00
	Put - OTC USD versus TRY	41,160	11.11.2024	5	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC USD versus TWD	TWD 31,000	04.03.2024	21	0	(1)	0,00
JPM	Call - OTC USD versus IDR	IDR 14.950,000	06.06.2024	21	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC USD versus IDR	14.950,000	06.06.2024	21	(1)	0	0,00
	Put - OTC USD versus TWD	TWD 31,000	01.03.2024	58	(1)	(2)	0,00
MYI	Call - OTC USD versus IDR	IDR 15.370,000	13.08.2024	45	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC USD versus IDR	15.370,000	13.08.2024	45	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC USD versus MXN	MXN 19,500	07.03.2024	67	(1)	0	0,00
	Call - OTC USD versus MXN	17,449	26.06.2024	50	(2)	(2)	0,00
	Put - OTC USD versus MXN	17,449	26.06.2024	50	(2)	(2)	0,00
					\$ (31)	\$ (29)	(0,03)

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,545 %	16.01.2024	300	\$ (1)	\$ (4)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,995	16.01.2024	300	(1)	0	0,01
GLM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300	16.01.2024	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	16.01.2024	100	(1)	0	0,00
GST	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,440	08.01.2024	1.800	(4)	(6)	(0,01)
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,860	08.01.2024	1.800	(4)	0	0,00
JPM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,490	12.01.2024	800	(3)	(6)	(0,01)
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,890	12.01.2024	800	(3)	(1)	0,00
							\$ (18)	\$ (17)	(0,01)

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

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
BOA	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS zzgl. 0,048 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month PHP-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	20.06.2025	\$ 10.000	PHP 552.500	\$ 10	\$ (29)	\$ (19)	(0,02)
GLM	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS zzgl. 0,053 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month PHP-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	20.03.2029	123	6.830	0	(1)	(1)	0,00
JPM	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS zzgl. 0,054 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month PHP-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	20.03.2029	13	730	0	0	0	0,00
						\$ 10	\$ (30)	\$ (20)	(0,02)

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond ESG Fund (Forts.)

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 %	20.03.2029	MYR 80	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
GST	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	20.03.2029	410	1	(1)	0	0,00
						\$ 1	\$ (1)	\$ 0	0,00

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2024	CLP	9.581	\$ 11	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2024	COP	160.986	42	1	0	0,00
	01.2024	DOP	458	8	0	0	0,00
	01.2024	HUF	558	2	0	0	0,00
	01.2024	KZT	4.244	9	0	0	0,00
	01.2024	NZD	38	23	0	(1)	0,00
	01.2024	\$	53	COP 213.294	2	2	0,00
	01.2024		24	HUF 8.682	1	1	0,00
	01.2024		79	MXN 1.380	2	2	0,00
	01.2024		34	PLN 142	2	2	0,00
	01.2024		950	TRY 28.188	0	(3)	0,00
	02.2024	DOP	289	\$ 5	0	0	0,00
	02.2024	EGP	66	2	0	0	0,00
	02.2024	\$	535	EGP 20.357	0	(7)	(0,01)
	02.2024		10	KES 1.593	0	0	0,00
	02.2024		45	TRY 1.414	1	1	0,00
	03.2024	DOP	172	\$ 3	0	0	0,00
	03.2024	IDR	156.603	10	0	0	0,00
	03.2024	\$	41	COP 160.986	0	(1)	0,00
	03.2024		525	IDR 8.171.901	5	5	0,00
	03.2024		6	INR 490	0	0	0,00
	06.2024		18	MXN 314	0	0	0,00
BPS	01.2024	COP	819.443	\$ 207	0	(4)	0,00
	01.2024	€	280	306	0	(3)	0,00
	01.2024	HUF	381.022	1.087	0	(14)	(0,01)
	01.2024	MXN	499	28	0	(1)	0,00
	01.2024	MYR	433	93	0	(1)	0,00
	01.2024	PLN	141	32	0	(4)	0,00
	01.2024	\$	369	AUD 555	10	10	0,01
	01.2024		9.386	BRL 46.145	113	113	0,11
	01.2024		131	CAD 177	4	4	0,00
	01.2024		72	€ 66	1	1	0,00
	01.2024		306	HUF 106.647	3	(1)	0,00
	01.2024		2.011	¥ 284.300	7	7	0,01
	01.2024		9	NZD 14	0	0	0,00
	01.2024		47	PLN 199	3	3	0,00
	02.2024	EGP	2.031	\$ 52	0	0	0,00
	02.2024	KZT	1.173	2	0	0	0,00
	02.2024	\$	3	EGP 105	0	0	0,00
	02.2024		13	TWD 399	1	1	0,00
	03.2024	IDR	1.067.922	\$ 68	0	(1)	0,00
	03.2024	TWD	900	29	0	(1)	0,00
	03.2024	\$	44	IDR 685.495	0	0	0,00
	03.2024		20	INR 1.703	0	0	0,00
	03.2024		209	THB 7.221	4	4	0,00
	03.2024		135	TWD 4.094	1	1	0,00
	12.2024		52	EGP 2.554	0	(2)	0,00
BRC	01.2024	PLN	118	\$ 28	0	(3)	0,00
	01.2024	\$	2.839	HUF 1.009.066	69	69	0,07
	01.2024		536	MYR 2.474	4	4	0,00
	02.2024		107	RON 488	2	2	0,00
	02.2024		51	TRY 1.591	0	0	0,00
	03.2024		1	THB 18	0	0	0,00
	03.2024		105	TRY 3.288	0	(1)	0,00
	04.2024		42	1.349	0	(1)	0,00
CBK	01.2024	AUD	118	\$ 78	0	(3)	0,00
	01.2024	BRL	49.261	10.117	0	(24)	(0,02)
	01.2024	CAD	516	380	0	(11)	(0,01)
	01.2024	CLP	33.844	39	0	0	0,00
	01.2024	COP	655.579	164	1	(7)	(0,01)
	01.2024	€	104	113	0	(2)	0,00
	01.2024	¥	78.300	550	0	(5)	(0,01)
	01.2024	MXN	11.495	655	0	(21)	(0,02)
	01.2024	PLN	518	128	0	(4)	0,00
	01.2024	\$	177	CAD 237	3	3	0,00
	01.2024		49	CLP 43.499	1	1	0,00
	01.2024		363	COP 1.422.714	6	(2)	0,00
	01.2024		12	HUF 4.300	1	1	0,00
	01.2024		533	¥ 75.300	1	1	0,00
	01.2024		554	MXN 9.781	21	21	0,02
	01.2024		3	NOK 32	0	0	0,00
	01.2024		233	PLN 924	2	2	0,00

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
	01.2024	ZAR 67.089	\$ 3.545	\$ 0	\$ (119)	\$ (119)	(0,12)
	02.2024	EGP 2.792	\$ 74	1	0	1	0,00
	02.2024	\$ 438	BRL 2.247	24	0	24	0,02
	02.2024	43	EGP 1.513	0	(4)	(4)	0,00
	02.2024	7	UYU 278	0	0	0	0,00
	03.2024	CLP 43.678	\$ 49	0	(1)	(1)	0,00
	03.2024	COP 1.687.333	425	1	(5)	(4)	0,00
	03.2024	EGP 106	3	1	0	1	0,00
	03.2024	ILS 28	8	0	0	0	0,00
	03.2024	\$ 12	EGP 455	0	(2)	(2)	0,00
	03.2024	179	IDR 2.755.379	0	0	0	0,00
	03.2024	532	PEN 1.986	4	(1)	3	0,00
	04.2024	10.117	BRL 49.760	42	0	42	0,04
	04.2024	19	EGP 716	0	(3)	(3)	0,00
	06.2024	£ 141	\$ 176	0	(3)	(3)	0,00
	06.2024	\$ 13	BRL 65	0	0	0	0,00
	10.2024	24	COP 104.688	2	0	2	0,00
	12.2024	66	EGP 3.197	0	(3)	(3)	0,00
	01.2025	24	COP 105.792	2	0	2	0,00
	04.2025	24	107.640	2	0	2	0,00
	10.2025	12	58.464	2	0	2	0,00
GLM	01.2024	CHF 211	\$ 242	0	(9)	(9)	(0,01)
	01.2024	COP 216.291	51	0	(5)	(5)	0,00
	01.2024	DOP 76.905	1.346	28	0	28	0,03
	01.2024	EGP 761	20	0	(2)	(2)	0,00
	01.2024	£ 62	79	0	0	0	0,00
	01.2024	HUF 5.032	14	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	MXN 352	20	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	\$ 57	COP 216.291	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	10	EGP 329	0	0	0	0,00
	01.2024	1.972	MXN 34.501	56	0	56	0,06
	01.2024	429	ZAR 8.022	9	0	9	0,01
	01.2024	ZAR 599	\$ 34	1	0	1	0,00
	02.2024	DOP 47.881	838	17	0	17	0,02
	02.2024	EGP 842	24	3	0	3	0,00
	02.2024	KZT 4.061	8	0	0	0	0,00
	02.2024	\$ 10	BRL 52	1	0	1	0,00
	02.2024	9	EGP 318	0	(1)	(1)	0,00
	02.2024	15	KZT 6.963	0	0	0	0,00
	02.2024	268	RON 1.221	2	0	2	0,00
	02.2024	UYU 2.346	\$ 59	0	(1)	(1)	0,00
	03.2024	DOP 16.252	284	6	0	6	0,01
	03.2024	\$ 25	TRY 792	0	0	0	0,00
	03.2024	10	TWD 310	0	0	0	0,00
	04.2024	DOP 44.281	\$ 770	15	0	15	0,02
	08.2024	\$ 10	COP 43.220	1	0	1	0,00
	10.2024	3	TRY 121	0	0	0	0,00
	11.2024	8	316	0	0	0	0,00
	04.2025	51	COP 232.994	5	0	5	0,00
JPM	01.2024	BRL 1.890	\$ 388	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	EGP 147	4	0	0	0	0,00
	01.2024	HUF 290.882	829	0	(11)	(11)	(0,01)
	01.2024	PLN 591	135	0	(15)	(15)	(0,01)
	01.2024	\$ 121	BRL 590	0	0	0	0,00
	01.2024	42	HUF 15.179	1	0	1	0,00
	01.2024	111	MXN 1.920	1	0	1	0,00
	01.2024	53	PLN 222	3	0	3	0,00
	01.2024	2.838	TRY 84.207	0	(8)	(8)	(0,01)
	02.2024	KZT 511	\$ 1	0	0	0	0,00
	02.2024	\$ 75	BRL 370	1	0	1	0,00
	02.2024	21	EGP 739	0	(1)	(1)	0,00
	02.2024	720	RON 3.319	16	0	16	0,02
	02.2024	122	TRY 3.731	0	(1)	(1)	0,00
	03.2024	CLP 156.003	\$ 173	0	(5)	(5)	0,00
	03.2024	THB 4.301	121	0	(6)	(6)	(0,01)
	03.2024	\$ 267	BRL 1.310	1	0	1	0,00
	03.2024	57	IDR 894.383	1	0	1	0,00
	03.2024	6	INR 510	0	0	0	0,00
	03.2024	952	SGD 1.263	8	0	8	0,01
	03.2024	292	THB 10.379	14	0	14	0,01
	03.2024	112	TWD 3.489	3	0	3	0,00
	04.2024	TRY 533	\$ 17	1	0	1	0,00
	04.2024	\$ 121	BRL 596	1	0	1	0,00
	06.2024	3	IDR 45.000	0	0	0	0,00
	08.2024	€ 60	PLN 277	3	0	3	0,00
	08.2024	PLN 276	€ 60	0	(3)	(3)	0,00
	08.2024	\$ 22	COP 95.145	1	0	1	0,00
	09.2024	€ 14	PLN 66	1	0	1	0,00
	09.2024	PLN 30	€ 7	0	0	0	0,00
MBC	01.2024	CAD 51	\$ 38	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	€ 125	136	0	(2)	(2)	0,00
	01.2024	¥ 280.500	1.962	0	(29)	(29)	(0,03)

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond ESG Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
	01.2024	PLN	68 \$	17	0	0	0,00	
	01.2024	\$	9 AUD	13	0	0	0,00	
	01.2024		4 EGP	125	0	0	0,00	
	01.2024		5 €	5	0	0	0,00	
	01.2024		66 HUF	24.304	4	4	0,00	
	01.2024		1.916 PLN	7.707	44	44	0,04	
	02.2024		0 EGP	0	0	0	0,00	
	03.2024	PHP	1.053 \$	19	0	0	0,00	
	03.2024	\$	146 IDR	2.304.219	3	3	0,00	
	03.2024		118 INR	9.832	0	0	0,00	
	03.2024		31 TRY	975	0	0	0,00	
	03.2024		9 TWD	289	0	0	0,00	
MYI	01.2024	EGP	21 \$	1	0	0	0,00	
	01.2024	€	142	156	0	(1)	0,00	
	01.2024	£	2	3	0	0	0,00	
	01.2024	HUF	24.565	70	0	(1)	0,00	
	01.2024	PLN	188	47	0	(1)	0,00	
	01.2024	\$	9	8	0	0	0,00	
	01.2024		11 EGP	356	0	0	0,00	
	01.2024		9 KZT	4.238	0	0	0,00	
	01.2024		10.199 MYR	47.601	189	0	0,18	
	01.2024		228 PLN	903	1	1	0,00	
	01.2024		164 RON	739	0	0	0,00	
	01.2024		337 ZAR	6.199	2	2	0,00	
	01.2024	ZAR	9.494 \$	509	2	(11)	(0,01)	
	02.2024	EGP	157	4	0	0	0,00	
	02.2024	KZT	1.675	4	0	0	0,00	
	02.2024	\$	5	2.315	0	0	0,00	
	03.2024	IDR	105.147.387 \$	6.764	0	(55)	(0,05)	
	03.2024	MXN	86	5	0	0	0,00	
	03.2024	THB	4.552	133	0	(1)	0,00	
	03.2024	\$	182	CZK 4.086	0	0	0,00	
	03.2024		1	EGP 51	0	0	0,00	
	03.2024		13	IDR 202.419	0	0	0,00	
	03.2024		2.170	TWD 67.409	64	64	0,06	
	06.2024	£	141 \$	176	0	(3)	0,00	
	06.2024	\$	353	£ 281	5	5	0,01	
	06.2024		9	MXN 157	0	0	0,00	
	08.2024		8	IDR 122.960	0	0	0,00	
RYL	01.2024	NZD	219 \$	135	0	(4)	0,00	
	01.2024	\$	226	NOK 2.455	16	16	0,02	
	03.2024		8.177	IDR 126.868.150	50	50	0,05	
SCX	01.2024	MXN	3.486 \$	201	0	(4)	0,00	
	01.2024	MYR	21.801	4.669	0	(89)	(0,09)	
	01.2024	\$	278	BRL 1.369	4	4	0,00	
	01.2024		0	EGP 7	0	0	0,00	
	01.2024		121	¥ 17.400	2	2	0,00	
	01.2024		83	SEK 865	3	3	0,00	
	01.2024		14	ZMW 346	0	(1)	0,00	
	02.2024	EGP	3.023 \$	79	2	2	0,00	
	02.2024	MYR	159	33	0	(1)	0,00	
	02.2024	\$	8	KES 1.276	0	0	0,00	
	03.2024	IDR	7.095.783 \$	456	0	(4)	0,00	
	03.2024	THB	18.872	545	0	(12)	(0,01)	
	03.2024	TWD	18.928	611	0	(16)	(0,02)	
	03.2024	\$	1	EGP 51	0	0	0,00	
	03.2024		8	IDR 130.805	0	0	0,00	
	03.2024		13	INR 1.111	0	0	0,00	
	03.2024		1.392	THB 48.126	27	27	0,03	
	03.2024		17	TWD 548	1	1	0,00	
	08.2024		9	COP 38.952	1	1	0,00	
	12.2024		66	EGP 3.242	0	(3)	0,00	
SSB	01.2024	CLP	1.704.803 \$	1.928	0	(22)	(0,02)	
	01.2024	£	80	101	0	(1)	0,00	
	03.2024	\$	146	CLP 126.862	0	(1)	0,00	
	03.2024		109	COP 435.027	2	2	0,00	
	03.2024		493	INR 41.221	1	1	0,00	
UAG	01.2024	€	3.591 \$	3.877	0	(92)	(0,09)	
	01.2024	£	14	18	0	0	0,00	
	01.2024	PLN	46	11	0	(1)	0,00	
	01.2024	\$	620	BRL 3.049	8	8	0,01	
	01.2024		24	HUF 8.810	1	1	0,00	
	01.2024		90	MXN 1.592	4	4	0,00	
	01.2024		13	NOK 143	1	1	0,00	
	01.2024		52	ZAR 954	1	0	0,00	
	03.2024		1.000	CZK 22.256	0	(6)	(0,01)	
	04.2024		18	TRY 544	0	(1)	0,00	
					\$ 991	\$ (705)	\$ 286	0,28
Summe Freiverkehrsfinanzderivate							\$ 234	0,23

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
EINLAGENZERTIFIKATE			
Banco Davivienda S.A.			
11,679 % fällig am 12.05.2025	COP 47.700	\$ 12	0,01
12,950 % fällig am 08.03.2026	34.677	9	0,01
13,183 % fällig am 06.06.2026	30.000	8	0,01
13,455 % fällig am 13.06.2025	20.000	5	0,01
13,456 % fällig am 07.06.2025	41.000	11	0,01
13,456 % fällig am 09.06.2025	14.000	4	0,00
13,501 % fällig am 13.12.2024	33.000	9	0,01
15,389 % fällig am 21.02.2024	9.500	3	0,00
Bancolombia S.A.			
5,917 % fällig am 27.01.2024	46.200	12	0,01
10,388 % fällig am 20.04.2026	65.000	16	0,02
13,320 % fällig am 08.06.2025	17.000	4	0,00
13,456 % fällig am 14.06.2025	33.000	9	0,01
13,637 % fällig am 14.12.2024	47.000	12	0,01
16,137 % fällig am 01.09.2024	18.000	5	0,01
BBVA Colombia S.A.			
13,093 % fällig am 28.04.2026	18.000	5	0,01
13,229 % fällig am 10.05.2026	7.000	2	0,00
13,365 % fällig am 04.05.2026	11.000	3	0,00
14,460 % fällig am 13.01.2024	18.800	5	0,00
Summe Einlagenzertifikate		\$ 134	0,13
Summe Anlagen		\$ 100.067	97,71
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ 2.341	2,29
Nettovermögen		\$ 102.408	100,00

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

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

(a) Nullkuponwertpapier.

(b) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(c) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(d) Wertpapiere mit einem aggregierten beizulegenden Zeitwert von USD 8.738 (31. Dezember 2022: USD null) waren zum 31. Dezember 2023 Wertpapiere als Sicherheiten gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 1.388 (31. Dezember 2022: USD 39) waren zum 31. Dezember 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 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	\$ 83.869	\$ 0	\$ 83.869
Pensionsgeschäfte	0	15.600	0	15.600
Finanzderivate ⁽³⁾	17	447	0	464
Einlagen bei Kreditinstituten	0	134	0	134
Summen	\$ 17	\$ 100.050	\$ 0	\$ 100.067

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 6.270	\$ 0	\$ 6.270
Finanzderivate ⁽³⁾	0	54	0	54
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	4	4
Summen	\$ 0	\$ 6.324	\$ 4	\$ 6.328

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

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

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

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond ESG Fund (Forts.)

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften	
					\$	% des Nettovermögens
BPS	6,100 %	31.07.2023	TBD ⁽¹⁾	PLN (206)	\$ (54)	(0,05)
	6,100	09.08.2023	TBD ⁽¹⁾	(1.050)	(273)	(0,27)
	9,000	31.07.2023	TBD ⁽¹⁾	ZAR (1.425)	(81)	(0,08)
	9,000	02.10.2023	TBD ⁽¹⁾	(1.004)	(57)	(0,05)
	9,000	16.11.2023	TBD ⁽¹⁾	(4.649)	(257)	(0,25)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (722)	(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 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ (23)	\$ 0	\$ (23)	\$ 3	\$ 0	\$ 3
BPS	111	0	111	k. A.	k. A.	k. A.
BRC	70	0	70	33	0	33
CBK	(110)	0	(110)	26	0	26
GLM	115	(70)	45	30	0	30
GST	(6)	0	(6)	k. A.	k. A.	k. A.
MBC	19	0	19	k. A.	k. A.	k. A.
MYI	192	0	192	(2)	0	(2)
RYL	62	0	62	k. A.	k. A.	k. A.
SCX	(89)	0	(89)	(35)	0	(35)
SSB	(21)	0	(21)	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	(86)	0	(86)	k. A.	k. A.	k. A.

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

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	73,55	69,10
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	7,67	24,21
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,67	1,57
Pensionsgeschäfte	15,23	k. A.
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,02	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,21	(0,02)
Freiverkehrsfinaanzderivate	0,23	0,83
Einlagenzertifikate	0,13	0,06
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,70)	k. A.

* Gemäß der Liste der Märkte, die die Kriterien für einen geregelten OGAW-Markt erfüllen, in Anlage 1 zum Verkaufsprospekt.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Chile	4,25	2,02
Kolumbien	4,56	3,54
Tschechische Republik	6,48	6,84
Dominikanische Republik	3,34	0,23
Ecuador	0,12	k. A.
Deutschland	0,24	1,45
Ungarn	2,35	2,17
Indonesien	7,61	5,33
Israel	k. A.	2,52
Malaysia	5,92	8,58
Mexiko	8,02	5,26
Peru	1,93	2,20
Polen	7,10	2,47
Rumänien	3,63	4,38
Südafrika	11,42	10,65
Supranational	2,89	14,91
Thailand	7,98	4,28
Türkei	0,01	k. A.
Uruguay	0,39	1,12
Kurzfristige Instrumente	3,65	16,93
Pensionsgeschäfte	15,23	k. A.
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,02	k. A.

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Zinsswaps	0,21	(0,02)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	0,01	0,09
Verkaufsoptionen		
Devisenoptionen	(0,03)	0,00
Zinsswapoptionen	(0,01)	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	k. A.	(0,09)
Cross-Currency Swaps	(0,02)	k. A.
Zinsswaps	0,00	k. A.
Volatilitätsswaps	k. A.	0,00
Devisenterminkontrakte	0,28	0,83
Einlagenzertifikate	0,13	0,06
Sonstige Aktiva und Passiva	2,29	4,25
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE											
ANGOLA											
STAATSEMISSIONEN											
Angolan Government International Bond				4,875 % fällig am 13.05.2036	€ 5.200	\$ 6.168	0,16	New Metro Global Ltd.			
8,000 % fällig am 26.11.2029	\$ 9.700	\$ 8.643	0,22	Summe Bulgarien		10.587	0,27	4,500 % fällig am 02.05.2026	\$ 2.600	\$ 657	0,02
8,250 % fällig am 09.05.2028	11.200	10.353	0,27	KAMERUN				Poinsettia Finance Ltd.	11.679	9.919	0,26
8,750 % fällig am 14.04.2032	300	265	0,01	STAATSEMISSIONEN				Seazen Group Ltd.	2.300	679	0,02
9,125 % fällig am 26.11.2049	10.000	8.187	0,21	Republic of Cameroon Government International Bond	11.880	9.731	0,25	4,450 % fällig am 13.07.2025			
9,375 % fällig am 08.05.2048	7.000	5.843	0,15	5,950 % fällig am 07.07.2032				Suci Second Investment Co.	15.500	16.400	0,43
9,500 % fällig am 12.11.2025	6.100	6.003	0,16	9,500 % fällig am 19.11.2025	\$ 1.478	1.446	0,04	6,000 % fällig am 25.10.2028			
Summe Angola		39.294	1,02	Summe Kamerun		11.177	0,29	Sunac China Holdings Ltd.	511	54	0,00
ARGENTINIEN								6,250 % fällig am 30.09.2026	511	40	0,00
STAATSEMISSIONEN								6,500 % fällig am 30.09.2027	1.022	81	0,00
Argentina Government International Bond				KANADA				6,750 % fällig am 30.09.2028	1.533	70	0,00
0,750 % fällig am 09.07.2030	18.162	7.296	0,19	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				7,000 % fällig am 30.09.2029	1.533	83	0,00
1,000 % fällig am 09.07.2029	11.837	4.726	0,12	Frontera Energy Corp.	1.300	974	0,03	7,250 % fällig am 30.09.2030	720	28	0,00
3,500 % fällig am 09.07.2041	54.655	18.671	0,48	CAYMAN-INSELN				Tencent Holdings Ltd.	200	150	0,00
3,625 % fällig am 09.07.2035	59.367	20.245	0,53	FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				Zhongsheng Group Holdings Ltd.	3.900	3.637	0,10
4,250 % fällig am 09.01.2038	43.156	17.156	0,45	Betony CLO Ltd.	1.877	1.877	0,05	3,000 % fällig am 13.01.2026			
Provincia de Buenos Aires				6,732 % fällig am 30.04.2031				Summe Cayman-Inseln		124.786	3,24
6,375 % fällig am 01.09.2037	5.000	1.927	0,05	CIFC Funding Ltd.	982	981	0,03	CHILE			
Provincia de Cordoba				Dryden CLO Ltd.	319	319	0,01	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
6,875 % fällig am 10.12.2025	1.527	1.390	0,04	6,775 % fällig am 15.01.2031				Banco del Estado de Chile	4.300	4.162	0,11
Provincia de la Rioja				Dryden Senior Loan Fund	2.023	2.022	0,05	Banco Santander Chile	5.200	5.061	0,13
6,500 % fällig am 24.02.2028	6.321	3.666	0,09	6,852 % fällig am 15.08.2030				Corp. Nacional del Cobre de Chile			
Provincia de Neuquen				Golub Capital Partners CLO 26B Ltd.	937	938	0,02	3,625 % fällig am 01.08.2027	6.700	6.361	0,16
6,750 % fällig am 27.04.2030	2.210	1.901	0,05	KKR CLO Ltd.	951	950	0,02	4,500 % fällig am 01.08.2047	3.200	2.633	0,07
Summe Argentinien		76.978	2,00	6,655 % fällig am 15.04.2031	1.357	1.358	0,04	4,875 % fällig am 04.11.2044 (j)	5.600	4.877	0,13
ASERBAIDSCHAN								5,125 % fällig am 02.02.2033	2.800	2.718	0,07
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL								5,950 % fällig am 08.01.2034	4.400	4.472	0,12
SOCAR Turkey Enerji AS Via Steas Funding DAC	12.500	12.406	0,32	6,785 % fällig am 16.10.2030				6,150 % fällig am 24.10.2036	1.000	1.026	0,03
7,230 % fällig am 17.03.2026				Northwoods Capital Ltd.	976	978	0,03	6,300 % fällig am 08.09.2053	8.100	8.236	0,21
Southern Gas Corridor CJSC	26.700	27.162	0,71	7,246 % fällig am 15.06.2031				Embotelladora Andina S.A.	3.900	2.977	0,08
6,875 % fällig am 24.03.2026		39.568	1,03	Voya CLO Ltd.	880	879	0,02	3,950 % fällig am 21.01.2050			
Summe Aserbaidschan				6,608 % fällig am 19.04.2031				Empresa de los Ferrocarriles del Estado	1.500	915	0,02
BRASILIEN								4,875 % fällig am 14.02.2035	7.000	4.816	0,12
STAATSEMISSIONEN								5,000 % fällig am 13.10.2027 (j)			
Azerbaijan Government International Bond	3.239	3.227	0,08	5,125 % fällig am 14.02.2053	22.200	22.438	0,58	Empresa de Transporte de Pasajeros Metro S.A.	1.600	1.475	0,04
4,750 % fällig am 18.03.2024				ICD Funding Ltd.	8.230	7.765	0,20	3,650 % fällig am 07.05.2030			
Summe Aserbaidschan		42.795	1,11	3,223 % fällig am 28.04.2026				Empresa Nacional del Petroleo	8.700	7.342	0,19
BAHRAIN								Interoceanica Finance Ltd.			
STAATSEMISSIONEN								0,000 % fällig am 30.11.2025 (c)	401	373	0,01
Bahrain Government International Bond	11.300	10.685	0,28	0,000 % fällig am 15.05.2030 (c)	6.095	4.190	0,11	0,000 % fällig am 05.01.2036	8.400	8.322	0,22
4,250 % fällig am 25.01.2028	700	660	0,01	7,860 % fällig am 15.05.2030	3.350	3.427	0,09	5,330 % fällig am 05.01.2054	3.241	3.232	0,08
5,625 % fällig am 30.09.2031				Kaisa Group Holdings Ltd.				Summe Chile		104.698	2,72
Summe Bahrain		11.345	0,29	8,500 % fällig am 30.06.2022 ^	600	23	0,00	AKTIEN			
BRASILIEN								9,375 % fällig am 30.06.2024 ^			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL								9,750 % fällig am 28.09.2023 ^			
Banco do Brasil S.A.	2.700	2.565	0,07	11,250 % fällig am 09.04.2022 ^	1.100	40	0,00	CHINA			
3,250 % fällig am 30.09.2026				11,500 % fällig am 30.01.2023 ^	200	7	0,00	STAMMAKTIEN			
8,500 % fällig am 29.07.2026 MXN294.000		16.337	0,43	11,700 % fällig am 11.11.2025 ^	3.300	119	0,00	Sunac Services Holdings Ltd.	4.121.446	988	0,03
Brazil Minas SPE Via State of Minas Gerais	\$ 25.095	24.727	0,64	11,950 % fällig am 12.11.2023 ^	2.600	94	0,00	Summe China		1.014	0,03
5,333 % fällig am 15.02.2028				KSA Sukuk Ltd.	12.300	12.790	0,33	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
CSN Inova Ventures	15.800	15.450	0,40	5,268 % fällig am 25.10.2028				Yango Justice International Ltd.			
6,750 % fällig am 28.01.2028				Lima Metro Line Finance Ltd.	350	321	0,01	7,500 % fällig am 15.04.2024 ^	\$ 4.700	26	0,00
Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd.				4,350 % fällig am 05.04.2036	1.004	994	0,03	Summe China			
0,000 % fällig am 29.01.2024 (c)(f)	14.563	500	0,01	5,875 % fällig am 05.07.2034							
Vale S.A.				WADELANLEIHEN & WECHSEL							
0,000 % (f)	BRL 188.860	13.773	0,36	Sunac China Holdings Ltd.	880	68	0,00				
Summe Brasilien		73.352	1,91	1,000 % fällig am 30.09.2032							
BULGARIEN								STAATSEMISSIONEN			
STAATSEMISSIONEN											
Bulgaria Government International Bond				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL							
4,375 % fällig am 13.05.2031	€ 3.800	4.419	0,11	Bioceanico Sovereign Certificate Ltd.				Chile Government International Bond			

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
KOLUMBIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Banco Davivienda S.A. 6,650 % fällig am 22.04.2031 (f)(h)	\$ 900	\$ 645	0,02
Ecopetrol S.A. 4,625 % fällig am 02.11.2031	9.800	8.324	0,22
5,375 % fällig am 26.06.2026	2.200	2.159	0,05
5,875 % fällig am 28.05.2045	3.100	2.452	0,06
6,875 % fällig am 29.04.2030	200	198	0,01
7,375 % fällig am 18.09.2043	2.400	2.294	0,06
		16.072	0,42
STAATSEMISSIONEN			
Colombia Government International Bond			
3,125 % fällig am 15.04.2031	15.507	12.663	0,33
3,875 % fällig am 15.02.2061			
(j)	13.000	8.130	0,21
4,125 % fällig am 15.05.2051	13.700	9.151	0,24
4,500 % fällig am 28.01.2026	7.900	7.790	0,20
4,500 % fällig am 15.03.2029	400	376	0,01
5,000 % fällig am 15.06.2045	3.400	2.650	0,07
5,200 % fällig am 15.05.2049	12.700	9.963	0,26
5,625 % fällig am 26.02.2044	4.800	4.051	0,10
7,375 % fällig am 18.09.2037	1.400	1.458	0,04
7,500 % fällig am 02.02.2034	5.800	6.136	0,16
8,000 % fällig am 14.11.2035	4.300	4.713	0,12
8,750 % fällig am 14.11.2053	3.600	4.148	0,11
		71.229	1,85
Summe Kolumbien		87.301	2,27
COSTA RICA			
STAATSEMISSIONEN			
Costa Rica Government International Bond			
5,625 % fällig am 30.04.2043	3.000	2.765	0,07
7,300 % fällig am 13.11.2054	6.300	6.851	0,18
Summe Costa Rica		9.616	0,25
DOMINIKANISCHE REPUBLIK			
STAATSEMISSIONEN			
Dominican Republic Central Bank Notes			
12,000 % fällig am 03.10.2025 DOP	48.600	854	0,02
13,000 % fällig am 05.12.2025	787.600	14.226	0,37
13,000 % fällig am 30.01.2026	350.100	6.340	0,16
Dominican Republic Government International Bond			
4,875 % fällig am 23.09.2032	\$ 6.200	5.660	0,15
5,300 % fällig am 21.01.2041	7.700	6.679	0,17
5,500 % fällig am 27.01.2025	9.600	9.564	0,25
5,500 % fällig am 22.02.2029	17.500	17.150	0,45
5,875 % fällig am 30.01.2060	7.650	6.636	0,17
5,950 % fällig am 25.01.2027	16.600	16.697	0,43
6,000 % fällig am 19.07.2028	12.400	12.450	0,32
6,000 % fällig am 22.02.2033	10.800	10.679	0,28
6,400 % fällig am 05.06.2049	250	236	0,01
6,875 % fällig am 29.01.2026	8.600	8.775	0,23
7,450 % fällig am 30.04.2044	100	106	0,00
9,750 % fällig am 05.06.2026	DOP 207.150	3.572	0,09
11,250 % fällig am 15.09.2035	320.900	5.981	0,16
13,625 % fällig am 03.02.2033	420.200	8.829	0,23
13,625 % fällig am 10.02.2034	326.900	6.811	0,18
Summe Dominikanische Republik		141.245	3,67
ECUADOR			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Ecuador Social Bond SARL			
0,000 % fällig am 30.01.2035	\$ 622	472	0,01
(c)			
STAATSEMISSIONEN			
Ecuador Government International Bond			
0,000 % fällig am 31.07.2030			
(c)	5.432	1.567	0,04
2,500 % fällig am 31.07.2040	23.343	7.470	0,20
3,500 % fällig am 31.07.2035	33.551	12.062	0,31
6,000 % fällig am 31.07.2030	44.006	20.595	0,54
		41.694	1,09
Summe Ecuador		42.166	1,10

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
ÄGYPTEN			
STAATSEMISSIONEN			
Egypt Government International Bond			
4,750 % fällig am 11.04.2025	€ 2.452\$	2.473	0,07
5,250 % fällig am 06.10.2025			
(j)	\$ 6.000	5.471	0,14
5,625 % fällig am 16.04.2030	€ 1.670	1.183	0,03
5,750 % fällig am 29.05.2024			
(j)	\$ 800	784	0,02
6,375 % fällig am 11.04.2031	€ 20.000	14.262	0,37
6,875 % fällig am 30.04.2040	\$ 5.100	3.097	0,08
7,053 % fällig am 15.01.2032	6.100	4.197	0,11
7,300 % fällig am 30.09.2033	16.200	10.742	0,28
7,500 % fällig am 16.02.2061	6.500	3.817	0,10
7,625 % fällig am 29.05.2032	11.800	8.231	0,21
7,903 % fällig am 21.02.2048	22.000	13.328	0,35
8,150 % fällig am 20.11.2059	2.100	1.296	0,03
8,500 % fällig am 31.01.2047	10.300	6.437	0,17
8,750 % fällig am 30.09.2051	2.000	1.270	0,03
8,875 % fällig am 29.05.2050	12.300	7.873	0,21
Summe Ägypten		84.461	2,20
EL SALVADOR			
STAATSEMISSIONEN			
El Salvador Government International Bond			
6,375 % fällig am 18.01.2027	1.100	976	0,03
7,125 % fällig am 20.01.2050	12.707	9.048	0,24
7,625 % fällig am 21.09.2034	3.800	2.829	0,07
7,625 % fällig am 01.02.2041	530	400	0,01
8,250 % fällig am 10.04.2032	2.610	2.222	0,06
8,625 % fällig am 28.02.2029	185	166	0,00
9,500 % fällig am 15.07.2052	1.400	1.173	0,03
Summe El Salvador		16.814	0,44
GABUN			
STAATSEMISSIONEN			
Gabon Government International Bond			
6,375 % fällig am 12.12.2024	540	520	0,01
6,625 % fällig am 06.02.2031	400	335	0,01
Summe Gabun		855	0,02
GEORGIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Georgian Railway JSC			
4,000 % fällig am 17.06.2028	300	277	0,01
GHANA			
STAATSEMISSIONEN			
Ghana Government International Bond			
6,375 % fällig am 11.02.2027 ^	11.100	4.985	0,13
7,625 % fällig am 16.05.2029 ^	800	351	0,01
7,750 % fällig am 07.04.2029 ^	6.800	2.990	0,08
7,875 % fällig am 11.02.2035 ^	4.029	1.774	0,05
8,125 % fällig am 26.03.2032 ^	6.100	2.698	0,07
8,625 % fällig am 07.04.2034 ^	12.600	5.533	0,14
8,750 % fällig am 11.03.2061 ^	1.750	760	0,02
8,875 % fällig am 07.05.2042 ^	1.600	691	0,02
8,950 % fällig am 26.03.2051 ^	4.600	1.998	0,05
Summe Ghana		21.780	0,57
GUATEMALA			
STAATSEMISSIONEN			
Guatemala Government International Bond			
4,375 % fällig am 05.06.2027	8.200	7.884	0,20
4,500 % fällig am 03.05.2026	6.900	6.716	0,17
4,650 % fällig am 07.10.2041	800	656	0,02
4,875 % fällig am 13.02.2028	7.120	6.948	0,18
5,375 % fällig am 24.04.2032	300	291	0,01
6,600 % fällig am 13.06.2036	7.400	7.640	0,20
Summe Guatemala		30.135	0,78
HONGKONG			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
AIA Group Ltd.			
3,200 % fällig am 16.09.2040	900	684	0,02
Fortune Star BVI Ltd.			
3,950 % fällig am 02.10.2026	€ 3.000	2.118	0,06
5,000 % fällig am 18.05.2026	\$ 200	147	0,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
5,050 % fällig am 27.01.2027	\$ 1.300	\$ 861	0,02
6,850 % fällig am 02.07.2024	2.200	2.131	0,06
Huarong Finance Co. Ltd.			
3,875 % fällig am 13.11.2029	300	255	0,01
4,500 % fällig am 29.05.2029	3.650	3.237	0,08
5,000 % fällig am 19.11.2025	3.700	3.574	0,09
5,500 % fällig am 16.01.2025	200	198	0,01
		13.205	0,35
STAATSEMISSIONEN			
Airport Authority Hong Kong			
2,100 % fällig am 08.03.2026	7.500	7.009	0,18
(f)	1.000	693	0,02
2,625 % fällig am 04.02.2051	1.000	693	0,02
4,875 % fällig am 12.01.2030	9.100	9.259	0,24
Hong Kong Government International Bond			
3,750 % fällig am 07.06.2032	€ 7.700	8.902	0,23
		25.863	0,67
Summe Hongkong		39.068	1,02
UNGARN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
MVM Energetika Zrt			
7,500 % fällig am 09.06.2028	\$ 5.600	5.859	0,15
STAATSEMISSIONEN			
Hungarian Development Bank			
6,500 % fällig am 29.06.2028	15.300	15.778	0,41
Hungary Government International Bond			
3,125 % fällig am 21.09.2051	2.500	1.703	0,04
5,250 % fällig am 16.06.2029	8.400	8.463	0,22
5,500 % fällig am 16.06.2034	700	713	0,02
6,125 % fällig am 22.05.2028	4.300	4.478	0,12
6,250 % fällig am 22.09.2032	7.000	7.486	0,19
6,750 % fällig am 25.09.2052	3.500	3.925	0,10
7,625 % fällig am 29.03.2041	5.000	5.991	0,16
Magyar Export-Import Bank			
6,000 % fällig am 16.05.2029	€ 8.400	9.871	0,26
6,125 % fällig am 04.12.2027	\$ 5.500	5.604	0,15
		64.012	1,67
Summe Ungarn		69.871	1,82
INDIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
NTPC Ltd.			
3,750 % fällig am 03.04.2024	2.000	1.991	0,05
Reliance Industries Ltd.			
2,875 % fällig am 12.01.2032	2.400	2.058	0,06
		4.049	0,11
STAATSEMISSIONEN			
Export-Import Bank of India			
3,375 % fällig am 05.08.2026	600	577	0,01
3,875 % fällig am 12.03.2024	4.100	4.087	0,11
		4.664	0,12
Summe Indien		8.713	0,23
INDONESIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Indonesia Asahan Aluminium PT			
5,450 % fällig am 15.05.2030	8.000	8.080	0,21
5,800 % fällig am 15.05.2050	3.000	2.918	0,08
LLPL Capital Pte. Ltd.			
6,875 % fällig am 04.02.2039	885	854	0,02
Pelabuhan Indonesia Persero PT			
4,250 % fällig am 05.05.2025	6.500	6.381	0,17
4,875 % fällig am 01.10.2024	3.100	3.079	0,08
5,375 % fällig am 05.05.2045	3.693	3.594	0,09
Pertamina Persero PT			
1,400 % fällig am 09.02.2026	600	557	0,01
4,175 % fällig am 21.01.2050	5.000	4.183	0,11
5,625 % fällig am 20.05.2043	1.800	1.825	0,05
6,000 % fällig am 03.05.2042	18.900	19.949	0,52
6,450 % fällig am 30.05.2044	12.400	13.607	0,35
6,500 % fällig am 07.11.2048	9.500	10.642	0,28

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara			
4,000 % fällig am 30.06.2050	\$ 16.800	\$ 13.032	0,34
4,125 % fällig am 15.05.2027	5.600	5.452	0,14
4,375 % fällig am 05.02.2050	2.900	2.404	0,06
5,250 % fällig am 24.10.2042	2.300	2.179	0,06
5,250 % fällig am 15.05.2047	8.400	7.888	0,20
6,150 % fällig am 21.05.2048	2.700	2.773	0,07
6,250 % fällig am 25.01.2049	7.800	8.131	0,21
		117.528	3,05

STAATSEMISSIONEN			
Indonesia Government International Bond			
4,750 % fällig am 18.07.2047 (j)	2.700	2.680	0,07
5,350 % fällig am 11.02.2049	200	214	0,01
5,650 % fällig am 11.01.2053	800	883	0,02
6,625 % fällig am 17.02.2037	5.900	6.932	0,18
6,750 % fällig am 15.01.2044	7.000	8.635	0,23
7,750 % fällig am 17.01.2038	1.000	1.285	0,03

Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia			
3,800 % fällig am 23.06.2050	7.000	5.862	0,15
		26.491	0,69
Summe Indonesien		144.019	3,74

INTERNATIONAL KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG			
Project Mercury			
8,127 % fällig am 11.08.2030	€ 6.700	7.424	0,20
State Oil Co. of the Azerbaijan Republic			
8,305 % fällig am 26.11.2024	\$ 500	496	0,01
Summe International		7.920	0,21

IRAK STAATSEMISSIONEN			
Iraq Government International Bond			
5,800 % fällig am 15.01.2028	3.375	3.164	0,08

IRLAND FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
Avoca Static CLO DAC			
5,690 % fällig am 15.10.2030	€ 1.700	1.877	0,05

UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC			
5,950 % fällig am 15.04.2030	\$ 6.600	396	0,01
^(h)			
Republic of Angola Via Avenir Issuer Ireland DAC			
6,927 % fällig am 19.02.2027	19.815	18.478	0,48
Saderea DAC			
12,500 % fällig am 30.11.2026 ^	10.373	4.512	0,12
		23.386	0,61
Summe Irland		25.263	0,66

ISRAEL UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Bank Hapoalim B.M.			
3,255 % fällig am 21.01.2032	(h)	9.900	8.606
			0,22
Israel Electric Corp. Ltd.			
4,250 % fällig am 14.08.2028	5.000	4.692	0,12
5,000 % fällig am 12.11.2024	200	198	0,01
Leviathan Bond Ltd.			
6,125 % fällig am 30.06.2025	2.100	2.041	0,05
6,500 % fällig am 30.06.2027	6.800	6.414	0,17
		21.951	0,57

STAATSEMISSIONEN			
Israel Government International Bond			
5,000 % fällig am 30.10.2026 (j)	€ 39.500	44.656	1,16
Summe Israel		66.607	1,73

ELFENBEINKÜSTE KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG			
Republic of Cote d'Ivoire			
9,055 % fällig am 19.03.2027	3.010	3.208	0,08

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
JAMAICA STAATSEMISSIONEN			
Ivory Coast Government International Bond			
4,875 % fällig am 30.01.2032	€ 6.300	\$ 5.885	0,15
6,625 % fällig am 22.03.2048	300	265	0,01
		6.150	0,16
Summe Elfenbeinküste		9.358	0,24

JAMAICA UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
TransJamaican Highway Ltd.			
5,750 % fällig am 10.10.2036	\$ 3.216	2.820	0,07

JAPAN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.			
5,063 % fällig am 12.09.2025	16.500	16.442	0,43

JERSEY, KANALINSELN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Corsair International Ltd.			
8,802 % fällig am 28.01.2027	€ 15.900	17.564	0,45
9,152 % fällig am 28.01.2029	6.900	7.622	0,20
Summe Jersey, Kanalinseln		25.186	0,65

JORDANIEN STAATSEMISSIONEN			
Jordan Government International Bond			
4,950 % fällig am 07.07.2025	\$ 2.200	2.158	0,06
5,750 % fällig am 31.01.2027	2.400	2.364	0,06
6,125 % fällig am 29.01.2026	6.250	6.245	0,16
7,375 % fällig am 10.10.2047	700	624	0,02
Summe Jordanien		11.391	0,30

KASACHSTAN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
KazMunayGas National Co. JSC			
3,500 % fällig am 14.04.2033	1.800	1.500	0,04
4,750 % fällig am 19.04.2027	16.600	16.177	0,42
5,750 % fällig am 19.04.2047	15.490	13.617	0,35
6,375 % fällig am 24.10.2048	4.300	4.058	0,10
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.			
3,250 % fällig am 15.08.2030	5.400	4.463	0,12
Summe Kasachstan		39.815	1,03

KENIA STAATSEMISSIONEN			
Kenya Government International Bond			
6,875 % fällig am 24.06.2024	3.750	3.652	0,10
7,000 % fällig am 22.05.2027	2.400	2.258	0,06
7,250 % fällig am 28.02.2028	800	734	0,02
8,000 % fällig am 22.05.2032	1.900	1.725	0,04
Summe Kenia		8.369	0,22

LIBANON STAATSEMISSIONEN			
Lebanon Government International Bond			
8,250 % fällig am 17.05.2034 ^	9.700	604	0,02

LUXEMBURG STAMMAKTIEN			
DrillCo Holding Lux S.A. (b)	143.033	3.552	0,09
DrillCo Holding Lux S.A. (b)(i)	364.034	9.040	0,24
Summe Stammaktien		12.592	0,33

UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Chile Electricity Lux MPC SARL			
6,010 % fällig am 20.01.2033	\$ 8.800	9.032	0,23
Constellation Oil Services Holding S.A.			
13,500 % fällig am 30.06.2025	1.568	1.554	0,04

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Constellation Oil Services Holding S.A. (3,000 % bar oder 4,000 % PIK)			
3,000 % fällig am 31.12.2026			
(a)	\$ 3.893	\$ 2.832	0,07
FORESEA Holding S.A.			
7,500 % fällig am 15.06.2030	6.316	5.855	0,15
Greensaif Pipelines Bidco SARL			
6,129 % fällig am 23.02.2038	4.700	4.909	0,13
6,510 % fällig am 23.02.2042	4.600	4.871	0,13
Guara Norte SARL			
5,198 % fällig am 15.06.2034	13.366	12.191	0,32
Petrorio Luxembourg Trading SARL			
6,125 % fällig am 09.06.2026	7.100	6.977	0,18
TMS Issuer SARL			
5,780 % fällig am 23.08.2032	6.600	6.902	0,18
Unigel Luxembourg S.A.			
8,750 % fällig am 01.10.2026^	3.900	1.073	0,03
		56.196	1,46
Summe Luxemburg		68.788	1,79

MAZEDONIEN STAATSEMISSIONEN			
North Macedonia Government International Bond			
6,960 % fällig am 13.03.2027	€ 7.700	8.907	0,23

MALAYSIA UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Axiata SPV2 Bhd.			
2,163 % fällig am 19.08.2030	\$ 1.900	1.618	0,04
Khazanah Capital Ltd.			
4,876 % fällig am 01.06.2033	6.100	6.133	0,16
Khazanah Global Sukuk Bhd.			
4,687 % fällig am 01.06.2028	8.200	8.230	0,22
Petronas Capital Ltd.			
4,550 % fällig am 21.04.2050	9.700	8.928	0,23
Summe Malaysia		24.909	0,65

MEXIKO STAMMAKTIEN			
Hipotecaria Su Casita S.A. de C.V. (b)	39.443	0	0,00
Urbi Desarrollos Urbanos S.A.B. de C.V. (b)	2.622	1	0,00
Summe Stammaktien		1	0,00

UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Banco Mercantil del Norte S.A.			
6,625 % fällig am 24.01.2032	(f)(h)	\$ 4.100	3.494
			0,09
6,750 % fällig am 27.09.2024	(f)(h)	3.000	2.968
			0,08
7,500 % fällig am 27.06.2029	(f)(h)	5.400	5.102
			0,13
Comision Federal de Electricidad			
6,264 % fällig am 15.02.2052	5.700	5.008	0,13
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	3.148	0,08
Petroleos Mexicanos			
3,625 % fällig am 24.11.2025	€ 1.400	1.453	0,04
4,875 % fällig am 21.02.2028	1.300	1.255	0,03
6,350 % fällig am 12.02.2048	\$ 30.367	19.307	0,50
6,500 % fällig am 02.06.2041	2.000	1.366	0,04
6,625 % fällig am 15.06.2035	7.850	6.030	0,16
6,625 % fällig am 15.06.2038	200	141	0,00
6,700 % fällig am 16.02.2032	12.558	10.435	0,27
6,750 % fällig am 21.09.2047	17.180	11.263	0,29
6,840 % fällig am 23.01.2030	278	241	0,01
6,950 % fällig am 28.01.2060	29.647	19.563	0,51
7,690 % fällig am 23.01.2050	66.636	47.474	1,23
10,000 % fällig am 07.02.2033	(j)	9.950	10.002
			0,26
Sitios Latinoamerica S.A.B. de C.V.			
5,375 % fällig am 04.04.2032	7.250	6.746	0,18
		154.996	4,03

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	
STAATSEMISSIONEN				OMAN				STAATSEMISSIONEN				
Mexico Government International Bond				Oman Government International Bond				Peru Government International Bond				
2,750 % fällig am				4,875 % fällig am 01.02.2025	\$ 1.100	\$ 1.093	0,03	3,230 % fällig am 28.07.2121	\$ 1.900	\$ 1.186	0,03	
27.11.2031 (e)	MXN 263.393	\$ 13.734	0,36	5,625 % fällig am 17.01.2028	6.690	6.830	0,18	3,600 % fällig am 15.01.2072	2.600	1.840	0,05	
3,000 % fällig am				6,000 % fällig am 01.08.2029	16.100	16.715	0,43	6,550 % fällig am 14.03.2037	14.243	15.907	0,41	
03.12.2026 (e)	820.381	45.003	1,17	6,250 % fällig am 25.01.2031	7.000	7.377	0,19	8,750 % fällig am 21.11.2033	185	234	0,01	
3,750 % fällig am 19.04.2071	\$ 9.200	6.168	0,16	6,500 % fällig am 08.03.2047	3.473	3.552	0,09					
3,771 % fällig am 24.05.2061	15.400	10.489	0,27	6,750 % fällig am 28.10.2027	13.300	14.066	0,36					
4,000 % fällig am				6,750 % fällig am 17.01.2048	3.900	4.091	0,11					
30.11.2028 (e)	MXN 124.441	7.186	0,19	7,000 % fällig am 25.01.2051	2.400	2.597	0,07	Summe Peru		46.908	1,22	
5,000 % fällig am				Summe Oman		56.321	1,46	PHILIPPINEN				
27.04.2051 (j)	\$ 14.100	12.276	0,32					STAATSEMISSIONEN				
5,750 % fällig am 12.10.2110	53.450	48.034	1,25	PAKISTAN				Philippines Government International Bond				
6,338 % fällig am 04.05.2053	1.285	1.311	0,03	STAATSEMISSIONEN				2,650 % fällig am 10.12.2045	7.400	5.280	0,14	
6,350 % fällig am 09.02.2035	15.700	16.487	0,43	Pakistan Government International Bond				2,950 % fällig am 05.05.2045	1.600	1.205	0,03	
6,750 % fällig am 27.09.2034	4.570	4.970	0,13	6,000 % fällig am 08.04.2026	5.952	4.220	0,11	3,700 % fällig am 01.03.2041	650	559	0,01	
		165.658	4,31	6,875 % fällig am 05.12.2027	4.747	3.258	0,08	5,000 % fällig am 17.07.2033	6.800	6.997	0,18	
Summe Mexiko		320.655	8,34	7,375 % fällig am 08.04.2031	5.439	3.334	0,09	6,375 % fällig am 23.10.2034	847	962	0,03	
MONGOLEI				8,250 % fällig am 15.04.2024	2.866	2.725	0,07	9,500 % fällig am 02.02.2030	4.179	5.268	0,14	
STAATSEMISSIONEN				8,875 % fällig am 08.04.2051	27.405	16.658	0,43	Summe Philippinen		20.271	0,53	
Mongolia Government International Bond				PAKISTAN				POLEN				
7,875 % fällig am 05.06.2029	1.300	1.331	0,03	STAATSEMISSIONEN				STAATSEMISSIONEN				
MAROKKO				Pakistan Government International Bond				Bank Gospodarstwa Krajowego				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				6,000 % fällig am 08.04.2026	5.952	4.220	0,11	6,250 % fällig am 31.10.2028	8.000	8.459	0,22	
OCP S.A.				6,875 % fällig am 05.12.2027	4.747	3.258	0,08	Poland Government International Bond				
3,750 % fällig am 23.06.2031	10.650	9.184	0,24	7,375 % fällig am 08.04.2031	5.439	3.334	0,09	4,875 % fällig am 04.10.2033	13.400	13.618	0,35	
5,125 % fällig am 23.06.2051	4.300	3.275	0,09	8,250 % fällig am 15.04.2024	2.866	2.725	0,07	5,500 % fällig am 16.11.2027	10.250	10.657	0,28	
		12.459	0,33	8,875 % fällig am 08.04.2051	27.405	16.658	0,43	5,500 % fällig am 04.04.2053	9.500	9.931	0,26	
STAATSEMISSIONEN				Pakistan Water & Power Development Authority				Summe Polen		42.665	1,11	
Morocco Government International Bond				7,500 % fällig am 04.06.2031	5.020	2.664	0,07	KATAR				
5,500 % fällig am 11.12.2042	9.000	8.212	0,21	Summe Pakistan		32.859	0,85	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Summe Marokko		20.671	0,54	PANAMA				QatarEnergy				
MULTINATIONAL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				1,375 % fällig am 12.09.2026	15.800	14.519	0,37	
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Aeropuerto Internacional de Tocumen S.A.				2,250 % fällig am 12.07.2031	9.000	7.673	0,20	
ATP Tower Holdings LLC				5,125 % fällig am 11.08.2061	7.100	5.416	0,14	3,125 % fällig am 12.07.2041	27.350	21.082	0,55	
4,050 % fällig am 27.04.2026	10.600	9.636	0,25	Banco General S.A.				3,300 % fällig am 12.07.2051	1.200	879	0,02	
NAMIBIA				5,250 % fällig am 07.05.2031		400	344	0,01	3,300 % fällig am 12.07.2051 (j)	41.100	30.111	0,78
STAATSEMISSIONEN				(f)(h)				Summe Katar		96.645	2,51	
Namibia Government International Bond				5,250 % fällig am 07.05.2031		8.300	7.137	0,19	STAATSEMISSIONEN			
5,250 % fällig am 29.10.2025	6.000	5.943	0,15	(f)				Qatar Government International Bond				
NIEDERLANDE				Banco Nacional de Panamá				4,400 % fällig am 16.04.2050	7.100	6.558	0,17	
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				2,500 % fällig am 11.08.2030	6.100	4.533	0,12	4,625 % fällig am 02.06.2046	300	287	0,01	
Metinvest BV				Summe Panama		17.430	0,46	4,817 % fällig am 14.03.2049	1.800	1.756	0,05	
8,500 % fällig am 23.04.2026	5.700	4.018	0,10	PARAGUAY				5,103 % fällig am 23.04.2048	12.280	12.460	0,32	
Prosus NV				STAATSEMISSIONEN								
1,539 % fällig am 03.08.2028	€ 2.400	2.294	0,06	Panama Government International Bond								
2,031 % fällig am 03.08.2032	1.200	1.017	0,03	3,870 % fällig am 23.07.2060	1.400	842	0,02					
3,257 % fällig am 19.01.2027	\$ 2.400	2.219	0,06	4,300 % fällig am 29.04.2053	9.900	6.656	0,17					
3,832 % fällig am 08.02.2051	2.100	1.321	0,03	4,500 % fällig am 15.05.2047	6.100	4.349	0,11					
4,027 % fällig am 03.08.2050	1.600	1.051	0,03	4,500 % fällig am 16.04.2050	6.600	4.596	0,12					
Summe Niederlande		11.920	0,31	4,500 % fällig am 10.04.2056	3.400	2.292	0,06					
NIGERIA				4,500 % fällig am 19.01.2063	8.200	5.385	0,14					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				6,400 % fällig am 14.02.2035	13.900	13.602	0,35					
BOI Finance BV				6,700 % fällig am 26.01.2036	3.800	3.775	0,10					
7,500 % fällig am 16.02.2027	€ 14.400	14.663	0,38	6,853 % fällig am 28.03.2054	5.400	5.066	0,13					
STAATSEMISSIONEN				6,875 % fällig am 31.01.2036	2.500	2.501	0,07					
Nigeria Government International Bond				8,125 % fällig am 28.04.2034	300	319	0,01					
6,125 % fällig am 28.09.2028	\$ 2.000	1.778	0,05	8,875 % fällig am 30.09.2027	1.700	1.862	0,05					
6,500 % fällig am 28.11.2027	3.544	3.249	0,09			51.245	1,33					
7,143 % fällig am 23.02.2030	5.800	5.241	0,14	Summe Panama		68.675	1,79					
7,375 % fällig am 28.09.2033	600	513	0,01	PARAGUAY				RUMÄNIEN				
7,625 % fällig am 28.11.2047	9.846	7.837	0,20	STAATSEMISSIONEN				STAATSEMISSIONEN				
7,696 % fällig am 23.02.2038	4.800	3.949	0,10	Paraguay Government International Bond				Romania Government International Bond				
7,875 % fällig am 16.02.2032	8.100	7.304	0,19	2,739 % fällig am 29.01.2033	1.900	1.568	0,04	2,000 % fällig am 08.12.2026 (j)	€ 5.600	5.824	0,15	
8,250 % fällig am 28.09.2051	4.400	3.624	0,09	3,849 % fällig am 28.06.2033	2.200	1.957	0,05	2,125 % fällig am 07.03.2028 (j)	3.600	3.617	0,09	
8,375 % fällig am 24.03.2029	2.600	2.503	0,07	4,700 % fällig am 27.03.2027	1.800	1.778	0,05	2,625 % fällig am 02.12.2040 (j)	7.400	5.519	0,14	
		35.998	0,94	5,400 % fällig am 30.03.2050	4.400	3.924	0,10	2,875 % fällig am 13.04.2042 (j)	3.400	2.551	0,07	
Summe Nigeria		50.661	1,32	5,850 % fällig am 21.08.2033	3.600	3.666	0,10	5,000 % fällig am 27.09.2026 (j)	13.300	15.103	0,39	
				6,100 % fällig am 11.08.2044	2.400	2.364	0,06	6,125 % fällig am 22.01.2044	\$ 4.050	4.006	0,11	
				Summe Paraguay		15.257	0,40	6,375 % fällig am 18.09.2033 (j)	€ 11.400	13.340	0,35	
				PERU				7,625 % fällig am 17.01.2053	\$ 9.500	10.675	0,28	
				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Summe Rumänien		60.635	1,58	
				Banco de Credito del Peru S.A.				RUSSLAND				
				4,650 % fällig am 17.09.2024	PEN 26.100	6.846	0,18	STAATSEMISSIONEN				
				Credicorp Capital Sociedad Titulizadora S.A.				Russia Government International Bond				
				10,100 % fällig am				1,125 % fällig am 20.11.2027 ^	€ 100	45	0,00	
				15.12.2043	14.200	3.869	0,10	5,250 % fällig am 23.06.2047 ^	\$ 200	71	0,00	
				InRetail Consumer				7,500 % fällig am 31.03.2030 ^	174	114	0,01	
				3,250 % fällig am 22.03.2028	\$ 4.600	4.132	0,11	Summe Russland		230	0,01	
				Petroleos del Peru S.A.								
				4,750 % fällig am 19.06.2032	2.600	1.869	0,05					
				5,625 % fällig am 19.06.2047	17.869	11.025	0,28					
						27.741	0,72					

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
SAUDI-ARABIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Saudi Arabian Oil Co.			
1,625 % fällig am 24.11.2025	\$ 6.075	\$ 5.724	0,15
2,250 % fällig am 24.11.2030	4.500	3.875	0,10
2,875 % fällig am 16.04.2024	600	595	0,02
3,500 % fällig am 16.04.2029	3.000	2.844	0,07
3,500 % fällig am 24.11.2070	45.000	31.050	0,81
		44.088	1,15
STAATSEMISSIONEN			
Saudi Arabia Government International Bond			
0,000 % fällig am 03.03.2024 (c)	€ 1.500	1.645	0,04
2,250 % fällig am 02.02.2033	\$ 1.700	1.411	0,04
3,250 % fällig am 22.10.2030	2.000	1.859	0,05
3,450 % fällig am 02.02.2061	9.900	6.985	0,18
3,750 % fällig am 21.01.2055	8.600	6.567	0,17
4,500 % fällig am 26.10.2046 (j)	26.600	23.609	0,61
4,625 % fällig am 04.10.2047	300	270	0,01
4,750 % fällig am 18.01.2028	8.300	8.396	0,22
4,750 % fällig am 18.01.2028 (j)	27.600	27.918	0,72
		78.660	2,04
Summe Saudi-Arabien		122.748	3,19
SENEGAL			
STAATSEMISSIONEN			
Senegal Government International Bond			
4,750 % fällig am 13.03.2028	€ 3.400	3.480	0,09
5,375 % fällig am 08.06.2037	25.500	20.901	0,54
Summe Senegal		24.381	0,63
SERBIEN			
STAATSEMISSIONEN			
Serbia Government International Bond			
1,500 % fällig am 26.06.2029	12.400	11.589	0,30
6,250 % fällig am 26.05.2028	\$ 9.600	9.846	0,26
6,500 % fällig am 26.09.2033	1.150	1.183	0,03
6,500 % fällig am 26.09.2033 (j)	24.000	24.690	0,64
Summe Serbien		47.308	1,23
SINGAPUR			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Flex Ltd.			
4,875 % fällig am 15.06.2029	1.300	1.279	0,03
Singapore Airlines Ltd.			
3,375 % fällig am 19.01.2029	7.800	7.311	0,19
Summe Singapur		8.590	0,22
SLOWENIEN			
STAATSEMISSIONEN			
Slovenia Government International Bond			
5,000 % fällig am 19.09.2033	12.500	12.744	0,33
SÜDAFRIKA			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
AngloGold Ashanti Holdings PLC			
3,750 % fällig am 01.10.2030	3.600	3.132	0,08
6,500 % fällig am 15.04.2040	200	196	0,01
Development Bank of Southern Africa			
8,600 % fällig am 21.10.2024	ZAR 467.300	25.473	0,66
(i)			
Eskom Holdings SOC Ltd.			
4,314 % fällig am 23.07.2027	\$ 13.650	12.788	0,33
6,350 % fällig am 10.08.2028	14.400	14.046	0,37
7,125 % fällig am 11.02.2025	4.588	4.596	0,12
8,450 % fällig am 10.08.2028	13.200	13.420	0,35
Sasol Financing USA LLC			
5,875 % fällig am 27.03.2024	5.815	5.785	0,15
8,750 % fällig am 03.05.2029	10.600	10.826	0,28
		90.262	2,35
STAATSEMISSIONEN			
South Africa Government International Bond			
4,300 % fällig am 12.10.2028	800	750	0,02
4,850 % fällig am 30.09.2029	11.100	10.437	0,27

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
5,000 % fällig am 12.10.2046	\$ 10.200	\$ 7.579	0,20
5,375 % fällig am 24.07.2044	400	320	0,01
5,750 % fällig am 30.09.2049	6.400	5.130	0,13
7,300 % fällig am 20.04.2052	5.300	5.035	0,13
10,500 % fällig am			
21.12.2026	ZAR 921.000	52.723	1,37
		81.974	2,13
Summe Südafrika		172.236	4,48
SÜDKOREA			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Kodit Global Co. Ltd.			
4,954 % fällig am 25.05.2026	\$ 1.700	1.697	0,04
SK on Co. Ltd.			
5,375 % fällig am 11.05.2026	4.900	4.934	0,13
		6.631	0,17
STAATSEMISSIONEN			
Korea Electric Power Corp.			
5,375 % fällig am 31.07.2026	10.000	10.114	0,26
Korea National Oil Corp.			
4,875 % fällig am 03.04.2028	15.800	15.896	0,42
		26.010	0,68
Summe Südkorea		32.641	0,85
SPANIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Banco Santander S.A.			
5,147 % fällig am 18.08.2025	13.600	13.526	0,35
SRI LANKA			
STAATSEMISSIONEN			
Sri Lanka Government International Bond			
5,750 % fällig am 18.04.2023 ^	3.770	1.939	0,05
5,875 % fällig am 25.07.2022 ^	2.050	1.086	0,03
6,125 % fällig am 03.06.2025 ^	5.100	2.633	0,07
6,200 % fällig am 11.05.2027 ^	8.700	4.418	0,11
6,350 % fällig am 28.06.2024 ^	1.420	723	0,02
6,825 % fällig am 18.07.2026 ^	1.200	617	0,02
6,850 % fällig am 14.03.2024 ^	4.000	2.037	0,05
6,850 % fällig am 03.11.2025 ^	6.500	3.364	0,09
7,550 % fällig am 28.03.2030 ^	17.700	8.936	0,23
7,850 % fällig am 14.03.2029 ^	4.200	2.121	0,05
Summe Sri Lanka		27.874	0,72
ÜBERNATIONAL			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Eastern & Southern African Trade & Development Bank			
4,125 % fällig am 30.06.2028	7.300	6.325	0,16
STAATSEMISSIONEN			
Ghana Government International Bond			
10,750 % fällig am			
14.10.2030	1.050	665	0,02
Summe Supranational		6.990	0,18
SCHWEIZ			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Credit Suisse AG			
4,750 % fällig am 09.08.2024	6.000	5.965	0,15
UBS Group AG			
2,593 % fällig am 11.09.2025	1.100	1.077	0,03
6,373 % fällig am 15.07.2026	4.500	4.554	0,12
Summe Schweiz		11.596	0,30
TANSANIA			
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG			
Ivory Coast Government International Bond			
6,915 % fällig am 28.06.2024	€ 25.500	28.181	0,73
The Ministry of Finance and Planning, Government of the United Republic of Tanzania			
9,502 % fällig am 26.04.2028	10.064	11.033	0,29
Summe Tansania		39.214	1,02

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
THAILAND			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Bangkok Bank PCL			
3,733 % fällig am 25.09.2034 (h)	\$ 800	\$ 712	0,02
PTTEP Treasury Center Co. Ltd.			
2,587 % fällig am 10.06.2027	1.300	1.208	0,03
3,903 % fällig am 06.12.2059	550	438	0,01
Summe Thailand		2.358	0,06
TRINIDAD UND TOBAGO			
STAATSEMISSIONEN			
Trinidad & Tobago Government International Bond			
5,950 % fällig am 14.01.2031	5.800	6.019	0,16
TUNESIEN			
STAATSEMISSIONEN			
Banque Centrale de Tunisie Government International Bond			
3,280 % fällig am 09.08.2027	¥200.000	788	0,02
5,625 % fällig am 17.02.2024	€ 9.470	10.136	0,27
5,750 % fällig am 30.01.2025	\$ 12.200	10.045	0,26
6,375 % fällig am 15.07.2026	€ 5.505	4.254	0,11
Summe Tunesien		25.223	0,66
TÜRKEI			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Turkish Airlines Pass-Through Trust			
4,200 % fällig am 15.09.2028	\$ 4.022	3.810	0,10
Türkiye İş Bankası A/S			
6,125 % fällig am 25.04.2024	2.200	2.200	0,06
Yapı ve Kredi Bankası A/S			
5,850 % fällig am 21.06.2024	600	599	0,01
		6.609	0,17
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG			
SOCAR Turkey Enerji A/S			
7,387 % fällig am 11.08.2026	€ 18.884	20.600	0,54
STAATSEMISSIONEN			
Export-Credit Bank of Turkey			
5,750 % fällig am 06.07.2026	\$ 3.500	3.411	0,09
Hazine Mustesarlığı Varlık Kiralama A/S			
8,509 % fällig am 14.01.2029	12.600	13.382	0,35
Turkey Government International Bond			
4,875 % fällig am 16.04.2043	7.500	5.496	0,14
5,125 % fällig am 17.02.2028	22.300	21.299	0,55
5,750 % fällig am 11.05.2047 (j)	59.500	46.805	1,22
5,950 % fällig am 15.01.2031	19.600	18.521	0,48
6,000 % fällig am 14.01.2041	18.635	15.887	0,41
6,125 % fällig am 24.10.2028	5.200	5.126	0,13
6,875 % fällig am 17.03.2036	17.970	17.229	0,45
9,125 % fällig am 13.07.2030	12.000	13.274	0,35
9,875 % fällig am 15.01.2028	15.900	17.683	0,46
		178.113	4,63
Summe Türkei		205.322	5,34
UKRAINE			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
NPC Ukrenergo			
6,875 % fällig am 09.11.2028	1.700	462	0,01
STAATSEMISSIONEN			
Ukraine Government International Bond			
6,876 % fällig am 21.05.2031	2.400	558	0,01
7,253 % fällig am 15.03.2035	11.139	2.646	0,07
7,375 % fällig am 25.09.2034	5.020	1.199	0,03
7,750 % fällig am 01.09.2026	5.000	1.402	0,04
7,750 % fällig am 01.09.2027	3.300	907	0,02
7,750 % fällig am 01.08.2041	18.700	8.420	0,22
8,994 % fällig am 01.02.2026	7.500	2.252	0,06
		17.384	0,45
Summe Ukraine		17.846	0,46

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL								KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG			
Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC				Towd Point Mortgage Funding PLC				DAE Funding LLC			
3,650 % fällig am 02.11.2029	\$	4.200	3,996	6,570 % fällig am 20.05.2045	£	1.039	1.326	2,625 % fällig am 20.03.2025	\$	3.500	3.361
4,600 % fällig am 02.11.2047		5.600	5.156	6,571 % fällig am 20.07.2045		624	798	Gran Tierra Energy, Inc.		416	366
Abu Dhabi National Energy Co. PJSC				Tower Bridge Funding PLC				9,500 % fällig am 15.10.2029		416	366
4,375 % fällig am 24.01.2029		6.500	6.471	5,940 % fällig am 20.12.2063		1.085	1.376	Pricoa Global Funding		450	445
4,696 % fällig am 24.04.2033		5.500	5.582	Warwick Finance Residential Mortgages PLC				4,200 % fällig am 28.08.2025		450	445
DP World Ltd.				0,000 % fällig am				Rio Oil Finance Trust			
4,700 % fällig am 30.09.2049		1.800	1.527	21.12.2049 (c)		0	588	8,200 % fällig am 06.04.2028		6.602	6.763
5,625 % fällig am 25.09.2048		2.175	2.090	6,170 % fällig am 21.12.2049		2.869	3.667	9,750 % fällig am 06.01.2027		5.710	5.948
6,850 % fällig am 02.07.2037		4.880	5.399	6,870 % fällig am 21.12.2049		735	929	Rutas 2 and 7 Finance Ltd.			
First Abu Dhabi Bank PJSC				7,370 % fällig am 21.12.2049		367	461	0,000 % fällig am 30.09.2036		4.853	3.231
4,774 % fällig am 06.06.2028		9.100	9.067	7,870 % fällig am 21.12.2049		210	263	(c)			0,08
Kuwait Projects Co. SPC Ltd.				8,370 % fällig am 21.12.2049		210	259			29.604	0,77
4,500 % fällig am 23.02.2027		4.000	3.529	Summe Großbritannien		44.070	1,15	KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG			
Masdar Abu Dhabi Future Energy Co.								Ecopetrol S.A.			
4,875 % fällig am 25.07.2033		14.500	14.391	USA				TBD % fällig am 17.08.2024		15.200	14.918
MDGH GMTN RSC Ltd.				FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				NON-AGENCY-MBS			
3,950 % fällig am 21.05.2050		1.600	1.334	Aames Mortgage Investment Trust		2.805	2.553	Banc of America Merrill Lynch Commercial Mortgage, Inc.			
5,084 % fällig am 22.05.2053		2.700	2.656	5,950 % fällig am 25.04.2036	\$	2.805	2.553	4,407 % fällig am 15.11.2061		3.700	3.598
5,875 % fällig am 01.05.2034		6.000	6.565	Argent Securities Trust		902	786	Banc of America Mortgage Trust			
		67.763	1,76	5,770 % fällig am 25.07.2036		902	786	3,887 % fällig am 25.02.2036		4	4
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass- Through Certificates		425	358	BCAP LLC Trust		3.451	3.075
NMC Healthcare LLC				5,950 % fällig am 25.05.2035		425	358	3,671 % fällig am 26.05.2037		3.451	3.075
11,640 % fällig am				Countrywide Asset-Backed Certificates Trust		1.378	1.322	Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust		82	74
25.03.2025	AED	15.761	4.366	5,950 % fällig am 25.02.2037		1.378	1.322	3,877 % fällig am 25.05.2047		82	74
11,640 % fällig am 25.03.2027		21.014	5.822	6,595 % fällig am 25.11.2035		3.299	3.226	4,924 % fällig am 25.01.2035		4	4
		10.188	0,27	GSA Home Equity Trust		691	403	Bear Stearns ALT-A Trust		57	53
STAATSEMISSIONEN				5,910 % fällig am 25.05.2047		257	84	4,488 % fällig am 25.05.2035			
Emirate of Abu Dhabi Government International Bond				5,950 % fällig am 25.11.2036		856	332	Benchmark Mortgage Trust		1.700	1.591
3,125 % fällig am 30.09.2049	\$	900	664	6,502 % fällig am 25.11.2036		856	332	3,666 % fällig am 15.01.2051		4.800	4.556
3,875 % fällig am 16.04.2050		14.500	12.190	Home Equity Asset Trust		202	190	4,261 % fällig am 10.10.2051		162	143
Emirate of Dubai Government International Bond				6,820 % fällig am 25.02.2033		202	190	Citigroup Mortgage Loan Trust		162	143
3,900 % fällig am 09.09.2050		1.700	1.283	Humboldt Americas LLC				4,523 % fällig am 25.09.2037			
Finance Department Government of Sharjah				0,000 % fällig am				CitiMortgage Alternative Loan Trust		991	823
4,000 % fällig am 28.07.2050		9.000	6.033	31.07.2022	COP 20.000.000	4.478	0,12	6,000 % fällig am 25.10.2036			
		20.170	0,52	JPMorgan Mortgage Acquisition Trust		100	91	Countrywide Alternative Loan Trust		996	411
Summe Vereinigte Arabische Emirate		98.121	2,55	5,740 % fällig am 25.08.2036	\$	100	91	5,820 % fällig am 25.05.2036		569	513
GROSSBRITANNIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Lehman XS Trust		1.977	1.738	6,112 % fällig am 20.12.2035		82	77
Antofagasta PLC				5,011 % fällig am 25.01.2036		1.977	1.738	Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust		418	384
2,375 % fällig am 14.10.2030		2.200	1.803	MASTR Asset-Backed Securities Trust		1.060	627	3,673 % fällig am 20.05.2036		82	77
Barclays PLC				5,910 % fällig am 25.11.2036		1.060	627	4,418 % fällig am 25.11.2037		418	384
5,304 % fällig am 09.08.2026		8.400	8.370	Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust		1.385	657	Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust		174	155
HSBC Holdings PLC				5,670 % fällig am 25.02.2037		185	178	5,877 % fällig am 25.11.2034			
3,973 % fällig am 22.05.2030		400	374	6,235 % fällig am 25.01.2035		174	37	Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust		676	536
Lloyds Banking Group PLC				Morgan Stanley Mortgage Loan Trust		174	37	5,800 % fällig am 25.08.2037			
4,716 % fällig am 11.08.2026		3.700	3.654	5,930 % fällig am 25.02.2037		174	37	GSMPS Mortgage Loan Trust		137	110
NatWest Group PLC				Option One Mortgage Loan Trust		704	481	5,820 % fällig am 25.01.2036		21	20
2,875 % fällig am 19.09.2026	£	400	489	5,690 % fällig am 25.04.2037		541	321	GSR Mortgage Loan Trust			
4,269 % fällig am 22.03.2025	\$	200	199	5,690 % fällig am 25.05.2037		541	321	4,630 % fällig am 25.01.2036		21	20
4,800 % fällig am 05.04.2026		1.100	1.091	Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass- Through Certificates		3.900	3.383	HarborView Mortgage Loan Trust		98	53
5,076 % fällig am 27.01.2030		200	197	6,250 % fällig am 25.09.2035		3.900	3.383	7,012 % fällig am 19.10.2035			
Santander UK Group Holdings PLC				Renaissance Home Equity Loan Trust		780	313	HomeBanc Mortgage Trust		187	177
6,833 % fällig am 21.11.2026		900	917	5,797 % fällig am 25.08.2036		780	313	5,990 % fällig am 25.01.2036			
Ukraine Railways Via Rail Capital Markets PLC				Saxon Asset Securities Trust		243	230	Impac CMB Trust		70	62
8,250 % fällig am 09.07.2026		16.100	8.855	5,780 % fällig am 25.09.2037		243	230	6,110 % fällig am 25.03.2035			
Ukreximbank Via Biz Finance PLC				Soundview Home Loan Trust		570	481	IndyMac Mortgage Loan Trust		202	168
9,750 % fällig am 22.01.2025		1.093	1.019	5,640 % fällig am 25.08.2037		67	63	3,506 % fällig am 25.11.2037		1.268	1.248
		26.968	0,70	5,970 % fällig am 25.11.2036		421	418	5,830 % fällig am 25.02.2037		320	255
NON-AGENCY-MBS				5,995 % fällig am 25.03.2036		1.259	989	6,110 % fällig am 25.07.2045			
Canada Square Funding PLC				6,370 % fällig am 25.10.2037		1.259	989	JPMorgan Resecuritization Trust		191	183
6,070 % fällig am 17.01.2059	£	2.476	3.139	Summe USA		23.739	0,62	2,500 % fällig am 25.03.2056			
Formentera Issuer PLC				AKTIEN				Lehman XS Trust		1.931	1.627
6,020 % fällig am 28.07.2047		142	180	ENERGIE				5,850 % fällig am 25.09.2046		1.931	1.627
Rochester Financing PLC				Constellation Oil Services Holding S.A. 'B' (b)(i)		4.243.669	460	Residential Accredited Loans, Inc. Trust		326	266
5,920 % fällig am 18.12.2044		2.618	3.313					6,000 % fällig am 25.08.2036			
Stratton Mortgage Funding PLC				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust		21	19
6,120 % fällig am 12.03.2052		630	803	Cantor Fitzgerald LP				4,974 % fällig am 25.09.2037			
				7,200 % fällig am 12.12.2028	\$	9.250	9.490	Structured Asset Mortgage Investments Trust		704	644
								5,770 % fällig am 25.02.2037			
								SunTrust Adjustable Rate Mortgage Loan Trust		455	392
								4,456 % fällig am 25.10.2037			
								TBW Mortgage-Backed Trust		1.257	295
								6,540 % fällig am 25.01.2037			

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

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

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2024	\$ 500	\$ 2	0,00

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS		4,320 %	20.10.2033	£ 1.100	\$ 123	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		1,000	21.09.2024	\$ 90.600	(5)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		1,000	15.06.2029	11.100	(1.102)	(0,03)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		1,500	21.06.2027	13.700	(1.916)	(0,05)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		1,500	15.12.2028	400	(45)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		1,750	15.06.2024	93.700	(477)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		1,750	15.12.2031	5.700	(885)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		2,250	21.12.2046	1.200	540	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		2,500	15.06.2046	600	279	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,500	20.12.2030	152.400	(4.412)	(0,12)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,500	20.12.2030	40.500	2.137	0,06
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,500	20.12.2033	12.640	723	0,02
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,730	03.08.2033	3.300	59	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,735	07.08.2033	3.700	70	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,750	20.12.2028	2.100	97	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,830	12.10.2053	2.300	226	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,870	17.10.2053	1.900	201	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,880	16.10.2053	2.300	248	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		4,030	04.10.2033	300	14	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		4,150	12.10.2033	4.500	258	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		4,155	02.10.2033	6.200	355	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		4,165	27.09.2033	7.200	418	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		4,170	03.10.2033	8.900	522	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		4,175	10.10.2033	5.300	313	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		4,220	20.10.2033	4.000	253	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		4,230	23.10.2033	2.200	141	0,00
Erhalt ⁽³⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		4,250	20.03.2034	12.500	(124)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		4,255	23.10.2033	2.400	159	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		4,393	25.10.2033	400	31	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		4,450	31.10.2033	3.800	317	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI		11,850	02.01.2025	BRL 87.000	25	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		12,240	02.01.2025	210.200	79	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI		13,055	04.01.2027	102.700	(1.400)	(0,04)
Erhalt	1-Year BRL-CDI		13,216	02.01.2025	36.500	(190)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI		13,241	02.01.2025	38.600	(204)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI		13,427	02.01.2025	86.600	(514)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		13,428	02.01.2025	124.500	743	0,02
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR		5,950	30.11.2024	ZAR 560.000	655	0,02
Zahlung ⁽³⁾	6-Month AUD-BBR-BBSW		4,500	20.03.2034	AUD 138.400	2.124	0,05
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW		4,750	20.12.2028	59.100	1.524	0,04
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		4,855	18.12.2033	CLP 10.615.700	(70)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		5,511	13.11.2033	11.556.400	(562)	(0,01)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR		4,175	07.11.2028	CZK 1.701.000	1.909	0,05
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR		4,611	06.06.2028	186.600	354	0,01
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR		2,750	20.03.2054	€ 16.000	(720)	(0,02)
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR		3,000	20.03.2034	30.200	656	0,02
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR		3,250	20.03.2029	70.700	3.504	0,09
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		3,300	03.10.2033	5.100	399	0,01
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		3,370	09.10.2028	1.800	82	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		3,450	20.10.2028	8.200	408	0,01
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		5,455	10.01.2028	PLN 24.000	(340)	(0,01)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		5,490	10.01.2028	22.800	(332)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIE		9,769	27.09.2028	MXN 170.620	(458)	(0,01)
						\$ 6.190	0,16
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						\$ 6.192	0,16

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

⁽²⁾ Der maximale mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

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

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond Fund (Forts.)

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

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

OPTIONSKAUF

DEVISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Put - OTC GBP versus USD	\$ 1,160	12.06.2024	58	\$ 0	\$ 0	0,00
MYI	Put - OTC GBP versus USD	1,160	12.06.2024	73.182	291	156	0,00
					\$ 291	\$ 156	0,00

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Chile Government International Bond	(1,000) %	20.12.2028	\$ 3.800	\$ (78)	\$ (10)	\$ (88)	0,00
	Oman Government International Bond	(1,000)	20.12.2027	2.300	75	(79)	(4)	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	(1,000)	20.12.2028	54.600	(827)	(375)	(1.202)	(0,03)
BPS	Chile Government International Bond	(1,000)	20.12.2028	2.590	(52)	(8)	(60)	0,00
	Oman Government International Bond	(1,000)	20.12.2027	1.100	36	(38)	(2)	0,00
BRC	Oman Government International Bond	(1,000)	20.12.2027	2.400	64	(68)	(4)	0,00
GST	Chile Government International Bond	(1,000)	20.12.2028	190	(4)	0	(4)	0,00
	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.12.2028	15.400	(453)	(64)	(517)	(0,01)
HUS	Dubai Government International Bond	(1,000)	20.12.2024	3.600	(12)	(18)	(30)	0,00
JPM	Chile Government International Bond	(1,000)	20.12.2028	4.500	(91)	(13)	(104)	0,00
	Dubai Government International Bond	(1,000)	20.12.2024	1.500	(2)	(11)	(13)	0,00
	South Africa Government International Bond	(1,000)	20.06.2026	27.250	1.274	(1.240)	34	0,00
	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.12.2025	6.300	608	(552)	56	0,00
MYC	Chile Government International Bond	(1,000)	20.12.2028	6.320	(128)	(18)	(146)	(0,01)
	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.12.2026	800	135	(113)	22	0,00
				\$ 545	\$ (2.607)	\$ (2.062)	(0,05)	

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Chile Government International Bond	1,000 %	20.06.2024	\$ 8.100	\$ 26	\$ 13	\$ 39	0,00
	Chile Government International Bond	1,000	20.12.2026	700	4	12	16	0,00
	Chile Government International Bond	1,000	20.12.2027	5.000	(18)	139	121	0,00
	Egypt Government International Bond	1,000	20.12.2024	1.300	(156)	68	(88)	0,00
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.12.2028	12.900	(17)	192	175	0,01
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	13.200	4	56	60	0,00
	Nigeria Government International Bond	1,000	20.12.2028	1.300	(289)	59	(230)	(0,01)
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	2.900	26	23	49	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.12.2031	2.000	(84)	67	(17)	0,00
	Qatar Government International Bond	1,000	20.12.2028	60.850	1.130	368	1.498	0,04
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2025	9.600	(526)	564	38	0,00
BPS	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2027	2.500	(171)	175	4	0,00
	Chile Government International Bond	1,000	20.12.2024	5.400	6	44	50	0,00
	Chile Government International Bond	1,000	20.12.2026	6.800	39	112	151	0,01
	Chile Government International Bond	1,000	20.06.2027	10.000	(182)	414	232	0,01
	China Government International Bond	1,000	20.12.2028	74.700	895	491	1.386	0,04
	Egypt Government International Bond	1,000	20.06.2024	1.000	(93)	65	(28)	0,00
	Egypt Government International Bond	1,000	20.12.2024	200	(24)	10	(14)	0,00
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.12.2028	63.500	0	860	860	0,02
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	3.900	(6)	24	18	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	12.000	65	37	102	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2026	4.900	6	73	79	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	32.100	116	422	538	0,02
	Serbia Government International Bond	1,000	20.12.2027	1.800	(160)	117	(43)	0,00
BRC	Chile Government International Bond	1,000	20.06.2024	4.500	12	10	22	0,00
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.12.2028	400	0	5	5	0,00
	Poland Government International Bond	1,000	20.06.2028	3.200	24	31	55	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.12.2024	15.687	(277)	405	128	0,00
CBK	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2026	5.000	(237)	285	48	0,00
	Chile Government International Bond	1,000	20.12.2024	3.300	8	23	31	0,00
	China Government International Bond	1,000	20.12.2028	4.100	20	56	76	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2026	6.000	11	86	97	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2028	7.100	(8)	74	66	0,00
	Panama Government International Bond	1,000	20.06.2024	3.400	6	5	11	0,00
	Panama Government International Bond	1,000	20.12.2024	5.900	0	28	28	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	2.200	19	18	37	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2024	50.000	429	(209)	220	0,01
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.12.2024	1.200	(41)	51	10	0,00
DUB	Eskom Holdings SOC Ltd.	4,650	30.06.2029	16.000	0	1.389	1.389	0,04
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2024	10.000	(131)	167	36	0,00
GLM	Nigeria Government International Bond	1,000	20.12.2028	1.250	(270)	49	(221)	(0,01)

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festsinnsatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens	
GST	Brazil Government International Bond	1,000 %	20.06.2026	\$ 600	\$ (32)	\$ 38	\$ 6	0,00	
	Chile Government International Bond	1,000	20.12.2026	3.600	33	47	80	0,00	
	Chile Government International Bond	1,000	20.06.2028	9.300	18	202	220	0,01	
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	100	(1)	2	1	0,00	
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2028	700	(7)	11	4	0,00	
	Panama Government International Bond	1,000	20.12.2024	15.000	73	(1)	72	0,00	
	Panama Government International Bond	1,000	20.12.2025	10.000	22	10	32	0,00	
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	29.100	118	370	488	0,01	
	Philippines Government International Bond	1,000	20.12.2028	12.200	52	158	210	0,01	
	Poland Government International Bond	1,000	20.06.2028	4.200	38	34	72	0,00	
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2024	3.000	29	(16)	13	0,00	
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.12.2024	3.413	36	(8)	28	0,00	
	HUS	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	100	(1)	1	0	0,00
		Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2024	9.700	103	(60)	43	0,00
	JPM	Banco do Brasil S.A.	1,000	20.12.2024	9.800	(220)	216	(4)	0,00
		Chile Government International Bond	1,000	20.12.2026	7.700	41	130	171	0,01
		Chile Government International Bond	1,000	20.06.2027	10.000	(178)	410	232	0,01
Nigeria Government International Bond		1,000	20.12.2024	5.950	(244)	169	(75)	0,00	
Nigeria Government International Bond		1,000	20.12.2028	5.000	(1.158)	273	(885)	(0,02)	
Nigeria Government International Bond		5,000	20.06.2024	10.000	38	82	120	0,00	
Panama Government International Bond		1,000	20.12.2024	10.000	47	1	48	0,00	
Peru Government International Bond		1,000	20.06.2026	1.500	13	12	25	0,00	
Poland Government International Bond		1,000	20.06.2028	1.300	(3)	25	22	0,00	
Saudi Arabia Government International Bond		1,000	20.06.2024	11.100	140	(91)	49	0,00	
MYC	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2027	9.100	(564)	615	51	0,00	
	Egypt Government International Bond	1,000	20.06.2024	1.000	(87)	59	(28)	0,00	
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.12.2028	8.400	2	112	114	0,00	
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	1.500	(1)	8	7	0,00	
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	4.100	(15)	50	35	0,00	
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2027	200	(1)	4	3	0,00	
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2028	500	(10)	15	5	0,00	
	Nigeria Government International Bond	1,000	20.12.2028	5.000	(1.139)	253	(886)	(0,02)	
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	37.300	105	521	626	0,02	
	Peru Government International Bond	1,000	20.12.2026	3.000	(10)	65	55	0,00	
	Qatar Government International Bond	1,000	20.12.2026	5.300	77	26	103	0,00	
	Qatar Government International Bond	1,000	20.12.2028	5.700	86	54	140	0,01	
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2024	18.000	98	(19)	79	0,00	
	MYI	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	2.700	23	22	45	0,00
							\$ (2.323)	\$10.678	\$8.355

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

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

⁽³⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	01.2024	\$ 2.051	AUD 3.097	\$ 63	0	\$ 63	0,00
	03.2024	CNH 8.813	\$ 1.223	0	(22)	(22)	0,00
BOA	01.2024	CAD 1.417	1.046	0	(29)	(29)	0,00
	01.2024	COP 228.201.723	56.735	0	(2.101)	(2.101)	(0,06)
	01.2024	DOP 142.697	2.493	46	0	46	0,00
	01.2024	£ 728	925	0	(3)	(3)	0,00
	01.2024	HUF 236.678	651	0	(31)	(31)	0,00
	01.2024	PEN 13.560	3.654	0	(6)	(6)	0,00
	01.2024	PLN 5.625	1.353	0	(77)	(77)	0,00
	01.2024	\$ 59.661	COP 228.201.723	0	(823)	(823)	(0,02)
	01.2024	4.367	HUF 1.614.506	286	0	286	0,01
	01.2024	2.477	¥ 365.529	117	0	117	0,00
	01.2024	614	NOK 6.530	29	0	29	0,00
	01.2024	3.729	PLN 15.274	154	0	154	0,00
	01.2024	1.756	TRY 52.056	0	(6)	(6)	0,00
	02.2024	DOP 399.889	\$ 6.926	74	0	74	0,00
	02.2024	\$ 6	CNY 40	0	0	0	0,00
	03.2024	CNH 12.404	\$ 1.713	0	(39)	(39)	0,00
	03.2024	COP 228.201.723	58.800	790	0	790	0,02
	03.2024	EGP 50.687	1.448	284	0	284	0,01
	03.2024	IDR 21.051.063	1.334	0	(31)	(31)	0,00
	03.2024	\$ 301	INR 25.155	1	0	1	0,00
03.2024	14	PHP 796	0	0	0	0,00	

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	04.2024	MYR	20.480	\$ 4.475	\$ 0	\$ (22)	0,00
	04.2024	\$	1.262	EGP 50.112	0	(139)	0,00
BPS	04.2024		4.465	MYR 20.596	57	0	0,00
	01.2024	CAD	980	\$ 721	0	(22)	0,00
	01.2024	€	49.768	54.351	4	(641)	(0,02)
	01.2024	£	2.776	3.521	0	(18)	0,00
	01.2024	HUF	5.092.251	14.502	0	(213)	(0,01)
	01.2024	IDR	117.148.900	7.580	0	(26)	0,00
	01.2024	¥	2.280.000	16.163	0	(53)	0,00
	01.2024	PEN	688	185	0	(1)	0,00
	01.2024	PLN	25.025	5.878	0	(484)	(0,01)
	01.2024	\$	7.378	AUD 10.960	102	0	0,00
	01.2024		4.019	BRL 19.766	50	0	0,00
	01.2024		1.435	CAD 1.945	41	0	0,00
	01.2024		63.637	€ 57.792	251	(33)	0,01
	01.2024		1.677	HUF 594.996	38	0	0,00
	01.2024		1.014	IDR 15.655.050	2	0	0,00
	01.2024		2.809	¥ 409.400	97	0	0,00
	01.2024		1.314	PLN 5.674	129	0	0,00
	01.2024	ZAR	265.390	\$ 14.316	0	(177)	0,00
	02.2024	EGP	22.149	633	113	0	0,00
	02.2024	TWD	37.726	1.186	0	(61)	0,00
	02.2024	\$	262	EGP 9.414	0	(40)	0,00
	03.2024	CLP	2.273.328	\$ 2.626	33	0	0,00
	03.2024	CNH	8.584	1.193	0	(20)	0,00
	03.2024	IDR	53.081.818	3.405	0	(37)	0,00
	03.2024	PEN	12.538	3.376	0	(2)	0,00
	03.2024	THB	77.328	2.199	0	(82)	0,00
	03.2024	\$	3.382	IDR 53.145.084	64	0	0,00
	03.2024		2.663	ILS 9.639	20	0	0,00
	03.2024		1.045	INR 87.374	2	0	0,00
	03.2024		2.204	PEN 8.301	33	0	0,00
	03.2024		750	THB 25.911	14	0	0,00
	06.2024		102	£ 81	2	0	0,00
BRC	06.2024		2.676	KRW 3.441.788	3	0	0,00
	01.2024	€	245.386	\$ 269.871	0	(1.257)	(0,03)
	01.2024	NZD	9.123	5.612	0	(164)	0,00
	01.2024	PLN	14.785	3.381	0	(378)	(0,01)
	01.2024	\$	1.378	AUD 2.095	52	0	0,00
	01.2024		1.072	HUF 381.469	28	0	0,00
	01.2024		8.225	TRY 246.649	53	(10)	0,00
	02.2024	EGP	109.243	\$ 3.123	555	0	0,01
	02.2024	\$	2.122	TRY 64.694	0	(14)	0,00
	03.2024		6.031	189.470	10	(45)	0,00
	04.2024		13.765	440.765	0	(181)	0,00
BSH	06.2024	£	5.790	\$ 7.284	0	(100)	0,00
CBK	02.2024	¥	7.320.000	52.140	0	(158)	0,00
	01.2024	BRL	43.245	8.882	0	(21)	0,00
	01.2024	CAD	2.002	1.500	0	(18)	0,00
	01.2024	CLP	10.186.369	11.488	0	(175)	0,00
	01.2024	COP	20.000.000	4.886	0	(247)	(0,01)
	01.2024	€	1.419	1.542	0	(26)	0,00
	01.2024	£	232	294	0	(2)	0,00
	01.2024	HUF	909.915	2.557	4	(74)	0,00
	01.2024	MXN	729.388	40.843	0	(2.035)	(0,05)
	01.2024	PLN	9.702	2.294	0	(173)	0,00
	01.2024	\$	1.302	AUD 1.936	19	0	0,00
	01.2024		3.308	BRL 16.285	45	0	0,00
	01.2024		5.208	CAD 6.969	78	0	0,00
	01.2024		2.062	CHF 1.796	74	0	0,00
	01.2024		11.599	CLP 10.169.137	44	0	0,00
	01.2024		1.097	€ 1.014	24	0	0,00
	01.2024		17.360	¥ 2.451.100	37	0	0,00
	01.2024		8.695	MXN 151.374	204	0	0,01
	01.2024		148	NOK 1.579	8	0	0,00
	01.2024		5.730	PLN 24.008	374	0	0,01
	01.2024		1.741	SEK 18.225	68	0	0,00
	01.2024		863	ZAR 16.268	26	0	0,00
	01.2024	ZAR	12.375	\$ 672	0	(4)	0,00
	02.2024	\$	2.165	BRL 10.953	86	0	0,00
	02.2024		2.010	EGP 72.647	0	(303)	(0,01)
	03.2024	ILS	6.779	\$ 1.862	0	(25)	0,00
	03.2024	¥	1.180.000	8.419	0	(28)	0,00
	03.2024	PEN	34.641	9.199	0	(134)	0,00
	03.2024	\$	11.488	CLP 10.228.300	178	0	0,00
	03.2024		1.006	IDR 15.600.344	6	0	0,00
	03.2024		6.766	PEN 25.193	40	(18)	0,00
	04.2024		8.882	BRL 43.683	37	0	0,00
	04.2024		4.586	TRY 154.052	78	0	0,00
DUB	01.2024	NGN	135.300	\$ 220	86	0	0,00
	01.2024	\$	1.444	ZAR 27.412	53	0	0,00
	02.2024		1.861	EGP 67.006	0	(287)	(0,01)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	03.2024	CNH	5.903	\$ 819	\$ 0	\$ (15)	0,00
	03.2024	\$	1.664	SGD 2.203	12	0	0,00
	04.2024	EGP	70.919	\$ 1.861	271	0	0,01
	04.2024	\$	1.573	EGP 62.146	0	(180)	(0,01)
GLM	01.2024	AUD	4.142	\$ 2.777	0	(50)	0,00
	01.2024	CAD	17.928	13.220	0	(378)	(0,01)
	01.2024	CHF	7.894	9.008	0	(376)	(0,01)
	01.2024	DOP	1.447.741	25.378	558	0	0,01
	01.2024	HUF	726.758	2.004	0	(90)	0,00
	01.2024	MXN	843.867	48.107	0	(1.500)	(0,04)
	01.2024	NOK	3.775	364	0	(7)	0,00
	01.2024	\$	5.518	HUF 1.999.083	243	0	0,01
	01.2024	2.155	MXN 37.281	37	0	37	0,00
	01.2024	8.563	PLN 33.915	60	0	60	0,00
	01.2024	703	TRY 21.370	11	0	11	0,00
	01.2024	1.058	ZAR 20.062	38	0	38	0,00
	01.2024	ZAR	959.411	\$ 51.340	0	(1.040)	(0,03)
	02.2024	\$	46	EGP 1.665	0	(7)	0,00
	03.2024	CNH	3.838	\$ 532	0	(10)	0,00
	03.2024	DOP	167.242	2.924	63	0	0,00
	03.2024	\$	2.283	PEN 8.484	3	0	0,00
	03.2024	564	TRY 17.707	0	(6)	(6)	0,00
	04.2024	DOP	160.100	\$ 2.784	56	0	0,00
	04.2024	\$	2.442	EGP 96.337	0	(282)	(0,01)
JPM	01.2024	HUF	6.615.722	\$ 18.831	0	(287)	(0,01)
	01.2024	\$	744	BRL 3.675	13	0	0,00
	01.2024	258	MXN 4.802	24	0	24	0,00
	01.2024	81	NGN 66.987	0	(15)	(15)	0,00
	01.2024	3.986	TRY 118.303	0	(11)	(11)	0,00
	02.2024	EGP	55.500	\$ 1.593	289	0	0,01
	02.2024	\$	8.652	BRL 42.436	69	0	0,00
	02.2024	1.000	EGP 36.046	0	(153)	(153)	0,00
	02.2024	10.529	INR 879.612	17	0	17	0,00
	02.2024	2.946	TRY 89.936	0	(16)	(16)	0,00
	03.2024	AED	37.511	\$ 10.221	2	0	0,00
	03.2024	CLP	2.744.025	3.043	0	(87)	0,00
	03.2024	IDR	21.657.544	1.396	0	(8)	0,00
	03.2024	THB	64.518	1.815	0	(88)	0,00
	03.2024	TWD	19.460	626	0	(19)	0,00
	03.2024	\$	1.037	IDR 16.011.487	1	0	0,00
	03.2024	313	INR 26.188	0	0	0	0,00
	04.2024	709	EGP 27.991	0	(81)	(81)	0,00
MBC	06.2024	KRW	602.380	\$ 461	0	(8)	0,00
	01.2024	AUD	1.667	1.129	0	(9)	0,00
	01.2024	€	37.460	40.868	0	(522)	(0,01)
	01.2024	HUF	2.102.208	5.670	0	(388)	(0,01)
	01.2024	¥	520.000	3.643	0	(49)	0,00
	01.2024	\$	963	AUD 1.453	28	0	0,00
	01.2024	4.595	CAD 6.234	133	0	133	0,00
	01.2024	1.748	£ 1.388	21	0	21	0,00
	01.2024	690	HUF 242.371	9	0	9	0,00
	01.2024	1.887	¥ 269.000	22	0	22	0,00
	01.2024	1.043	NOK 11.305	71	0	71	0,00
	01.2024	ZAR	144.060	\$ 7.538	0	(330)	(0,01)
	02.2024	¥	1.060.000	7.467	0	(98)	0,00
	03.2024	PHP	136.267	2.435	0	(25)	0,00
	03.2024	TWD	56.481	1.814	0	(57)	0,00
	03.2024	\$	3.088	CNH 21.851	0	(2)	0,00
	03.2024	3.361	INR 280.000	0	(8)	(8)	0,00
	04.2024	4.551	EGP 182.950	0	(449)	(449)	(0,01)
MYI	01.2024	AUD	18	\$ 13	0	0	0,00
	01.2024	€	318	353	2	0	0,00
	01.2024	£	50	64	0	0	0,00
	01.2024	HUF	1.290.164	3.667	0	(61)	0,00
	01.2024	MYR	4.927	1.056	0	(19)	0,00
	01.2024	NGN	322.875	525	205	0	0,01
	01.2024	PLN	9.528	2.310	0	(112)	0,00
	01.2024	SGD	283	215	0	0	0,00
	01.2024	\$	1.786	£ 1.415	20	(1)	0,00
	01.2024	1.390	HUF 490.251	23	0	23	0,00
	01.2024	942	¥ 138.852	44	0	44	0,00
	01.2024	135	SGD 178	0	0	0	0,00
	01.2024	3.673	ZAR 67.686	23	0	23	0,00
	02.2024	EGP	29.660	\$ 847	151	0	0,00
	02.2024	\$	11	CNY 80	0	0	0,00
	02.2024	25	EGP 905	0	(4)	(4)	0,00
	03.2024	CNH	8.410	\$ 1.166	0	(22)	0,00
	03.2024	IDR	27.010.172	1.755	3	0	0,00
	03.2024	THB	26.336	761	0	(16)	0,00
	03.2024	\$	582	EGP 20.855	0	(103)	0,00
	04.2024	EGP	59.622	\$ 1.562	225	0	0,01
	04.2024	\$	3.020	EGP 120.817	0	(311)	(0,01)

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
	06.2024	KRW	209.363	\$ 161	\$ 0	\$ (2)	0,00	
	06.2024	\$	7.167	£ 5.709	114	0	0,00	
RBC	04.2024	MXN	1.229	\$ 69	0	(2)	0,00	
RYL	01.2024	AUD	2.612	£ 1.756	0	(27)	0,00	
	01.2024	\$	1.479	£ 1.156	0	(5)	0,00	
SCX	01.2024	€	18	\$ 20	0	0	0,00	
	01.2024	¥	1.279.000	8.897	0	(181)	(0,01)	
	01.2024	\$	88	€ 79	0	0	0,00	
	01.2024		149	MYR 698	3	0	0,00	
	01.2024		557	NGN 457.854	0	(104)	0,00	
	01.2024		783	TRY 23.176	0	(2)	0,00	
	02.2024	MYR	11.150	\$ 2.437	0	0	0,00	
	02.2024	\$	801	EGP 28.824	0	(123)	0,00	
	02.2024		2.413	MYR 11.177	30	0	0,00	
	03.2024	CNH	8.257	\$ 1.140	0	(26)	0,00	
	03.2024	THB	92.277	2.670	0	(52)	0,00	
	03.2024	\$	853	EGP 30.605	0	(150)	0,00	
	03.2024		7.761	IDR 120.023.865	22	0	0,00	
	03.2024		682	INR 57.015	1	0	0,00	
	04.2024		3.000	EGP 118.215	0	(350)	(0,01)	
SSB	01.2024	CLP	10.916.650	\$ 12.349	0	(142)	0,00	
	03.2024	IDR	26.871.161	1.731	0	(11)	0,00	
	03.2024	\$	688	IDR 10.714.513	7	0	0,00	
TOR	01.2024		1.557	¥ 228.343	64	0	0,00	
	03.2024	CNH	3.993	\$ 553	0	(11)	0,00	
UAG	01.2024	£	16.023	20.269	0	(158)	0,00	
	01.2024	HUF	1.641	5	0	0	0,00	
	01.2024	\$	779	AUD 1.175	22	0	0,00	
	01.2024		719	BRL 3.543	10	0	0,00	
	01.2024		6.556	IDR 101.444.549	30	0	0,00	
	01.2024		3.405	NOK 36.325	172	0	0,00	
	01.2024		1.044	NZD 1.697	30	0	0,00	
	01.2024		140	SEK 1.446	3	0	0,00	
	01.2024	ZAR	100.853	\$ 5.283	0	(224)	(0,01)	
	03.2024	CZK	363.202	16.315	98	0	0,00	
	03.2024	IDR	101.499.619	6.556	0	(26)	0,00	
	03.2024	¥	5.040.000	36.009	0	(112)	0,00	
					\$ 8.519	\$ (20.124)	\$ (11.605)	(0,30)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 31. Dezember 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	01.2024	\$ 1.620	AUD 2.443	\$ 47	\$ 0	\$ 47	0,00
BOA	01.2024	86	130	3	0	3	0,00
BPS	01.2024	AUD 16	\$ 11	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 49	AUD 73	1	0	1	0,00
BRC	01.2024	3	5	0	0	0	0,00
CBK	01.2024	80	118	1	0	1	0,00
GLM	01.2024	52	78	1	0	1	0,00
MBC	01.2024	673	1.015	20	0	20	0,00
RYL	01.2024	3	5	0	0	0	0,00
UAG	01.2024	780	1.176	22	0	22	0,00
				\$ 95	\$ 0	\$ 95	0,00

Zum 31. Dezember 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
BRC	01.2024	\$ 4.277	CHF 3.730	\$ 158	\$ 0	\$ 158	0,00
CBK	01.2024	25.313	22.054	904	0	904	0,02
GLM	01.2024	28.222	24.731	1.178	0	1.178	0,04
MYI	01.2024	CHF 11	\$ 13	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	\$ 28.368	CHF 24.763	1.070	0	1.070	0,03
				\$ 3.310	\$ (1)	\$ 3.309	0,09

Zum 31. Dezember 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	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	01.2024	€ 18.529	\$ 20.239	\$ 1	\$ (235)	\$ (234)	(0,01)
	01.2024	\$ 539.487	€ 490.734	2.731	(4)	2.727	0,07
BRC	01.2024	449.859	409.045	2.096	0	2.096	0,06
CBK	01.2024	€ 20.731	\$ 22.535	10	(381)	(371)	(0,01)
MBC	01.2024	78	85	0	(2)	(2)	0,00
	01.2024	\$ 400.182	€ 366.005	4.219	0	4.219	0,10
				\$ 9.057	\$ (622)	\$ 8.435	0,21

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu liefernde Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2024	£ 284	\$ 359	\$ 0	\$ (3)	\$ (3)	0,00
	01.2024	\$ 4.229	£ 3.338	27	0	27	0,00
BPS	01.2024	£ 14	\$ 17	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 3.386	£ 2.670	17	0	17	0,00
BRC	01.2024	55	43	0	0	0	0,00
CBK	01.2024	£ 237	\$ 299	0	(2)	(2)	0,00
GLM	01.2024	\$ 95	£ 75	1	0	1	0,00
	01.2024	£ 44	\$ 56	0	0	0	0,00
MBC	01.2024	214	273	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 17	£ 13	0	0	0	0,00
MYI	01.2024	£ 84	\$ 106	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	\$ 8	£ 6	0	0	0	0,00
SCX	01.2024	19.415	15.349	153	0	153	0,01
SSB	01.2024	11.885	9.419	123	0	123	0,00
UAG	01.2024	£ 0	\$ 0	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 19.413	£ 15.339	142	0	142	0,00
				\$ 463	\$ (6)	\$ 457	0,01

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) thesaurierend und Class E SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
DUB	01.2024	\$ 8.020	SGD 10.661	\$ 64	\$ 0	\$ 64	0,00
GLM	01.2024	SGD 157	\$ 117	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	\$ 248	SGD 329	2	0	2	0,00
JPM	01.2024	2.036	2.715	23	0	23	0,00
MBC	01.2024	SGD 635	\$ 475	0	(7)	(7)	0,00
	01.2024	\$ 7	SGD 10	0	0	0	0,00
MYI	02.2024	SGD 182	\$ 139	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 7.502	SGD 10.007	87	0	87	0,01
TOR	02.2024	146	193	0	0	0	0,00
	01.2024	6.949	9.271	82	0	82	0,00
UAG	02.2024	SGD 39	\$ 30	0	0	0	0,00
	01.2024	45	34	0	0	0	0,00
				\$ 258	\$ (8)	\$ 250	0,01
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 7.390	0,19

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
INLAGENZERTIFIKATE			
Banco Davivienda S.A.			
10,942 % fällig am 28.04.2026	COP 1.520.000	\$ 396	0,01
11,679 % fällig am 12.05.2025	20.903.700	5.369	0,14
12,950 % fällig am 08.03.2026	15.954.589	4.283	0,11
13,183 % fällig am 06.06.2026	13.699.000	3.725	0,10
13,455 % fällig am 13.06.2025	8.845.000	2.353	0,06
13,456 % fällig am 07.06.2025	17.680.000	4.705	0,12
13,456 % fällig am 09.06.2025	5.906.000	1.572	0,04
13,501 % fällig am 13.12.2024	15.106.000	3.984	0,10
15,389 % fällig am 21.02.2024	4.622.500	1.207	0,03
BanColombia S.A.			
5,917 % fällig am 27.01.2024	21.517.000	5.555	0,15
10,388 % fällig am 20.04.2026	29.093.800	7.506	0,20
13,320 % fällig am 08.06.2025	7.817.000	2.055	0,05
13,456 % fällig am 14.06.2025	14.569.000	3.867	0,10
13,637 % fällig am 14.12.2024	20.654.000	5.408	0,14
16,137 % fällig am 01.09.2024	8.476.000	2.245	0,06

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
BBVA Colombia S.A.			
13,093 % fällig am 28.04.2026	COP 7.588.000	\$ 2.069	0,06
13,229 % fällig am 10.05.2026	3.293.000	901	0,02
13,365 % fällig am 04.05.2026	4.790.000	1.287	0,03
14,460 % fällig am 13.01.2024	9.047.900	2.327	0,06
16,412 % fällig am 25.04.2024	334.000	86	0,00
Summe Einlagenzertifikate		\$ 60.900	1,58
Summe Anlagen		\$ 4.217.590	109,65
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (371.305)	(9,65)
Nettovermögen		\$ 3.846.285	100,00

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(b) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(c) Nullkuponwertpapier.

(d) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(e) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

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

(g) Mit dem Teilfonds verbunden.

(h) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(i) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,89 %):

Emittentenbeschreibung	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Constellation Oil Services Holding S.A. - Exp. 10. Juni 2071	10.06.2022	\$ 0	\$ 0	0,00
Constellation Oil Services Holding S.A. ‚B‘	10.06.2022	460	460	0,01
Development Bank of Southern Africa 8,600 % fällig am 21.10.2024	07.10.2021	31.381	25.473	0,66
DrillCo Holding Lux S.A.	08.06.2023	7.281	9.040	0,24
		\$ 39.122	\$ 34.973	0,91

(j) Wertpapiere mit einem aggregierten beizulegenden Zeitwert von USD 422.139 (31. Dezember 2022: USD 84.485) und Barmittel in Höhe von USD null (31. Dezember 2022: USD 842) waren zum 31. Dezember 2023 Wertpapiere als Sicherheiten gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte verpfändet.

Wertpapiere mit einem aggregierten beizulegenden Zeitwert von USD 4.698 (31. Dezember 2022: USD null) und Barmittel in Höhe von USD 3.381 (31. Dezember 2022: USD 3.002) waren zum 31. Dezember 2023 Wertpapiere als Sicherheiten gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte eingegangen.

Barmittel in Höhe von USD 27.700 (31. Dezember 2022: USD 36.243) waren zum 31. Dezember 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 4.980 (31. Dezember 2022: USD 11.680) waren zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten für Finanzderivate gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 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	\$ 3.834.962	\$ 99.009	\$ 3.933.972
Investmentfonds	192.346	0	0	192.346
Pensionsgeschäfte	0	2.599	0	2.599
Finanzderivate ⁽³⁾	(1.938)	28.322	1.389	27.773
Einlagen bei Kreditinstituten	0	60.900	0	60.900
Summen	\$ 190.409	\$ 3.926.783	\$ 100.398	\$ 4.217.590

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 1	\$ 3.210.349	\$ 57.311	\$ 3.267.661
Investmentfonds	52.797	0	0	52.797
Pensionsgeschäfte	0	9.160	0	9.160
Finanzderivate ⁽³⁾	5.730	14.061	25	19.766
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	2.227	2.227
Summen	\$ 58.528	\$ 3.233.570	\$ 59.513	\$ 3.351.611

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

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

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnu- ngs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BPS	4,050 %	27.12.2023	TBD ⁽¹⁾	€ (38.488)	\$ (42.540)	(1,11)
	4,500	22.11.2023	TBD ⁽¹⁾	\$ (714)	(717)	(0,02)
	5,540	19.12.2023	TBD ⁽¹⁾	(21.425)	(21.468)	(0,56)
	5,680	19.12.2023	TBD ⁽¹⁾	(17.119)	(17.154)	(0,45)
	5,690	19.12.2023	TBD ⁽¹⁾	(23.158)	(23.206)	(0,60)
	5,990	18.07.2023	16.01.2024	(16.646)	(17.108)	(0,45)
BRC	4,000	02.11.2023	TBD ⁽¹⁾	(7.423)	(7.473)	(0,19)
BSN	5,510	19.12.2023	04.01.2024	(180.465)	(180.824)	(4,70)
MYI	3,750	01.11.2023	TBD ⁽¹⁾	(751)	(756)	(0,02)
	4,000	13.11.2023	TBD ⁽¹⁾	(4.389)	(4.413)	(0,11)
NOM	5,250	13.10.2023	TBD ⁽¹⁾	(421)	(426)	(0,01)
	5,450	05.12.2023	TBD ⁽¹⁾	(9.554)	(9.554)	(0,25)
SCX	4,080	20.11.2023	TBD ⁽¹⁾	€ (37.848)	(42.005)	(1,09)
	5,560	17.11.2023	TBD ⁽¹⁾	\$ (25.689)	(25.868)	(0,67)
	5,580	17.11.2023	TBD ⁽¹⁾	(9.151)	(9.215)	(0,24)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (402.727)	(10,47)

⁽¹⁾ Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
AZD	\$ 88	\$ 0	\$ 88	\$ 2	\$ 0	\$ 2
BOA	(1.075)	1.740	665	(9.485)	8.490	(995)
BPS	4.872	(7.810)	(2.938)	1.829	(690)	1.139
BRC	1.009	(1.900)	(891)	(897)	860	(37)
BSH	(158)	0	(158)	k. A.	k. A.	k. A.
CBK	(696)	1.140	444	20.215	(19.290)	925
CLY	k. A.	k. A.	k. A.	(454)	0	(454)
DUB	1.429	(1.270)	159	126	(230)	(104)
FAR	0	(290)	(290)	k. A.	k. A.	k. A.
FBF	k. A.	k. A.	k. A.	(33)	0	(33)
GLM	(1.718)	940	(778)	46	(120)	(74)
GST	705	(690)	15	(1.298)	1.330	32
HUS	13	(150)	(137)	58	(150)	(92)
IND	k. A.	k. A.	k. A.	0	270	270
JPM	(659)	620	(39)	1.107	(1.310)	(203)
MBC	2.577	(4.680)	(2.103)	3.472	(2.910)	562
MYC	180	(380)	(200)	(27)	(60)	(87)
MYI	1.515	(1.480)	35	70	(160)	(90)
RBC	(2)	0	(2)	1	0	1
RYL	(32)	0	(32)	1.375	(1.300)	75
SCX	(779)	540	(239)	8.586	(8.150)	436
SOG	k. A.	k. A.	k. A.	(37)	0	(37)
SSB	(23)	0	(23)	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	135	0	135	8	(20)	(12)
UAG	9	0	9	(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. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond Fund (Forts.)

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	91,76	83,54
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	10,19	15,12
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,33	0,17
Investmentfonds	5,00	1,60
Pensionsgeschäfte	0,07	0,28
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,37	0,01
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,16	(0,14)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,19	0,73
Einlagenzertifikate	1,58	0,07
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(10,47)	(2,28)

* Gemäß der Liste der Märkte, die die Kriterien für einen geregelten OGAW-Markt erfüllen, in Anlage 1 zum Verkaufsprospekt.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Albanien	k. A.	0,09
Angola	1,02	0,19
Argentinien	2,00	1,46
Aserbaidschan	1,11	1,31
Bahamas	k. A.	0,36
Bahrain	0,29	0,36
Weißrussland	k. A.	0,02
Benin	k. A.	0,18
Brasilien	2,00	2,04
Bulgarien	0,27	k. A.
Kamerun	0,29	0,18
Kanada	0,03	k. A.
Cayman-Inseln	3,24	3,52
Chile	2,72	2,67
China	0,03	0,32
Kolumbien	2,27	2,78
Costa Rica	0,25	0,27
Dominikanische Republik	3,67	2,69
Ecuador	1,10	1,11
Ägypten	2,20	2,10
El Salvador	0,44	0,28
Äthiopien	k. A.	0,06
Gabun	0,02	k. A.
Georgien	0,01	0,01
Deutschland	k. A.	0,33
Ghana	0,57	0,74
Guatemala	0,78	0,68
Hongkong	1,02	0,83
Ungarn	1,82	0,96
Indien	0,23	0,30
Indonesien	3,74	4,75
International	0,21	k. A.
Irak	0,08	k. A.
Irland	0,66	0,73
Israel	1,73	1,74
Elfenbeinküste	0,24	0,67
Jamaika	0,07	0,08
Japan	0,43	0,50
Jersey, Kanalinseln	0,65	0,71
Jordanien	0,30	0,72
Kasachstan	1,03	1,37
Kenia	0,22	0,03
Libanon	0,02	0,02
Luxemburg	1,79	0,45
Mazedonien	0,23	k. A.
Malaysia	0,65	0,33
Mauritius	k. A.	0,08
Mexiko	8,34	6,66
Mongolei	0,03	0,05
Marokko	0,54	0,51
Multinational	0,25	0,28
Namibia	0,15	0,17
Niederlande	0,31	0,61
Nigeria	1,32	1,62
Oman	1,46	1,73
Pakistan	0,85	0,34
Panama	1,79	1,59
Paraguay	0,40	0,35
Peru	1,22	1,17
Philippinen	0,53	0,42
Polen	1,11	0,38
Katar	2,51	1,66
Rumänien	1,58	1,80

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Russland	0,01	0,22
Saudi-Arabien	3,19	2,32
Senegal	0,63	0,23
Serbien	1,23	0,69
Singapur	0,22	0,50
Slowenien	0,33	k. A.
Südafrika	4,48	4,48
Südkorea	0,85	k. A.
Spanien	0,35	0,41
Sri Lanka	0,72	0,50
Supranational	0,18	0,21
Schweiz	0,30	0,82
Tansania	1,02	0,50
Thailand	0,06	0,10
Trinidad und Tobago	0,16	k. A.
Tunesien	0,66	0,28
Türkei	5,34	5,16
Ukraine	0,46	0,27
Vereinigte Arabische Emirate	2,55	1,89
Großbritannien	1,15	2,07
USA	10,62	9,86
Usbekistan	0,37	0,21
Venezuela	0,69	0,40
Vietnam	0,01	0,02
Jungferninseln (Britisch)	0,12	0,64
Sambia	0,01	0,11
Kurzfristige Instrumente	4,75	9,58
Investmentfonds	5,00	1,60
Pensionsgeschäfte	0,07	0,28
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,37	0,01
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzkauf	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	k. A.	(0,02)
Zinsswaps	0,16	(0,12)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	0,00	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzkauf	(0,05)	0,08
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,22	(0,11)
Volatilitätsswaps	k. A.	0,00
Devisenterminkontrakte	(0,30)	(0,14)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,32	0,90
Einlagenzertifikate	1,58	0,07
Sonstige Aktiva und Passiva	(9,65)	(1,38)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
COSTA RICA			
STAATSEMISSIONEN			
Costa Rica Government International Bond			
5,625 % fällig am 30.04.2043	\$ 20.050	\$ 18.481	0,69
6,550 % fällig am 03.04.2034	1.200	1.246	0,05
7,158 % fällig am 12.03.2045	2.400	2.554	0,09
7,300 % fällig am 13.11.2054	4.200	4.567	0,17
Summe Costa Rica		26.848	1,00

ZYPERN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Atrium Finance PLC			
2,625 % fällig am 05.09.2027	€ 8.000	6.897	0,26

DOMINIKANISCHE REPUBLIK			
STAATSEMISSIONEN			
Dominican Republic Central Bank Notes			
12,000 % fällig am 03.10.2025	DOP 36.900	648	0,02
13,000 % fällig am 05.12.2025	647.400	11.693	0,44
13,000 % fällig am 30.01.2026	273.800	4.958	0,18

Dominican Republic Government International Bond			
4,500 % fällig am 30.01.2030	\$ 3.000	2.771	0,10
4,875 % fällig am 23.09.2032	7.800	7.121	0,27
5,300 % fällig am 21.01.2041	8.800	7.634	0,28
5,500 % fällig am 27.01.2025	2.500	2.491	0,09
5,500 % fällig am 22.02.2029	8.800	8.624	0,32
5,875 % fällig am 30.01.2060	31.800	27.587	1,03
5,950 % fällig am 25.01.2027	8.400	8.449	0,31
6,000 % fällig am 19.07.2028	1.520	1.526	0,06
6,000 % fällig am 22.02.2033	1.700	1.681	0,06
6,400 % fällig am 05.06.2049	2.500	2.362	0,09
6,500 % fällig am 15.02.2048	200	192	0,01
6,850 % fällig am 27.01.2045	2.800	2.800	0,10
6,875 % fällig am 29.01.2026	4.200	4.286	0,16
8,625 % fällig am 20.04.2027	6.500	6.819	0,25
9,750 % fällig am 05.06.2026	DOP 129.900	2.240	0,08
11,250 % fällig am 15.09.2035	374.000	6.969	0,26
13,625 % fällig am 03.02.2033	330.100	6.936	0,26
13,625 % fällig am 10.02.2034	113.700	2.369	0,09
Summe Dominikanische Republik		120.156	4,46

ECUADOR			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Ecuador Social Bond SARL			
0,000 % fällig am 30.01.2035			
(a)	\$ 8.667	6.587	0,24

Ecuador Government International Bond			
0,000 % fällig am 31.07.2030			
(a)	10.286	2.968	0,11
2,500 % fällig am 31.07.2040	5.157	1.650	0,06
3,500 % fällig am 31.07.2035	67.953	24.429	0,91
6,000 % fällig am 31.07.2030	31.524	14.753	0,55
		43.800	1,63
Summe Ecuador		50.387	1,87

ÄGYPTEN			
STAATSEMISSIONEN			
Egypt Government International Bond			
4,750 % fällig am 11.04.2025	€ 7.500	7.565	0,28
5,250 % fällig am 06.10.2025			
(g)	\$ 14.400	13.132	0,49
5,750 % fällig am 29.05.2024			
(g)	700	686	0,02
5,875 % fällig am 16.02.2031	1.500	987	0,04
6,375 % fällig am 11.04.2031	€ 19.500	13.906	0,52
7,053 % fällig am 15.01.2032	\$ 5.400	3.715	0,14
7,300 % fällig am 30.09.2033	6.900	4.575	0,17
7,500 % fällig am 16.02.2061	10.800	6.342	0,23
7,625 % fällig am 29.05.2032	9.300	6.487	0,24
7,903 % fällig am 21.02.2048	5.700	3.453	0,13
8,150 % fällig am 20.11.2059	3.500	2.160	0,08
8,500 % fällig am 31.01.2047	4.000	2.500	0,09
8,750 % fällig am 30.09.2051	8.500	5.397	0,20
Summe Ägypten		70.905	2,63

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
EL SALVADOR			
STAATSEMISSIONEN			
El Salvador Government International Bond			
6,375 % fällig am 18.01.2027	\$ 3.500	\$ 3.105	0,11
7,125 % fällig am 20.01.2050	13.600	9.684	0,36
7,625 % fällig am 21.09.2034	1.100	819	0,03
7,625 % fällig am 01.02.2041	250	189	0,01
7,650 % fällig am 15.06.2035	1.000	784	0,03
9,500 % fällig am 15.07.2052	10.550	8.836	0,33
Summe El Salvador		23.417	0,87

GABUN			
STAATSEMISSIONEN			
Gabon Government International Bond			
6,625 % fällig am 06.02.2031	600	502	0,02

GEORGIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Georgian Railway JSC			
4,000 % fällig am 17.06.2028	10.700	9.876	0,37

GHANA			
STAATSEMISSIONEN			
Ghana Government International Bond			
0,000 % fällig am 07.04.2025	^ 1.400	539	0,02
6,375 % fällig am 11.02.2027	^ 8.200	3.682	0,14
7,625 % fällig am 16.05.2029	^ 3.300	1.447	0,05
7,750 % fällig am 07.04.2029	^ 2.700	1.187	0,04
7,875 % fällig am 11.02.2035	^ 5.700	2.510	0,09
8,125 % fällig am 26.03.2032	^ 11.300	4.998	0,19
8,625 % fällig am 07.04.2034	^ 7.900	3.470	0,13
8,627 % fällig am 16.06.2049	^ 1.600	689	0,03
8,750 % fällig am 11.03.2061	^ 29.450	12.789	0,47
8,875 % fällig am 07.05.2042	^ 1.100	475	0,02
8,950 % fällig am 26.03.2051	^ 6.700	2.911	0,11
Summe Ghana		34.697	1,29

GUERNSEY, KANALINSELN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Globalworth Real Estate Investments Ltd.			
2,950 % fällig am 29.07.2026	€ 3.500	3.191	0,12

HONGKONG			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
AIA Group Ltd.			
3,200 % fällig am 16.09.2040	\$ 200	152	0,01
Fortune Star BVI Ltd.			
3,950 % fällig am 02.10.2026	€ 1.500	1.059	0,04
5,000 % fällig am 18.05.2026	\$ 200	147	0,01
5,050 % fällig am 27.01.2027	200	132	0,00
5,950 % fällig am 19.10.2025	4.000	3.335	0,12
Huarong Finance Co. Ltd.			
3,875 % fällig am 13.11.2029	900	765	0,03
4,500 % fällig am 29.05.2029	4.200	3.725	0,14
4,750 % fällig am 27.04.2027	800	751	0,02
Lenovo Group Ltd.			
3,421 % fällig am 02.11.2030			
(g)	1.500	1.325	0,05
6,536 % fällig am 27.07.2032			
(g)	6.800	7.245	0,27
MTR Corp. Ltd.			
1,625 % fällig am 19.08.2030	6.300	5.269	0,19
		23.905	0,88

Airport Authority Hong Kong			
2,100 % fällig am 08.03.2026			
(d)	1.200	1.121	0,04
2,400 % fällig am 08.03.2028			
(d)	3.600	3.192	0,12
2,500 % fällig am 12.01.2032	200	173	0,01
4,875 % fällig am 12.01.2030	6.300	6.410	0,24
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	6.358	0,23
5,250 % fällig am 11.01.2053	\$ 3.500	3.951	0,15
		22.021	0,82
Summe Hongkong		45.926	1,70

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
UNGARN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
MVM Energetika Zrt			
7,500 % fällig am 09.06.2028	\$ 4.400	\$ 4.604	0,17

Hungarian Development Bank			
6,500 % fällig am 29.06.2028	10.700	11.034	0,41
Hungary Government International Bond			
1,625 % fällig am 28.04.2032	€ 1.200	1.082	0,04
1,750 % fällig am 05.06.2035			
(g)	8.400	7.142	0,27
2,125 % fällig am 22.09.2031	\$ 18.650	15.081	0,56
3,125 % fällig am 21.09.2051	7.600	5.176	0,19
5,250 % fällig am 16.06.2029	9.600	9.672	0,36
5,375 % fällig am 12.09.2033	€ 1.600	1.893	0,07
5,500 % fällig am 16.06.2034	\$ 8.100	8.257	0,31
6,125 % fällig am 22.05.2028	5.600	5.831	0,22
6,750 % fällig am 25.09.2052	16.200	18.168	0,67
7,625 % fällig am 29.03.2041	500	599	0,02
Magyar Export-Import Bank			
6,000 % fällig am 16.05.2029	€ 6.200	7.286	0,27
6,125 % fällig am 04.12.2027	\$ 4.000	4.076	0,15
		95.297	3,54
Summe Ungarn		99.901	3,71

INDIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Adani Renewable Energy RJ Ltd.			
4,625 % fällig am 15.10.2039	3.856	3.031	0,11
Indian Railway Finance Corp. Ltd.			
3,570 % fällig am 21.01.2032	16.100	14.470	0,54
3,835 % fällig am 13.12.2027	3.500	3.351	0,13
JSW Hydro Energy Ltd.			
4,125 % fällig am 18.05.2031	3.824	3.336	0,12
ReNew Power Pvt Ltd.			
5,875 % fällig am 05.03.2027	1.202	1.150	0,04
ReNew Wind Energy AP2			
4,500 % fällig am 14.07.2028	10.000	8.896	0,33
Wipro IT Services LLC			
1,500 % fällig am 23.06.2026	4.800	4.400	0,16
Summe Indien		38.634	1,43

INDONESIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Bank Mandiri Persero Tbk PT			
2,000 % fällig am 19.04.2026	6.700	6.220	0,23
Pelabuhan Indonesia Persero PT			
4,250 % fällig am 05.05.2025	6.500	6.381	0,23
5,375 % fällig am 05.05.2045			
(g)	3.000	2.920	0,11
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia			
4,700 % fällig am 06.06.2032	24.800	25.065	0,93
		40.586	1,50

Indonesia Government International Bond			
1,300 % fällig am 23.03.2034	€ 13.100	11.390	0,42
4,750 % fällig am 18.07.2047			
(g)	\$ 4.400	4.367	0,16
5,125 % fällig am 15.01.2045	1.200	1.241	0,05
5,125 % fällig am 15.01.2045			
(g)	1.264	1.308	0,05
5,250 % fällig am 08.01.2047	200	209	0,01
5,650 % fällig am 11.01.2053	700	772	0,03
7,750 % fällig am 17.01.2038	3.280	4.216	0,16
8,500 % fällig am 12.10.2035	1.055	1.406	0,05
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia			
3,550 % fällig am 09.06.2051	9.100	7.348	0,27
		32.257	1,20
Summe Indonesien		72.843	2,70

INTERNATIONAL			
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG			
Project Mercury			
8,127 % fällig am 11.08.2030	€ 4.800	5.319	0,20

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond ESG Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
IRLAND			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC 5,950 % fällig am 15.04.2030 ^(e)	\$ 3.900	\$ 234	0,01
Sovcombank Via SovCom Capital DAC 3,400 % fällig am 26.01.2025 ^	5.400	146	0,01
Summe Irland		380	0,02
ELFENBEINKÜSTE			
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG			
Republic of Cote d'Ivoire 9,055 % fällig am 19.03.2027	€ 1.050	1.119	0,04
Ivory Coast Government International Bond 5,250 % fällig am 22.03.2030	17.900	17.819	0,66
5,875 % fällig am 17.10.2031 (g)	4.200	4.171	0,15
6,625 % fällig am 22.03.2048	2.900	2.563	0,10
		24.553	0,91
Summe Elfenbeinküste		25.672	0,95
JAMAICA			
STAATSEMISSIONEN			
Jamaica Government International Bond 7,875 % fällig am 28.07.2045	\$ 3.300	4.026	0,15
JERSEY, KANALINSELN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Corsair International Ltd. 8,802 % fällig am 28.01.2027	€ 7.900	8.727	0,32
9,152 % fällig am 28.01.2029	3.400	3.756	0,14
Summe Jersey, Kanalinseln		12.483	0,46
JORDANIEN			
STAATSEMISSIONEN			
Jordan Government International Bond 5,750 % fällig am 31.01.2027	\$ 300	295	0,01
6,125 % fällig am 29.01.2026	3.000	2.998	0,11
7,375 % fällig am 10.10.2047	7.100	6.330	0,24
7,500 % fällig am 13.01.2029	8.500	8.630	0,32
Summe Jordanien		18.253	0,68
KASACHSTAN			
STAATSEMISSIONEN			
Kazakhstan Government International Bond 4,875 % fällig am 14.10.2044	8.700	8.442	0,31
6,500 % fällig am 21.07.2045	14.600	16.738	0,62
Summe Kasachstan		25.180	0,93
KENIA			
STAATSEMISSIONEN			
Kenya Government International Bond 6,300 % fällig am 23.01.2034	5.700	4.588	0,17
6,875 % fällig am 24.06.2024	6.100	5.941	0,22
Summe Kenia		10.529	0,39
LUXEMBURG			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Amaggi Luxembourg International SARL 5,250 % fällig am 28.01.2028	6.000	5.765	0,21
Chile Electricity Lux MPC SARL 6,010 % fällig am 20.01.2033	6.600	6.774	0,25
MHP Lux S.A. 6,950 % fällig am 03.04.2026	522	406	0,02
Unigel Luxembourg S.A. 8,750 % fällig am 01.10.2026 ^	3.400	935	0,04
Summe Luxemburg		13.880	0,52
MAZEDONIEN			
STAATSEMISSIONEN			
North Macedonia Government International Bond 2,750 % fällig am 18.01.2025	€ 3.600	3.896	0,14

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
6,960 % fällig am 13.03.2027	€ 6.500	\$ 7.519	0,28
Summe Mazedonien		11.415	0,42
MALAYSIA			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Axiata SPV5 Labuan Ltd. 3,064 % fällig am 19.08.2050	\$ 4.600	3.182	0,12
Khazanah Capital Ltd. 4,876 % fällig am 01.06.2033	4.300	4.324	0,16
Khazanah Global Sukuk Bhd. 4,687 % fällig am 01.06.2028	5.600	5.620	0,21
Summe Malaysia		13.126	0,49
MAURITIUS			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
India Green Energy Holdings 5,375 % fällig am 29.04.2024	9.400	9.307	0,35
MEXIKO			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Banco Mercantil del Norte S.A. 6,625 % fällig am 24.01.2032 (d)(e)	2.000	1.704	0,06
7,500 % fällig am 27.06.2029 (d)(e)	3.400	3.212	0,12
7,625 % fällig am 10.01.2028 (d)(e)	300	289	0,01
8,375 % fällig am 14.10.2030 (d)(e)	400	395	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	8.733	0,32
Sitios Latinoamerica S.A.B. de C.V. 5,375 % fällig am 04.04.2032	6.300	5.862	0,22
Trust Fibra Uno 6,390 % fällig am 15.01.2050	1.000	811	0,03
		21.006	0,78
Mexico Government International Bond 1,350 % fällig am 18.09.2027	€ 600	620	0,02
2,250 % fällig am 12.08.2036	9.700	8.456	0,31
2,750 % fällig am 27.11.2031 (c)	197.146	10.280	0,38
3,000 % fällig am 03.12.2026 (c)	612.987	33.626	1,25
3,750 % fällig am 19.04.2071	\$ 1.100	737	0,03
4,000 % fällig am 30.11.2028 (c)	89.218	5.152	0,19
4,875 % fällig am 19.05.2033	\$ 25.700	24.818	0,92
5,750 % fällig am 12.10.2110	23.940	21.515	0,80
6,338 % fällig am 04.05.2053	3.900	3.980	0,15
		109.184	4,05
Summe Mexiko		130.190	4,83
MONGOLEI			
STAATSEMISSIONEN			
Mongolia Government International Bond 3,500 % fällig am 07.07.2027	7.000	6.264	0,23
5,125 % fällig am 07.04.2026	1.100	1.070	0,04
7,875 % fällig am 05.06.2029	800	819	0,03
8,650 % fällig am 19.01.2028	268	281	0,01
Summe Mongolei		8.434	0,31
MAROKKO			
STAATSEMISSIONEN			
Morocco Government International Bond 4,000 % fällig am 15.12.2050	19.500	14.113	0,52
5,500 % fällig am 11.12.2042	4.100	3.741	0,14
Summe Marokko		17.854	0,66
MULTINATIONAL			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
NXP BV 3,400 % fällig am 01.05.2030	500	460	0,02

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
NAMIBIA			
STAATSEMISSIONEN			
Namibia Government International Bond 5,250 % fällig am 29.10.2025	\$ 2.300	\$ 2.278	0,08
NIEDERLANDE			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
IHS Netherlands Holdco BV 8,000 % fällig am 18.09.2027	10.500	9.387	0,35
ING Groep NV 1,125 % fällig am 07.12.2028 (g)	€ 4.000	4.482	0,17
1,400 % fällig am 01.07.2026 (g)	\$ 7.900	7.439	0,28
InterCement Financial Operations BV 5,750 % fällig am 17.07.2024	200	142	0,01
Metinvest BV 8,500 % fällig am 23.04.2026	1.100	775	0,03
NE Property BV 2,000 % fällig am 20.01.2030 (g)	€ 5.600	4.979	0,18
3,375 % fällig am 14.07.2027 (g)	2.300	2.405	0,09
Prosus NV 1,539 % fällig am 03.08.2028	800	765	0,03
2,031 % fällig am 03.08.2032	400	339	0,01
3,257 % fällig am 19.01.2027	\$ 2.200	2.034	0,07
4,027 % fällig am 03.08.2050	800	525	0,02
Summe Niederlande		33.272	1,24
OMAN			
STAATSEMISSIONEN			
Oman Government International Bond 4,750 % fällig am 15.06.2026	4.600	4.553	0,17
4,875 % fällig am 01.02.2025	3.000	2.981	0,11
5,375 % fällig am 08.03.2027	5.600	5.650	0,21
5,625 % fällig am 17.01.2028	8.200	8.371	0,31
6,000 % fällig am 01.08.2029	18.200	18.895	0,70
6,250 % fällig am 25.01.2031	4.900	5.164	0,19
6,500 % fällig am 08.03.2047	2.650	2.710	0,10
6,750 % fällig am 28.10.2027	14.400	15.230	0,57
6,750 % fällig am 17.01.2048	6.700	7.027	0,26
7,000 % fällig am 25.01.2051	4.400	4.761	0,18
Summe Oman		75.342	2,80
PAKISTAN			
STAATSEMISSIONEN			
Pakistan Government International Bond 6,875 % fällig am 05.12.2027	5.515	3.786	0,14
7,375 % fällig am 08.04.2031	5.418	3.321	0,12
8,250 % fällig am 15.04.2024	3.090	2.938	0,11
8,875 % fällig am 08.04.2051	3.000	1.823	0,07
Summe Pakistan		11.868	0,44
PANAMA			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Aeropuerto Internacional de Tocumen S.A. 5,125 % fällig am 11.08.2061	2.900	2.212	0,08
Banco General S.A. 5,250 % fällig am 07.05.2031 (d)	6.500	5.589	0,21
Banco Nacional de Panamá 2,500 % fällig am 11.08.2030	600	446	0,01
Empresa de Transmision Electrica S.A. 5,125 % fällig am 02.05.2049	1.000	727	0,03
		8.974	0,33
STAATSEMISSIONEN			
Panama Government International Bond 2,252 % fällig am 29.09.2032	2.600	1.902	0,07
3,160 % fällig am 23.01.2030	800	683	0,03
3,870 % fällig am 23.07.2060	8.500	5.112	0,19
4,300 % fällig am 29.04.2053	1.500	1.009	0,04
4,500 % fällig am 15.05.2047	8.500	6.060	0,22
4,500 % fällig am 16.04.2050	9.800	6.825	0,25
4,500 % fällig am 01.04.2056	15.000	10.111	0,37
4,500 % fällig am 19.01.2063	18.300	12.018	0,45
6,400 % fällig am 14.02.2035	17.200	16.831	0,62
6,700 % fällig am 26.01.2036	6.500	6.458	0,24
6,853 % fällig am 28.03.2054	3.600	3.377	0,13

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond ESG Fund (Forts.)

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,320 %	20.10.2033	£ 900	\$ 100	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,000	21.09.2024	\$ 63.400	(4)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.06.2024	68.300	(348)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.12.2031	1.800	(279)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2030	70.600	(2.045)	(0,07)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2033	9.250	529	0,02
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,730	03.08.2033	2.300	41	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,735	07.08.2033	2.700	51	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,830	12.10.2053	1.700	167	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,870	17.10.2053	1.400	148	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,880	16.10.2053	1.700	183	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,030	04.10.2033	1.300	60	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,150	12.10.2033	3.400	195	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,155	02.10.2033	4.500	258	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,165	27.09.2033	5.500	320	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,170	03.10.2033	5.900	346	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,175	10.10.2033	4.000	236	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,220	20.10.2033	3.100	196	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,230	23.10.2033	2.800	180	0,01
Erhalt ⁽³⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	20.03.2034	9.100	(90)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,255	23.10.2033	2.200	146	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,393	25.10.2033	200	16	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,450	31.10.2033	2.500	209	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,850	02.01.2025	BRL 68.400	19	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,240	02.01.2025	160.300	60	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,055	04.01.2027	81.200	(1.108)	(0,04)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,216	02.01.2025	28.100	(146)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,241	02.01.2025	28.200	(149)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,427	02.01.2025	66.100	(392)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	13,428	02.01.2025	93.200	556	0,02
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	5,950	30.11.2024	ZAR 346.600	406	0,01
Zahlung ⁽³⁾	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	20.03.2034	AUD 101.000	1.871	0,07
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,750	20.12.2028	43.400	1.119	0,04
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	4,855	18.12.2033	CLP 8.000.000	(53)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,511	13.11.2033	8.456.600	(411)	(0,02)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,175	07.11.2028	CZK 1.243.200	1.389	0,05
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,611	06.06.2028	139.300	264	0,01
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	20.03.2054	€ 12.000	(540)	(0,02)
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.03.2034	15.500	337	0,01
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	3,300	03.10.2033	3.700	289	0,01
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	3,370	09.10.2028	1.000	46	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	3,450	20.10.2028	4.300	214	0,01
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	5,455	10.01.2028	PLN 18.000	(255)	(0,01)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	5,490	10.01.2028	17.100	(249)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,769	27.09.2028	MXN 79.850	(214)	(0,01)
					\$ 3.668	0,14
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ 3.669	0,14

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

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

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

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

OPTIONSKAUF

DEVIENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
MYI	Put - OTC GBP versus USD	\$ 1,160	12.06.2024	52.520	\$ 209	\$ 112	0,00

(1) Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Chile Government International Bond	(1,000) %	20.12.2028	\$ 2.800	\$ (57)	\$ (8)	\$ (65)	0,00
	Mexico Government International Bond	(1,000)	20.12.2028	9.900	4	(59)	(55)	0,00
	Oman Government International Bond	(1,000)	20.12.2027	2.200	72	(76)	(4)	0,00
BPS	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.12.2026	4.300	715	(598)	117	0,00
	Chile Government International Bond	(1,000)	20.12.2028	1.740	(35)	(5)	(40)	0,00
	Mexico Government International Bond	(1,000)	20.12.2028	2.800	1	(17)	(16)	0,00
BRC	Oman Government International Bond	(1,000)	20.12.2027	700	23	(24)	(1)	0,00
	Chile Government International Bond	(1,000)	20.12.2027	3.400	91	(97)	(6)	0,00
	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.12.2027	15.000	(167)	106	(61)	0,00
CBK	China Government International Bond	(1,000)	20.06.2024	2.800	467	(391)	76	0,00
	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.12.2026	2.800	467	(391)	76	0,00
	Chile Government International Bond	(1,000)	20.12.2028	60	(1)	(1)	(2)	0,00
GST	China Government International Bond	(1,000)	20.06.2024	15.000	(167)	106	(61)	0,00
	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.12.2028	62.500	(1.841)	(257)	(2.098)	(0,08)
	Chile Government International Bond	(1,000)	20.12.2028	3.600	(73)	(10)	(83)	0,00
JPM	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.12.2028	1.700	(51)	(6)	(57)	0,00
	Chile Government International Bond	(1,000)	20.12.2028	4.800	(97)	(14)	(111)	(0,01)
MYC	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.12.2026	2.500	423	(355)	68	0,00
					\$ (693)	\$ (1.706)	\$ (2.399)	(0,09)

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens	
BOA	Brazil Government International Bond	1,000 %	20.06.2031	\$ 1.200	\$ (181)	\$ 106	\$ (75)	0,00	
	Chile Government International Bond	1,000	20.06.2024	200	1	0	1	0,00	
	Egypt Government International Bond	1,000	20.12.2024	1.000	(120)	52	(68)	0,00	
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.12.2028	11.300	(15)	168	153	0,01	
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	18.100	13	140	153	0,01	
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	6.400	26	81	107	0,00	
	Peru Government International Bond	1,000	20.12.2031	11.900	(502)	402	(100)	0,00	
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2024	9.400	(90)	124	34	0,00	
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2025	1.200	(66)	71	5	0,00	
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2027	100	(20)	16	(4)	0,00	
	BPS	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2026	10.400	(639)	739	100	0,00
		Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2027	8.200	(589)	603	14	0,00
		Chile Government International Bond	1,000	20.06.2024	3.300	9	7	16	0,00
		Chile Government International Bond	1,000	20.12.2024	4.000	5	32	37	0,00
		Egypt Government International Bond	1,000	20.12.2024	200	(24)	10	(14)	0,00
Mexico Government International Bond		1,000	20.12.2024	2.100	(5)	23	18	0,00	
Peru Government International Bond		1,000	20.06.2026	6.100	54	48	102	0,00	
Serbia Government International Bond		1,000	20.12.2027	1.600	(142)	103	(39)	0,00	
South Africa Government International Bond		1,000	20.06.2028	32.000	(2.762)	1.656	(1.106)	(0,04)	
Turkey Government International Bond		1,000	20.06.2027	3.800	(751)	603	(148)	(0,01)	
BRC		Chile Government International Bond	1,000	20.06.2024	5.800	18	10	28	0,00
		Chile Government International Bond	1,000	20.12.2026	2.500	14	41	55	0,00
		Peru Government International Bond	1,000	20.12.2025	17.500	360	(93)	267	0,01
CBK		Poland Government International Bond	1,000	20.06.2028	6.500	49	63	112	0,01
		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	3	6	0,00	
DUB	Panama Government International Bond	1,000	20.06.2024	2.300	4	4	8	0,00	
	Panama Government International Bond	1,000	20.12.2024	4.300	0	21	21	0,00	
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	2.100	18	17	35	0,00	
GST	Qatar Government International Bond	1,000	20.12.2026	5.000	140	(42)	98	0,00	
	Egypt Government International Bond	1,000	20.12.2024	800	(108)	54	(54)	0,00	
	Qatar Government International Bond	1,000	20.12.2028	5.300	80	50	130	0,01	
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2024	13.800	(148)	197	49	0,00	
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2026	900	(15)	14	(1)	0,00	
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2026	10.400	(638)	572	(66)	0,00	
MYC	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2026	200	(11)	13	2	0,00	
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2031	1.500	(227)	133	(94)	0,00	
	Chile Government International Bond	1,000	20.06.2028	8.900	17	194	211	0,01	
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2024	14.000	(34)	145	111	0,01	
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	13.700	99	131	230	0,01	
	Poland Government International Bond	1,000	20.06.2024	11.200	50	1	51	0,00	
	Poland Government International Bond	1,000	20.06.2028	8.500	77	70	147	0,01	
	Qatar Government International Bond	1,000	20.12.2028	3.800	64	29	93	0,00	
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2024	1.000	(10)	14	4	0,00	
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2027	4.300	(840)	672	(168)	(0,01)	
	HUS	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	100	(1)	1	0	0,00
	JPM	Banco do Brasil S.A.	1,000	20.12.2024	8.000	(180)	177	(3)	0,00
		Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2028	1.100	(38)	31	(7)	0,00
		Hungary Government International Bond	1,000	20.06.2027	5.700	(290)	275	(15)	0,00
	MYC	Indonesia Government International Bond	1,000	20.12.2024	7.400	60	0	60	0,00
Poland Government International Bond		1,000	20.06.2028	900	(2)	18	16	0,00	
Chile Government International Bond		1,000	20.12.2024	2.400	6	16	22	0,00	
Chile Government International Bond		1,000	20.06.2026	15.000	208	87	295	0,01	
Chile Government International Bond		1,000	20.12.2026	16.300	112	250	362	0,01	
Indonesia Government International Bond		1,000	20.12.2028	1.500	0	20	20	0,00	
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	4.800	19	22	41	0,00	

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond ESG Fund (Forts.)

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
	Peru Government International Bond	1,000 %	20.06.2026	\$ 9.800	\$ 45	\$ 119	\$ 164	0,01
	Peru Government International Bond	1,000	20.12.2026	20.000	80	285	365	0,01
	Qatar Government International Bond	1,000	20.12.2026	3.900	57	19	76	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2026	4.600	(206)	177	(29)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2027	1.800	(356)	286	(70)	0,00
MYI	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	1.300	11	11	22	0,00
					\$ (7.314)	\$ 9.095	\$ 1.781	0,07

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

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

(3) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	01.2024	\$ 1.508	AUD 2.277	\$ 46	\$ 0	\$ 46	0,00
BOA	01.2024	CAD 1.056	\$ 779	0	(22)	(22)	0,00
	01.2024	COP 170.024.801	42.271	0	(1.565)	(1.565)	(0,06)
	01.2024	DOP 187.420	3.275	61	0	61	0,00
	01.2024	£ 555	704	0	(3)	(3)	0,00
	01.2024	HUF 177.249	488	0	(23)	(23)	0,00
	01.2024	NZD 6.855	4.177	0	(164)	(164)	(0,01)
	01.2024	PLN 3.089	743	0	(42)	(42)	0,00
	01.2024	\$ 44.451	COP 170.024.801	0	(613)	(613)	(0,02)
	01.2024	3.553	HUF 1.313.648	233	0	233	0,01
	01.2024	1.801	¥ 265.757	85	0	85	0,00
	01.2024	503	NOK 5.344	24	0	24	0,00
	01.2024	2.753	PLN 11.293	118	0	118	0,00
	01.2024	1.371	TRY 40.629	0	(4)	(4)	0,00
	02.2024	DOP 374.153	\$ 6.486	75	0	75	0,00
	02.2024	\$ 4	CNY 28	0	0	0	0,00
	03.2024	COP 170.024.801	\$ 43.810	589	0	589	0,02
	03.2024	EGP 38.362	1.096	215	0	215	0,01
	03.2024	\$ 3.859	IDR 59.519.224	1	0	1	0,00
	03.2024	302	INR 25.232	1	0	1	0,00
	03.2024	13	PHP 703	0	0	0	0,00
	04.2024	886	EGP 35.185	0	(97)	(97)	0,00
BPS	01.2024	CAD 708	\$ 521	0	(16)	(16)	0,00
	01.2024	COP 7.391.156	1.883	0	(25)	(25)	0,00
	01.2024	€ 13.102	14.274	4	(206)	(202)	(0,01)
	01.2024	£ 2.114	2.682	0	(14)	(14)	0,00
	01.2024	HUF 3.661.387	10.427	0	(153)	(153)	(0,01)
	01.2024	IDR 92.730.000	6.000	0	(20)	(20)	0,00
	01.2024	PLN 19.746	4.614	0	(407)	(407)	(0,02)
	01.2024	\$ 3.900	AUD 5.773	40	0	40	0,00
	01.2024	4.726	BRL 23.265	63	0	63	0,00
	01.2024	1.039	CAD 1.409	29	0	29	0,00
	01.2024	1.934	COP 7.391.156	0	(26)	(26)	0,00
	01.2024	12.746	€ 11.673	152	0	152	0,01
	01.2024	1.478	HUF 524.374	34	0	34	0,00
	01.2024	803	IDR 12.391.878	2	0	2	0,00
	01.2024	2.311	¥ 339.000	95	0	95	0,00
	01.2024	1.772	PLN 7.729	193	0	193	0,01
	01.2024	ZAR 755.428	\$ 40.749	0	(504)	(504)	(0,02)
	02.2024	EGP 17.565	502	89	0	89	0,00
	02.2024	TWD 28.245	888	0	(46)	(46)	0,00
	02.2024	\$ 5	CNY 39	0	0	0	0,00
	02.2024	349	EGP 12.570	0	(54)	(54)	0,00
	03.2024	CLP 1.852.598	\$ 2.140	27	0	27	0,00
	03.2024	IDR 36.173.169	2.317	0	(29)	(29)	0,00
	03.2024	PEN 4.969	1.338	0	(1)	(1)	0,00
	03.2024	THB 55.669	1.583	0	(59)	(59)	0,00
	03.2024	\$ 1.853	COP 7.391.156	26	0	26	0,00
	03.2024	2.459	IDR 38.647.355	47	0	47	0,00
	03.2024	1.870	ILS 6.768	14	0	14	0,00
	03.2024	1.048	INR 87.644	2	0	2	0,00
	03.2024	1.849	PEN 6.964	27	0	27	0,00
	03.2024	535	THB 18.483	10	0	10	0,00
	06.2024	1.866	KRW 2.399.991	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					
BRC	01.2024	€	229.654	\$	252.568	\$	0	\$	(1.177)	\$	(1.177)	(0,04)
	01.2024	PLN	12.395		2.835	0	(317)	(317)	(0,01)			
	01.2024	\$	799	BRL	3.921	8	8	0,00				
	01.2024		528	HUF	187.551	12	0	12	0,00			
	01.2024		799	MXN	13.634	3	0	3	0,00			
	01.2024		6.518	TRY	195.841	51	(6)	45	0,00			
	02.2024		1.535		46.786	0	(10)	(10)	0,00			
	03.2024	IDR	8.292.724	\$	536	0	(2)	(2)	0,00			
	03.2024	\$	8.188	TRY	256.943	26	(36)	(10)	0,00			
	04.2024		9.557		306.020	0	(125)	(125)	0,00			
	06.2024	£	4.144	\$	5.214	0	(72)	(72)	0,00			
	CBK	01.2024	BRL	31.125		6.392	0	(15)	(15)	0,00		
		01.2024	CAD	1.065		798	0	(10)	(10)	0,00		
		01.2024	CLP	3.235.742		3.649	0	(56)	(56)	0,00		
		01.2024	COP	7.391.156		1.934	26	0	26	0,00		
		01.2024	€	2.544		2.773	0	(38)	(38)	0,00		
01.2024		£	160		203	0	(1)	(1)	0,00			
01.2024		HUF	11.000		32	0	0	0	0,00			
01.2024		MXN	484.444		27.077	0	(1.401)	(1.401)	(0,05)			
01.2024		PLN	7.307		1.728	0	(130)	(130)	(0,01)			
01.2024		\$	1.072	AUD	1.594	16	0	16	0,00			
01.2024			3.734	CAD	4.997	56	0	56	0,00			
01.2024			1.553	CHF	1.353	55	0	55	0,00			
01.2024			3.685	CLP	3.230.268	14	0	14	0,00			
01.2024			1.875	COP	7.391.156	32	0	32	0,00			
01.2024			1.121	HUF	386.724	0	(3)	(3)	0,00			
01.2024			13.337	¥	1.883.100	29	0	29	0,00			
01.2024			6.761	MXN	117.695	158	0	158	0,01			
01.2024			121	NOK	1.293	6	0	6	0,00			
01.2024			4.322	PLN	18.093	278	0	278	0,01			
01.2024			1.382	SEK	14.465	54	0	54	0,00			
02.2024			3.382	BRL	17.111	135	0	135	0,01			
02.2024			0	EGP	1	0	0	0	0,00			
03.2024		ILS	4.306	\$	1.183	0	(16)	(16)	0,00			
03.2024		PEN	6.775		1.792	0	(34)	(34)	0,00			
03.2024		\$	3.649	CLP	3.249.062	57	0	57	0,00			
03.2024			749	IDR	11.614.968	4	0	4	0,00			
03.2024			4.545	PEN	16.918	26	(13)	13	0,00			
04.2024			6.392	BRL	31.440	27	0	27	0,00			
DUB		01.2024	€	10	\$	11	0	0	0	0,00		
		01.2024	\$	31.703	ZAR	601.809	1.166	0	1.166	0,04		
		02.2024		1.069	EGP	38.470	0	(165)	(165)	(0,01)		
		03.2024		558	SGD	738	4	0	4	0,00		
	04.2024	EGP	43.739	\$	1.148	167	0	167	0,01			
GLM	04.2024	\$	1.151	EGP	45.448	0	(132)	(132)	(0,01)			
	01.2024	AUD	1.971	\$	1.322	0	(24)	(24)	0,00			
	01.2024	CAD	13.437		9.907	0	(285)	(285)	(0,01)			
	01.2024	CHF	6.172		7.043	0	(294)	(294)	(0,01)			
	01.2024	DOP	979.288		17.164	376	0	376	0,01			
	01.2024	HUF	887.957		2.432	0	(127)	(127)	0,00			
	01.2024	MXN	554.532		31.613	0	(987)	(987)	(0,04)			
	01.2024	NOK	5.530		534	0	(11)	(11)	0,00			
	01.2024	\$	4.098	HUF	1.484.967	182	0	182	0,01			
	01.2024		1.297	MXN	22.662	35	0	35	0,00			
	01.2024		1.057	NOK	11.560	82	0	82	0,00			
	01.2024		6.393	PLN	25.322	45	0	45	0,00			
	01.2024		532	TRY	16.177	9	0	9	0,00			
	01.2024		1.310	ZAR	24.858	47	0	47	0,00			
	02.2024		429	EGP	15.479	0	(65)	(65)	0,00			
	03.2024	DOP	194.982	\$	3.409	73	0	73	0,00			
	03.2024	\$	1.607	PEN	5.972	2	0	2	0,00			
03.2024		406	TRY	12.738	0	(5)	(5)	0,00				
04.2024	DOP	78.670	\$	1.368	27	0	27	0,00				
04.2024	\$	1.689	EGP	66.631	0	(195)	(195)	(0,01)				
JPM	01.2024	HUF	4.755.878	\$	13.537	0	(206)	(206)	(0,01)			
	01.2024	\$	801	BRL	3.957	14	0	14	0,00			
	01.2024		240	MXN	4.477	23	0	23	0,00			
	01.2024		3.111	TRY	92.344	0	(8)	(8)	0,00			
	02.2024	EGP	43.975	\$	1.262	229	0	229	0,01			
	02.2024	\$	7.978	BRL	39.131	64	0	64	0,00			
	02.2024		790	EGP	28.471	0	(121)	(121)	0,00			
	02.2024		8.057	INR	673.050	13	0	13	0,00			
	02.2024		1.601	TRY	48.882	0	(9)	(9)	0,00			
	03.2024	AED	26.039	\$	7.095	1	0	1	0,00			
	03.2024	CLP	1.925.236		2.135	0	(61)	(61)	0,00			
	03.2024	THB	46.271		1.302	0	(63)	(63)	0,00			
	03.2024	TWD	22.756		732	0	(22)	(22)	0,00			
	03.2024	\$	314	INR	26.269	0	0	0	0,00			
	04.2024		6.033	EGP	240.962	0	(630)	(630)	(0,02)			
06.2024	KRW	416.207	\$	318	0	(6)	(6)	0,00				

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond ESG Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
MBC	01.2024	AUD 1.187	\$ 804	\$ 0	\$ (6)	\$ (6)	0,00
	01.2024	€ 32.316	35.186	0	(520)	(520)	(0,02)
	01.2024	HUF 1.455.505	3.922	0	(272)	(272)	(0,01)
	01.2024	¥ 390.000	2.732	0	(37)	(37)	0,00
	01.2024	\$ 1.722	AUD 2.597	51	0	51	0,00
	01.2024	3.634	CAD 4.930	106	0	106	0,00
	01.2024	1.359	£ 1.079	16	0	16	0,00
	01.2024	514	HUF 180.728	7	0	7	0,00
	01.2024	ZAR 193.580	\$ 10.129	0	(444)	(444)	(0,02)
	02.2024	¥ 800.000	5.635	0	(74)	(74)	0,00
	02.2024	\$ 183	EGP 6.596	0	(28)	(28)	0,00
	03.2024	PHP 120.495	\$ 2.153	0	(22)	(22)	0,00
	03.2024	TWD 32.382	1.040	0	(33)	(33)	0,00
	03.2024	\$ 1.605	INR 133.731	0	(3)	(3)	0,00
	04.2024	830	EGP 33.366	0	(82)	(82)	0,00
MYI	01.2024	£ 4	\$ 5	0	0	0	0,00
	01.2024	HUF 927.336	2.636	0	(44)	(44)	0,00
	01.2024	MYR 2.649	568	0	(10)	(10)	0,00
	01.2024	NZD 848	528	0	(8)	(8)	0,00
	01.2024	PLN 7.974	1.933	0	(94)	(94)	0,00
	01.2024	\$ 106	€ 96	0	0	0	0,00
	01.2024	1.945	£ 1.523	0	(3)	(3)	0,00
	01.2024	1.036	HUF 365.230	17	0	17	0,00
	01.2024	685	¥ 100.951	32	0	32	0,00
	01.2024	1.618	ZAR 29.717	5	0	5	0,00
	02.2024	EGP 104.685	\$ 2.991	531	0	531	0,02
	02.2024	\$ 4	CNY 29	0	0	0	0,00
	02.2024	1.379	EGP 49.859	0	(208)	(208)	(0,01)
	03.2024	IDR 65.037.042	\$ 4.225	8	0	8	0,00
	03.2024	\$ 528	CLP 463.045	0	0	0	0,00
	03.2024	548	EGP 19.629	0	(96)	(96)	0,00
	03.2024	510	IDR 7.928.103	4	0	4	0,00
	04.2024	EGP 51.122	\$ 1.339	193	0	193	0,01
	04.2024	\$ 624	EGP 24.799	0	(68)	(68)	0,00
	06.2024	KRW 152.116	\$ 117	0	(1)	(1)	0,00
	06.2024	\$ 5.203	£ 4.144	83	0	83	0,00
RBC	04.2024	MXN 808	\$ 46	0	(1)	(1)	0,00
RYL	01.2024	AUD 1.971	1.325	0	(20)	(20)	0,00
	01.2024	€ 99	110	1	0	1	0,00
	01.2024	NOK 5.510	528	0	(15)	(15)	0,00
	01.2024	\$ 1.293	NZD 2.114	45	0	45	0,00
SCX	01.2024	¥ 848.600	\$ 5.903	0	(120)	(120)	0,00
	01.2024	\$ 95	£ 74	0	0	0	0,00
	01.2024	36	MYR 169	1	0	1	0,00
	01.2024	611	TRY 18.080	0	(2)	(2)	0,00
	02.2024	MYR 7.742	\$ 1.692	0	0	0	0,00
	02.2024	\$ 409	EGP 14.732	0	(63)	(63)	0,00
	02.2024	1.675	MYR 7.761	21	0	21	0,00
	03.2024	THB 61.679	\$ 1.784	0	(35)	(35)	0,00
	03.2024	\$ 522	EGP 18.722	0	(92)	(92)	0,00
	03.2024	5.833	IDR 90.207.345	17	0	17	0,00
	03.2024	601	INR 50.266	1	0	1	0,00
	04.2024	1.158	EGP 45.626	0	(135)	(135)	(0,01)
SSB	01.2024	CLP 3.769.579	\$ 4.264	0	(49)	(49)	0,00
	03.2024	IDR 27.996.464	1.799	0	(16)	(16)	0,00
TOR	01.2024	\$ 1.132	¥ 166.016	47	0	47	0,00
UAG	01.2024	€ 15.878	\$ 17.416	0	(128)	(128)	0,00
	01.2024	£ 11.770	14.895	0	(110)	(110)	0,00
	01.2024	\$ 573	AUD 864	16	0	16	0,00
	01.2024	5.189	IDR 80.299.109	24	0	24	0,00
	01.2024	2.787	NOK 29.728	141	0	141	0,01
	01.2024	ZAR 128.505	\$ 6.732	0	(286)	(286)	(0,01)
	03.2024	CZK 266.807	11.985	72	0	72	0,00
	03.2024	IDR 80.342.700	5.189	0	(20)	(20)	0,00
				\$ 7.375	\$ (14.116)	\$ (6.741)	(0,25)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 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	01.2024	CHF 438	\$ 513	\$ 0	\$ (8)	\$ (8)	0,00
	01.2024	\$ 31	CHF 27	1	0	1	0,00
BRC	01.2024	31.373	27.364	1.156	0	1.156	0,05
CBK	01.2024	CHF 5	\$ 6	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 76.655	CHF 66.784	2.736	0	2.736	0,10
GLM	01.2024	CHF 62	\$ 71	0	(3)	(3)	0,00
	01.2024	\$ 86.733	CHF 76.007	3.621	0	3.621	0,14
MYI	01.2024	87.267	76.178	3.290	0	3.290	0,12
SCX	01.2024	CHF 12	\$ 14	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 2.106	CHF 1.832	72	0	72	0,00
				\$ 10.876	\$ (11)	\$ 10.865	0,41

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilklassen 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
BPS	01.2024	€ 3.077	\$ 3.368	\$ 1	\$ (32)	\$ (31)	0,00
	01.2024	\$ 468.808	€ 426.362	2.289	(7)	2.282	0,08
BRC	01.2024	403.846	367.206	1.882	0	1.882	0,07
CBK	01.2024	€ 13.429	\$ 14.712	5	(131)	(126)	0,00
	01.2024	\$ 28	€ 26	0	0	0	0,00
MBC	01.2024	€ 27.200	\$ 29.381	0	(672)	(672)	(0,03)
	01.2024	\$ 352.539	€ 322.415	3.700	0	3.700	0,14
				\$ 7.877	\$ (842)	\$ 7.035	0,26

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilklasse Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2024	£ 7	\$ 9	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BPS	01.2024	\$ 9.440	£ 7.451	59	0	59	0,00
	01.2024	£ 331	\$ 418	0	(4)	(4)	0,00
BRC	01.2024	\$ 8.197	£ 6.462	42	0	42	0,00
	01.2024	165	130	1	0	1	0,00
CBK	01.2024	£ 684	\$ 863	0	(9)	(9)	0,00
GLM	01.2024	\$ 66	£ 51	0	0	0	0,00
MBC	01.2024	£ 4.355	\$ 5.506	0	(46)	(46)	0,00
	01.2024	\$ 186	£ 146	0	0	0	0,00
MYI	01.2024	£ 941	\$ 1.184	0	(16)	(16)	0,00
	01.2024	\$ 365	£ 286	0	(1)	(1)	0,00
SCX	01.2024	47.462	37.523	374	0	374	0,02
SSB	01.2024	£ 1.633	\$ 2.055	0	(27)	(27)	0,00
	01.2024	\$ 29.123	£ 23.080	300	0	300	0,01
UAG	01.2024	£ 409	\$ 512	0	(10)	(10)	0,00
	01.2024	\$ 47.451	£ 37.494	348	0	348	0,01
				\$ 1.124	\$ (113)	\$ 1.011	0,04

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilklasse 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	01.2024	\$ 109	NOK 1.158	\$ 5	\$ 0	\$ 5	0,00
CBK	01.2024	123	1.316	6	0	6	0,00
UAG	01.2024	176	1.880	9	0	9	0,00
				\$ 20	\$ 0	\$ 20	0,00

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilklassen 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	01.2024	SEK 53	\$ 5	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2024	\$ 732	SEK 7.631	26	0	26	0,00
CBK	01.2024	SEK 96	\$ 9	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 129	SEK 1.342	4	0	4	0,00
GLM	01.2024	SEK 49	\$ 5	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 14	SEK 142	0	0	0	0,00
MBC	01.2024	SEK 46	\$ 5	0	0	0	0,00
SCX	01.2024	21	2	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 812	SEK 8.430	25	0	25	0,00
UAG	01.2024	SEK 59	\$ 6	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 934	SEK 9.611	20	0	20	0,00
				\$ 75	\$ 0	\$ 75	0,00
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 11.759	0,44

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond ESG Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
EINLAGENZERTIFIKATE				
Banco Davivienda S.A.				
10,942 % fällig am 28.04.2026	COP	1.060.000	\$ 276	0,01
11,679 % fällig am 12.05.2025		15.923.200	4.090	0,15
12,950 % fällig am 08.03.2026		11.878.809	3.189	0,12
13,183 % fällig am 06.06.2026		10.206.000	2.775	0,10
13,455 % fällig am 13.06.2025		6.749.000	1.796	0,07
13,456 % fällig am 07.06.2025		13.621.000	3.625	0,14
13,456 % fällig am 09.06.2025		4.550.000	1.211	0,05
13,501 % fällig am 13.12.2024		10.517.000	2.773	0,10
15,389 % fällig am 21.02.2024		3.593.000	938	0,04
BanColombia S.A.				
5,917 % fällig am 27.01.2024		16.789.000	4.334	0,16
10,388 % fällig am 20.04.2026		21.845.200	5.636	0,21
13,320 % fällig am 08.06.2025		5.439.000	1.430	0,05
13,456 % fällig am 14.06.2025		11.102.000	2.947	0,11
13,637 % fällig am 14.12.2024		14.365.000	3.762	0,14
16,137 % fällig am 01.09.2024		5.832.000	1.545	0,06
BBVA Colombia S.A.				
13,093 % fällig am 28.04.2026		5.275.000	1.438	0,05
13,229 % fällig am 10.05.2026		2.290.000	627	0,02
13,365 % fällig am 04.05.2026		3.329.000	894	0,03
14,460 % fällig am 13.01.2024		7.110.900	1.829	0,07
16,412 % fällig am 25.04.2024		258.000	66	0,00
Summe Einlagenzertifikate			\$ 45.181	1,68
Summe Anlagen			\$ 2.916.581	108,27
Sonstige Aktiva und Passiva			\$ (222.660)	(8,27)
Nettovermögen			\$ 2.693.921	100,00

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Nullkuponwertpapier.

(b) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(c) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

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

(e) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(f) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,64 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits- datum	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Development Bank of Southern Africa	8,600 %	21.10.2024	07.10.2021	\$ 17.010	\$ 13.808	0,51

(g) Wertpapiere mit einem aggregierten beizulegenden Zeitwert von USD 228.436 (31. Dezember 2022: USD 38.910) und Barmittel in Höhe von USD null (31. Dezember 2022: USD 300) waren zum 31. Dezember 2023 Wertpapiere als Sicherheiten gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte verpfändet.

(h) Wertpapiere mit einem aggregierten beizulegenden Zeitwert von USD 55.830 (31. Dezember 2022: USD null) waren zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte verpfändet oder geliefert.

Wertpapiere mit einem aggregierten beizulegenden Zeitwert von USD 301 (31. Dezember 2022: USD null) und Barmittel in Höhe von USD 6.296 (31. Dezember 2022: USD 807) waren zum 31. Dezember 2023 Wertpapiere als Sicherheiten gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte eingegangen.

Barmittel in Höhe von USD 19.878 (31. Dezember 2022: USD 18.655) waren zum 31. Dezember 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 3.680 (31. Dezember 2022: USD 6.470) waren zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten für Finanzderivate gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 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	\$ 2.794.082	\$ 39.430	\$ 2.833.512
Pensionsgeschäfte	0	13.694	0	13.694
Finanzderivate ⁽³⁾	(3.078)	27.272	0	24.194
Einlagen bei Kreditinstituten	0	45.181	0	45.181
Summen	\$ (3.078)	\$ 2.880.229	\$ 39.430	\$ 2.916.581

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	\$ 2.396.551	\$ 25.705	\$ 2.422.256
Pensionsgeschäfte	0	44.661	0	44.661
Finanzderivate ⁽³⁾	5.273	27.624	(11)	32.886
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	1.659	1.659
Summen	\$ 5.273	\$ 2.468.836	\$ 27.353	\$ 2.501.462

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

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

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BPS	4,050 %	28.09.2023	TBD ⁽¹⁾	\$ (329)	\$ (333)	(0,01)
	4,150	20.09.2023	TBD ⁽¹⁾	€ (19.570)	(21.868)	(0,81)
	4,300	22.11.2023	TBD ⁽¹⁾	\$ (2.523)	(2.535)	(0,09)
	4,500	22.11.2023	TBD ⁽¹⁾	(1.249)	(1.255)	(0,05)
	5,000	13.10.2023	TBD ⁽¹⁾	(2.293)	(2.315)	(0,09)
	5,400	10.11.2023	TBD ⁽¹⁾	£ (3.224)	(4.142)	(0,15)
	5,520	19.12.2023	TBD ⁽¹⁾	\$ (9.581)	(9.600)	(0,36)
	9,000	11.12.2023	TBD ⁽¹⁾	ZAR (586.920)	(32.258)	(1,20)
	4,500	11.12.2023	TBD ⁽¹⁾	\$ (2.609)	(2.615)	(0,10)
	4,750	19.09.2023	TBD ⁽¹⁾	(2.557)	(2.592)	(0,10)
BRC	4,750	11.12.2023	TBD ⁽¹⁾	(8.000)	(8.022)	(0,30)
	4,750	12.12.2023	TBD ⁽¹⁾	(1.747)	(1.751)	(0,06)
	4,750	19.12.2023	TBD ⁽¹⁾	(2.297)	(2.301)	(0,09)
	5,510	14.12.2023	04.01.2024	(15.401)	(15.443)	(0,57)
	3,750	01.11.2023	TBD ⁽¹⁾	(657)	(662)	(0,02)
MYI	4,000	28.09.2023	TBD ⁽¹⁾	(2.790)	(2.819)	(0,10)
	4,000	13.11.2023	TBD ⁽¹⁾	(10.374)	(10.431)	(0,39)
	4,000	29.11.2023	TBD ⁽¹⁾	(1.734)	(1.740)	(0,06)
	4,200	05.05.2023	TBD ⁽¹⁾	(1.518)	(1.552)	(0,06)
	4,200	06.07.2023	TBD ⁽¹⁾	(3.759)	(3.837)	(0,14)
	4,650	25.10.2023	TBD ⁽¹⁾	(1.063)	(1.071)	(0,04)
	4,100	02.08.2023	TBD ⁽¹⁾	€ (1.477)	(1.658)	(0,06)
SCX	4,100	10.11.2023	TBD ⁽¹⁾	(40.343)	(44.826)	(1,66)
	4,140	10.11.2023	TBD ⁽¹⁾	(3.036)	(3.374)	(0,13)
	5,490	11.12.2023	TBD ⁽¹⁾	\$ (35.719)	(35.833)	(1,33)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte				\$ (214.833)	(7,97)	

⁽¹⁾ Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Zahlbar für Rückkauf- Finanzierungs- geschäfte ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
BRC	5,730 %	28.12.2023	02.01.2024	\$ (44.855)	\$ (44.884)	(1,66)
GSC	5,530	18.12.2023	04.01.2024	(11.756)	(11.781)	(0,44)
Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte					\$ (56.665)	(2,10)

⁽¹⁾ In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag sind USD 13 für einen aufgeschobenen Kursrückgang enthalten.

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond ESG Fund (Forts.)

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement ⁽¹⁾
AZD	\$ 46	\$ 0	\$ 46	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ k. A.
BOA	(842)	1.300	458	5	0	5
BPS	501	(3.470)	(2.969)	(1.369)	2.060	691
BRC	1.850	(2.610)	(760)	(218)	320	102
CBK	2.051	(2.440)	(389)	22.572	(21.703)	869
DUB	1.098	(740)	358	(250)	270	20
FBF	k. A.	k. A.	k. A.	(5)	0	(5)
GLM	2.503	(2.430)	73	619	(580)	39
GST	(1.574)	1.570	(4)	(2.119)	2.110	(9)
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	1	0	1
JPM	(871)	810	(61)	(645)	680	35
MBC	1.641	(3.320)	(1.679)	5.068	(4.320)	748
MYC	1.203	(1.190)	13	(538)	760	222
MYI	3.748	(4.290)	(542)	23	0	23
RBC	(1)	0	(1)	(189)	0	(189)
RYL	11	0	11	k. A.	k. A.	k. A.
SCX	64	(310)	(246)	9.690	(9.190)	500
SOG	k. A.	k. A.	k. A.	(20)	0	(20)
SSB	208	(360)	(152)	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	47	0	47	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	76	0	76	(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. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	93,42	84,95
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	11,74	12,05
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,01	0,17
Pensionsgeschäfte	0,51	1,79
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,33	0,04
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,14	(0,02)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,44	1,30
Einlagezertifikate	1,68	0,07
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(7,97)	(1,56)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(2,10)	k. A.

* Gemäß der Liste der Märkte, die die Kriterien für einen geregelten OGAW-Markt erfüllen, in Anlage 1 zum Verkaufsprospekt.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Argentinien	2,10	1,90
Armenien	0,24	0,27
Bahamas	0,16	0,33
Bahrain	0,97	0,93
Benin	0,59	0,36
Bermuda	0,13	0,13
Brasilien	2,40	3,00
Bulgarien	0,53	k. A.
Cayman-Inseln	2,32	2,06
Chile	3,07	2,80
China	0,00	0,01
Kolumbien	3,17	2,57
Costa Rica	1,00	1,12
Zypern	0,26	0,24
Dominikanische Republik	4,46	2,95
Ecuador	1,87	2,19
Ägypten	2,63	2,28
El Salvador	0,87	0,48
Frankreich	k. A.	0,10
Gabun	0,02	k. A.
Georgien	0,37	0,39
Deutschland	k. A.	0,02
Ghana	1,29	1,16
Guernsey, Kanalinseln	0,12	0,12
Hongkong	1,70	1,28
Ungarn	3,71	2,09
Indien	1,43	1,69
Indonesien	2,70	2,63
International	0,20	k. A.
Irland	0,02	0,08

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Israel	k. A.	2,24
Elfenbeinküste	0,95	1,27
Jamaika	0,15	0,17
Jersey, Kanalinseln	0,46	0,48
Jordanien	0,68	0,38
Kasachstan	0,93	1,46
Kenia	0,39	0,54
Luxemburg	0,52	0,36
Mazedonien	0,42	k. A.
Malaysia	0,49	0,13
Mauritius	0,35	0,85
Mexiko	4,83	2,31
Mongolei	0,31	0,65
Marokko	0,66	0,77
Multinational	0,02	0,02
Namibia	0,08	0,09
Niederlande	1,24	0,87
Oman	2,80	3,07
Pakistan	0,44	k. A.
Panama	3,08	2,85
Paraguay	0,93	0,91
Peru	1,31	1,36
Philippinen	1,39	1,24
Polen	1,26	0,40
Katar	1,37	1,81
Rumänien	3,48	2,26
Russland	0,01	0,04
Senegal	0,59	0,41
Serbien	1,63	0,84
Singapur	0,40	0,43
Slowenien	0,34	k. A.
Südafrika	2,81	3,59
Südkorea	5,62	4,60
Spanien	0,35	0,38
Sri Lanka	0,98	0,67
Supranational	1,22	1,81
Schweiz	0,43	0,58
Tansania	0,94	0,24
Trinidad und Tobago	0,17	k. A.
Tunesien	0,62	0,34
Türkei	2,56	2,08
Ukraine	0,99	0,78
Vereinigte Arabische Emirate	3,03	1,00
Großbritannien	1,17	1,65
USA	10,31	7,06
Uruguay	1,89	1,65
Usbekistan	0,11	0,03
Vietnam	0,04	0,04
Jungfernseln (Britisch)	0,23	0,73
Sambia	0,01	0,12
Kurzfristige Instrumente	1,85	8,43
Pensionsgeschäfte	0,51	1,79
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,33	0,04
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzkauf	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Zinsswaps	0,14	(0,02)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	0,00	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzkauf	(0,09)	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,07	(0,18)
Volatilitätsswaps	k. A.	0,00
Devisenterminkontrakte	(0,25)	0,21
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,71	1,27
Einlagenzertifikate	1,68	0,07
Sonstige Aktiva und Passiva	(8,27)	(0,35)
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Corporate Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
WANDELANLEIHEN & WECHSEL				4,340 % fällig am 07.03.2042 \$ 900 \$ 807 0,51				IMMOBILIEN			
Sunac China Holdings Ltd. 1,000 % fällig am 30.09.2032	\$ 69	\$ 5	0,00	Colombia Government International Bond 4,500 % fällig am 28.01.2026	1.000	986	0,63	Sunac Services Holdings Ltd.	321.644	\$ 77	0,05
Wynn Macau Ltd. 4,500 % fällig am 07.03.2029	400	410	0,26	Dominican Republic Central Bank Notes 13,000 % fällig am 05.12.2025	DOP 25.900	468	0,30			412	0,26
		415	0,26	Dominican Republic Government International Bond 5,300 % fällig am 21.01.2041	\$ 200	174	0,11	OPTIONSSCHEINE			
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				7,050 % fällig am 03.02.2031				OAS S.A. - Exp. 21.01.2039 (h)			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.02.2054	450	426	0,27	11,250 % fällig am 15.09.2035	DOP 44.200	824	0,52	175.616		0	0,00
4,500 % fällig am 01.02.2054	450	437	0,28	Ecuador Government International Bond				KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
5,000 % fällig am 01.02.2054	2.050	2.029	1,28	6,000 % fällig am 31.07.2030	\$ 100	47	0,03	KURZFRISTIGE SCHULDITITEL			
5,500 % fällig am 01.02.2054	550	552	0,35	Export-Credit Bank of Turkey 9,375 % fällig am 31.01.2026	900	943	0,60	Digicel International Finance Ltd. 8,750 % fällig am 25.05.2024			
		3.444	2,18	Hungarian Development Bank 6,500 % fällig am 29.06.2028	200	206	0,13	145		136	0,09
US-SCHATZOBIGATIONEN				Israel Government International Bond				UNGARISCHE SCHATZWECHSEL			
U.S. Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.05.2045	8.000	6.603	4,19	5,000 % fällig am 30.10.2026	€ 400	452	0,29	10,900 % fällig am 04.01.2024 (c)(d)	HUF 275.000	794	0,50
NON-AGENCY-MBS				Korea Electric Power Corp.				JAPANISCHE SCHWATZWECHSEL			
Canada Square Funding PLC 6,070 % fällig am 17.01.2059	£ 83	105	0,06	5,375 % fällig am 31.07.2026	\$ 300	303	0,19	(0,210) % fällig am 29.01.2024 (c)(d)			
Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates 5,700 % fällig am 25.10.2035	\$ 373	343	0,22	Magyar Export-Import Bank 6,000 % fällig am 16.05.2029	€ 100	118	0,08	€ 360.000 2.554 1,62			
Citigroup Mortgage Loan Trust 4,546 % fällig am 25.08.2036	249	218	0,14	Malaysia Government Investment Issue 3,465 % fällig am 15.10.2030	MYR 220	47	0,03	(0,190) % fällig am 10.01.2024 (c)(d)			
Countrywide Alternative Loan Trust 6,112 % fällig am 20.12.2035	46	42	0,03	4,245 % fällig am 30.09.2030	210	47	0,03	(0,170) % fällig am 13.02.2024 (c)(d)			
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust 4,418 % fällig am 25.11.2037	31	28	0,02	Panama Government International Bond 6,875 % fällig am 31.01.2036	\$ 200	200	0,13	50.000 355 0,22			
Rochester Financing PLC 5,920 % fällig am 18.12.2044	£ 116	147	0,09	Peru Government International Bond 7,300 % fällig am 12.08.2033	PEN 800	227	0,14	3.051 1,93			
Tower Bridge Funding PLC 5,940 % fällig am 20.12.2063	49	63	0,04	Romania Government International Bond 2,000 % fällig am 14.04.2033	€ 400	332	0,21	MALAYSISCHE SCHATZWECHSEL			
		946	0,60	4,625 % fällig am 03.04.2049	500	465	0,30	3,289 % fällig am 06.02.2024 (c)(d)			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				Saudi Arabia Government International Bond				AKTIEN			
Citigroup Mortgage Loan Trust 7,250 % fällig am 25.05.2036	\$ 347	181	0,12	4,875 % fällig am 18.07.2033	\$ 300	307	0,20	INVESTMENTFONDS			
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 5,690 % fällig am 25.09.2037	33	33	0,02	5,000 % fällig am 18.01.2053	200	189	0,12	ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust 5,660 % fällig am 25.04.2037	132	85	0,05	Turkey Government International Bond 9,375 % fällig am 19.01.2033	500	566	0,36	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)			
JPMorgan Mortgage Acquisition Corp. 6,445 % fällig am 25.12.2035	1.100	1.004	0,64	Ukraine Government International Bond 4,375 % fällig am 27.01.2032	€ 300	69	0,04	644.282	6.420	4,07	
NovaStar Mortgage Funding Trust 5,670 % fällig am 25.09.2037	100	97	0,06	7,750 % fällig am 01.09.2026	\$ 300	84	0,05	PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (f)			
		1.400	0,89			8.293	5,26	25.272	343	0,22	
STAATSEMISSIONEN				AMERIKA				6.763 4,29			
Argentina Government International Bond 0,750 % fällig am 09.07.2030	18	7	0,00	STAMMAKTIE				BÖRSENGEHANDELTE FONDS			
3,625 % fällig am 09.07.2035	11	4	0,00	ENERGIE				PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (f)			
Bank Gospodarstwa Krajowego 6,250 % fällig am 31.10.2028	200	211	0,13	FINANZWERT				1.000 100 0,06			
Chile Government International Bond				BAUSTOFFE				Summe Investmentfonds			
				Petra Diamonds Ltd. (b)				\$ 331.402 296 0,19			
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	2,600 %	29.12.2023	02.01.2024	\$ 993	U.S. Treasury Notes 4,875 % fällig am 30.11.2025	\$ (1.013)	\$ 993	\$ 993	0,63
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (1.013)	\$ 993	\$ 993	0,63

(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 March Futures	Long	03.2024	15	\$ 32	0,02
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2024	6	(27)	(0,02)
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Long	03.2024	151	325	0,21
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2024	36	84	0,05
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2024	18	66	0,04
U.S. Treasury 10-Year Ultra March Futures	Short	03.2024	7	(36)	(0,02)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2024	42	(506)	(0,32)
				\$ (62)	(0,04)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (62)	(0,04)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – 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	\$ 2	0,00
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5,000	20.06.2028	600	44	0,03
				\$ 46	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-39 5-Year Index	1,000 %	20.06.2028	\$ 700	\$ 17	0,01
CDX.EM-40 5-Year Index	1,000	20.12.2028	3.000	62	0,04
CDX.IG-41 5-Year Index	1,000	20.12.2028	2.300	15	0,01
iTraxx Crossover 40 5-Year Index	5,000	20.12.2028	€ 1.000	51	0,03
iTraxx Europe Main 40 5-Year Index	1,000	20.12.2028	1.700	15	0,01
				\$ 160	0,10

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750 %	21.06.2047	\$ 1.700	\$ 217	0,14
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2030	300	(8)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,131	04.01.2027	BRL 6.500	10	0,01
Erhalt ⁽³⁾	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,250	20.03.2029	CNY 2.520	0	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,205	22.04.2027	ZAR 7.200	7	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,210	22.04.2027	35.600	19	0,01
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	20.09.2033	AUD 3.000	78	0,05
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,611	06.06.2028	CZK 12.800	29	0,02
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	4,930	29.06.2028	PLN 1.700	(22)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,207	19.06.2028	MXN 6.900	(8)	(0,01)
					\$ 322	0,20
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ 528	0,33

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

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

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

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Corporate Bond Fund (Forts.)

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

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

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BRC	America Movil S.A.B. de C.V.	1,000 %	20.12.2025	\$ 1.200	\$ (30)	\$ 45	\$ 15	0,01
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2028	500	(88)	55	(33)	(0,02)
CBK	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2026	50	1	0	1	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2026	900	(42)	36	(6)	0,00
GST	Poland Government International Bond	1,000	20.06.2024	300	1	0	1	0,00
JPM	Banco do Brasil S.A.	1,000	20.12.2024	400	(9)	9	0	0,00
MYC	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2028	400	(4)	6	2	0,00
					\$ (171)	\$ 151	\$ (20)	(0,01)

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

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

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 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS zzgl. 0,053 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month PHP-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	20.03.2029	\$ 242	PHP 13.460	\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	0,00
JPM	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS zzgl. 0,054 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month PHP-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	20.03.2029	16	890	0	0	0	0,00
						\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	0,00

ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
GST	Erhalt ⁽¹⁾	3-Month MYR-KLIBOR	3,500 %	20.03.2029	MYR 3.140	\$ 2	\$ 1	\$ 3	0,00

⁽¹⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	03.2024	CNH 1.648	\$ 229	\$ 0	\$ (4)	\$ (4)	0,00
BOA	01.2024	CAD 60	44	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	COP 11.062.049	2.750	0	(102)	(102)	(0,06)
	01.2024	NZD 514	313	0	(12)	(12)	(0,01)
	01.2024	PEN 551	148	0	0	0	0,00
	01.2024	PLN 185	44	0	(3)	(3)	0,00
	01.2024	\$ 2.892	COP 11.062.049	0	(40)	(40)	(0,03)
	01.2024	163	PLN 669	7	0	7	0,00
	02.2024	334	CNY 2.357	0	0	0	0,00
	03.2024	CNH 2.542	\$ 351	0	(8)	(8)	(0,01)
	03.2024	COP 11.062.049	2.850	39	0	39	0,02
	03.2024	\$ 78	INR 6.501	0	0	0	0,00
	04.2024	MYR 9.655	\$ 2.109	0	(10)	(10)	(0,01)
	04.2024	\$ 2.105	MYR 9.710	27	0	27	0,02
BPS	01.2024	COP 370.327	\$ 94	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	€ 114	124	0	(2)	(2)	0,00
	01.2024	HUF 86.861	247	0	(4)	(4)	0,00
	01.2024	¥ 8.900	62	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	PEN 51	14	0	0	0	0,00
	01.2024	PLN 1.104	260	0	(21)	(21)	(0,01)
	01.2024	\$ 184	CAD 250	5	0	5	0,00
	01.2024	97	COP 370.327	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	198	HUF 70.029	4	0	4	0,00
	01.2024	832	¥ 121.700	32	0	32	0,02
	01.2024	75	PLN 329	8	0	8	0,01

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
	02.2024	TWD 1.683	\$ 53	\$ 0	\$ (3)	\$ (3)	0,00
	02.2024	\$ 592	CNY 4.204	2	0	2	0,00
	03.2024	CLP 108.213	\$ 125	2	0	2	0,00
	03.2024	CNH 1.832	254	0	(4)	(4)	0,00
	03.2024	IDR 2.648.144	171	1	(2)	(1)	0,00
	03.2024	PEN 524	141	0	0	0	0,00
	03.2024	THB 3.271	93	0	(3)	(3)	0,00
	03.2024	TWD 1.151	37	0	(1)	(1)	0,00
	03.2024	\$ 93	COP 370.327	1	0	1	0,00
	03.2024	124	IDR 1.955.982	3	0	3	0,00
	03.2024	110	ILS 397	1	0	1	0,00
	03.2024	270	INR 22.583	0	0	0	0,00
	03.2024	93	PEN 350	1	0	1	0,00
	03.2024	47	THB 1.624	1	0	1	0,00
	06.2024	109	KRW 140.192	0	0	0	0,00
BRC	01.2024	PLN 702	\$ 161	0	(18)	(18)	(0,01)
	01.2024	\$ 31	BRL 154	1	0	1	0,00
	01.2024	76	TRY 2.270	0	0	0	0,00
	03.2024	HKD 701	\$ 90	0	0	0	0,00
CBK	04.2024	\$ 375	TRY 11.983	0	(5)	(5)	0,00
	01.2024	BRL 660	\$ 135	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	CAD 83	62	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	COP 370.327	97	1	0	1	0,00
	01.2024	€ 43	46	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	MXN 3.444	195	0	(7)	(7)	0,00
	01.2024	PLN 434	103	0	(8)	(8)	(0,01)
	01.2024	\$ 203	CAD 271	3	0	3	0,00
	01.2024	94	COP 370.327	2	0	2	0,00
	01.2024	245	MXN 4.508	20	0	20	0,01
	01.2024	29	NOK 306	2	0	2	0,00
	01.2024	242	PLN 1.013	16	0	16	0,01
	01.2024	ZAR 7.619	\$ 401	0	(16)	(16)	(0,01)
	03.2024	ILS 294	81	0	(1)	(1)	0,00
	03.2024	PEN 1.022	271	0	(4)	(4)	0,00
	03.2024	\$ 46	IDR 713.336	0	0	0	0,00
	03.2024	281	PEN 1.046	2	(1)	1	0,00
	04.2024	76	BRL 374	0	0	0	0,00
DUB	06.2024	KRW 26.559	\$ 21	0	0	0	0,00
GLM	01.2024	\$ 134	ZAR 2.553	5	0	5	0,00
	01.2024	CAD 63	\$ 47	0	0	0	0,00
	01.2024	CHF 312	356	0	(15)	(15)	(0,01)
	01.2024	DOP 24.930	438	10	0	10	0,01
	01.2024	HUF 73.283	197	0	(14)	(14)	(0,01)
	01.2024	MXN 12.662	722	0	(22)	(22)	(0,01)
	01.2024	\$ 100	BRL 506	5	0	5	0,00
	01.2024	47	HUF 16.254	0	0	0	0,00
	01.2024	106	NOK 1.160	8	0	8	0,01
	03.2024	94	PEN 349	0	0	0	0,00
JPM	08.2024	43	COP 185.846	3	0	3	0,00
	01.2024	HUF 151.520	\$ 431	0	(7)	(7)	0,00
	01.2024	\$ 78	CAD 103	0	0	0	0,00
	02.2024	373	BRL 1.831	3	0	3	0,00
	03.2024	CLP 112.719	\$ 125	0	(4)	(4)	0,00
	03.2024	CNH 1.402	194	0	(4)	(4)	0,00
	03.2024	SGD 60	45	0	0	0	0,00
	03.2024	THB 2.737	77	0	(4)	(4)	0,00
	03.2024	\$ 81	INR 6.769	0	0	0	0,00
MBC	08.2024	88	COP 380.578	6	0	6	0,00
	01.2024	CAD 615	\$ 454	0	(12)	(12)	(0,01)
	01.2024	€ 6.929	7.618	0	(38)	(38)	(0,02)
	01.2024	HUF 47.613	130	0	(7)	(7)	(0,01)
	01.2024	¥ 26.800	187	0	(3)	(3)	0,00
	01.2024	MXN 204	11	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	\$ 242	AUD 365	7	0	7	0,00
	01.2024	193	£ 153	2	0	2	0,00
	01.2024	ZAR 8.643	\$ 452	0	(20)	(20)	(0,01)
	02.2024	¥ 50.000	352	0	(5)	(5)	0,00
	03.2024	HKD 31	4	0	0	0	0,00
	03.2024	PHP 6.728	120	0	(1)	(1)	0,00
	03.2024	TWD 1.899	61	0	(2)	(2)	0,00
	03.2024	\$ 109	INR 9.082	0	0	0	0,00
MYI	01.2024	HUF 35.854	\$ 102	0	(2)	(2)	0,00
	01.2024	PLN 435	105	0	(6)	(6)	0,00
	01.2024	\$ 31	BRL 151	0	0	0	0,00
	01.2024	77	CHF 67	3	0	3	0,00
	01.2024	74	€ 67	0	0	0	0,00
	01.2024	59	HUF 20.720	1	0	1	0,00
	01.2024	251	MYR 1.172	5	0	5	0,00
	01.2024	160	NZD 252	0	0	0	0,00
	02.2024	348	CNY 2.461	0	0	0	0,00
	03.2024	CLP 27.098	\$ 31	0	0	0	0,00
	03.2024	CNH 1.573	218	0	(4)	(4)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Corporate Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	03.2024	THB 1.627	\$ 47	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	03.2024	\$ 84	IDR 1.291.714	0	0	0	0,00
	06.2024	KRW 9.171	\$ 7	0	0	0	0,00
RBC	01.2024	¥ 430.000	2.916	0	(146)	(146)	(0,09)
	04.2024	MXN 18	1	0	0	0	0,00
RYL	01.2024	NOK 480	46	0	(1)	(1)	0,00
SCX	01.2024	MYR 1.909	409	0	(8)	(8)	(0,01)
	02.2024	3.083	648	0	(25)	(25)	(0,02)
	03.2024	CNH 1.544	213	0	(5)	(5)	0,00
	03.2024	THB 3.632	105	0	(2)	(2)	0,00
	03.2024	\$ 169	INR 14.136	0	0	0	0,00
	08.2024	40	COP 173.120	3	0	3	0,00
SSB	03.2024	IDR 1.665.213	\$ 107	0	(1)	(1)	0,00
TOR	03.2024	CNH 947	131	0	(3)	(3)	0,00
UAG	01.2024	£ 712	901	0	(6)	(6)	0,00
	01.2024	\$ 30	MXN 532	1	0	1	0,00
	01.2024	128	NOK 1.368	7	0	7	0,00
	01.2024	ZAR 5.421	\$ 284	0	(12)	(12)	(0,01)
	03.2024	CZK 7.501	337	2	0	2	0,00
				\$ 252	\$ (667)	\$ (415)	(0,26)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 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
BRC	01.2024	\$ 301	CHF 262	\$ 10	\$ 0	\$ 10	0,01
CBK	01.2024	2.988	2.603	107	0	107	0,07
GLM	01.2024	CHF 51	\$ 58	0	(2)	(2)	0,00
	01.2024	\$ 3.266	CHF 2.862	136	0	136	0,08
MYI	01.2024	3.283	2.866	124	0	124	0,08
				\$ 377	\$ (2)	\$ 375	0,24

Zum 31. Dezember 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
BPS	01.2024	€ 193	\$ 210	\$ 0	\$ (4)	\$ (4)	0,00
	01.2024	\$ 4.493	€ 4.118	57	0	57	0,04
BRC	01.2024	36.247	32.959	169	0	169	0,11
CBK	01.2024	€ 95	\$ 105	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	\$ 19	€ 17	0	0	0	0,00
MBC	01.2024	€ 548	\$ 598	0	(7)	(7)	(0,01)
MYI	01.2024	\$ 39.927	€ 36.326	210	0	210	0,13
UAG	01.2024	39.958	36.326	180	0	180	0,11
				\$ 616	\$ (12)	\$ 604	0,38

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 545 0,35

BESCHREIBUNG

EINLAGENZERTIFIKATE

	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
Banco Davivienda S.A.			
11,679 % fällig am 12.05.2025	COP 1.262.200	\$ 324	0,20
12,950 % fällig am 08.03.2026	715.416	192	0,12
13,183 % fällig am 06.06.2026	621.000	169	0,11
13,455 % fällig am 13.06.2025	404.000	108	0,07
13,456 % fällig am 07.06.2025	818.000	218	0,14
13,456 % fällig am 09.06.2025	273.000	73	0,05
13,501 % fällig am 13.12.2024	714.000	188	0,12
Bancolombia S.A.			
5,917 % fällig am 27.01.2024	1.097.400	283	0,18
10,388 % fällig am 20.04.2026	1.318.900	340	0,21
13,320 % fällig am 08.06.2025	369.000	97	0,06
13,456 % fällig am 14.06.2025	663.000	176	0,11
13,637 % fällig am 14.12.2024	978.000	256	0,16
16,137 % fällig am 01.09.2024	400.000	106	0,07

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
BBVA Colombia S.A.				
13,229 % fällig am 10.05.2026	COP	154.000	\$ 42	0,03
13,365 % fällig am 04.05.2026		225.000	61	0,04
14,460 % fällig am 13.01.2024		467.400	120	0,08
Summe Einlagezertifikate			\$ 2.753	1,75
Summe Anlagen			\$ 159.895	101,38
Sonstige Aktiva und Passiva			\$ (2.182)	(1,38)
Nettovermögen			\$ 157.713	100,00

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(b) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(c) Nullkuponwertpapier.

(d) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

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

(f) Mit dem Teilfonds 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	0,02
Development Bank of Southern Africa 8,600 % fällig am 21.10.2024	07.10.2021	1.498	1.216	0,77
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. 16. Mai 2039	16.11.2018	5	0	0,00
		\$ 1.556	\$ 1.260	0,79

(i) Wertpapier mit einem aggregierten beizulegenden Zeitwert von USD 177 (31. Dezember 2022: USD null) war zum 31. Dezember 2023 Wertpapiere als Sicherheiten gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 1.731 (31. Dezember 2022: USD 1.839) waren zum 31. Dezember 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 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	\$ 296	\$ 145.730	\$ 2.249	\$ 148.275
Investmentfonds	6.763	100	0	6.863
Pensionsgeschäfte	0	993	0	993
Finanzderivate ⁽³⁾	4	1.007	0	1.011
Einlagen bei Kreditinstituten	0	2.753	0	2.753
Summen	\$ 7.063	\$ 150.583	\$ 2.249	\$ 159.895

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 458	\$ 140.620	\$ 2.309	\$ 143.387
Investmentfonds	16.419	99	0	16.518
Pensionsgeschäfte	0	8.386	0	8.386
Finanzderivate ⁽³⁾	191	3.630	0	3.821
Summen	\$ 17.068	\$ 152.735	\$ 2.309	\$ 172.112

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

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

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

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Corporate Bond Fund (Forts.)

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	
					% des Nettovermögens	
BPS	4,050 %	28.09.2023	TBD ⁽¹⁾	\$ (165)	\$ (166)	(0,11)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (166)	(0,11)

⁽¹⁾ Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement
AZD	\$ (4)	\$ 0	\$ (4)	\$ (141)	\$ 0	\$ (141)
BOA	(103)	0	(103)	92	(40)	52
BPS	71	0	71	(36)	0	(36)
BRC	139	(340)	(201)	(2)	0	(2)
CBK	107	0	107	1.221	(1.150)	71
DUB	5	0	5	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	107	0	107	1	0	1
GST	4	0	4	k. A.	k. A.	k. A.
JPM	(10)	0	(10)	14	0	14
MBC	(87)	0	(87)	648	(550)	98
MYC	2	0	2	(5)	0	(5)
MYI	330	(540)	(210)	76	0	76
RBC	(146)	0	(146)	k. A.	k. A.	k. A.
RYL	(1)	0	(1)	k. A.	k. A.	k. A.
SCX	(37)	0	(37)	981	(940)	41
SSB	(1)	0	(1)	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	(3)	0	(3)	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	172	(390)	(218)	(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. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	77,71	67,07
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	16,30	17,79
Investmentfonds	4,35	9,77
Pensionsgeschäfte	0,63	4,96
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,04)	0,10
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,33	0,50
Freiverkehrsinanzderivate	0,35	1,66
Einlagenzertifikate	1,75	k. A.
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,11)	k. A.

* Gemäß der Liste der Märkte, die die Kriterien für einen geregelten OGAW-Markt erfüllen, in Anlage 1 zum Verkaufsprospekt.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	1,79	1,15
Unternehmensanleihen und Wechsel	75,63	70,02
Wandelanleihen & Wechsel	0,26	k. A.
US-Regierungsbehörden	2,18	0,76
US-Schatzobligationen	4,19	3,90
Non-Agency-MBS	0,60	0,77
Forderungsbesicherte Wertpapiere	0,89	0,84
Staatsemissionen	5,26	3,53
Stammaktien	0,26	0,52
Optionsscheine	0,00	0,00
Kurzfristige Instrumente	2,95	3,37
Investmentfonds	4,35	9,77
Pensionsgeschäfte	0,63	4,96
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,04)	0,10
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,03	(0,01)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,10	0,20
Zinsswaps	0,20	0,31

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	(0,01)	(0,02)
Cross-Currency Swaps	0,00	k. A.
Zinsswaps	0,00	k. A.
Volatilitätsswaps	k. A.	0,00
Devisenterminkontrakte	(0,26)	(0,24)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,62	1,92
Einlagezertifikate	1,75	k. A.
Sonstige Aktiva und Passiva	(1,38)	(1,85)
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				
ANGOLA				
STAATSEMISSIONEN				
Angolan Government International Bond				
8,750 % fällig am 14.04.2032	\$ 4.400	\$ 3.882	1,37	
BRASILIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Banco BTG Pactual S.A.				
8,300 % fällig am 15.08.2024	BRL 10.000	2.020	0,72	
Banco do Brasil S.A.				
8,500 % fällig am 29.07.2026	MXN 38.000	2.112	0,75	
Oi S.A.				
0,000 % fällig am 25.02.2035	BRL 350	38	0,01	
Vale S.A.				
0,000 % (d)	46.580	3.397	1,20	
Summe Brasilien		7.567	2,68	
KAMERUN				
STAATSEMISSIONEN				
Republic of Cameroon Government International Bond				
5,950 % fällig am 07.07.2032	€ 800	655	0,23	
CAYMAN-INSELN				
WANDELANLEIHEN & WECHSEL				
Sunac China Holdings Ltd.				
1,000 % fällig am 30.09.2032	\$ 38	3	0,00	
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Kaisa Group Holdings Ltd.				
9,375 % fällig am 30.06.2024 ^	3.400	123	0,05	
9,750 % fällig am 28.09.2023 ^	700	26	0,01	
11,700 % fällig am 11.11.2025 ^	200	7	0,00	
Peru Payroll Deduction Finance Ltd.				
0,000 % fällig am 01.11.2029 (a)	1.408	1.166	0,41	
Poinsettia Finance Ltd.				
6,625 % fällig am 17.06.2031	767	652	0,23	
Suci Second Investment Co.				
6,000 % fällig am 25.10.2028	1.200	1.270	0,45	
Sunac China Holdings Ltd.				
6,000 % fällig am 30.09.2026	22	2	0,00	
6,250 % fällig am 30.09.2027	22	2	0,00	
6,500 % fällig am 30.09.2027	44	3	0,00	
6,750 % fällig am 30.09.2028	65	3	0,00	
7,000 % fällig am 30.09.2029	65	3	0,00	
7,250 % fällig am 30.09.2030	31	1	0,00	
		3.258	1,15	
Summe Cayman-Inseln		3.261	1,15	
CHILE				
STAATSEMISSIONEN				
Bonos de la Tesorería de la República en Pesos				
5,800 % fällig am 01.10.2034	CLP 5.300.000	6.257	2,21	
6,000 % fällig am 01.04.2033	4.070.000	4.902	1,74	
Summe Chile		11.159	3,95	
CHINA				
AKTIEN				
Sunac Services Holdings Ltd.	176.012	42	0,02	
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Yango Justice International Ltd.				
7,500 % fällig am 17.02.2025	\$ 1.100	11	0,00	
Summe China		53	0,02	
KOLUMBIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Ecopetrol S.A.				
5,875 % fällig am 28.05.2045	700	554	0,20	

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES
STAATSEMISSIONEN				
Colombia Government International Bond				
8,000 % fällig am 14.11.2035	\$ 300	\$ 329	0,12	
8,750 % fällig am 14.11.2053	500	576	0,20	
		905	0,32	
Summe Kolumbien		1.459	0,52	
KONGO				
STAATSEMISSIONEN				
Congolese Government International Bond				
6,000 % fällig am 30.06.2029	585	479	0,17	
COSTA RICA				
STAATSEMISSIONEN				
Costa Rica Government International Bond				
7,300 % fällig am 13.11.2054	800	870	0,31	
TSCHECHISCHE REPUBLIK				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
EP Infrastructure A/S				
1,816 % fällig am 02.03.2031	€ 1.400	1.201	0,43	
STAATSEMISSIONEN				
Czech Republic Government International Bond				
2,000 % fällig am 13.10.2033	CZK 19.400	747	0,26	
2,750 % fällig am 23.07.2029	49.000	2.082	0,74	
		2.829	1,00	
Summe Tschechische Republik		4.030	1,43	
DÄNEMARK				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
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	
1,500 % 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	
Summe Dänemark		0	0,00	
DOMINIKANISCHE REPUBLIK				
STAATSEMISSIONEN				
Dominican Republic Central Bank Notes				
12,000 % fällig am 03.10.2025	DOP 84.300	1.481	0,52	
13,000 % fällig am 05.12.2025	244.600	4.418	1,56	
Dominican Republic Government International Bond				
11,250 % fällig am 15.09.2035	157.300	2.931	1,04	
13,625 % fällig am 03.02.2033	50.200	1.055	0,37	
13,625 % fällig am 10.02.2034	56.700	1.181	0,42	
Summe Dominikanische Republik		11.066	3,91	
ECUADOR				
STAATSEMISSIONEN				
Ecuador Government International Bond				
2,500 % fällig am 31.07.2040	\$ 90	29	0,01	
3,500 % fällig am 31.07.2035	580	208	0,07	
6,000 % fällig am 31.07.2030	7.820	3.660	1,30	
Summe Ecuador		3.897	1,38	
ÄGYPTEN				
STAATSEMISSIONEN				
Egypt Government International Bond				
7,903 % fällig am 21.02.2048	3.100	1.878	0,66	
8,750 % fällig am 30.09.2051	3.100	1.969	0,70	
Summe Ägypten		3.847	1,36	
GUATEMALA				
STAATSEMISSIONEN				
Guatemala Government International Bond				
6,600 % fällig am 13.06.2036	900	929	0,33	

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES
HONGKONG				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Fortune Star BVI Ltd.				
3,950 % fällig am 02.10.2026	€ 1.900	\$ 1.342	0,47	
UNGARN				
STAATSEMISSIONEN				
Hungary Government International Bond				
6,125 % fällig am 22.05.2028	\$ 900	937	0,33	
Magyar Export-Import Bank				
6,000 % fällig am 16.05.2029	€ 1.200	1.410	0,50	
Summe Ungarn		2.347	0,83	
INDIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
JSW Hydro Energy Ltd.				
4,125 % fällig am 18.05.2031	\$ 564	492	0,17	
IRLAND				
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
Black Diamond CLO DAC				
4,853 % fällig am 20.01.2032	€ 302	332	0,12	
Cairn CLO DAC				
4,745 % fällig am 15.10.2031	799	869	0,31	
Carlyle Euro CLO DAC				
4,665 % fällig am 15.01.2031	1.388	1.518	0,53	
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.				
4,752 % fällig am 15.11.2031	1.298	1.414	0,50	
Harvest CLO DAC				
4,566 % fällig am 26.06.2030	926	1.012	0,36	
Oak Hill European Credit Partners DAC				
4,733 % fällig am 20.10.2031	499	545	0,19	
		5.690	2,01	
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC				
5,950 % fällig am 15.04.2030	\$ 900	54	0,02	
^ (f)				
Sovcombank Via SovCom Capital DAC				
8,000 % fällig am 07.04.2030	400	24	0,01	
^ (f)				
		78	0,03	
NON-AGENCY-MBS				
European Loan Conduit DAC				
4,994 % fällig am 17.02.2030	€ 287	312	0,11	
Summe Irland		6.080	2,15	
ISRAEL				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Israel Electric Corp. Ltd.				
8,100 % fällig am 15.12.2096	\$ 1.100	1.268	0,45	
STAATSEMISSIONEN				
Israel Government International Bond				
5,000 % fällig am 30.10.2026	€ 5.300	5.992	2,12	
Summe Israel		7.260	2,57	
ELFENBEINKÜSTE				
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				
Republic of Cote d'Ivoire				
9,055 % fällig am 19.03.2027	700	746	0,26	
JAMAICA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
TransJamaican Highway Ltd.				
5,750 % fällig am 10.10.2036	\$ 735	645	0,23	
KENIA				
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				
Republic of Kenya				
TBD % fällig am 29.06.2025	1.169	1.161	0,41	

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE								INVESTMENTFONDS			
UNGARISCHE SCHWATZWECHSEL								ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
10.900 % fällig am				(0,226) % fällig am				PIMCO Select Funds plc -			
04.01.2024 (a)(b)	HUF 2.804.000	\$ 8.099	2,87	15.01.2024 (a)(b)	¥ 183.000	\$ 1.298	0,46	PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e)	20.899	\$ 208	0,08
JAPANISCHE SCHWATZWECHSEL								BÖRSENGEHANDELTE FONDS			
(0,252) % fällig am				22.01.2024 (a)(b)	2.866.000	20.331	7,19	PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (e)	6.300	628	0,22
26.02.2024 (a)(b)	¥ 1.158.000	8.216	2,90	(0,197) % fällig am							
(0,238) % fällig am				22.01.2024 (a)(b)	278.000	1.972	0,70				
15.01.2024 (a)(b)	322.000	2.284	0,81			36.314	12,84				
(0,231) % fällig am				Summe kurzfristige Instrumente		44.413	15,71				
26.02.2024 (a)(b)	312.000	2.213	0,78	Summe übertragbare Wertpapiere		\$ 264.943	93,69				
								Summe Investmentfonds		\$ 836	0,30

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
SSB	2,600 %	29.12.2023	02.01.2024	\$ 6.274	U.S. Treasury Notes 0,250 % fällig am 31.10.2025	\$ (6.400)	\$ 6.274	\$ 6.275	2,22
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (6.400)	\$ 6.274	\$ 6.275	2,22

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Long	03.2024	7	\$ 32	0,01
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2024	272	628	0,22
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Short	03.2024	148	(523)	(0,18)
U.S. Treasury 10-Year Ultra March Futures	Short	03.2024	1	(5)	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2024	30	(388)	(0,14)
				\$ (256)	(0,09)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (256)	(0,09)

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	4,900 %	25.08.2028	£ 11.000	\$ 699	0,25
Erhalt ⁽¹⁾	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,500	20.03.2029	INR 1.520.420	(46)	(0,02)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,232	05.10.2025	¥ 15.220.000	(194)	(0,07)
Zahlung ⁽¹⁾	1-Day THB-THORON Compounded-OIS	2,250	20.03.2026	THB 866.415	(7)	0,00
Erhalt ⁽¹⁾	1-Day THB-THORON Compounded-OIS	2,500	20.03.2029	358.480	6	0,00
Zahlung ⁽¹⁾	1-Day THB-THORON Compounded-OIS	2,750	20.03.2029	204.760	78	0,03
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,750	16.06.2031	\$ 2.500	313	0,11
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,250	17.06.2025	400	(30)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,250	16.12.2050	1.500	632	0,22
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,250	16.06.2051	4.500	1.038	0,37
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,500	21.06.2024	7.100	(49)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,500	18.12.2024	270	12	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,500	18.12.2029	4.100	402	0,14
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,562	14.02.2024	22.300	839	0,30
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.12.2031	2.700	423	0,15
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,250	20.12.2053	8.900	(1.140)	(0,40)
Erhalt ⁽¹⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,319	30.05.2033	12.400	(249)	(0,09)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2030	17.800	(221)	(0,08)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2030	21.200	766	0,27
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2033	1.300	(49)	(0,02)
Erhalt ⁽¹⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,684	03.01.2034	200	(3)	0,00
Erhalt ⁽¹⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	02.01.2034	200	(4)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,830	12.10.2053	100	10	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,854	29.12.2033	400	(11)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,950	19.12.2033	300	(11)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,030	04.10.2033	100	5	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,030	15.12.2033	300	(13)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,150	12.10.2033	300	17	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,155	02.10.2033	400	23	0,01

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,170 %	03.10.2033	\$ 1.200	\$ 70	0,03
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,175	10.10.2033	100	6	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,220	20.10.2033	200	13	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,230	23.10.2033	100	6	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	22.11.2033	300	(18)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,393	25.10.2033	100	8	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,435	01.11.2033	200	17	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,450	01.11.2033	400	34	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,585	02.01.2025	BRL 10.000	(278)	(0,10)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	6,225	02.01.2025	4.600	(95)	(0,03)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,750	02.01.2025	10.500	154	0,05
Zahlung	1-Year BRL-CDI	6,962	04.01.2027	8.300	(157)	(0,06)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	8,589	04.01.2027	11.900	178	0,06
Zahlung	1-Year BRL-CDI	8,621	02.01.2025	6.000	(26)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,772	04.01.2027	56.200	19	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,145	04.01.2027	2.500	(14)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,231	04.01.2027	9.400	(46)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,472	04.01.2027	28.200	(87)	(0,03)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,559	02.01.2025	45.000	21	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,602	04.01.2027	45.800	59	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,665	02.01.2024	5.800	(46)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,755	02.01.2024	22.000	(165)	(0,06)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,800	02.01.2024	51.900	378	0,13
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,831	02.01.2025	125.300	(16)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,833	02.01.2024	31.800	(230)	(0,08)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,995	02.01.2024	15.300	(100)	(0,04)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,065	02.01.2024	10.600	(65)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,083	04.01.2027	22.200	14	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,134	04.01.2027	27.200	(122)	(0,04)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,148	02.01.2024	2.600	(15)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,199	04.01.2027	24.800	(42)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,439	04.01.2027	15.500	95	0,03
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,449	04.01.2027	15.500	95	0,03
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,456	02.01.2026	38.300	164	0,06
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,839	02.01.2025	65.900	(73)	(0,03)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,920	02.01.2024	99.100	389	0,14
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,920	02.01.2025	88.400	9	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,946	04.01.2027	37.800	(323)	(0,11)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,026	02.01.2025	22.100	7	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,131	04.01.2027	25.200	(82)	(0,03)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,132	04.01.2027	21.700	203	0,07
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,231	02.01.2025	15.500	17	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,260	01.04.2024	466.000	(26)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,290	02.01.2024	54.800	(201)	(0,07)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,350	01.07.2024	52.300	(18)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,490	01.07.2024	56.100	(36)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,569	02.01.2029	16.000	(232)	(0,08)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,595	01.07.2024	46.000	44	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,721	02.01.2029	19.000	293	0,10
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,784	02.01.2029	20.500	323	0,11
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,981	04.01.2027	27.000	359	0,13
Zahlung	1-Year BRL-CDI	13,080	01.07.2024	100.300	188	0,07
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,257	02.01.2029	39.300	(730)	(0,26)
Zahlung ⁽¹⁾	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,250	20.03.2029	CNY 62.560	12	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	2,690	24.07.2024	COP 7.257.000	123	0,04
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	2,740	24.07.2024	7.084.900	(120)	(0,04)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3,100	26.11.2025	2.651.000	73	0,03
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,060	26.11.2025	14.071.000	322	0,11
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,110	23.03.2026	4.493.200	(90)	(0,03)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,651	26.11.2025	2.624.800	(53)	(0,02)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	6,130	26.10.2026	25.320.800	378	0,13
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	6,885	31.01.2025	24.609.000	267	0,09
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,080	02.02.2027	1.622.900	13	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,090	28.04.2028	1.750.200	12	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,130	31.01.2027	8.865.000	67	0,02
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	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,320	31.03.2027	2.908.000	10	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,560	30.03.2027	4.424.200	23	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,686	30.03.2027	26.334.600	158	0,06
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	(210)	(0,07)
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	20.872.100	351	0,12
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,800	17.01.2028	9.809.000	170	0,06
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,265	12.04.2025	41.439.000	(25)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	11,640	21.10.2025	11.114.000	(127)	(0,04)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	11,930	10.11.2025	5.929.100	80	0,03
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	12,000	26.11.2025	427.000	(6)	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	12,060	09.11.2025	4.198.000	59	0,02
Zahlung ⁽¹⁾	3-Month KRW-KORIBOR	3,750	20.03.2034	KRW 5.813.150	56	0,02
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	5,757	14.04.2026	ZAR 96.300	(248)	(0,09)
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,650	05.10.2033	AUD 12.200	446	0,16

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,750 %	20.12.2028	AUD 32.700	\$ 867	0,31
Zahlung ⁽¹⁾	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,750	20.12.2033	18.700	198	0,07
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,947	23.11.2027	CLP 999.000	121	0,04
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,950	05.05.2026	1.239.600	(113)	(0,04)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,965	24.11.2027	851.000	104	0,04
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,020	30.04.2026	1.300.000	(117)	(0,04)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,183	04.12.2027	2.661.000	(290)	(0,10)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	2,640	01.03.2026	795.000	65	0,02
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,530	06.07.2026	1.995.000	146	0,05
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	4,000	06.07.2028	1.019.000	63	0,02
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,050	01.04.2033	2.200.000	6	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,180	01.10.2028	790.000	(12)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,240	01.09.2030	1.286.000	(23)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,260	01.03.2026	620.000	6	0,00
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	(68)	(0,02)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,470	01.09.2030	460.000	(14)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,548	10.04.2028	833.000	23	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,570	01.10.2028	245.000	(10)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,600	12.12.2027	1.803.000	(65)	(0,02)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,635	12.12.2027	3.695.000	(133)	(0,05)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,700	17.05.2028	1.602.100	(68)	(0,02)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,734	18.05.2028	9.093.000	(377)	(0,13)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,855	05.10.2033	5.448.000	(351)	(0,12)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,020	02.03.2029	190.000	13	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,070	28.02.2028	3.391.700	(150)	(0,05)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,170	30.10.2033	3.885.900	(422)	(0,15)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,194	10.03.2028	1.681.200	91	0,03
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,223	13.03.2028	680.300	37	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,255	13.03.2028	478.200	31	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,270	02.03.2027	415.700	18	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,330	09.03.2028	526.800	35	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,360	25.05.2027	24.600	1	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,386	24.05.2027	1.861.000	103	0,04
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,440	07.03.2028	1.344.000	85	0,03
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,500	12.12.2025	2.564.000	(71)	(0,03)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,535	09.01.2026	9.540.000	112	0,04
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,567	12.12.2025	1.464.000	(44)	(0,02)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,570	22.12.2025	1.277.000	(42)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,590	22.12.2025	3.565.000	(111)	(0,04)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,590	21.03.2027	4.540.300	162	0,06
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,805	06.03.2027	1.852.000	107	0,04
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	7,000	27.09.2032	1.785.800	304	0,11
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	7,265	07.03.2026	262.400	13	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	7,270	07.03.2026	2.463.000	107	0,04
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	7,370	06.03.2026	1.686.000	80	0,03
Zahlung ⁽¹⁾	6-Month CZK-PRIBOR	1,025	29.07.2030	CZK 35.800	(143)	(0,05)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	1,224	28.01.2031	44.500	(318)	(0,11)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	1,575	26.03.2026	28.100	(76)	(0,03)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	1,725	22.07.2026	23.800	(84)	(0,03)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	1,815	28.01.2031	34.200	181	0,06
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	2,000	19.06.2024	26.100	(28)	(0,01)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	3,490	18.01.2032	10.600	0	0,00
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	3,680	03.03.2027	78.400	(56)	(0,02)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	4,164	14.03.2027	73.600	(76)	(0,03)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	4,220	14.03.2027	73.500	(83)	(0,03)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,300	18.03.2027	143.400	208	0,07
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	4,310	15.03.2027	19.100	(24)	(0,01)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	4,320	15.03.2027	7.200	(9)	0,00
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	4,560	14.07.2032	111.300	(228)	(0,08)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,611	06.06.2028	118.100	267	0,09
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,640	18.05.2028	64.400	176	0,06
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,740	28.02.2033	91.700	460	0,16
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	4,740	28.02.2033	91.700	(239)	(0,08)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	5,040	17.04.2028	27.900	96	0,03
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	5,100	18.04.2028	11.800	42	0,01
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	5,110	22.03.2026	72.500	(129)	(0,05)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	5,125	22.03.2026	50.000	(90)	(0,03)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	5,480	15.03.2026	216.500	483	0,17
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	5,606	28.06.2027	54.800	217	0,08
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	15.12.2040	€ 300	129	0,05
Erhalt ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	20.03.2054	3.400	(387)	(0,14)
Erhalt ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR	2,760	03.01.2029	400	(6)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,880	19.12.2028	200	(4)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,890	22.12.2033	200	(7)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,910	29.12.2033	300	(11)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,920	13.12.2028	500	(11)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,970	15.12.2033	1.500	(62)	(0,02)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,990	08.12.2033	600	(26)	(0,01)
Zahlung ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.03.2034	12.800	421	0,15
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,148	20.11.2033	100	(6)	0,00
Erhalt ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,250	20.03.2029	1.500	(61)	(0,02)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,250	06.11.2033	500	(33)	(0,01)

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	6-Month	EUR-EURIBOR	3,255 %	22.11.2028	€ 200	\$ (8)	0,00
Erhalt	6-Month	EUR-EURIBOR	3,270	08.11.2028	600	(22)	(0,01)
Zahlung	6-Month	EUR-EURIBOR	3,300	03.10.2033	14.200	1.148	0,41
Zahlung	6-Month	EUR-EURIBOR	3,370	09.10.2028	1.200	55	0,02
Zahlung	6-Month	HUF-BBR	1,500	19.06.2024	HUF 1.427.600	(174)	(0,06)
Erhalt	6-Month	HUF-BBR	1,760	21.01.2030	380.000	270	0,10
Zahlung	6-Month	HUF-BBR	1,958	19.03.2026	398.600	(126)	(0,04)
Erhalt	6-Month	HUF-BBR	5,500	04.03.2027	2.382.600	47	0,02
Zahlung	6-Month	HUF-BBR	6,280	18.03.2027	2.363.300	208	0,07
Erhalt	6-Month	HUF-BBR	13,600	12.12.2024	1.418.700	(192)	(0,07)
Erhalt	6-Month	PLN-WIBOR	1,110	12.01.2031	9.800	544	0,19
Zahlung	6-Month	PLN-WIBOR	1,165	28.01.2031	4.400	(87)	(0,03)
Erhalt ⁽¹⁾	6-Month	PLN-WIBOR	1,215	29.07.2030	10.300	314	0,11
Zahlung	6-Month	PLN-WIBOR	1,855	28.01.2031	6.000	(251)	(0,09)
Zahlung	6-Month	PLN-WIBOR	1,933	17.01.2025	11.800	(198)	(0,07)
Erhalt	6-Month	PLN-WIBOR	2,635	28.10.2026	32.900	(352)	(0,12)
Erhalt	6-Month	PLN-WIBOR	3,035	09.12.2026	42.000	475	0,17
Erhalt	6-Month	PLN-WIBOR	4,075	07.03.2027	28.700	(22)	(0,01)
Erhalt	6-Month	PLN-WIBOR	4,710	25.05.2027	12.000	(62)	(0,02)
Erhalt	6-Month	PLN-WIBOR	4,735	09.10.2028	12.100	(40)	(0,01)
Erhalt	6-Month	PLN-WIBOR	4,740	25.10.2033	7.100	(38)	(0,01)
Zahlung	6-Month	PLN-WIBOR	4,830	18.03.2027	17.300	172	0,06
Zahlung	6-Month	PLN-WIBOR	4,895	17.03.2027	7.200	59	0,02
Zahlung	6-Month	PLN-WIBOR	4,920	17.03.2027	15.000	128	0,05
Erhalt	6-Month	PLN-WIBOR	6,300	25.04.2028	11.900	(218)	(0,08)
Zahlung	6-Month	PLN-WIBOR	6,670	28.06.2027	6.200	158	0,06
Erhalt	6-Month	PLN-WIBOR	6,725	27.06.2027	20.700	(540)	(0,19)
Zahlung	6-Month	PLN-WIBOR	6,843	28.06.2027	1.500	41	0,01
Erhalt	6-Month	PLN-WIBOR	7,310	30.06.2027	11.000	(347)	(0,12)
Zahlung	28-Day	MXN-TIIE	5,080	16.06.2025	16.400	(73)	(0,03)
Zahlung	28-Day	MXN-TIIE	5,700	12.09.2030	35.400	(301)	(0,11)
Erhalt	28-Day	MXN-TIIE	5,770	09.10.2030	150.700	1.261	0,45
Zahlung	28-Day	MXN-TIIE	5,850	19.08.2030	12.100	(96)	(0,03)
Zahlung	28-Day	MXN-TIIE	5,875	16.08.2030	16.800	(133)	(0,05)
Zahlung	28-Day	MXN-TIIE	5,880	16.08.2030	8.700	(69)	(0,02)
Zahlung	28-Day	MXN-TIIE	5,920	16.08.2030	9.100	(71)	(0,02)
Zahlung	28-Day	MXN-TIIE	6,240	10.07.2026	113.600	(426)	(0,15)
Zahlung	28-Day	MXN-TIIE	6,480	28.05.2040	16.700	(64)	(0,02)
Erhalt	28-Day	MXN-TIIE	6,495	17.07.2026	140.500	563	0,20
Erhalt	28-Day	MXN-TIIE	6,505	17.07.2026	102.100	408	0,14
Zahlung	28-Day	MXN-TIIE	6,580	01.01.2025	29.700	(78)	(0,03)
Zahlung	28-Day	MXN-TIIE	6,830	27.12.2029	19.900	(94)	(0,03)
Zahlung	28-Day	MXN-TIIE	7,570	19.11.2026	300	(1)	0,00
Zahlung	28-Day	MXN-TIIE	7,675	04.06.2029	65.100	(144)	(0,05)
Erhalt	28-Day	MXN-TIIE	8,465	16.08.2027	167.300	132	0,05
Zahlung	28-Day	MXN-TIIE	8,480	24.03.2027	121.900	(149)	(0,05)
Erhalt	28-Day	MXN-TIIE	8,560	18.05.2028	14.500	5	0,00
Erhalt	28-Day	MXN-TIIE	8,585	18.05.2028	14.700	4	0,00
Erhalt	28-Day	MXN-TIIE	8,600	18.05.2028	7.400	2	0,00
Erhalt	28-Day	MXN-TIIE	8,610	18.05.2028	7.600	2	0,00
Erhalt	28-Day	MXN-TIIE	8,645	18.05.2028	7.600	1	0,00
Erhalt	28-Day	MXN-TIIE	8,656	18.05.2028	17.300	2	0,00
Zahlung	28-Day	MXN-TIIE	8,700	05.11.2027	8.700	(2)	0,00
Erhalt	28-Day	MXN-TIIE	8,740	07.03.2028	192.900	(72)	(0,03)
Zahlung	28-Day	MXN-TIIE	8,743	05.11.2027	37.900	(6)	0,00
Zahlung	28-Day	MXN-TIIE	8,760	05.11.2027	25.400	(3)	0,00
Zahlung	28-Day	MXN-TIIE	8,773	05.11.2027	20.000	(2)	0,00
Zahlung	28-Day	MXN-TIIE	8,845	04.12.2028	214.700	(34)	(0,01)
Zahlung	28-Day	MXN-TIIE	9,045	04.11.2027	17.200	7	0,00
Zahlung	28-Day	MXN-TIIE	9,053	04.11.2027	18.900	8	0,00
Zahlung	28-Day	MXN-TIIE	9,117	04.11.2027	47.100	27	0,01
Zahlung	28-Day	MXN-TIIE	9,165	05.11.2026	25.600	(2)	0,00
						\$ 7.323	2,59
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						\$ 7.323	2,59

⁽¹⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

OPTIONSKAUF

DEVIENSOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
GLM	Call - OTC USD versus JPY	¥ 167,000	05.11.2024	1.708	\$ 87	\$ 30	0,01
JPM	Put - OTC EUR versus PLN	PLN 4,400	22.08.2024	585	147	341	0,12
					\$ 234	\$ 371	0,13

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (Forts.)

VERKAUFSOPTIONEN

DEVISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC USD versus BRL	BRL 4,923	26.06.2024	2.800	\$ (115)	\$ (107)	(0,04)
	Put - OTC USD versus BRL	4,923	26.06.2024	2.800	(116)	(99)	(0,04)
	Call - OTC USD versus MXN	MXN 17,449	26.06.2024	2.800	(97)	(94)	(0,03)
CBK	Put - OTC USD versus MXN	17,449	26.06.2024	2.800	(97)	(97)	(0,03)
	Call - OTC USD versus BRL	BRL 4,968	20.06.2024	8.800	(365)	(296)	(0,11)
	Put - OTC USD versus BRL	4,968	20.06.2024	8.800	(365)	(354)	(0,13)
DUB	Call - OTC USD versus MXN	MXN 17,450	01.07.2024	2.600	(91)	(90)	(0,03)
	Put - OTC USD versus MXN	17,450	01.07.2024	2.600	(91)	(90)	(0,03)
	Call - OTC USD versus TRY	TRY 40,385	28.10.2024	610	(61)	(41)	(0,01)
GLM	Put - OTC USD versus TRY	40,385	28.10.2024	610	(61)	(66)	(0,02)
	Call - OTC USD versus TRY	40,250	30.10.2024	616	(62)	(42)	(0,02)
	Put - OTC USD versus TRY	40,250	30.10.2024	616	(62)	(65)	(0,02)
GLM	Call - OTC USD versus TRY	39,800	31.10.2024	306	(30)	(22)	(0,01)
	Put - OTC USD versus TRY	39,800	31.10.2024	306	(30)	(30)	(0,01)
	Call - OTC USD versus TRY	40,930	07.11.2024	304	(29)	(20)	(0,01)
	Put - OTC USD versus TRY	40,930	07.11.2024	304	(29)	(35)	(0,01)
	Call - OTC USD versus TRY	41,150	07.11.2024	304	(29)	(20)	(0,01)
	Put - OTC USD versus TRY	41,150	07.11.2024	304	(29)	(36)	(0,01)
	Call - OTC USD versus TRY	41,160	11.11.2024	304	(29)	(21)	(0,01)
	Put - OTC USD versus TRY	41,160	11.11.2024	304	(29)	(36)	(0,01)
	Call - OTC USD versus MXN	MXN 19,500	07.03.2024	4.072	(46)	(6)	0,00
	Put - OTC USD versus MXN	17,449	26.06.2024	3.900	(135)	(132)	(0,05)
MYI	Put - OTC USD versus MXN	17,449	26.06.2024	3.900	(135)	(135)	(0,05)
					\$ (2.133)	\$ (1.934)	(0,69)

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	3,288 %	19.01.2024	200	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,738	19.01.2024	200	(1)	(1)	0,00
CBK	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,310	18.01.2024	500	(2)	(2)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,590	05.01.2024	100	0	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,700	18.01.2024	500	(2)	(2)	0,00
FAR	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,960	05.01.2024	100	0	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,489	08.01.2024	100	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,989	08.01.2024	100	(1)	0	0,00
GLM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,285	19.01.2024	100	0	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300	16.01.2024	1.000	(4)	(3)	(0,01)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,648	04.01.2024	200	(1)	(3)	(0,01)
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,735	19.01.2024	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	16.01.2024	1.000	(4)	(1)	0,00
GST	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,440	08.01.2024	800	(2)	(3)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,860	08.01.2024	800	(2)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,600	12.01.2024	100	(1)	(2)	0,00
JPM	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,050	12.01.2024	100	0	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,490	12.01.2024	300	(1)	(2)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,650	04.01.2024	200	(1)	(3)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,890	12.01.2024	300	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,030	04.01.2024	200	(1)	0	0,00
MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,330	15.01.2024	1.200	(5)	(3)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,740	15.01.2024	1.200	(5)	(2)	0,00
							\$ (36)	\$ (30)	(0,01)

(1) Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Egypt Government International Bond	1,000 %	20.12.2024	\$ 2.600	\$ (221)	\$ 44	\$ (177)	(0,06)
BRC	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	1.200	(84)	78	(6)	0,00
GST	Poland Government International Bond	1,000	20.06.2024	400	2	0	2	0,00
JPM	Banco do Brasil S.A.	1,000	20.12.2024	600	(13)	13	0	0,00
					\$ (316)	\$ 135	\$ (181)	(0,06)

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

CROSS-CURRENCY SWAPS

Kontrahent	Erhalt	Zahlung	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. 0,069 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	20.03.2029	INR 180.139	\$ 2.154	\$ 6	\$ 28	\$ 34	0,01
GLM	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month INR-LIBOR zzgl. 0,069 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	20.03.2029	709.400	8.482	26	109	135	0,05
JPM	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	99	99	0,04
SCX	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month INR-LIBOR zzgl. 0,069 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	20.03.2029	180.040	\$ 2.153	6	28	34	0,01
			20.03.2029	444.906	5.319	16	69	85	0,03
						\$ 54	\$ 333	\$ 387	0,14

ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
GST	Erhalt ⁽¹⁾	3-Month MYR-KLIBOR	3,500 %	20.03.2029	MYR 3.310	\$ 2	\$ 1	\$ 3	0,00
JPM	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,020	06.06.2024	CLP 770.000	0	(21)	(21)	(0,01)
						\$ 2	\$ (20)	\$ (18)	(0,01)

⁽¹⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	01.2024	\$ 840	AUD 1.268	\$ 26	\$ 0	\$ 26	0,01
	03.2024	CNH 2.561	\$ 355	0	(6)	(6)	0,00
BOA	01.2024	COP 13.509.292	3.532	49	0	49	0,02
	01.2024	DOP 34.076	595	11	0	11	0,00
	01.2024	£ 106	134	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	HUF 845.089	2.286	0	(150)	(150)	(0,05)
	01.2024	NZD 1.972	1.202	0	(47)	(47)	(0,02)
	01.2024	PEN 18.603	5.013	0	(8)	(8)	0,00
	01.2024	PLN 2.032	477	0	(40)	(40)	(0,01)
	01.2024	\$ 445	AUD 673	14	0	14	0,01
	01.2024	3.359	COP 13.509.292	124	0	124	0,04
	01.2024	20.164	HUF 7.181.003	530	0	530	0,19
	01.2024	2.356	¥ 347.638	112	0	112	0,04
	01.2024	161	NOK 1.707	8	0	8	0,00
	01.2024	618	PLN 2.582	38	0	38	0,01
	02.2024	CNY 16.572	\$ 2.291	0	(52)	(52)	(0,02)
	02.2024	\$ 1.801	CNY 12.726	0	(1)	(1)	0,00
	02.2024	131	KES 20.868	0	0	0	0,00
	02.2024	ZMW 8.652	\$ 377	41	0	41	0,01
	03.2024	CNH 3.604	498	0	(11)	(11)	0,00
	03.2024	DOP 2.637	46	1	0	1	0,00
	03.2024	\$ 3.481	COP 13.509.292	0	(47)	(47)	(0,02)
	03.2024	2.275	IDR 35.930.668	55	0	55	0,02
	03.2024	464	PEN 1.764	11	0	11	0,00
	03.2024	25	PHP 1.377	0	0	0	0,00
	04.2024	MYR 29.355	\$ 6.414	0	(31)	(31)	(0,01)
	04.2024	\$ 6.400	MYR 29.521	82	0	82	0,03
	06.2024	355	BRL 1.748	0	(1)	(1)	0,00
	06.2024	105	KES 17.655	1	0	1	0,00
	06.2024	503	MXN 8.777	0	0	0	0,00
BPS	01.2024	€ 2.605	\$ 2.847	0	(31)	(31)	(0,01)
	01.2024	£ 404	512	0	(3)	(3)	0,00
	01.2024	HUF 14.820	42	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	¥ 53.900	374	0	(9)	(9)	0,00
	01.2024	PEN 1.970	529	0	(3)	(3)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	01.2024	\$ 617	AUD 935	\$ 22	\$ 0	\$ 22	0,01
	01.2024	714	€ 652	7	(1)	6	0,00
	01.2024	10.012	¥ 1.412.100	11	0	11	0,00
	01.2024	3.215	PLN 13.498	217	0	217	0,08
	01.2024	ZAR 38.465	\$ 2.075	0	(26)	(26)	(0,01)
	02.2024	TWD 19.674	619	0	(31)	(31)	(0,01)
	02.2024	\$ 3.197	CNY 22.696	12	0	12	0,00
	03.2024	CNH 2.494	\$ 347	0	(6)	(6)	0,00
	03.2024	IDR 35.779.097	2.291	0	(29)	(29)	(0,01)
	03.2024	\$ 5.521	COP 22.160.797	112	0	112	0,04
	03.2024	3.420	IDR 54.446.468	111	0	111	0,04
	03.2024	290	TWD 9.114	12	0	12	0,00
BRC	01.2024	¥ 505.000	\$ 3.453	0	(135)	(135)	(0,05)
	01.2024	PLN 104.976	24.008	0	(2.681)	(2.681)	(0,95)
	01.2024	TRY 71.673	2.355	0	(38)	(38)	(0,01)
	01.2024	\$ 3.722	MYR 17.324	58	0	58	0,02
	01.2024	607	TRY 18.103	1	(1)	0	0,00
	02.2024	¥ 1.470.000	\$ 9.914	0	(598)	(598)	(0,21)
	02.2024	\$ 5.317	TRY 166.141	68	(3)	65	0,02
	03.2024	1	THB 43	0	0	0	0,00
	03.2024	2.541	TRY 79.778	12	(4)	8	0,00
	04.2024	35	1.131	0	(1)	(1)	0,00
CBK	01.2024	BRL 7.177	\$ 1.474	0	(3)	(3)	0,00
	01.2024	CLP 1.909.412	2.178	0	(8)	(8)	0,00
	01.2024	€ 24.171	26.379	0	(328)	(328)	(0,12)
	01.2024	£ 7.647	9.613	0	(135)	(135)	(0,05)
	01.2024	HUF 48.170	131	0	(8)	(8)	0,00
	01.2024	¥ 391.200	2.750	0	(27)	(27)	(0,01)
	01.2024	MXN 4.567	262	0	(6)	(6)	0,00
	01.2024	PLN 2.045	507	0	(13)	(13)	0,00
	01.2024	\$ 753	AUD 1.112	7	(1)	6	0,00
	01.2024	2.157	CLP 1.912.648	33	0	33	0,01
	01.2024	286	£ 226	2	0	2	0,00
	01.2024	8.627	HUF 2.977.029	0	(24)	(24)	(0,01)
	01.2024	2.799	¥ 395.200	6	0	6	0,00
	01.2024	27.649	MXN 490.330	1.176	0	1.176	0,42
	01.2024	39	NOK 413	2	0	2	0,00
	01.2024	1.079	PLN 4.497	65	0	65	0,02
	01.2024	225	ZMW 5.566	0	(9)	(9)	0,00
	02.2024	EGP 6.270	\$ 167	4	0	4	0,00
	02.2024	\$ 6.223	BRL 31.921	338	0	338	0,12
	02.2024	409	EGP 14.313	0	(39)	(39)	(0,01)
	03.2024	CLP 1.920.521	\$ 2.157	0	(33)	(33)	(0,01)
	03.2024	ILS 450	124	0	(2)	(2)	0,00
	03.2024	PEN 24.202	6.429	0	(92)	(92)	(0,03)
	03.2024	\$ 751	EGP 27.760	0	(118)	(118)	(0,04)
	03.2024	3.072	PEN 11.616	58	0	58	0,02
	03.2024	ZMW 14.042	\$ 569	28	0	28	0,01
	04.2024	\$ 1.474	BRL 7.249	6	0	6	0,00
	04.2024	441	EGP 16.704	0	(62)	(62)	(0,02)
	04.2024	404	KES 66.341	4	0	4	0,00
	06.2024	KRW 18.257	\$ 14	0	0	0	0,00
	06.2024	\$ 1.137	BRL 5.648	6	0	6	0,00
	06.2024	328	KES 55.179	5	0	5	0,00
	07.2024	464	MXN 8.097	0	0	0	0,00
DUB	01.2024	PLN 732	\$ 183	0	(3)	(3)	0,00
	01.2024	\$ 111	PLN 433	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	182	ZMW 4.528	0	(6)	(6)	0,00
	02.2024	EGP 15.155	\$ 437	26	0	26	0,01
	02.2024	\$ 2.218	EGP 77.705	0	(210)	(210)	(0,07)
	02.2024	388	ZMW 9.118	0	(34)	(34)	(0,01)
	03.2024	CNH 1.715	\$ 238	0	(4)	(4)	0,00
	03.2024	SGD 10.065	7.604	0	(54)	(54)	(0,02)
	04.2024	\$ 242	KES 39.485	1	0	1	0,00
	08.2024	€ 3.876	PLN 17.898	206	0	206	0,07
	10.2024	\$ 207	TRY 8.376	9	0	9	0,00
	11.2024	¥ 186.742	\$ 1.323	0	(61)	(61)	(0,02)
FAR	01.2024	BRL 1.448	297	0	(1)	(1)	0,00
	03.2024	IDR 71.409.818	4.539	0	(92)	(92)	(0,03)
	04.2024	\$ 297	BRL 1.463	2	0	2	0,00
GLM	01.2024	CHF 1.561	\$ 1.782	0	(74)	(74)	(0,03)
	01.2024	DOP 260.663	4.576	107	0	107	0,04
	01.2024	HUF 1.656.121	4.446	0	(326)	(326)	(0,12)
	01.2024	MXN 573.733	32.707	0	(1.021)	(1.021)	(0,36)
	01.2024	\$ 1.046	HUF 388.096	73	0	73	0,03
	01.2024	5.700	MXN 97.986	60	0	60	0,02
	01.2024	5.894	TRY 179.131	96	0	96	0,03
	02.2024	BRL 54	\$ 11	0	(1)	(1)	0,00
	02.2024	DOP 67.652	1.177	17	0	17	0,01
	03.2024	CNH 1.115	155	0	(3)	(3)	0,00
	03.2024	DOP 124.789	2.181	46	0	46	0,02
	03.2024	\$ 24	TRY 764	0	0	0	0,00
	04.2024	DOP 25.763	\$ 448	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
	10.2024	\$ 209	TRY 8.412	\$ 8	\$ 0	\$ 8	0,00
	11.2024	1.323	¥ 186.955	63	0	63	0,02
	11.2024	422	TRY 17.219	19	0	19	0,01
IND	06.2024	815	TWD 20.969	0	(113)	(113)	(0,04)
JPM	01.2024	BRL 26.892	\$ 5.513	0	(23)	(23)	(0,01)
	01.2024	MXN 1.192	69	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	PLN 10.484	2.396	0	(269)	(269)	(0,09)
	01.2024	\$ 296	BRL 1.443	1	0	1	0,00
	01.2024	50	EGP 1.641	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	3.646	PLN 14.403	16	0	16	0,01
	02.2024	EGP 47.299	\$ 1.248	28	0	28	0,01
	02.2024	\$ 5.308	BRL 26.033	43	0	43	0,02
	02.2024	7.191	INR 600.715	12	0	12	0,00
	02.2024	5.995	TRY 184.301	33	(1)	32	0,01
	03.2024	TWD 50.584	\$ 1.627	0	(49)	(49)	(0,02)
	03.2024	\$ 5.513	BRL 27.078	28	0	28	0,01
	04.2024	KES 133.703	\$ 870	47	0	47	0,02
	04.2024	\$ 446	KES 72.905	3	0	3	0,00
MBC	08.2024	PLN 17.851	€ 3.876	0	(194)	(194)	(0,07)
	01.2024	CAD 846	\$ 625	0	(17)	(17)	(0,01)
	01.2024	€ 16.086	17.686	0	(87)	(87)	(0,03)
	01.2024	HUF 3.160.975	8.616	0	(493)	(493)	(0,17)
	01.2024	¥ 2.020.000	14.132	0	(206)	(206)	(0,07)
	01.2024	\$ 394	AUD 595	12	0	12	0,00
	01.2024	64	EGP 2.100	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	318	€ 292	4	0	4	0,00
	01.2024	3	PLN 10	0	0	0	0,00
MYI	03.2024	PHP 235.809	\$ 4.214	0	(43)	(43)	(0,01)
	01.2024	EGP 18.824	507	0	(44)	(44)	(0,02)
	01.2024	€ 53	59	0	0	0	0,00
	01.2024	MYR 27.193	5.827	0	(107)	(107)	(0,04)
	01.2024	NGN 116.850	190	74	0	74	0,03
	01.2024	PLN 746	189	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	\$ 306	EGP 10.285	0	(10)	(10)	0,00
	01.2024	16	€ 14	0	0	0	0,00
	01.2024	896	¥ 132.056	42	0	42	0,01
	01.2024	2.212	PLN 9.188	124	0	124	0,04
	01.2024	680	ZAR 12.498	2	0	2	0,00
	02.2024	EGP 38.449	\$ 923	2	(76)	(74)	(0,03)
	02.2024	\$ 1.877	CNY 13.289	2	0	2	0,00
	02.2024	431	EGP 14.958	0	(26)	(26)	(0,01)
	03.2024	CNH 2.444	\$ 339	0	(6)	(6)	0,00
	03.2024	MXN 5.212	295	0	(9)	(9)	0,00
	03.2024	\$ 11.550	IDR 177.777.105	0	(22)	(22)	(0,01)
	06.2024	KRW 2.500	\$ 2	0	0	0	0,00
RBC	06.2024	\$ 697	MXN 12.162	0	0	0	0,00
	01.2024	5.530	BRL 26.892	6	0	6	0,00
	01.2024	270	MXN 4.630	2	0	2	0,00
SCX	04.2024	MXN 835	\$ 47	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	\$ 1.458	BRL 7.181	20	0	20	0,01
	01.2024	0	EGP 13	0	0	0	0,00
	01.2024	7.139	MYR 33.344	138	0	138	0,05
	01.2024	142	NGN 116.724	0	(26)	(26)	(0,01)
	01.2024	441	ZMW 10.814	0	(21)	(21)	(0,01)
	02.2024	MYR 1.517	\$ 332	0	0	0	0,00
	02.2024	\$ 114	KES 18.183	0	0	0	0,00
	02.2024	328	MYR 1.521	4	0	4	0,00
	03.2024	CNH 2.399	\$ 331	0	(7)	(7)	0,00
	03.2024	\$ 2.849	THB 98.480	55	0	55	0,02
	03.2024	220	TWD 6.940	10	0	10	0,00
SOG	06.2024	KES 68.980	\$ 449	33	0	33	0,01
	01.2024	\$ 147	EGP 4.785	0	(5)	(5)	0,00
	02.2024	5.003	RON 22.945	89	0	89	0,03
	03.2024	1.288	CZK 29.037	8	0	8	0,00
	03.2024	106	TWD 3.347	5	0	5	0,00
SSB	01.2024	CLP 5.057.673	\$ 5.721	0	(66)	(66)	(0,02)
	03.2024	\$ 4.547	IDR 71.097.847	63	0	63	0,02
	03.2024	3.722	PHP 207.275	20	0	20	0,01
TOR	01.2024	HUF 427.806	\$ 1.124	0	(109)	(109)	(0,04)
	01.2024	\$ 1.480	¥ 217.167	61	0	61	0,02
	03.2024	CNH 1.160	\$ 161	0	(3)	(3)	0,00
UAG	01.2024	€ 1.289	1.414	0	(10)	(10)	0,00
	01.2024	£ 2.193	2.776	0	(20)	(20)	(0,01)
	01.2024	HUF 960.337	2.558	0	(210)	(210)	(0,07)
	01.2024	¥ 3.144.000	21.326	0	(1.035)	(1.035)	(0,37)
	01.2024	\$ 6.927	HUF 2.571.155	482	0	482	0,17
	01.2024	890	NOK 9.498	45	0	45	0,02
	01.2024	ZAR 154.191	\$ 8.078	0	(343)	(343)	(0,12)
	03.2024	CZK 30.600	1.375	8	0	8	0,00
				\$ 5.750	\$ (10.450)	\$ (4.700)	(1,66)

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (Forts.)

ABGESICHERTE DEVISENTERMIKONTRÄKTE

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilklassen 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
BPS	01.2024	€ 1.173	\$ 1.288	\$ 0	\$ (9)	\$ (9)	0,00
	01.2024	INR 138.619	€ 1.661	0	(4)	(4)	0,00
	01.2024	\$ 2.854	€ 2.569	2	(18)	(16)	(0,01)
BRC	01.2024	509	THB 17.888	16	0	16	0,01
	02.2024	TRY 50.496	\$ 1.611	0	(24)	(24)	(0,01)
CBK	01.2024	€ 19	21	0	0	0	0,00
	01.2024	HUF 148.036	429	1	0	1	0,00
	01.2024	¥ 321.277	2.275	0	(5)	(5)	0,00
	01.2024	MXN 20.510	1.210	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	\$ 99	BRL 487	2	0	2	0,00
	01.2024	4.965	€ 4.595	112	0	112	0,04
	01.2024	390	£ 310	5	0	5	0,00
	01.2024	1	HUF 455	0	0	0	0,00
	01.2024	351	RON 1.604	5	0	5	0,00
	01.2024	12	ZAR 235	0	0	0	0,00
	02.2024	BRL 489	\$ 99	0	(2)	(2)	0,00
	02.2024	\$ 1.204	MXN 20.510	1	0	1	0,00
FAR	01.2024	BRL 0	\$ 0	0	0	0	0,00
	02.2024	\$ 0	BRL 0	0	0	0	0,00
GLM	01.2024	MYR 2.016	\$ 434	0	(5)	(5)	0,00
	01.2024	\$ 2.444	CNY 17.257	0	(6)	(6)	0,00
	01.2024	935	CZK 20.693	0	(9)	(9)	0,00
	01.2024	433	MYR 2.016	6	0	6	0,00
	01.2024	2.897	PLN 11.581	48	0	48	0,02
	02.2024	TRY 33.598	\$ 1.089	0	(18)	(18)	(0,01)
	02.2024	\$ 435	MYR 2.016	6	0	6	0,00
JPM	01.2024	BRL 487	\$ 100	0	0	0	0,00
	01.2024	TRY 774	26	0	0	0	0,00
MBC	01.2024	\$ 26.618	€ 24.211	134	0	134	0,05
	01.2024	1.192	MXN 20.510	19	0	19	0,01
	01.2024	5	TRY 161	0	0	0	0,00
MYI	01.2024	13.757	€ 12.516	72	0	72	0,02
	01.2024	43	PLN 171	0	0	0	0,00
SCX	01.2024	19	CNY 138	0	0	0	0,00
SOG	01.2024	IDR 5.170.544	\$ 333	0	(3)	(3)	0,00
UAG	01.2024	HUF 913.322	2.661	22	0	22	0,01
	01.2024	0	CZK 8	0	0	0	0,00
	01.2024	238	£ 188	2	0	2	0,00
	01.2024	140	PLN 560	2	0	2	0,00
	01.2024	797	ZAR 14.794	11	0	11	0,00
				\$ 466	\$ (104)	\$ 362	0,13

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilklasse 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	01.2024	\$ 19	£ 15	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BRC	01.2024	6	THB 223	0	0	0	0,00
CBK	01.2024	¥ 4.029	\$ 29	0	0	0	0,00
	01.2024	MXN 255	15	0	0	0	0,00
	01.2024	TRY 47	2	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 8	£ 7	0	0	0	0,00
	01.2024	0	HUF 9	0	0	0	0,00
	01.2024	0	ZAR 3	0	0	0	0,00
	02.2024	15	MXN 255	0	0	0	0,00
GLM	01.2024	MYR 25	\$ 5	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 31	CNY 220	0	0	0	0,00
	01.2024	12	CZK 262	0	0	0	0,00
	01.2024	5	MYR 25	0	0	0	0,00
	01.2024	38	PLN 152	1	0	1	0,00
	02.2024	TRY 478	\$ 15	0	0	0	0,00
	02.2024	\$ 5	MYR 25	0	0	0	0,00
JPM	01.2024	TRY 557	\$ 19	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 1	TRY 45	0	0	0	0,00
MBC	01.2024	15	MXN 255	0	0	0	0,00
MYI	01.2024	£ 11	\$ 14	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 37	€ 34	0	0	0	0,00
SCX	01.2024	52	£ 41	1	0	1	0,00
	01.2024	HUF 1.823	\$ 5	0	0	0	0,00
	01.2024	INR 1.743	21	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 0	CNY 2	0	0	0	0,00
	01.2024	135	£ 107	1	0	1	0,00
SOG	01.2024	IDR 50.560	\$ 3	0	0	0	0,00
SSB	01.2024	\$ 14	€ 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
UAG	01.2024	HUF 11.167	\$ 33	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2024	\$ 0	CZK 0	0	0	0	0,00
	01.2024	331	£ 262	2	0	2	0,00
	01.2024	2	PLN 7	0	0	0	0,00
	01.2024	10	ZAR 184	0	0	0	0,00
				\$ 5	\$ 0	\$ 5	0,00
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ (5.738)	(2,03)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
EINLAGENZERTIFIKATE			
Banco Davivienda S.A.			
10,942 % fällig am 28.04.2026	COP 100.000	\$ 26	0,01
11,679 % fällig am 12.05.2025	1.420.000	365	0,13
12,950 % fällig am 08.03.2026	1.800.246	483	0,17
13,183 % fällig am 06.06.2026	1.772.000	482	0,17
13,455 % fällig am 13.06.2025	1.172.000	312	0,11
13,456 % fällig am 07.06.2025	1.189.000	316	0,11
13,456 % fällig am 09.06.2025	397.000	106	0,04
13,501 % fällig am 13.12.2024	1.000.000	264	0,09
15,389 % fällig am 21.02.2024	289.500	76	0,03
Bancolombia S.A.			
5,917 % fällig am 27.01.2024	1.311.000	338	0,12
10,388 % fällig am 20.04.2026	2.361.700	609	0,22
13,320 % fällig am 08.06.2025	540.000	142	0,05
13,456 % fällig am 14.06.2025	2.146.000	570	0,20
13,637 % fällig am 14.12.2024	1.432.000	375	0,13
16,137 % fällig am 01.09.2024	561.000	148	0,05
BBVA Colombia S.A.			
13,093 % fällig am 28.04.2026	520.000	142	0,05
13,229 % fällig am 10.05.2026	224.000	61	0,02
13,365 % fällig am 04.05.2026	327.000	88	0,03
14,460 % fällig am 13.01.2024	543.100	140	0,05
Summe Einlagenzertifikate		\$ 5.043	1,78
Summe Anlagen		\$ 278.425	98,46
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ 4.365	1,54
Nettovermögen		\$ 282.790	100,00

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

- (a) Nullkuponwertpapier.
- (b) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (c) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (d) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (e) Mit dem Teilfonds verbunden.
- (f) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (g) Wertpapier mit einem aggregierten beizulegenden Zeitwert von USD 5.239 (31. Dezember 2022: USD null) war zum 31. Dezember 2023 Wertpapiere als Sicherheiten gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 7.361 (31. Dezember 2022: USD 4.974) waren zum 31. Dezember 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 5.780 (31. Dezember 2022: USD 5.521) wurden zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten für Finanzderivate gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 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	\$ 250.859	\$ 14.084	\$ 264.943
Investmentfonds	208	628	0	836
Pensionsgeschäfte	0	6.274	0	6.274
Finanzderivate ⁽³⁾	32	1.297	0	1.329
Einlagen bei Kreditinstituten	0	5.043	0	5.043
Summen	\$ 240	\$ 264.101	\$ 14.084	\$ 278.425

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (Forts.)

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 180.287	\$ 1.313	\$ 181.600
Investmentfonds	14.173	624	0	14.797
Pensionsgeschäfte	0	706	0	706
Finanzderivate ⁽³⁾	126	3.194	(7)	3.313
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	137	137
Summen	\$ 14.299	\$ 184.811	\$ 1.443	\$ 200.553

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

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

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BOS	5,540 %	29.12.2023	02.01.2024	\$ (5.269)	\$ (5.271)	(1,86)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (5.271)	(1,86)

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
AZD	\$ 20	\$ 0	\$ 20	\$ (17)	\$ 0	\$ (17)
BOA	323	(610)	(287)	(2.672)	2.460	(212)
BPS	158	0	158	(2.204)	1.480	(724)
BRC	(3.336)	3.320	(16)	(334)	510	176
CBK	115	(350)	(235)	(169)	10	(159)
CLY	k. A.	k. A.	k. A.	(239)	0	(239)
DUB	(238)	0	(238)	653	(650)	3
FAR	(92)	0	(92)	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	(974)	1.080	106	(338)	440	102
GST	2	0	2	203	(260)	(57)
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	(8)	0	(8)
IND	(113)	80	(33)	(94)	340	246
JPM	20	0	20	224	0	224
MBC	(678)	570	(108)	847	(804)	43
MYC	(5)	0	(5)	84	0	84
MYI	(255)	20	(235)	(104)	281	177
RBC	7	0	7	(4)	0	(4)
SCX	292	0	292	922	(790)	132
SOG	94	0	94	86	0	86
SSB	17	0	17	630	(630)	0
TOR	(51)	0	(51)	151	0	151
UAG	(1.044)	710	(334)	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. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	86,38	54,96
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	7,31	32,75
Sonstige übertragbare Wertpapiere	k. A.	0,83
Investmentfonds	0,30	7,21
Pensionsgeschäfte	2,22	0,34
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,09)	0,34
Zentral abgerechnete Finanzderivate	2,59	2,31
Freiverkehrsfinanzderivate	(2,03)	(1,04)
Einlagenzertifikate	1,78	0,07
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(1,86)	k. A.

* Gemäß der Liste der Märkte, die die Kriterien für einen geregelten OGAW-Markt erfüllen, in Anlage 1 zum Verkaufsprospekt.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Argentinien	k. A.	0,49
Angola	1,37	k. A.
Bahamas	k. A.	0,37
Weißrussland	k. A.	0,08
Brasilien	2,68	2,65
Kamerun	0,23	k. A.
Cayman-Inseln	1,15	0,70
Chile	3,95	k. A.
China	0,02	0,02
Kolumbien	0,52	k. A.
Kongo	0,17	0,27
Costa Rica	0,31	k. A.
Tschechische Republik	1,43	k. A.
Dänemark	0,00	2,08
Dominikanische Republik	3,91	1,52
Ecuador	1,38	k. A.
Ägypten	1,36	k. A.
Ghana	k. A.	0,48
Guatemala	0,33	k. A.
Hongkong	0,47	k. A.
Ungarn	0,83	k. A.
Indien	0,17	k. A.
Irland	2,15	3,14
Israel	2,57	2,82
Elfenbeinküste	0,26	0,45
Jamaika	0,23	k. A.
Jersey, Kanalinseln	k. A.	1,29
Kenia	0,41	k. A.
Luxemburg	0,43	1,19
Mexiko	6,82	4,32
Niederlande	0,42	2,16
Pakistan	0,47	k. A.
Panama	0,16	k. A.
Peru	3,24	3,18
Polen	8,42	1,16
Rumänien	1,80	k. A.
Russland	k. A.	0,05
Serbien	0,04	0,05
Südafrika	6,45	5,04
Südkorea	0,20	k. A.
Supranational	0,19	k. A.
Tansania	0,78	k. A.
Tunesien	0,93	0,09
Türkei	1,24	0,91
Ukraine	0,75	k. A.
Vereinigte Arabische Emirate	0,19	0,26
Großbritannien	0,61	1,36
USA	18,29	20,18
Usbekistan	0,47	0,62
Jungferninseln (Britisch)	k. A.	1,24
Sambia	0,18	k. A.
Kurzfristige Instrumente	15,71	30,37
Investmentfonds	0,30	7,21
Pensionsgeschäfte	2,22	0,34
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,09)	0,34
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	k. A.	0,08
Zinsswaps	2,59	2,23
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	0,13	0,29
Verkaufsoptionen		
Devisenoptionen	(0,69)	k. A.
Zinsswapoptionen	(0,01)	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzkauf	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	(0,06)	(0,42)
Cross-Currency Swaps	0,14	0,04
Zinsswaps	(0,01)	0,12
Volatilitätsswaps	k. A.	0,00
Devisenterminkontrakte	(1,66)	(1,81)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,13	0,75
Einlagenzertifikate	1,78	0,07
Sonstige Aktiva und Passiva	1,54	2,23
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE			
ASERBAIDSCHAN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
SOCAR Turkey Enerji AS Via Steas Funding DAC 7,230 % fällig am 17.03.2026	\$ 200	\$ 199	1,00
BRASILIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Banco do Brasil S.A. 8,500 % fällig am 29.07.2026	MXN 2.000	111	0,55
Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd. 0,000 % fällig am 29.01.2024 (c)(f)	\$ 23	1	0,01
Oi S.A. 0,000 % fällig am 25.02.2035	BRL 50	5	0,02
Vale S.A. 0,000 % (f)	1.490	109	0,55
Summe Brasilien		226	1,13
CAYMAN-INSELN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Interoceanica Finance Ltd. 0,000 % fällig am 30.11.2025 (c)	\$10	9	0,05
CHILE			
STAATSEMISSIONEN			
Bonos de la Tesorería de la República en Pesos 3,400 % fällig am 01.10.2039	CLP 36.789	4	0,24
5,000 % fällig am 01.10.2028	250.000	283	1,42
5,300 % fällig am 01.11.2037	5.000	6	0,03
5,800 % fällig am 01.10.2034	115.000	136	0,68
6,000 % fällig am 01.04.2033	125.000	150	0,75
Summe Chile		622	3,12
CHINA			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Flourish Century 6,600 % fällig am 04.02.2022 ^ (i)	\$ 200	18	0,09
STAATSEMISSIONEN			
China Government International Bond 2,750 % fällig am 17.02.2032	CNY 30	4	0,02
3,020 % fällig am 27.05.2031	600	88	0,44
		92	0,46
Summe China		110	0,55
KOLUMBIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Empresas Publicas de Medellin ESP 7,625 % fällig am 10.09.2024	COP540.000	134	0,67
STAATSEMISSIONEN			
Colombia Government International Bond 1,000 % fällig am 18.09.2030	323.700	76	0,38
1,000 % fällig am 26.03.2031	676.600	151	0,76
1,000 % fällig am 30.06.2032	153.000	33	0,17
Financiera de Desarrollo Territorial S.A. Findeter 7,875 % fällig am 12.08.2024	12.000	3	0,01
		263	1,32
Summe Kolumbien		397	1,99
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	1.900	81	0,41
Summe Tschechische Republik		96	0,48
DÄNEMARK			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Jyske Realkredit A/S 1,500 % fällig am 01.10.2053	DKK 0	0	0,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
BESCHREIBUNG			
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
1,000 % 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			
Dominican Republic Central Bank Notes 12,000 % fällig am 03.10.2025	DOP 3.800	67	0,34
13,000 % fällig am 30.01.2026	3.200	58	0,29
Dominican Republic Government International Bond 11,250 % fällig am 15.09.2035	8.000	149	0,75
13,625 % fällig am 03.02.2033	8.000	168	0,84
13,625 % fällig am 10.02.2034	200	4	0,02
Summe Dominikanische Republik		446	2,24
ECUADOR			
STAATSEMISSIONEN			
Ecuador Government International Bond 3,500 % fällig am 31.07.2035	\$ 39	14	0,07
6,000 % fällig am 31.07.2030	110	52	0,26
Summe Ecuador		66	0,33
UNGARN			
STAATSEMISSIONEN			
Hungary Government International Bond 4,750 % fällig am 24.11.2032	HUF 6.200	16	0,08
6,750 % fällig am 22.10.2028	4.200	13	0,07
Summe Ungarn		29	0,15
IRLAND			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
Black Diamond CLO DAC 4,853 % fällig am 20.01.2032	€ 60	6	0,33
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd. 4,752 % fällig am 15.11.2031	100	109	0,55
Harvest CLO DAC 4,566 % fällig am 26.06.2030	66	72	0,36
		248	1,24
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		259	1,30
ISRAEL			
STAATSEMISSIONEN			
Israel Government International Bond 5,000 % fällig am 30.10.2026	€ 200	226	1,13
JERSEY, KANALINSELN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Corsair International Ltd. 8,802 % fällig am 28.01.2027	100	110	0,55
LUXEMBURG			
AKTIEN			
DrillCo Holding Lux S.A. (b)	311	8	0,04
DrillCo Holding Lux S.A. (b)(i)	787	19	0,10
Summe Stammaktien		27	0,14

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
FORESEA Holding S.A. 7,500 % fällig am 15.06.2030	€ 14	\$ 13	0,06
Sberbank of Russia Via SB Capital S.A. 5,250 % fällig am 23.05.2023 ^ (h)	200	12	0,06
		25	0,12
Summe Luxemburg		52	0,26
MALAYSIA			
STAATSEMISSIONEN			
Malaysia Government International Bond 4,696 % fällig am 15.10.2042	MYR 147	35	0,18
4,762 % fällig am 07.04.2037	66	15	0,07
Malaysia Government Investment Issue 3,990 % fällig am 15.10.2025	182	40	0,20
Summe Malaysia		90	0,45
MEXIKO			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Urbi Desarrollos Urbanos S.A.B. de C.V. 8,790 % fällig am 09.12.2014 ^	MXN 5.000	0	0,00
STAATSEMISSIONEN			
Mexico Government International Bond 2,750 % fällig am 27.11.2031 (e)	1.089	57	0,28
3,000 % fällig am 03.12.2026 (e)	3.991	219	1,10
5,750 % fällig am 05.03.2026	2.000	109	0,55
7,500 % fällig am 03.06.2027	2.100	117	0,59
		502	2,52
Summe Mexiko		502	2,52
PERU			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Banco de Credito del Peru S.A. 4,650 % fällig am 17.09.2024	PEN 1.230	322	1,61
Credicorp Capital Sociedad Titulizadora S.A. 10,100 % fällig am 15.12.2043	700	191	0,96
		513	2,57
STAATSEMISSIONEN			
Fondo MIVIENDA S.A. 7,000 % fällig am 14.02.2024	130	35	0,18
Summe Peru		548	2,75
POLEN			
STAATSEMISSIONEN			
Poland Government International Bond 1,250 % fällig am 25.10.2030	PLN 50	10	0,05
1,750 % fällig am 25.04.2032	100	20	0,10
2,500 % fällig am 25.07.2027	770	181	0,91
6,000 % fällig am 25.10.2033	200	54	0,27
7,500 % fällig am 25.07.2028	600	168	0,84
Summe Polen		433	2,17
RUMÄNIEN			
STAATSEMISSIONEN			
Romania Government International Bond 4,250 % fällig am 28.04.2036	RON 100	18	0,09
6,375 % fällig am 18.09.2033	€ 100	117	0,59
Summe Rumänien		135	0,68
SUDAFRIKA			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Development Bank of Southern Africa 8,600 % fällig am 21.10.2024 (i)	ZAR 3.200	174	0,87
Eskom Holdings SOC Ltd. 7,850 % fällig am 02.04.2026	5.000	266	1,33
		440	2,20
STAATSEMISSIONEN			
South Africa Government International Bond 2,000 % fällig am 31.01.2025 (e)	2.683	144	0,72
8,000 % fällig am 31.01.2030	3.500	176	0,88

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (Forts.)

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Long	03.2024	1	\$ 5	0,03
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2024	2	0	0,00
				\$ 5	0,03
Summe der an einem gereglten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 5	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 – SCHUTZKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-41 5-Year Index	(1,000) %	20.12.2028	\$ 4.800	\$ (16)	(0,08)

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	5,000 %	20.03.2029	£ 600	\$ 12	0,06
Zahlung	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,600	20.12.2033	INR 5.930	1	0,01
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,621	20.12.2028	8.869	(2)	(0,01)
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,625	20.12.2025	23.134	(1)	(0,01)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,232	05.10.2025	¥ 150.000	(2)	(0,01)
Erhalt ⁽³⁾	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,350	21.03.2026	155.000	(3)	(0,01)
Erhalt	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	3,322	20.12.2028	SGD 84	(1)	0,00
Zahlung	1-Day THB-THORON Compounded-OIS	2,770	20.12.2028	THB 1.579	0	0,00
Zahlung ⁽²⁾	1-Day THB-THORON Compounded-OIS	3,000	20.03.2034	217	0	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,250	21.06.2028	\$ 1.450	42	0,21
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,250	20.12.2053	65	(8)	(0,04)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2033	90	(7)	(0,03)
Erhalt ⁽³⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,684	03.01.2034	100	(1)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,735	07.08.2033	100	2	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.12.2028	700	9	0,04
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.12.2028	200	(8)	(0,04)
Zahlung ⁽³⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2029	400	2	0,01
Erhalt ⁽³⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,810	02.01.2034	100	(3)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,830	12.10.2053	100	10	0,05
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,170	03.10.2033	100	6	0,03
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,830	02.01.2026	BRL 2.200	1	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	9,946	04.01.2027	400	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,164	02.01.2026	300	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,491	02.01.2025	800	1	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,529	02.01.2026	1.000	(2)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,691	02.01.2026	1.600	5	0,03
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,768	04.01.2027	500	(2)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,792	04.01.2027	3.900	17	0,08
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,872	04.01.2027	800	(4)	(0,02)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,280	02.01.2026	90	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,439	02.01.2029	700	3	0,02
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,773	02.01.2025	200	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,040	01.04.2024	4.600	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,260	01.04.2024	4.000	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)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,569	02.01.2029	200	(3)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,595	01.07.2024	1.200	1	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	13,080	01.07.2024	2.600	5	0,02
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,241	02.01.2025	200	(1)	(0,01)
Erhalt ⁽³⁾	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,250	20.03.2029	CNY 2.886	(1)	(0,01)
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,405	20.12.2028	918	0	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,040	13.01.2031	COP 1.002.000	50	0,25
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,200	18.09.2030	514.560	(10)	(0,05)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,500	15.02.2025	112.850	1	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,590	17.07.2033	475.000	2	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,680	17.07.2028	799.000	(1)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,705	26.03.2031	548.600	(2)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,800	30.06.2032	112.500	0	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,960	01.09.2028	540.900	(5)	(0,02)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,020	04.12.2030	235.500	(2)	(0,01)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,190	13.06.2029	494.700	4	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	8,820 %	05.06.2028	COP 185.700	\$ (1)	0,00
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	291.130	(5)	(0,03)
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	9,370	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	9,470	01.07.2025	285.000	0	0,00
Erhalt		3-Month ILS-TELBOR	3,792	06.11.2028	ILS 270	(1)	0,00
Erhalt ⁽³⁾		3-Month KRW-KORIBOR	3,500	20.03.2029	KRW 249.007	(2)	(0,01)
Zahlung		3-Month KRW-KORIBOR	3,580	20.12.2033	63.344	2	0,01
Erhalt		3-Month KRW-KORIBOR	3,700	20.12.2025	257.908	(1)	(0,01)
Zahlung		3-Month KRW-KORIBOR	3,820	20.12.2028	295.105	4	0,02
Erhalt		3-Month ZAR-JIBAR	6,067	21.12.2026	ZAR 3.100	6	0,03
Erhalt		3-Month ZAR-JIBAR	6,635	04.02.2027	3.290	(3)	(0,01)
Erhalt		3-Month ZAR-JIBAR	7,205	22.04.2027	1.200	1	0,01
Erhalt		3-Month ZAR-JIBAR	7,210	22.04.2027	900	1	0,00
Erhalt		3-Month ZAR-JIBAR	7,565	22.03.2026	2.900	1	0,00
Erhalt		3-Month ZAR-JIBAR	8,185	31.07.2026	3.500	(2)	(0,01)
Erhalt		3-Month ZAR-JIBAR	8,195	21.12.2026	5.500	0	0,00
Erhalt		3-Month ZAR-JIBAR	8,210	21.12.2026	9.000	(1)	0,00
Erhalt		3-Month ZAR-JIBAR	8,410	13.07.2025	2.200	(1)	0,00
Erhalt		3-Month ZAR-JIBAR	8,410	10.11.2028	900	(1)	0,00
Erhalt		3-Month ZAR-JIBAR	8,440	02.11.2028	300	0	0,00
Zahlung		3-Month ZAR-JIBAR	8,500	17.10.2027	8.760	10	0,05
Erhalt		3-Month ZAR-JIBAR	8,650	31.01.2030	200	0	0,00
Erhalt		3-Month ZAR-JIBAR	8,695	31.01.2030	1.100	(1)	(0,01)
Erhalt		3-Month ZAR-JIBAR	8,700	31.01.2030	1.000	(1)	(0,01)
Erhalt		3-Month ZAR-JIBAR	8,735	31.01.2030	400	(1)	0,00
Erhalt		3-Month ZAR-JIBAR	8,820	31.01.2030	860	(1)	(0,01)
Zahlung		3-Month ZAR-JIBAR	9,290	26.05.2028	3.100	6	0,03
Zahlung		3-Month ZAR-JIBAR	9,435	13.07.2033	600	1	0,00
Zahlung		3-Month ZAR-JIBAR	9,455	31.01.2030	1.800	6	0,03
Zahlung		6-Month AUD-BBR-BBSW	4,390	30.12.2028	AUD 260	4	0,02
Zahlung		6-Month AUD-BBR-BBSW	4,750	20.12.2028	840	21	0,10
Erhalt		6-Month CLP-CHILIBOR	3,215	14.01.2030	CLP 86.260	9	0,05
Erhalt ⁽³⁾		6-Month CLP-CHILIBOR	4,640	01.10.2028	245.000	1	0,00
Zahlung		6-Month CLP-CHILIBOR	4,995	17.07.2033	15.400	0	0,00
Erhalt		6-Month CLP-CHILIBOR	5,240	01.09.2030	37.210	(1)	0,00
Erhalt		6-Month CLP-CHILIBOR	5,250	20.03.2028	95.100	(2)	(0,01)
Erhalt		6-Month CLP-CHILIBOR	5,350	01.09.2030	37.500	(1)	(0,01)
Erhalt		6-Month CLP-CHILIBOR	5,400	01.04.2033	22.100	(1)	0,00
Zahlung		6-Month CLP-CHILIBOR	5,400	16.11.2033	17.400	1	0,00
Erhalt		6-Month CLP-CHILIBOR	5,470	01.09.2030	50.000	(2)	(0,01)
Erhalt		6-Month CLP-CHILIBOR	5,500	13.11.2028	15.100	0	0,00
Zahlung		6-Month CLP-CHILIBOR	5,550	05.06.2028	81.300	5	0,02
Erhalt		6-Month CLP-CHILIBOR	5,631	23.08.2028	56.700	(2)	(0,01)
Erhalt		6-Month CLP-CHILIBOR	5,690	01.09.2030	2.400	0	0,00
Erhalt		6-Month CLP-CHILIBOR	5,780	03.10.2028	19.400	(1)	0,00
Erhalt		6-Month CLP-CHILIBOR	5,790	06.10.2033	18.000	(1)	(0,01)
Erhalt		6-Month CLP-CHILIBOR	5,855	05.10.2033	46.000	(4)	(0,02)
Erhalt		6-Month CLP-CHILIBOR	5,870	11.10.2033	18.200	(2)	(0,01)
Erhalt		6-Month CLP-CHILIBOR	5,920	02.10.2028	36.000	(2)	(0,01)
Erhalt		6-Month CLP-CHILIBOR	5,940	20.10.2033	8.000	(1)	0,00
Erhalt		6-Month CLP-CHILIBOR	5,990	20.10.2033	76.260	(7)	(0,04)
Erhalt		6-Month CLP-CHILIBOR	6,115	17.07.2025	66.200	0	0,00
Erhalt		6-Month CLP-CHILIBOR	6,146	30.10.2032	125.400	(13)	(0,07)
Erhalt		6-Month CLP-CHILIBOR	6,235	26.10.2033	37.300	(4)	(0,02)
Zahlung		6-Month CLP-CHILIBOR	6,370	29.06.2029	39.000	4	0,02
Zahlung		6-Month CLP-CHILIBOR	6,380	03.06.2027	116.000	8	0,04
Erhalt		6-Month CZK-PRIBOR	4,611	06.06.2028	CZK 4.390	(11)	(0,06)
Erhalt ⁽³⁾		6-Month EUR-EURIBOR	2,750	20.03.2054	€ 100	(11)	(0,06)
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	2,880	19.12.2028	400	(8)	(0,04)
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	3,100	20.09.2030	290	13	0,06
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	3,179	29.11.2028	100	(3)	(0,02)
Zahlung ⁽³⁾		6-Month EUR-EURIBOR	3,250	20.03.2029	600	9	0,05
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	3,329	27.10.2033	100	7	0,04
Zahlung		6-Month HUF-BBR	7,330	06.11.2028	HUF 33.500	4	0,02
Zahlung		6-Month HUF-BBR	7,610	03.11.2028	24.000	5	0,02
Erhalt		6-Month HUF-BBR	7,840	07.02.2033	6.600	(3)	(0,01)
Erhalt		6-Month HUF-BBR	8,740	28.04.2028	15.800	(5)	(0,03)
Erhalt		6-Month HUF-BBR	13,600	12.12.2024	5.100	(1)	0,00
Erhalt		6-Month PLN-WIBOR	0,980	09.06.2030	PLN 300	14	0,07
Erhalt		6-Month PLN-WIBOR	2,950	13.12.2026	1.500	18	0,09
Erhalt		6-Month PLN-WIBOR	4,075	07.03.2027	800	0	0,00
Erhalt		6-Month PLN-WIBOR	4,320	09.03.2027	150	0	0,00
Erhalt		6-Month PLN-WIBOR	4,560	06.11.2028	340	(1)	0,00
Erhalt		6-Month PLN-WIBOR	4,735	09.10.2028	300	(1)	(0,01)
Erhalt		6-Month PLN-WIBOR	4,910	25.07.2027	340	(1)	0,00
Erhalt		6-Month PLN-WIBOR	5,220	20.03.2033	200	(4)	(0,02)

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	5,310 %	21.03.2033	PLN 70	\$ (2)	(0,01)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	5,340	28.03.2027	100	(1)	(0,01)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	5,380	20.09.2025	500	1	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,430	16.03.2028	570	6	0,03
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,520	20.03.2026	500	5	0,03
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,620	21.03.2026	300	3	0,02
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,830	19.08.2024	3.000	(5)	(0,02)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,714	12.12.2028	MXN 2.000	(1)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,728	22.05.2028	2.350	1	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,295	30.10.2028	50	0	0,00
					\$ 149	0,75
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ 133	0,67

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

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

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

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

OPTIONSKAUF

DEIVENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
GLM	Call - OTC USD versus JPY	¥ 167,000	05.11.2024	72	\$ 4	\$ 1	0,01
JPM	Put - OTC EUR versus PLN	PLN 4,400	22.08.2024	28	7	16	0,08
MYI	Put - OTC GBP versus USD	\$ 1,160	12.06.2024	760	3	2	0,01
					\$ 14	\$ 19	0,10

VERKAUFSOPTIONEN

DEIVENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC USD versus BRL	BRL 4,923	26.06.2024	100	\$ (4)	\$ (4)	(0,02)
	Put - OTC USD versus BRL	4,923	26.06.2024	100	(4)	(4)	(0,02)
	Call - OTC USD versus MXN	MXN 17,449	26.06.2024	100	(3)	(3)	(0,02)
	Put - OTC USD versus MXN	17,449	26.06.2024	100	(3)	(3)	(0,02)
CBK	Call - OTC USD versus BRL	BRL 4,968	20.06.2024	400	(17)	(13)	(0,07)
	Put - OTC USD versus BRL	4,968	20.06.2024	400	(17)	(16)	(0,08)
DUB	Call - OTC USD versus TRY	TRY 40,385	28.10.2024	26	(3)	(2)	(0,01)
	Put - OTC USD versus TRY	40,385	28.10.2024	26	(3)	(3)	(0,01)
GLM	Call - OTC USD versus TRY	40,250	30.10.2024	26	(3)	(2)	(0,01)
	Put - OTC USD versus TRY	40,250	30.10.2024	26	(3)	(3)	(0,01)
	Call - OTC USD versus TRY	39,800	31.10.2024	13	(1)	(1)	(0,01)
	Put - OTC USD versus TRY	39,800	31.10.2024	13	(1)	(1)	(0,01)
	Call - OTC USD versus TRY	40,930	07.11.2024	13	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC USD versus TRY	40,930	07.11.2024	13	(1)	(1)	(0,01)
	Call - OTC USD versus TRY	41,150	07.11.2024	13	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC USD versus TRY	41,150	07.11.2024	13	(1)	(2)	(0,01)
	Call - OTC USD versus TRY	41,160	11.11.2024	13	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC USD versus TRY	41,160	11.11.2024	13	(1)	(2)	(0,01)
JPM	Put - OTC USD versus TWD	TWD 31,000	04.03.2024	52	(2)	(2)	(0,01)
	Call - OTC USD versus IDR	IDR 14.950,000	06.06.2024	58	(2)	(2)	(0,01)
	Put - OTC USD versus IDR	14.950,000	06.06.2024	58	(2)	0	0,00
	Put - OTC USD versus TWD	TWD 31,000	01.03.2024	141	(2)	(4)	(0,02)
	Call - OTC USD versus IDR	IDR 15.370,000	13.08.2024	114	(4)	(3)	(0,02)
MYI	Put - OTC USD versus IDR	15.370,000	13.08.2024	114	(4)	(2)	(0,01)
	Call - OTC USD versus MXN	MXN 19,500	07.03.2024	211	(2)	0	0,00
SOG	Call - OTC USD versus MXN	17,449	26.06.2024	200	(7)	(7)	(0,03)
	Put - OTC USD versus MXN	17,449	26.06.2024	200	(7)	(7)	(0,03)
	Put - OTC EUR versus PLN	PLN 4,220	15.03.2024	366	(2)	(1)	0,00
	Call - OTC EUR versus PLN	4,430	15.03.2024	366	(2)	(3)	(0,02)
					\$ (103)	\$ (94)	(0,47)

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
CBK	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,310 %	18.01.2024	200	\$ (1)	\$ (1)	(0,01)
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,700	18.01.2024	200	(1)	0	0,00
							\$ (2)	\$ (1)	(0,01)

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
GST	Poland Government International Bond	1,000 %	20.06.2024	\$ 100	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
JPM	Banco do Brasil S.A.	1,000	20.12.2024	100	(2)	2	0	0,00
					\$ (2)	\$ 2	\$ 0	0,00

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

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

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	Variable Zinssatz entspricht 6-Month USD-LIBOR zzgl. 0,333 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variable Zinssatz entspricht 6-Month ARS-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	30.05.2024	\$ 170	ARS 7.557	\$ (1)	\$ 165	\$ 164	0,81
	Variable Zinssatz entspricht 6-Month USD-LIBOR zzgl. 0,282 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variable Zinssatz entspricht 6-Month ARS-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	07.06.2027	60	2.693	0	60	60	0,30
	Variable Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS zzgl. 0,051 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variable Zinssatz entspricht 3-Month PHP-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	20.03.2029	56	PHP 3.131	0	0	0	0,00
	Variable Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS zzgl. 0,053 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variable Zinssatz entspricht 3-Month PHP-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	20.03.2029	161	8.940	0	(1)	(1)	0,00
JPM	Variable Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS zzgl. 0,054 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variable Zinssatz entspricht 3-Month PHP-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	20.03.2029	4	220	0	0	0	0,00
						\$ (1)	\$ 224	\$ 223	1,11

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 ⁽¹⁾	3-Month MYR-KLIBOR	3,500 %	20.03.2029	MYR 2.005	\$ 3	\$ (1)	\$ 2	0,01
	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	3,868	20.12.2028	231	1	0	1	0,00
GLM	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,265	14.06.2029	CLP 11.100	0	(1)	(1)	0,00
GST	Erhalt ⁽¹⁾	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	20.03.2029	MYR 60	0	0	0	0,00
						\$ 4	\$ (2)	\$ 2	0,01

⁽¹⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (Forts.)

DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
AZD	03.2024	\$ 25	CNH 183	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00	
BOA	01.2024	CLP 22.646	\$ 26	0	0	0	0,00	
	01.2024	COP 1.628.481	\$ 405	0	(15)	(15)	(0,07)	
	01.2024	DOP 687	12	0	0	0	0,00	
	01.2024	HUF 188.034	511	0	(31)	(31)	(0,16)	
	01.2024	¥ 97.704	662	0	(32)	(32)	(0,16)	
	01.2024	KZT 11.254	24	0	(1)	(1)	0,00	
	01.2024	NZD 93	57	0	(2)	(2)	(0,01)	
	01.2024	PEN 652	176	0	0	0	0,00	
	01.2024	PLN 23	5	0	0	0	0,00	
	01.2024	\$ 444	COP 1.698.225	0	(6)	(6)	(0,03)	
	01.2024	631	HUF 221.010	6	0	6	0,03	
	01.2024	390	MXN 6.774	8	0	8	0,04	
	01.2024	51	PLN 213	3	0	3	0,02	
	01.2024	29	TRY 871	0	0	0	0,00	
	02.2024	DOP 867	\$ 15	0	0	0	0,00	
	02.2024	EGP 174	5	1	0	1	0,00	
	02.2024	KZT 1.725	4	0	0	0	0,00	
	02.2024	\$ 428	CNY 3.023	0	0	0	0,00	
	02.2024	5	KES 797	0	0	0	0,00	
	02.2024	173	TRY 5.448	5	0	5	0,02	
	02.2024	16	ZMW 376	0	(1)	(1)	(0,01)	
	02.2024	ZMW 436	\$ 19	2	0	2	0,01	
	03.2024	CNH 339	47	0	(1)	(1)	(0,01)	
	03.2024	COP 1.698.225	438	6	0	6	0,03	
	03.2024	DOP 696	12	0	0	0	0,00	
	03.2024	EGP 273	8	1	0	1	0,01	
	03.2024	IDR 314.642	20	0	0	0	0,00	
	03.2024	INR 292	3	0	0	0	0,00	
	03.2024	MYR 917	194	0	(7)	(7)	(0,04)	
	03.2024	\$ 194	CNH 1.410	5	0	5	0,03	
	04.2024	MYR 3.023	\$ 661	0	(3)	(3)	(0,02)	
	06.2024	\$ 13	BRL 64	0	0	0	0,00	
	06.2024	5	KES 804	0	0	0	0,00	
	06.2024	44	KRW 57.478	1	0	1	0,00	
	06.2024	18	MXN 314	0	0	0	0,00	
	BPS	01.2024	BRL 425	\$ 87	0	0	0	0,00
		01.2024	EGP 625	18	0	(1)	(1)	0,00
01.2024		€ 22	24	0	0	0	0,00	
01.2024		HUF 156.603	447	0	(6)	(6)	(0,03)	
01.2024		ILS 6.236	1.753	21	0	21	0,10	
01.2024		¥ 70.369	483	0	(18)	(18)	(0,08)	
01.2024		PEN 51	14	0	0	0	0,00	
01.2024		PLN 105	24	0	(2)	(2)	(0,01)	
01.2024		\$ 16	€ 14	0	0	0	0,00	
01.2024		27	HUF 9.654	1	0	1	0,00	
01.2024		676	ILS 2.582	42	0	42	0,21	
01.2024		400	¥ 56.400	0	0	0	0,00	
01.2024		23	NZD 38	1	0	1	0,00	
01.2024		155	PLN 649	11	0	11	0,05	
01.2024		ZAR 7.639	\$ 418	5	(4)	1	0,00	
02.2024		EGP 419	11	0	0	0	0,00	
02.2024		KZT 3.101	7	0	0	0	0,00	
02.2024		\$ 760	CNY 5.392	3	0	3	0,01	
02.2024		7	EGP 253	0	(1)	(1)	(0,01)	
02.2024		153	TWD 4.861	8	0	8	0,04	
03.2024		CNH 154	\$ 21	0	(1)	(1)	0,00	
03.2024		IDR 2.174.125	138	0	(3)	(3)	(0,01)	
03.2024		INR 1.013	12	0	0	0	0,00	
03.2024		THB 817	23	0	(1)	(1)	(0,01)	
03.2024		TWD 2.866	93	0	(2)	(2)	(0,01)	
03.2024		\$ 457	CNH 3.317	12	0	12	0,06	
03.2024		20	IDR 304.759	0	0	0	0,00	
03.2024		36	ILS 130	0	0	0	0,00	
03.2024		21	THB 746	1	0	1	0,01	
03.2024		480	TWD 15.088	21	0	21	0,10	
06.2024		360	KRW 470.237	6	0	6	0,03	
12.2024		29	EGP 1.398	0	(1)	(1)	(0,01)	
BRC		01.2024	PLN 172	\$ 41	0	(2)	(2)	(0,01)
		01.2024	\$ 20	AUD 30	1	0	1	0,00
		01.2024	28	HUF 9.618	0	0	0	0,00
		01.2024	36	MXN 623	0	0	0	0,00
		01.2024	435	PLN 1.902	50	0	50	0,24
	01.2024	629	TRY 19.128	9	0	9	0,05	
	02.2024	97	3.045	1	0	1	0,01	
	03.2024	RSD 6.017	\$ 56	0	(1)	(1)	0,00	
	03.2024	\$ 24	CZK 532	0	0	0	0,00	
	03.2024	33	SGD 44	0	0	0	0,00	
	03.2024	0	THB 14	0	0	0	0,00	
	03.2024	174	TRY 5.462	0	(1)	(1)	(0,01)	
	04.2024	28	892	0	0	0	0,00	
	06.2024	371	KRW 484.693	6	0	6	0,03	

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BSH	02.2024	CLP 245.701	\$ 277	\$ 0	\$ (4)	\$ (4)	(0,02)
	02.2024	¥ 40.000	285	0	(1)	(1)	0,00
CBK	01.2024	BRL 5.225	1.073	0	(3)	(3)	(0,01)
	01.2024	CLP 134.636	155	0	0	0	0,00
	01.2024	COP 1.430.518	358	0	(11)	(11)	(0,05)
	01.2024	€ 13	14	0	0	0	0,00
	01.2024	HUF 993	3	0	0	0	0,00
	01.2024	¥ 15.900	112	0	(1)	(1)	(0,01)
	01.2024	MXN 2.974	169	0	(5)	(5)	(0,03)
	01.2024	PLN 373	89	0	(6)	(6)	(0,03)
	01.2024	\$ 21	AUD 31	0	0	0	0,00
	01.2024	52	BRL 255	0	0	0	0,00
	01.2024	46	CAD 61	1	0	1	0,00
	01.2024	178	CLP 157.548	3	0	3	0,01
	01.2024	173	COP 678.998	3	0	3	0,01
	01.2024	22	EGP 736	0	0	0	0,00
	01.2024	114	¥ 16.100	0	0	0	0,00
	01.2024	1.742	MXN 30.937	78	0	78	0,38
	01.2024	8	NOK 87	0	0	0	0,00
	01.2024	201	PLN 864	20	0	20	0,09
	01.2024	10	ZMW 238	0	0	0	0,00
	01.2024	ZAR 7.254	\$ 385	0	(11)	(11)	(0,06)
	02.2024	BRL 255	52	0	0	0	0,00
	02.2024	EGP 840	22	0	0	0	0,00
	02.2024	\$ 31	EGP 1.071	0	(3)	(3)	(0,01)
	02.2024	57	UYU 2.264	1	0	1	0,00
	03.2024	CLP 158.197	\$ 178	0	(3)	(3)	(0,01)
	03.2024	IDR 340.201	22	0	0	0	0,00
	03.2024	¥ 10.000	71	0	0	0	0,00
	03.2024	PEN 850	226	0	(3)	(3)	(0,01)
	03.2024	\$ 78	IDR 1.207.916	0	0	0	0,00
	03.2024	211	ILS 767	3	0	3	0,01
	03.2024	84	PEN 312	0	0	0	0,00
	03.2024	ZMW 159	\$ 6	0	0	0	0,00
	04.2024	\$ 1.073	BRL 5.278	4	0	4	0,02
	04.2024	22	KES 3.597	0	0	0	0,00
	06.2024	£ 29	\$ 36	0	(1)	(1)	0,00
	06.2024	\$ 52	BRL 258	0	0	0	0,00
06.2024	15	KES 2.595	0	0	0	0,00	
07.2024	18	MXN 314	0	0	0	0,00	
10.2024	32	COP 139.584	2	0	2	0,01	
12.2024	14	EGP 659	0	(1)	(1)	0,00	
01.2025	32	COP 141.056	2	0	2	0,01	
04.2025	32	143.520	2	0	2	0,01	
10.2025	16	77.952	2	0	2	0,01	
DUB	01.2024	HUF 9.583	\$ 26	0	(2)	(2)	(0,01)
	01.2024	NGN 3.075	5	2	0	2	0,01
	01.2024	\$ 3	PLN 11	0	0	0	0,00
	01.2024	14	ZAR 285	1	0	1	0,01
	01.2024	7	ZMW 175	0	0	0	0,00
	02.2024	128	EGP 4.496	0	(13)	(13)	(0,06)
	03.2024	1.490	SGD 1.972	10	0	10	0,05
	04.2024	10	KES 1.553	0	0	0	0,00
	06.2024	403	KRW 523.996	5	0	5	0,03
	08.2024	€ 185	PLN 854	10	0	10	0,05
	10.2024	\$ 9	TRY 357	0	0	0	0,00
	11.2024	¥ 7.872	\$ 56	0	(3)	(3)	(0,01)
	02.2024	CNY 374	52	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	CHF 70	79	0	(3)	(3)	(0,02)
01.2024	COP 279.906	66	0	(6)	(6)	(0,03)	
01.2024	DOP 7.841	136	2	0	2	0,01	
01.2024	EGP 1.105	29	0	(4)	(4)	(0,02)	
01.2024	HUF 38.361	103	0	(7)	(7)	(0,04)	
01.2024	MXN 20.284	1.158	0	(35)	(35)	(0,17)	
01.2024	\$ 978	BRL 4.970	47	0	47	0,23	
01.2024	73	COP 279.906	0	(1)	(1)	0,00	
01.2024	37	MXN 652	1	0	1	0,00	
01.2024	230	TRY 6.975	3	0	3	0,02	
02.2024	DOP 881	\$ 15	0	0	0	0,00	
02.2024	EGP 2.266	65	7	0	7	0,04	
02.2024	KZT 2.905	6	0	0	0	0,00	
02.2024	\$ 26	KZT 12.071	0	0	0	0,00	
02.2024	22	TRY 670	0	0	0	0,00	
02.2024	UYU 1.537	\$ 39	0	0	0	0,00	
03.2024	DOP 10.832	189	4	0	4	0,02	
03.2024	PHP 105	2	0	0	0	0,00	
03.2024	\$ 21	IDR 325.060	0	0	0	0,00	
03.2024	14	TRY 433	0	0	0	0,00	
03.2024	55	TWD 1.700	2	0	2	0,01	
04.2024	DOP 863	\$ 15	0	0	0	0,00	
08.2024	\$ 26	COP 112.372	2	0	2	0,01	
10.2024	9	TRY 362	0	0	0	0,00	

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	11.2024	\$ 56	¥ 7.881	\$ 3	\$ 0	\$ 3	0,01
	11.2024	19	TRY 757	1	0	1	0,00
	04.2025	66	COP 301.521	6	0	6	0,03
IND	03.2024	CNY 141	\$ 20	0	0	0	0,00
	06.2024	\$ 82	TWD 2.110	0	(11)	(11)	(0,06)
JPM	01.2024	BRL 221	\$ 46	0	0	0	0,00
	01.2024	EGP 626	18	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	HUF 118.387	338	0	(5)	(5)	(0,02)
	01.2024	PLN 256	59	0	(6)	(6)	(0,03)
	01.2024	\$ 46	BRL 222	0	0	0	0,00
	01.2024	32	EGP 1.065	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	153	MXN 2.627	2	0	2	0,01
	01.2024	134	PLN 559	8	0	8	0,04
	01.2024	103	TRY 3.056	0	0	0	0,00
	01.2024	ZMW 826	\$ 36	4	0	4	0,02
	02.2024	EGP 455	12	0	0	0	0,00
	02.2024	KZT 1.305	3	0	0	0	0,00
	02.2024	\$ 138	BRL 678	1	0	1	0,01
	02.2024	4	EGP 127	0	(1)	(1)	0,00
	02.2024	1.781	INR 148.774	3	0	3	0,01
	02.2024	8	TRY 237	0	0	0	0,00
	03.2024	CLP 37.874	\$ 42	0	(1)	(1)	(0,01)
	03.2024	CNH 1.645	227	0	(5)	(5)	(0,03)
	03.2024	INR 304	4	0	0	0	0,00
	03.2024	\$ 47	IDR 729.279	0	0	0	0,00
	03.2024	546	TWD 16.961	17	0	17	0,08
	04.2024	KES 7.223	\$ 47	3	0	3	0,01
	04.2024	\$ 46	BRL 223	0	0	0	0,00
	04.2024	24	KES 3.924	0	0	0	0,00
	06.2024	8	IDR 120.000	0	0	0	0,00
	06.2024	361	KRW 468.071	3	0	3	0,02
"	08.2024	PLN 852	€ 185	0	(9)	(9)	(0,05)
	08.2024	\$ 56	COP 242.186	4	0	4	0,02
	09.2024	€ 36	PLN 171	3	0	3	0,02
	09.2024	PLN 79	€ 17	0	(1)	(1)	0,00
MBC	12.2024	\$ 18	EGP 872	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	CAD 127	\$ 94	0	(3)	(3)	(0,01)
	01.2024	€ 1.272	1.395	0	(10)	(10)	(0,05)
	01.2024	HUF 110.940	302	0	(18)	(18)	(0,09)
	01.2024	¥ 66.700	467	0	(7)	(7)	(0,03)
	01.2024	\$ 24	AUD 36	1	0	1	0,00
	01.2024	25	CAD 34	1	0	1	0,00
	01.2024	41	EGP 1.358	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	14	€ 13	0	0	0	0,00
	02.2024	¥ 10.000	\$ 70	0	(1)	(1)	0,00
	02.2024	\$ 15	EGP 556	0	(2)	(2)	(0,01)
	03.2024	CNH 2.110	\$ 291	0	(7)	(7)	(0,04)
	03.2024	\$ 321	PHP 17.974	3	0	3	0,02
MYI	03.2024	75	TRY 2.354	0	0	0	0,00
	01.2024	EGP 654	\$ 18	0	(2)	(2)	(0,01)
	01.2024	HUF 15.932	45	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	¥ 37.114	252	0	(13)	(13)	(0,06)
	01.2024	MYR 341	73	0	(1)	(1)	(0,01)
	01.2024	NGN 3.075	5	2	0	2	0,01
	01.2024	PLN 52	13	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 31	EGP 1.035	0	(1)	(1)	(0,01)
	01.2024	24	KZT 11.205	0	0	0	0,00
	01.2024	21	MYR 98	0	0	0	0,00
	01.2024	23	PLN 92	1	0	1	0,00
	01.2024	27	ZAR 488	0	0	0	0,00
	02.2024	EGP 259	\$ 7	0	0	0	0,00
	02.2024	KZT 4.277	9	0	0	0	0,00
	02.2024	\$ 446	CNY 3.157	0	0	0	0,00
	02.2024	11	EGP 404	0	(2)	(2)	(0,01)
	02.2024	11	KZT 5.093	0	0	0	0,00
	03.2024	MXN 270	\$ 15	0	0	0	0,00
	03.2024	THB 761	22	0	0	0	0,00
	03.2024	\$ 24	CNH 175	0	0	0	0,00
	03.2024	4	EGP 137	0	(1)	(1)	0,00
	03.2024	718	IDR 11.051.398	0	(1)	(1)	(0,01)
	06.2024	£ 29	\$ 36	0	(1)	(1)	0,00
	06.2024	\$ 73	£ 58	1	0	1	0,01
	06.2024	232	KRW 301.328	3	0	3	0,01
	06.2024	36	MXN 628	0	0	0	0,00
	08.2024	21	IDR 322.770	0	0	0	0,00
RBC	04.2024	42	MXN 751	1	0	1	0,01
	06.2024	KRW 25.775	\$ 20	0	0	0	0,00
RYL	03.2024	IDR 296.298	19	0	0	0	0,00
	03.2024	\$ 24	IDR 369.990	0	0	0	0,00
SCX	01.2024	€ 4	\$ 5	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 59	BRL 291	1	0	1	0,00
	01.2024	23	CHF 20	1	0	1	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (Forts.)

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(c) Nullkuponwertpapier.

(d) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(e) 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: 0,99 %):

Emittentenbeschreibung	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Development Bank of Southern Africa 8,600 % fällig am 21.10.2024	07.10.2021	\$ 215	\$ 174	0,87
DrillCo Holding Lux S.A.	08.06.2023	16	19	0,10
Flourish Century 6,600 % fällig am 04.02.2022	25.08.2021	197	18	0,09
		\$ 428	\$ 211	1,06

Barmittel in Höhe von USD 305 (31. Dezember 2022: USD 282) wurden zum 31. Dezember 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 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	\$ 17.495	\$ 268	\$ 17.763
Investmentfonds	311	1.526	0	1.837
Pensionsgeschäfte	0	158	0	158
Finanzderivate ⁽³⁾	5	415	0	420
Einlagen bei Kreditinstituten	0	363	0	363
Summen	\$ 316	\$ 19.957	\$ 268	\$ 20.541

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

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

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

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC-Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ (72)	\$ 0	\$ (72)	\$ 95	\$ 0	\$ 95
BPS	92	0	92	(152)	0	(152)
BRC	63	0	63	21	0	21
BSH	(5)	0	(5)	k. A.	k. A.	k. A.
CBK	43	0	43	98	0	98
CLY	k. A.	k. A.	k. A.	(4)	0	(4)
DUB	5	0	5	13	0	13
FAR	(1)	0	(1)	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	228	(270)	(42)	404	(270)	134
IND	(11)	0	(11)	(9)	0	(9)

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
JPM	\$ 27	\$ 0	\$ 27	\$ 49	\$ 0	\$ 49
MBC	(44)	0	(44)	(34)	0	(34)
MYC	k. A.	k. A.	k. A.	(14)	0	(14)
MYI	(33)	0	(33)	25	0	25
RBC	1	0	1	1	0	1
SCX	54	0	54	124	0	124
SOG	1	0	1	38	0	38
SSB	3	0	3	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	(2)	0	(2)	(213)	0	(213)
UAG	(67)	0	(67)	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. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	77,08	27,93
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	10,53	44,26
Sonstige übertragbare Wertpapiere	1,44	0,70
Investmentfonds	9,21	9,83
Pensionsgeschäfte	0,79	13,22
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,03	0,09
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,67	1,99
OTC-Finanzderivate	1,41	2,67
Einlagenzertifikate	1,82	0,37

* Gemäß der Liste der Märkte, die die Kriterien für einen geregelten OGAW-Markt erfüllen, in Anlage 1 zum Verkaufsprospekt.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Argentinien	k. A.	0,22
Aserbaidschan	1,00	0,93
Brasilien	1,13	2,81
Cayman-Inseln	0,05	0,21
Chile	3,12	0,03
China	0,55	0,11
Kolumbien	1,99	1,99
Tschechische Republik	0,48	0,85
Dänemark	0,00	1,89
Dominikanische Republik	2,24	0,31
Ecuador	0,33	k. A.
Ungarn	0,15	0,93
Indonesien	k. A.	0,00
Irland	1,30	1,52
Israel	1,13	2,07
Jersey, Kanalinseln	0,55	0,51
Luxemburg	0,26	0,13
Malaysia	0,45	k. A.
Mauritius	k. A.	0,87
Mexiko	2,52	1,62
Niederlande	k. A.	0,05
Peru	2,75	1,60
Polen	2,17	0,37
Katar	k. A.	0,45
Rumänien	0,68	k. A.
Südafrika	7,68	3,99
Südkorea	1,01	k. A.
Thailand	0,01	k. A.
Großbritannien	0,64	1,48
USA	4,54	5,71
Uruguay	0,11	k. A.
Sambia	0,19	0,13
Kurzfristige Instrumente	52,02	42,11
Investmentfonds	9,21	9,83
Pensionsgeschäfte	0,79	13,22
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,03	0,09
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,08)	k. A.
Zinsswaps	0,75	1,99
OTC-Finanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	0,10	0,13

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Verkaufsoptionen		
Devisenoptionen	(0,47)	0,00
Zinsswapoptionen	(0,01)	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Cross-Currency Swaps	1,11	1,01
Zinsswaps	0,01	0,00
Volatilitätsswaps	k. A.	0,00
Devisenterminkontrakte	0,67	1,53
Einlagenzertifikate	1,82	0,37
Sonstige Aktiva und Passiva	(2,98)	(1,06)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS		
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				KBC Group NV					
Wm Morrison Supermarkets Ltd.	8,752	€ 800	\$ 842	0,31	CPI Property Group S.A.	€ 300	\$ 189	0,07	5,796	\$ 1.250	\$ 1.272	0,47	
8,752 % fällig am 04.11.2027					1,750 % fällig am 14.01.2030				8,000	€ 200	235	0,09	
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				BANKEN UND FINANZEN				(c)(d)					
BANKEN UND FINANZEN				BANKEN UND FINANZEN				Kilroy Realty LP					
ABN AMRO Bank NV	2,470	\$ 400	352	0,13	Crown Castle, Inc.	\$ 550	493	0,18	2,500	\$ 640	485	0,18	
2,470 % fällig am 13.12.2029					3,100 % fällig am 15.11.2029				2,650	200	152	0,06	
Acef Holding S.C.A.	0,750	€ 100	95	0,03	CTP NV	€ 400	367	0,14	Kookmin Bank				
0,750 % fällig am 14.06.2028					1,500 % fällig am 27.09.2031				2,500 % fällig am 04.11.2030 (d)				
1,250 % fällig am 26.04.2030					Deutsche Bank AG	400	345	0,13	2,500 % fällig am 15.11.2033				
AIB Group PLC	2,875	400	424	0,16	3,035 % fällig am 28.05.2032 (e)	\$ 350	293	0,11	Lendlease Finance Ltd.				
2,875 % fällig am 30.05.2031					3,742 % fällig am 07.01.2033	500	411	0,15	3,400 % fällig am 27.10.2027				
5,250 % fällig am 23.10.2031					6,720 % fällig am 18.01.2029	500	524	0,19	AUD 1.100				
6,608 % fällig am 13.09.2029					7,079 % fällig am 10.02.2034	500	514	0,19	€ 500				
Ally Financial, Inc.	2,200	600	511	0,19	Digital Dutch Finco BV	€ 600	628	0,23	Logicor Financing SARL				
2,200 % fällig am 02.11.2028					0,625 % fällig am 15.07.2025	€ 500	441	0,16	2,000 % fällig am 17.01.2034				
8,000 % fällig am 01.11.2031					1,000 % fällig am 15.01.2032	500	441	0,16	€ 500				
American Express Co.	4,050	500	495	0,18	EQT AB	600	529	0,20	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.				
4,050 % fällig am 03.05.2029					0,875 % fällig am 14.05.2031	600	529	0,20	2,494 % fällig am 13.10.2032				
American Tower Corp.	3,100	200	137	0,05	2,375 % fällig am 06.04.2028	700	732	0,27	5,475 % fällig am 22.02.2031				
3,100 % fällig am 15.06.2050					Equinix, Inc.	\$ 50	42	0,02	Mizuho Financial Group, Inc.				
3,800 % fällig am 15.08.2029					2,500 % fällig am 15.05.2031	260	242	0,09	2,201 % fällig am 10.07.2031				
Asian Development Bank	6,550	ZAR 42.000	2.242	0,83	3,900 % fällig am 15.04.2032	700	614	0,23	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG				
6,550 % fällig am 26.01.2025					Equitable Financial Life Global Funding	1,800 % fällig am 08.03.2028	700	614	0,23	in Muenchen			
Banco BTG Pactual S.A.	2,750	\$ 600	567	0,21	First American Financial Corp.	2,400 % fällig am 15.08.2031	600	475	0,18	5,875 % fällig am 23.05.2042			
2,750 % fällig am 11.01.2026					Ford Motor Credit Co. LLC	4,687 % fällig am 09.06.2025	200	197	0,07	400			
Banco de Sabadell S.A.	0,875	€ 100	100	0,04	5,584 % fällig am 18.03.2024	200	200	0,07	Nationstar Mortgage Holdings, Inc.				
0,875 % fällig am 16.06.2028					FS KKR Capital Corp.	3,125 % fällig am 12.10.2028	450	393	0,14	5,750 % fällig am 15.11.2031			
Banco Mercantil del Norte S.A.	6,625	\$ 200	170	0,06	Globalworth Real Estate Investments Ltd.	2,950 % fällig am 29.07.2026	€ 400	365	0,13	300			
6,625 % fällig am 24.01.2032 (c)(d)					Goldman Sachs Group, Inc.	2,383 % fällig am 21.07.2032	\$ 800	658	0,24	€ 200			
Bank Mandiri Persero Tbk PT	2,000	200	186	0,07	Goodman U.S. Finance Five LLC	4,625 % fällig am 04.05.2032	700	652	0,24	300			
2,000 % fällig am 19.04.2026					Goodman U.S. Finance Three LLC	3,700 % fällig am 15.03.2028	500	466	0,17	€ 200			
Bank of America Corp.	2,687	1.100	929	0,34	GPT Wholesale Office Fund	3,222 % fällig am 05.11.2031	AUD 400	217	0,08	€ 200			
2,687 % fällig am 22.04.2032					Grainger PLC	3,000 % fällig am 03.07.2030	€ 100	109	0,04	€ 200			
6,204 % fällig am 10.11.2028					Hanwha Life Insurance Co. Ltd.	3,379 % fällig am 04.02.2032	\$ 300	277	0,10	€ 200			
Bank of Ireland Group PLC	4,875	€ 500	578	0,21	HAT Holdings LLC	3,375 % fällig am 15.06.2026	610	574	0,21	€ 200			
4,875 % fällig am 16.07.2028					3,750 % fällig am 15.09.2030	230	194	0,07	€ 200				
7,594 % fällig am 06.12.2032					8,000 % fällig am 15.06.2027	300	313	0,12	€ 250				
Banque Oueest Africaine de Developpement	2,750	€ 470	400	0,15	Host Hotels & Resorts LP	2,900 % fällig am 15.12.2031	100	84	0,03	€ 250			
2,750 % fällig am 22.01.2033					3,375 % fällig am 15.12.2029	800	719	0,26	€ 200				
Barclays PLC	4,836	\$ 400	391	0,14	3,500 % fällig am 15.09.2030	240	214	0,08	€ 900				
4,836 % fällig am 09.05.2028					Howard Hughes Corp.	4,375 % fällig am 01.02.2031	700	608	0,22	€ 840			
5,501 % fällig am 09.08.2028					HSBC Holdings PLC	3,973 % fällig am 22.05.2030	200	187	0,07	€ 200			
BNP Paribas S.A.	1,675	400	367	0,14	4,583 % fällig am 19.06.2029	500	485	0,18	€ 200				
1,675 % fällig am 30.06.2027					6,254 % fällig am 09.03.2034	600	638	0,24	€ 187				
4,625 % fällig am 25.02.2031 (c)(d)					Hudson Pacific Properties LP	3,950 % fällig am 01.11.2027	250	210	0,08	€ 187			
7,750 % fällig am 16.08.2029 (c)(d)					5,950 % fällig am 15.02.2028	150	133	0,05	€ 200				
Boston Properties LP	2,550	400	319	0,12	ING Groep NV	4,125 % fällig am 24.08.2033	€ 300	333	0,12	€ 200			
2,550 % fällig am 01.04.2032					4,250 % fällig am 16.05.2031 (c)(d)	\$ 200	146	0,05	€ 200				
BPCE S.A.	2,045	300	272	0,10	4,875 % fällig am 16.05.2029 (c)(d)	700	581	0,21	€ 200				
2,045 % fällig am 19.10.2027					Intesa Sanpaolo SpA	4,198 % fällig am 01.06.2032	200	165	0,06	€ 200			
Brookfield Finance UK PLC	2,340	550	440	0,16	5,017 % fällig am 26.06.2024	200	198	0,07	€ 200				
2,340 % fällig am 30.01.2032					6,625 % fällig am 31.05.2033	€ 600	809	0,30	€ 200				
CaixaBank S.A.	3,625	€ 200	171	0,06	6,625 % fällig am 20.06.2033	\$ 1.000	1.026	0,38	€ 200				
3,625 % fällig am 14.09.2028 (c)(d)					JAB Holdings BV	5,000 % fällig am 12.06.2033	€ 200	239	0,09	€ 200			
3,750 % fällig am 07.09.2029					Jones Lang LaSalle, Inc.	6,875 % fällig am 01.12.2028	\$ 1.300	1.378	0,51	€ 500			
6,208 % fällig am 18.01.2029									€ 500				
Castellum Helsinki Finance Holding Abp	0,875	€ 300	256	0,09					€ 547				
0,875 % fällig am 17.09.2029									€ 0,20				
CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund	0,900	500	460	0,17									
0,900 % fällig am 12.10.2029													
Citigroup, Inc.	2,976	\$ 200	178	0,07									
2,976 % fällig am 05.11.2030													
6,075 % fällig am 25.01.2026 (e)													
Citycon Treasury BV	1,625	€ 300	266	0,10									
1,625 % fällig am 12.03.2028													
CNP Assurances SACA	1,250	400	391	0,14									
1,250 % fällig am 27.01.2029													
Coöperatieve Rabobank UA	1,004	\$ 900	836	0,31									
1,004 % fällig am 24.09.2026													
Corporate Office Properties LP	2,000	100	83	0,03									
2,000 % fällig am 15.01.2029													

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO ESG Income Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ZF Finance GmbH	€ 400	\$ 410	0,15	Pinnacle Bidco PLC	€ 250	\$ 288	0,11	TDC Net A/S	€ 300	\$ 345	0,13
2,000 % fällig am 06.05.2027				8,250 % fällig am 11.10.2028				5,056 % fällig am 31.05.2028	2.700	3.083	1,14
2,250 % fällig am 03.05.2028	100	102	0,04	RELX Capital, Inc.	\$ 800	807	0,30	5,618 % fällig am 06.02.2030			
		56.035	20,66	4,750 % fällig am 20.05.2032				TerraForm Power Operating LLC	\$ 230	224	0,08
				ReNew Power Pvt Ltd.	200	191	0,07	5,000 % fällig am 31.01.2028			
INDUSTRIEWERTE				5,875 % fällig am 05.03.2027				Verizon Communications, Inc.	300	222	0,08
Accor S.A.	900	950	0,35	S&P Global, Inc.	700	648	0,24	2,850 % fällig am 03.09.2041	1.500	1.531	0,56
2,375 % fällig am 29.11.2028				S&P Global, Inc.				5,050 % fällig am 09.05.2033			
Amgen, Inc.	\$ 900	931	0,34	Schaeffler AG	€ 200	215	0,08	Vodafone Group PLC	113	86	0,03
5,600 % fällig am 02.03.2043				3,375 % fällig am 12.10.2028				5,125 % fällig am 04.06.2081			
Arcadis NV	€ 200	229	0,08	SK Hynix, Inc.	\$ 600	620	0,23				
4,875 % fällig am 28.02.2028				6,375 % fällig am 17.01.2028				Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		14.030	5,17
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC	€ 200	229	0,08	Standard Industries, Inc.	€ 600	629	0,23				
3,000 % fällig am 01.09.2029	600	536	0,20	2,250 % fällig am 21.11.2026							
Ball Corp.	\$ 580	501	0,18	Tesco Corporate Treasury Services PLC	300	282	0,10				
3,125 % fällig am 15.09.2031				0,375 % fällig am 27.07.2029				US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
BCP Modular Services Finance PLC	€ 100	103	0,04	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV	400	502	0,19	Fannie Mae	2.977	2.705	1,00
4,750 % fällig am 30.11.2028				7,875 % fällig am 15.09.2031				3,500 % fällig am 01.08.2059	129	122	0,04
Boise Cascade Co.	\$ 380	357	0,13	Transurban Finance Co. Pty. Ltd.	\$ 500	416	0,15	4,000 % fällig am 01.11.2059			
4,875 % fällig am 01.07.2030				2,450 % fällig am 16.03.2031				Ginnie Mae	4.552	4.587	1,69
CDW LLC	500	444	0,16	Travis Perkins PLC	€ 400	481	0,18	5,500 % fällig am 20.07.2053			
3,569 % fällig am 01.12.2031				3,750 % fällig am 17.02.2026				Ginnie Mae, TBA	2.500	2.483	0,92
Cellnex Finance Co. S.A.	200	155	0,06	VeriSign, Inc.	\$ 650	557	0,21	5,000 % fällig am 01.01.2054			
3,875 % fällig am 07.07.2041				2,700 % fällig am 15.06.2031				Uniform Mortgage-Backed Security	486	430	0,16
Centene Corp.	600	520	0,19	Vilmorin & Cie S.A.	€ 300	281	0,10	3,000 % fällig am 01.07.2052	20.543	19.428	7,16
3,000 % fällig am 15.10.2030				1,375 % fällig am 26.03.2028				4,000 % fällig am 01.05.2053	7.799	7.564	2,79
Fair Isaac Corp.	610	578	0,21	Vmed O2 UK Financing PLC	€ 200	221	0,08	4,500 % fällig am 01.07.2052 - 01.09.2053	23.829	23.580	8,69
4,000 % fällig am 15.06.2028				4,500 % fällig am 15.07.2031	€ 600	536	0,20	5,000 % fällig am 01.08.2053	28.682	28.853	10,64
Flex Ltd.	300	310	0,11	4,750 % fällig am 15.07.2031				Uniform Mortgage-Backed Security, TBA	500	409	0,15
6,000 % fällig am 15.01.2028				Wabtec Transportation Netherlands BV	€ 400	408	0,15	2,000 % fällig am 01.02.2054	800	735	0,27
Ford Motor Co.	80	67	0,02	1,250 % fällig am 03.12.2027				3,500 % fällig am 01.02.2054	1.400	1.406	0,52
3,250 % fällig am 12.02.2032				Weir Group PLC	\$ 400	372	0,14	5,500 % fällig am 01.02.2054	7.400	7.514	2,77
Gap, Inc.	200	171	0,06	2,200 % fällig am 13.05.2026				6,000 % fällig am 01.02.2054	5.500	5.636	2,08
3,625 % fällig am 01.10.2029	300	247	0,09	Zenith Finco PLC	€ 200	208	0,08	6,500 % fällig am 01.02.2054			
3,875 % fällig am 01.10.2031				6,500 % fällig am 30.06.2027							
GN Store Nord A/S	€ 400	424	0,16	ZF North America Capital, Inc.	\$ 150	156	0,06				
0,875 % fällig am 25.11.2024				6,875 % fällig am 14.04.2028							
Graphic Packaging International LLC	400	410	0,15			23.076	8,51				
2,625 % fällig am 01.02.2029				VERSORGUNGSUNTERNEHMEN				US-SCHATZOBIGLATIONEN			
HCA, Inc.	\$ 500	494	0,18	AES Corp.	300	252	0,09	U.S. Treasury Inflation Protected Securities (b)	1.788	1.757	0,65
4,500 % fällig am 15.02.2027				2,450 % fällig am 15.01.2031	700	712	0,26	0,125 % fällig am 15.07.2024	2.027	1.983	0,73
Hilton Domestic Operating Co., Inc.	380	332	0,12	5,450 % fällig am 01.06.2028				0,125 % fällig am 15.10.2024	1.423	1.266	0,47
3,625 % fällig am 15.02.2032	200	183	0,07	CenterPoint Energy Houston Electric LLC	800	838	0,31	0,125 % fällig am 15.07.2031	6.882	6.048	2,23
4,000 % fällig am 01.05.2031				5,300 % fällig am 01.04.2053				0,250 % fällig am 15.01.2025	2.598	2.522	0,93
InterContinental Hotels Group PLC	€ 500	595	0,22	Clean Renewable Power Mauritius Pte. Ltd.	180	165	0,06	0,500 % fällig am 15.04.2024	49	48	0,02
3,375 % fällig am 08.10.2028				4,250 % fällig am 25.03.2027				0,625 % fällig am 15.01.2024	1.094	1.091	0,40
JCDecaux SE	€ 300	290	0,11	Enel Finance America LLC	800	854	0,32	0,750 % fällig am 15.02.2045	209	164	0,06
1,625 % fällig am 07.02.2030				7,100 % fällig am 14.10.2027				1,000 % fällig am 15.02.2046	532	436	0,16
JDE Peet's NV	\$ 600	481	0,18	Enel Finance International NV	300	273	0,10	1,375 % fällig am 15.02.2044	832	744	0,27
2,250 % fällig am 24.09.2031	€ 800	910	0,34	2,250 % fällig am 12.07.2031	400	325	0,12	1,500 % fällig am 15.02.2053	621	564	0,21
4,125 % fällig am 23.01.2030				Iberdrola International BV	250	267	0,10	U.S. Treasury Notes	2.100	1.950	0,72
John Lewis PLC	€ 200	254	0,09	6,750 % fällig am 15.09.2033				2,375 % fällig am 31.03.2029	2.400	2.396	0,88
6,125 % fällig am 21.01.2025				India Green Energy Holdings	250	248	0,09	3,875 % fällig am 30.09.2029			
Lenovo Group Ltd.	\$ 400	354	0,13	5,375 % fällig am 29.04.2024							
3,421 % fällig am 02.11.2030				India Green Power Holdings	250	230	0,09				
Liberty Utilities Finance GP	300	244	0,09	4,000 % fällig am 22.02.2027							
2,050 % fällig am 15.09.2030				National Grid PLC	€ 400	386	0,14				
Lindblad Expeditions LLC	300	299	0,11	0,250 % fällig am 01.09.2028							
6,750 % fällig am 15.02.2027				NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	\$ 400	355	0,13				
Marks & Spencer PLC	€ 350	431	0,16	1,900 % fällig am 15.06.2028	400	254	0,09				
4,500 % fällig am 10.07.2027				2,200 % fällig am 02.12.2026	AUD 400						
Metalsa S.A. de C.V.	\$ 150	124	0,05	Pacific Gas & Electric Co.	\$ 1.300	1.414	0,52				
3,750 % fällig am 04.05.2031				6,700 % fällig am 01.04.2053							
MSCI, Inc.	400	362	0,13	PacifiCorp	700	674	0,25				
3,625 % fällig am 01.09.2030				5,350 % fällig am 01.12.2053							
Nemak S.A.B. de C.V.	€ 400	393	0,15	Pattern Energy Operations LP	500	473	0,17				
2,250 % fällig am 20.07.2028				4,500 % fällig am 15.08.2028							
Newell Brands, Inc.	\$ 200	197	0,07	Southern California Edison Co.	400	343	0,13				
4,875 % fällig am 01.06.2025				2,500 % fällig am 01.06.2031	200	151	0,06				
NextEra Energy Operating Partners LP	1.000	1.048	0,39	3,650 % fällig am 01.06.2051							
7,250 % fällig am 15.01.2029				Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd.	324	325	0,12				
NXP BV	250	213	0,08	6,750 % fällig am 24.04.2033							
2,500 % fällig am 11.05.2031	1.000	1.002	0,37								
5,000 % fällig am 15.01.2033											
Pearson Funding PLC	€ 100	119	0,04								
3,750 % fällig am 04.06.2030											

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust				FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				Mosaic Solar Loans LLC			
5,610 % fällig am 19.03.2037	\$ 1.268	\$ 1.058	0,39	Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				4,450 % fällig am 20.06.2042	\$ 445	\$ 419	0,15
EMF-UK PLC				6,520 % fällig am 25.05.2035	\$ 1.275	\$ 1.110	0,41	Soundview Home Loan Trust			
6,319 % fällig am 13.03.2046	£ 2.825	3.566	1,31	Argent Securities Trust				5,970 % fällig am 25.10.2036	548	514	0,19
Great Hall Mortgages PLC				5,770 % fällig am 25.06.2036	1.984	566	0,21	Structured Asset Investment Loan Trust			
5,599 % fällig am 18.06.2038	2.040	2.527	0,93	Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				6,445 % fällig am 25.05.2035	1.405	1.235	0,46
Independence Plaza Trust				5,970 % fällig am 25.08.2036	1.287	1.164	0,43	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust			
3,763 % fällig am 10.07.2035	\$ 345	330	0,12	6,595 % fällig am 25.02.2035	57	57	0,02	5,760 % fällig am 25.07.2036	1.323	1.280	0,47
3,911 % fällig am 10.07.2035	1.940	1.831	0,68	BNC Mortgage Loan Trust				Structured Asset Securities Corp. Trust			
4,158 % fällig am 10.07.2035	132	124	0,05	4,291 % fällig am 25.10.2036	102	72	0,03	7,099 % fällig am 25.05.2031	67	52	0,02
4,356 % fällig am 10.07.2035	1.050	968	0,36	Centex Home Equity Loan Trust				Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust			
Madison Avenue Mortgage Trust				6,385 % fällig am 25.10.2035	14	13	0,00	6,470 % fällig am 25.10.2034	1.051	1.043	0,38
3,366 % fällig am 15.08.2034	690	580	0,21	Countrywide Asset-Backed Certificates Trust							
3,484 % fällig am 15.08.2034	225	183	0,07	5,610 % fällig am 25.06.2047	67	60	0,02				
3,976 % fällig am 15.08.2034	1.900	1.428	0,53	5,990 % fällig am 25.12.2036	283	263	0,10				
MortgageIT Trust				First Franklin Mortgage Loan Trust							
6,070 % fällig am 25.08.2035	331	315	0,12	4,757 % fällig am 25.03.2036	1.448	1.344	0,50	Chile Government International Bond			
Natixis Commercial Mortgage Securities Trust				6,220 % fällig am 25.12.2035	921	887	0,33	2,750 % fällig am 31.01.2027	300	284	0,10
3,790 % fällig am 15.11.2032	1.220	886	0,33	GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust				3,500 % fällig am 31.01.2034	300	268	0,10
Residential Accredit Loans, Inc. Trust				5,520 % fällig am 22.02.2055	657	643	0,24	Fondo MIVIVIENDA S.A.			
5,850 % fällig am 25.12.2036	72	62	0,02	GSAMP Trust				4,625 % fällig am 12.04.2027	300	293	0,11
Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust				5,950 % fällig am 25.06.2036	1.767	932	0,34	Mexico Government International Bond			
4,657 % fällig am 25.04.2037	42	35	0,01	6,370 % fällig am 25.11.2035	100	95	0,04	2,250 % fällig am 12.08.2036	€ 870	758	0,28
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				JPMorgan Mortgage Acquisition Trust				Romania Government International Bond			
6,115 % fällig am 25.04.2035	36	35	0,01	4,470 % fällig am 25.01.2037	4.141	2.189	0,81	1,750 % fällig am 13.07.2030	600	538	0,20
Towd Point Mortgage Funding PLC				Lehman XS Trust				5,500 % fällig am 18.09.2028	350	398	0,15
5,891 % fällig am 20.10.2051	£ 3.000	3.811	1,41	5,790 % fällig am 25.02.2037	528	512	0,19	6,375 % fällig am 18.09.2033	350	410	0,15
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				Long Beach Mortgage Loan Trust				Serbia Government International Bond			
4,020 % fällig am 25.11.2036	\$ 84	72	0,03	5,770 % fällig am 25.11.2036	492	353	0,13	1,000 % fällig am 23.09.2028	400	374	0,14
Worldwide Plaza Trust				5,780 % fällig am 25.08.2036	2.515	1.333	0,49	South Africa Government International Bond			
3,596 % fällig am 10.11.2036	1.795	410	0,15	Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR 8.000	458	0,17
		33.758	12,45	6,145 % fällig am 25.09.2035	477	447	0,16			3.781	1,40
								Summe Übertragbare Wertpapiere		\$ 274.526	101,23

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	5,420 %	29.12.2023	02.01.2024	\$ 8.200	U.S. Treasury Notes 4,000 % fällig am 28.02.2030	\$ (8.383)	\$ 8.200	\$ 8.205	3,02
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (8.383)	\$ 8.200	\$ 8.205	3,02

(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	20	\$ (78)	(0,03)
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2025	3	11	0,01
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2026	4	9	0,00
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2024	4	21	0,01
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2025	2	5	0,00
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2024	4	25	0,01
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2025	2	6	0,00
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2026	3	7	0,00
3-Month SOFR September Futures	Short	12.2024	3	13	0,01
3-Month SOFR September Futures	Short	12.2025	3	7	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Long	03.2024	2	9	0,01
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Short	03.2024	10	(24)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Short	03.2024	46	(163)	(0,06)
U.S. Treasury 10-Year Ultra March Futures	Short	03.2024	10	(51)	(0,02)
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Long	03.2024	1	9	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2024	14	(182)	(0,07)
				\$ (376)	(0,14)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (376)	(0,14)

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO ESG Income Fund (Forts.)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

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

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
British Telecommunications PLC	1,000 %	20.06.2028	€ 200	\$ 4	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2028	900	24	0,01
Tesco PLC	1,000	20.06.2028	100	1	0,00
				\$ 29	0,01

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,320 %	20.10.2033	£ 100	\$ 11	0,00
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,500	20.03.2034	1.500	(153)	(0,06)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.12.2026	¥ 330.000	11	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	16.06.2028	890.000	108	0,04
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.12.2028	1.690.000	(105)	(0,04)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	15.06.2032	226.300	37	0,01
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,500	15.03.2042	101.000	58	0,02
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,500	16.06.2028	\$ 150	13	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,750	16.06.2031	100	13	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,250	15.12.2026	6.000	(522)	(0,19)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,250	16.06.2051	40	9	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,350	20.01.2027	200	16	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,360	15.02.2027	550	44	0,02
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,380	04.01.2027	500	(40)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,418	20.01.2027	250	(20)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,420	24.02.2027	400	31	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,425	18.01.2027	500	(39)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,443	18.01.2027	500	(38)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,450	17.02.2027	500	38	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,450	16.07.2031	50	8	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,500	15.12.2028	800	(94)	(0,03)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,500	12.01.2029	110	12	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,518	20.01.2029	150	(16)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,535	15.10.2031	200	(30)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,550	20.01.2027	700	(50)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,570	11.01.2027	200	(15)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,570	12.01.2027	100	(7)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,573	28.02.2027	300	(28)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,580	16.02.2027	300	(21)	(0,01)
Erhalt ⁽³⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,600	16.01.2026	2.700	90	0,03
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,600	15.02.2027	2.200	(151)	(0,06)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,618	09.02.2029	200	(24)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,620	18.04.2027	300	(26)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,630	26.01.2029	150	(15)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,650	24.02.2027	1.300	(86)	(0,03)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,650	08.02.2032	250	(39)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,655	24.01.2032	150	(22)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,700	06.03.2024	500	(2)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,700	17.02.2027	2.100	(136)	(0,05)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,700	12.01.2029	400	(39)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,730	24.02.2032	150	(22)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,735	12.01.2032	150	(21)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,765	16.03.2032	300	(43)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,770	14.02.2032	150	(22)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,783	22.04.2027	400	(32)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,785	12.08.2051	50	17	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,788	03.05.2027	500	(40)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,815	24.01.2052	50	(16)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,817	05.04.2032	150	(21)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,867	26.01.2052	50	(15)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,872	06.04.2032	150	(20)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,888	22.03.2029	200	(20)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,928	25.03.2027	300	(23)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	21.12.2027	2.820	(30)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	21.12.2029	2.600	(29)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	18.02.2032	200	(23)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	21.12.2032	9.850	(56)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	15.12.2051	200	(67)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,250	17.06.2027	400	(24)	(0,01)
Erhalt ⁽³⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,300	17.01.2026	2.000	65	0,02
Erhalt ⁽³⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,350	17.01.2025	3.500	79	0,03
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,370	21.06.2027	400	(22)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,430	30.09.2027	460	23	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,450	20.12.2024	6.800	159	0,06
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,450	04.10.2027	460	22	0,01

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		2,468 %	27.07.2028	\$ 200	\$ (7)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		2,537	24.07.2053	100	(8)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		2,605	28.06.2027	400	(18)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		2,675	24.07.2028	200	(5)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		2,750	21.06.2053	3.200	275	0,10
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		2,765	27.07.2024	1.100	(21)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		2,841	31.10.2024	200	(3)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		2,850	30.08.2027	1.000	(31)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		2,880	30.09.2027	1.300	(33)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		2,900	04.10.2027	1.300	(32)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		2,910	14.11.2024	200	(3)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		2,920	17.10.2024	500	(8)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		2,955	04.10.2027	300	(7)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		2,973	27.10.2024	200	(3)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		2,993	13.10.2024	200	(3)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,000	21.06.2030	1.570	19	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,000	21.06.2033	40	(2)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,018	24.10.2024	200	(3)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,050	07.09.2027	600	(14)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,050	08.09.2029	600	(15)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,050	06.09.2032	500	(15)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,052	24.07.2024	1.100	(18)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,088	07.11.2024	200	(2)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,100	09.09.2029	600	(13)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,140	25.10.2024	200	(2)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,190	25.10.2024	200	(2)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,225	25.10.2024	200	(2)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,250	21.06.2028	4.810	(119)	(0,04)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,300	06.03.2033	200	(5)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,340	23.02.2030	400	(8)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,350	14.12.2032	100	1	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,370	01.03.2033	200	(4)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,370	12.07.2053	200	1	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,400	23.02.2033	200	(3)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,405	01.03.2033	300	(5)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,420	24.05.2033	300	(3)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,425	01.03.2033	300	(4)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,430	27.02.2033	300	(4)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,450	07.03.2033	500	(6)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,470	22.02.2030	400	(5)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,500	22.06.2030	600	(3)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,500	22.05.2033	21.620	(19)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,500	21.06.2033	400	(1)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,500	20.12.2033	100	(3)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,525	02.03.2030	200	(2)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,610	12.12.2032	200	(1)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,650	22.11.2024	400	(4)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,650	05.12.2024	400	(4)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,650	10.07.2033	200	2	0,00
Erhalt ⁽²⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,684	03.01.2034	100	(1)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,700	06.06.2033	12.640	(12)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,730	03.08.2033	100	2	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,750	21.11.2024	400	(3)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,750	11.12.2024	400	(3)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,750	21.06.2025	10.300	178	0,07
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,750	13.12.2027	400	(1)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,750	20.12.2028	4.800	(60)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,750	12.07.2033	200	4	0,00
Erhalt ⁽²⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,750	02.01.2034	100	(2)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,760	23.08.2033	400	9	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,800	22.08.2030	100	2	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,800	30.08.2033	200	5	0,00
Erhalt ⁽²⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,810	02.01.2034	100	(2)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,830	12.10.2053	100	10	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,842	26.12.2033	100	(3)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,854	29.12.2033	200	(6)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,870	17.10.2053	100	11	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,880	16.10.2053	100	11	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,900	30.08.2033	200	7	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,950	13.09.2033	500	19	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,950	19.12.2033	200	(7)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		4,030	04.10.2033	400	19	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		4,030	15.12.2033	200	(8)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		4,040	20.06.2024	1.500	(12)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		4,060	20.06.2024	6.000	(45)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		4,140	22.06.2024	2.500	(17)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		4,150	12.10.2033	200	12	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		4,165	27.09.2033	400	23	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		4,170	03.10.2033	300	18	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		4,175	10.10.2033	200	12	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		4,200	18.10.2033	200	12	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		4,220	20.10.2033	200	13	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO ESG Income Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variablem Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Zahlung		1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,230 %	23.10.2033	\$ 100	\$ 6	0,00
Zahlung		1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	20.12.2025	14.400	129	0,05
Erhalt		1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	22.11.2033	200	(12)	0,00
Zahlung		1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,255	23.10.2033	100	7	0,00
Zahlung		1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,393	25.10.2033	100	8	0,00
Zahlung		1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,435	01.11.2033	100	8	0,00
Zahlung		1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,450	31.10.2033	100	8	0,00
Zahlung		1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,450	01.11.2033	200	17	0,01
Zahlung		1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,500	22.05.2025	47.760	(98)	(0,04)
Zahlung		1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,900	06.06.2025	27.590	58	0,02
Zahlung		1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	5,100	22.05.2024	92.690	(98)	(0,04)
Zahlung		1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	5,400	06.06.2024	53.540	57	0,02
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027	€ 700	(35)	(0,01)
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	1,000	18.05.2027	400	(20)	(0,01)
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	2,100	11.04.2024	400	1	0,00
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	2,100	13.04.2024	800	2	0,00
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	2,100	17.05.2024	500	2	0,00
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	2,250	28.04.2024	400	2	0,00
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	2,250	03.05.2024	400	2	0,00
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	2,547	09.03.2033	400	15	0,01
Erhalt ⁽³⁾		6-Month EUR-EURIBOR	2,750	20.03.2054	300	(34)	(0,01)
Erhalt ⁽³⁾		6-Month EUR-EURIBOR	2,760	03.01.2029	200	(3)	0,00
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	2,880	19.12.2028	200	(4)	0,00
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	2,890	22.12.2033	200	(7)	0,00
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	2,910	29.12.2033	100	(4)	0,00
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	2,920	13.12.2028	300	(7)	0,00
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	2,950	29.12.2028	100	(2)	0,00
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	2,970	15.12.2033	200	(8)	0,00
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	2,990	08.12.2033	200	(9)	0,00
Erhalt ⁽³⁾		6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.03.2034	6.400	(402)	(0,15)
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	3,063	06.12.2033	100	(5)	0,00
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	3,128	04.12.2033	100	(6)	0,00
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	3,148	20.11.2033	100	(6)	0,00
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	3,179	29.11.2028	100	(3)	0,00
Erhalt ⁽³⁾		6-Month EUR-EURIBOR	3,250	20.03.2029	13.600	(550)	(0,20)
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	3,250	06.11.2033	200	(13)	(0,01)
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	3,255	22.11.2028	100	(4)	0,00
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	3,270	08.11.2028	200	(7)	0,00
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	3,270	21.08.2033	100	7	0,00
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	3,280	22.11.2033	100	(7)	0,00
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	3,300	03.10.2033	400	31	0,01
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	3,305	27.11.2033	100	(7)	0,00
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	3,370	09.10.2028	200	9	0,00
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	3,450	20.10.2028	200	10	0,00
						\$ (2.362)	(0,87)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						\$ (2.333)	(0,86)

(1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der jeweiligen Swap-Vereinbarung 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 als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, wie in den Bedingungen der jeweiligen Swap-Vereinbarung definiert.

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

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

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

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variablem Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Nettvermö- gens
GLM	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,110 %	26.07.2032	200	\$ 32	\$ 20	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,110	26.07.2032	300	49	67	0,02
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,620	22.07.2024	2.600	20	2	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,620	22.07.2024	2.600	20	33	0,01
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,400	20.07.2027	200	26	13	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,400	20.07.2027	200	26	38	0,01
							\$ 173	\$ 173	0,06

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	3,288 %	19.01.2024	100	\$ 0	\$ 0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,738	19.01.2024	100	0	0	0,00
BPS	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,494	08.01.2024	100	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,545	16.01.2024	200	(1)	(2)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,994	08.01.2024	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,995	16.01.2024	200	(1)	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
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,235	22.01.2024	200	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,685	22.01.2024	200	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,310	18.01.2024	100	0	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,590	05.01.2024	100	0	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,700	18.01.2024	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,960	05.01.2024	100	0	0	0,00
DUB	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)	(3)	0,00
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,697	02.04.2024	500	(4)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,697	02.04.2024	500	(4)	(8)	(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)	(3)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,215	22.01.2024	200	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,285	19.01.2024	100	0	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300	16.01.2024	200	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,560	05.01.2024	200	(1)	(2)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,594	05.01.2024	200	(1)	(2)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,648	04.01.2024	200	(1)	(3)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,665	22.01.2024	200	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,735	19.01.2024	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	16.01.2024	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,010	05.01.2024	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,044	05.01.2024	200	(1)	0	0,00
GST	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,440	08.01.2024	200	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,860	08.01.2024	200	0	0	0,00
JPM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,170	29.01.2024	100	0	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,205	22.01.2024	100	0	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	18.01.2024	100	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,600	12.01.2024	100	0	(2)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,620	29.01.2024	100	0	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,655	22.01.2024	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	18.01.2024	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,050	12.01.2024	100	0	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,490	12.01.2024	100	0	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,650	04.01.2024	200	(1)	(3)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,890	12.01.2024	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,030	04.01.2024	200	(1)	0	0,00
MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,455	08.01.2024	200	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,475	08.01.2024	100	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,600	12.01.2024	100	0	(2)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,670	04.01.2024	200	(1)	(4)	(0,01)
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,955	08.01.2024	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,975	08.01.2024	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,050	12.01.2024	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,120	04.01.2024	200	(1)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,330	15.01.2024	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,740	15.01.2024	100	0	0	0,00
UAG	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,344	18.01.2024	100	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,744	18.01.2024	100	(1)	0	0,00
							\$ (46)	\$ (50)	(0,02)

ZINSCAPS

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermö- gens
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Cap ⁽²⁾	1-Year USD-LIBOR	0,026 %	23.07.2025	2.600	\$ (23)	\$ (36)	(0,02)
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Floor	1-Year USD-LIBOR	0,030	24.07.2024	5.200	(20)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Floor ⁽²⁾	1-Year USD-LIBOR	0,026	23.07.2025	2.600	(23)	(5)	0,00
						\$ (66)	\$ (41)	(0,02)

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

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

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

Kontrahent	Referenzinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermö- gens
MYC	South Africa Government International Bond	1,000 %	20.12.2026	\$ 1.000	\$ (44)	\$ 38	\$ (6)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO ESG Income Fund (Forts.)

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)	\$ 23	\$ (16)	(0,01)

⁽¹⁾ Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der jeweiligen Swap-Vereinbarung 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 als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, wie in den Bedingungen der jeweiligen Swap-Vereinbarung definiert.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens	
AZD	01.2024	AUD	814	\$ 539	\$ 0	\$ (16)	(0,01)	
BOA	01.2024		814	538	0	(17)	(0,01)	
	01.2024	£	538	683	0	(2)	0,00	
	01.2024	\$	2.384	¥ 351.860	113	0	0,04	
BPS	01.2024	€	551	\$ 601	0	(7)	0,00	
	01.2024	£	2.050	2.601	0	(13)	(0,01)	
	01.2024	¥	25.700	175	0	(7)	0,00	
	01.2024	\$	344	¥ 50.600	15	0	0,01	
	01.2024	ZAR	9.848	\$ 531	0	(7)	0,00	
CBK	01.2024	MXN	38	2	0	0	0,00	
	01.2024	\$	330	£ 261	2	0	0,00	
	01.2024		422	MXN 7.749	34	0	0,01	
GLM	01.2024	MXN	7	\$ 0	0	0	0,00	
	01.2024	\$	1.148	¥ 168.767	50	0	0,02	
	01.2024		2.624	MXN 46.028	82	0	0,03	
MBC	01.2024	€	23.613	\$ 25.947	0	(144)	(0,05)	
	01.2024	£	68	86	0	(1)	0,00	
	01.2024	¥	146.400	1.027	0	(12)	0,00	
MYI	01.2024	€	16	18	0	0	0,00	
	01.2024	\$	907	¥ 133.659	42	0	0,01	
	03.2024	IDR	1.297.927	\$ 84	0	0	0,00	
UAG	01.2024	£	11.127	14.081	0	(104)	(0,04)	
					\$ 338	\$ (330)	\$ 8	0,00

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional AUD (Hedged) ausschüttend und Class R AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens	
AZD	01.2024	\$	33.419	AUD 50.400	\$ 978	\$ 978	0,36	
BOA	01.2024		2.465	3.727	79	79	0,03	
BPS	01.2024	AUD	1.384	\$ 937	0	(8)	0,00	
	01.2024	\$	554	AUD 822	7	7	0,00	
CBK	01.2024	AUD	800	\$ 547	1	0	0,00	
	01.2024	\$	558	AUD 826	6	6	0,00	
GLM	01.2024	AUD	822	\$ 551	0	(10)	0,00	
MBC	01.2024	\$	12.738	AUD 19.213	375	0	0,14	
RYL	01.2024	AUD	821	\$ 552	0	(8)	0,00	
UAG	01.2024	\$	16.103	AUD 24.272	461	0	0,17	
					\$ 1.907	\$ (26)	\$ 1.881	0,70

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens	
BRC	01.2024	\$	59	CHF 52	\$ 2	\$ 2	(0,01)	
CBK	01.2024	CHF	2	\$ 3	0	0	0,00	
	01.2024	\$	1	CHF 1	0	0	0,00	
GLM	01.2024		466	408	19	0	0,01	
MYI	01.2024		469	409	18	0	0,01	
UAG	01.2024		422	368	16	0	0,01	
					\$ 55	\$ 0	\$ 55	0,02

Zum 31. Dezember 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
BPS	01.2024	€ 6.865	\$ 7.503	\$ 1	\$ (82)	\$ (81)	(0,03)
	01.2024	\$ 3.370	€ 3.085	40	0	40	0,01
CBK	01.2024	€ 207	\$ 229	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 450	€ 416	10	0	10	0,00
MBC	01.2024	€ 2.349	\$ 2.541	0	(54)	(54)	(0,02)
	01.2024	\$ 36.745	€ 33.420	181	0	181	0,07
MYI	01.2024	€ 111	\$ 120	0	(3)	(3)	0,00
	01.2024	\$ 36.632	€ 33.329	193	0	193	0,07
UAG	01.2024	33.626	30.570	151	0	151	0,06
				\$ 576	\$ (139)	\$ 437	0,16

Zum 31. Dezember 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	01.2024	\$ 19	£ 15	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BPS	01.2024	28	22	0	0	0	0,00
BRC	01.2024	0	0	0	0	0	0,00
CBK	01.2024	£ 3	\$ 4	0	0	0	0,00
MBC	01.2024	1	1	0	0	0	0,00
SCX	01.2024	\$ 161	£ 127	2	0	2	0,00
SSB	01.2024	105	83	1	0	1	0,00
UAG	01.2024	161	127	1	0	1	0,00
				\$ 4	\$ 0	\$ 4	0,00

Zum 31. Dezember 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	01.2024	\$ 5.952	NOK 63.288	\$ 280	\$ 0	\$ 280	0,11
CBK	01.2024	8.347	89.319	449	0	449	0,17
GLM	01.2024	7.754	83.294	449	0	449	0,17
MBC	01.2024	467	5.069	32	0	32	0,01
RYL	01.2024	NOK 803	\$ 77	0	(2)	(2)	0,00
	01.2024	\$ 2.807	NOK 29.644	114	(1)	113	0,04
SCX	01.2024	557	5.996	33	0	33	0,01
				\$ 1.357	\$ (3)	\$ 1.354	0,51

Zum 31. Dezember 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	01.2024	SEK 1	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2024	\$ 6.527	SEK 68.082	230	0	230	0,08
CBK	01.2024	SEK 1.713	\$ 164	0	(6)	(6)	0,00
	01.2024	\$ 895	SEK 9.316	30	(1)	29	0,01
GLM	01.2024	SEK 582	\$ 57	0	(1)	(1)	0,00
MBC	01.2024	842	82	0	(2)	(2)	0,00
SCX	01.2024	\$ 7.195	SEK 74.725	222	0	222	0,08
UAG	01.2024	SEK 1.526	\$ 152	1	0	1	0,00
	01.2024	\$ 7.228	SEK 74.601	176	0	176	0,07
				\$ 659	\$ (10)	\$ 649	0,24

Zum 31. Dezember 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
BOA	01.2024	\$ 97	SGD 129	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
DUB	01.2024	99	132	1	0	1	0,00
GLM	01.2024	13	17	0	0	0	0,00
MYI	01.2024	93	123	1	0	1	0,00
	02.2024	SGD 3	\$ 3	0	0	0	0,00
				\$ 3	\$ 0	\$ 3	0,00

Summe OTC-Finanzderivate

\$ 4.451 1,64

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO ESG Income Fund (Forts.)

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.03.2054	\$ 500	\$ (443)	(0,16)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (443)	(0,16)
Summe Anlagen		\$ 284.025	104,73
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (12.817)	(4,73)
Nettovermögen		\$ 271.208	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) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

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

(d) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(e) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,38 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits- datum	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Citigroup, Inc.	6,075 %	25.01.2026	19.07.2022	\$ 490	\$ 497	0,18
Deutsche Bank AG	3,035	28.05.2032	25.08.2021 - 02.09.2021	358	293	0,11
Standard Chartered PLC	3,603	12.01.2033	05.01.2022	200	166	0,06
				\$ 1.048	\$ 956	0,35

Barmittel in Höhe von USD 2.915 (31. Dezember 2022: USD 1.927) wurden zum 31. Dezember 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 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	\$ 274.513	\$ 13	\$ 274.526
Pensionsgeschäfte	0	8.200	0	8.200
Finanzderivate ⁽³⁾	9	1.733	0	1.742
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(443)	0	(443)
Summen	\$ 9	\$ 284.003	\$ 13	\$ 284.025

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

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

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

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC-Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement ⁽¹⁾
AZD	\$ 962	\$ (1.000)	\$ (38)	\$ 4	\$ 0	\$ 4
BOA	684	(660)	24	43	0	43
BPS	(64)	0	(64)	(571)	550	(21)
BRC	2	0	2	59	0	59
CBK	520	(620)	(100)	1.021	(950)	71
DUB	(2)	(10)	(12)	(9)	0	(9)
GLM	655	(510)	145	3	260	263
GST	(1)	0	(1)	k. A.	k. A.	k. A.
JPM	(8)	0	(8)	187	0	187
MBC	375	(260)	115	660	(350)	310
MYC	15	0	15	(69)	0	(69)
MYI	251	(450)	(199)	263	(20)	243
RYL	103	0	103	88	0	88
SAL	k. A.	k. A.	k. A.	(6)	0	(6)
SCX	257	(300)	(43)	799	(780)	19
SSB	1	0	1	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	701	(990)	(289)	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. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapiieranlagen zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	39,24	36,58
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	61,99	69,50
Sonstige übertragbare Wertpapiere	k. A.	0,71
Pensionsgeschäfte	3,02	18,66
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,14)	0,05
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,86)	(0,62)
OTC-Finanzderivate	1,64	1,11
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,16)	(1,11)

* Gemäß der Liste der Märkte, die die Kriterien für einen geregelten OGAW-Markt erfüllen, in Anlage 1 zum Verkaufsprospekt.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	0,31	0,52
Unternehmensanleihen und Wechsel	34,34	34,38
US-Regierungsbehörden	38,88	29,05
US-Schatzobligationen	7,73	5,52
Non-Agency-MBS	12,45	12,90
Forderungsbesicherte Wertpapiere	6,12	6,03
Staatsemissionen	1,40	1,19
Kurzfristige Instrumente	k. A.	17,20
Pensionsgeschäfte	3,02	18,66
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,14)	0,05
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	k. A.	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,01	(0,01)
Zinsswaps	(0,87)	(0,61)
OTC-Finanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,06	0,08
Verkaufsoptionen		
Zinsswapoptionen	(0,02)	(0,10)
Zinsswaps	(0,02)	(0,04)
Optionen auf Wertpapiere	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,00	(0,02)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	(0,01)	(0,01)
Devisenterminkontrakte	0,00	(0,10)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,63	1,30
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,16)	(1,11)
Sonstige Aktiva und Passiva	(4,73)	(24,88)
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Lehman XS Trust				Toro European CLO DAC				2,350 % fällig am 30.07.2033			
6,500 % fällig am 25.06.2046	\$ 2.274	€ 1.724	0,10	4,908 % fällig am 12.01.2032	€ 3.900	€ 3.869	0,23	€ 12.400	€ 11.792	0,71	
Long Beach Mortgage Loan Trust				Voya Euro CLO DAC				3,150 % fällig am 30.04.2033	1.254	1.275	0,08
5,770 % fällig am 25.05.2036	2.010	980	0,06	4,715 % fällig am 15.10.2030	2.712	2.687	0,16	3,450 % fällig am 30.07.2043	9.100	9.022	0,54
5,770 % fällig am 25.06.2036	4.660	1.973	0,12			237.134	14,19	3,450 % fällig am 30.07.2066	9.400	8.814	0,53
Man GLG Euro CLO DAC								3,550 % fällig am 31.10.2033	5.870	6.148	0,37
4,645 % fällig am 15.10.2030	€ 1.583	1.573	0,09	STAATSEMISSIONEN				3,900 % fällig am 30.07.2039	1.600	1.696	0,10
4,775 % fällig am 15.10.2032	4.106	4.056	0,24	Autonomous Community of Catalonia						386.001	23,09
4,835 % fällig am 15.01.2030	2.990	2.988	0,18	4,220 % fällig am 26.04.2035	1.600	1.644	0,10				
MASTR Asset-Backed Securities Trust				Belgium Government International Bond							
5,620 % fällig am 25.10.2036	\$ 2.966	892	0,05	1,400 % fällig am 22.06.2053	18.000	12.076	0,72				
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				1,600 % fällig am 22.06.2047	14.000	10.541	0,63				
5,720 % fällig am 25.07.2036	335	266	0,02	Caisse Francaise de Financement Local							
Morgan Stanley Home Equity Loan Trust				4,016 % fällig am 25.02.2025	9.600	9.584	0,57				
5,610 % fällig am 25.12.2036	2.689	1.184	0,07	Cassa Depositi e Prestiti SpA							
Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust				5,750 % fällig am 05.05.2026	\$ 6.000	5.428	0,32				
5,620 % fällig am 25.07.2036	468	386	0,02	Europäische Union							
NovaStar Mortgage Funding Trust				3,000 % fällig am 04.03.2053	€ 1.210	1.188	0,07				
5,670 % fällig am 25.09.2037	430	376	0,02	3,375 % fällig am 04.10.2038	14.820	15.579	0,93				
6,175 % fällig am 25.01.2036	79	71	0,00	3,375 % fällig am 04.11.2042	1.550	1.618	0,10				
OCP Euro CLO DAC				France Government International Bond							
4,785 % fällig am 15.01.2032	€ 3.116	3.100	0,19	0,750 % fällig am 25.05.2052	2.900	1.663	0,10				
4,882 % fällig am 22.09.2034	5.600	5.520	0,33	2,500 % fällig am 24.09.2026	33.300	33.439	2,00				
Palmer Square European Loan Funding DAC				2,750 % fällig am 25.02.2029	48.800	49.976	2,99				
4,685 % fällig am 15.10.2031	3.563	3.506	0,21	3,000 % fällig am 25.05.2054	3.300	3.243	0,19				
PBD Germany Auto Lease Master S.A., Compartment				Italy Buoni Poliennali Del Tesoro							
4,576 % fällig am 26.11.2030	1.619	1.622	0,10	1,750 % fällig am 30.05.2024	5.300	5.256	0,31				
Red & Black Auto Italy SRL				1,750 % fällig am 01.07.2024	20.200	20.005	1,20				
4,865 % fällig am 28.07.2034	4.141	4.158	0,25	2,800 % fällig am 01.03.2067	15.500	11.352	0,68				
Red & Black Auto Lease France				3,850 % fällig am 01.09.2049	7.500	7.086	0,42				
4,556 % fällig am 27.06.2035	2.500	2.504	0,15	4,100 % fällig am 01.02.2029	34.700	36.393	2,18				
Revocar UG				4,500 % fällig am 01.10.2053	13.600	13.989	0,84				
4,513 % fällig am 21.04.2036	3.474	3.484	0,21	Korea Housing Finance Corp.							
SC Germany S.A. Compartment Consumer				0,723 % fällig am 22.03.2025	4.500	4.347	0,26				
4,578 % fällig am 15.09.2037	4.500	4.519	0,27	Mexico Government International Bond							
SCF Rahoituspalvelut DAC				2,659 % fällig am 24.05.2031	\$ 9.700	7.445	0,45				
4,535 % fällig am 25.06.2033	5.300	5.318	0,32	Bundesrepublik Deutschland							
Sculptor European CLO DAC				0,000 % fällig am 15.08.2050							
4,755 % fällig am 14.01.2032	4.600	4.534	0,27	(b)(i)	€ 2.200	1.233	0,07				
Silver Arrow Athlon NL BV				Romania Government International Bond							
4,576 % fällig am 26.04.2031	1.903	1.906	0,11	2,000 % fällig am 28.01.2032 (i)	7.700	5.976	0,36				
Silver Arrow Merfina SRL				Slovenia Government International Bond							
4,559 % fällig am 20.07.2033	1.495	1.497	0,09	0,000 % fällig am 12.02.2031							
Silver Arrow S.A.				(b)	6.100	5.012	0,30				
4,273 % fällig am 15.02.2030	1.932	1.934	0,12	1,000 % fällig am 06.03.2028	3.600	3.374	0,20				
SLC Student Loan Trust				1,175 % fällig am 13.02.2062	8.410	5.181	0,31				
6,481 % fällig am 25.11.2042	\$ 394	358	0,02	3,125 % fällig am 07.08.2045	7.000	6.960	0,42				
SLM Student Loan Trust				3,625 % fällig am 11.03.2033	1.300	1.377	0,08				
4,356 % fällig am 25.10.2039	€ 400	373	0,02	5,250 % fällig am 18.02.2024	\$ 21.451	19.392	1,16				
Soundview Home Loan Trust				South Korea Government International Bond							
5,970 % fällig am 25.10.2036	\$ 4.534	3.845	0,23	0,000 % fällig am 16.09.2025							
Tikehau CLO DAC				(b)	€ 4.400	4.165	0,25				
4,844 % fällig am 04.08.2034	€ 4.000	3.954	0,24	Spain Government International Bond							
				0,100 % fällig am 30.04.2031	300	248	0,01				
				0,600 % fällig am 31.10.2029	31.800	28.378	1,70				
				0,850 % fällig am 30.07.2037	1.100	811	0,05				
				1,900 % fällig am 31.10.2052	19.200	13.295	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 Nettovermö-gens
COM	3,600 %	29.12.2023	02.01.2024	€ 95.300	State of North Rhine-Westphalia 2,350 % fällig am 13.12.2029	€ (99.142)	€ 95.300	€ 95.338	5,70
FICC	2,600	29.12.2023	02.01.2024	\$ 2.520	U.S. Treasury Notes 4,875 % fällig am 30.11.2025	(2.327)	2.281	2.282	0,14
Summe Pensionsgeschäfte						€ (101.469)	€ 97.581	€ 97.620	5,84

(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 September Futures	Short	09.2025	640	€ (496)	(0,03)
3-Month Euribor September Futures	Long	09.2026	640	393	0,02
Euro-Bobl March Futures	Long	03.2024	2.895	5.240	0,31
Euro-BTP Italy Government Bond March Futures	Long	03.2024	1.011	3.244	0,19
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Long	03.2024	185	(116)	(0,01)
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Long	03.2024	379	3.787	0,23
Euro-OAT France Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2024	1.502	3.309	0,20
Euro-Schatz March Futures	Short	03.2024	2.017	(207)	(0,01)
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Short	03.2024	591	(860)	(0,05)
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Short	03.2024	2.535	(5.431)	(0,32)
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2024	1.731	4.906	0,29
U.S. Treasury 10-Year Ultra March Futures	Short	03.2024	389	(1.507)	(0,09)
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Long	03.2024	117	956	0,06
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2024	403	(4.182)	(0,25)
				€ 9.036	0,54

VERKAUFSOPTIONEN

FUTURE-STYLE-OPTIONEN AUF BÖRSEGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
Call - EUREX Euro-Bund February 2024 Futures	€ 137,000	26.01.2024	73	€ (50)	€ (103)	(0,01)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					€ 8.933	0,53

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	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt ⁽¹⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,865 %	13.02.2054	\$ 19.400	€ 1.003	0,06
Zahlung ⁽¹⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,085	13.02.2034	59.500	(1.147)	(0,07)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	20.12.2025	25.400	40	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,827	15.12.2025	31.400	(266)	(0,02)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	1,700	15.03.2073	€ 4.900	343	0,02
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	21.09.2037	44.600	290	0,02
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	21.09.2042	20.400	(163)	(0,01)
Erhalt ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	20.03.2054	88.500	(10.361)	(0,62)
Zahlung ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.03.2034	241.950	15.070	0,90
Erhalt ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.03.2044	2.000	(253)	(0,01)
Zahlung ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,250	20.03.2029	29.900	1.107	0,07
Zahlung ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,500	20.03.2026	182.000	219	0,01
					€ 5.882	0,35
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					€ 5.882	0,35

⁽¹⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

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	4,750 %	16.01.2024	31.400	€ (138)	€ (396)	(0,02)
BRC	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	3,150	06.10.2025	24.800	(272)	(583)	(0,03)
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,150	06.10.2025	24.800	(272)	(94)	(0,01)
CBK	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,950	15.09.2025	20.600	(234)	(435)	(0,03)
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,950	15.09.2025	20.600	(234)	(102)	(0,01)
GLM	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,900	29.08.2025	12.900	(153)	(256)	(0,01)
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,900	29.08.2025	12.900	(154)	(59)	0,00
GST	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,800	01.09.2025	27.900	(326)	(515)	(0,03)
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,800	01.09.2025	27.900	(326)	(140)	(0,01)
							€ (2.109)	€ (2.580)	(0,15)

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Bond Fund (Forts.)

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

Kontrahent	Referenzinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
GST	South Africa Government International Bond	1,000 %	20.06.2024	\$ 16.800	€ (655)	€ 710	€ 55	0,00

⁽¹⁾ Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der jeweiligen Swap-Vereinbarung 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 als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, wie in den Bedingungen der jeweiligen Swap-Vereinbarung definiert.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2024	€ 1.188	£ 1.024	0	(7)	(7)	0,00
	02.2024	¥ 2.121.000	€ 13.520	0	(148)	(148)	(0,01)
	03.2024	CNH 101.408	\$ 14.106	0	(196)	(196)	(0,01)
	06.2024	KRW 9.136.912	7.023	0	(80)	(80)	0,00
BPS	01.2024	AUD 215	€ 131	0	(2)	(2)	0,00
	01.2024	€ 985	£ 846	0	(9)	(9)	0,00
	01.2024	12.008	\$ 13.072	0	(177)	(177)	(0,01)
	01.2024	£ 1.187	€ 1.377	7	0	7	0,00
	01.2024	HUF 357.786	\$ 1.019	0	(14)	(14)	0,00
	01.2024	KRW 131.378	100	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	\$ 100	BRL 491	1	0	1	0,00
	01.2024	4.175	€ 3.805	26	0	26	0,00
	01.2024	3	HUF 928	0	0	0	0,00
	01.2024	250	IDR 3.867.095	1	0	1	0,00
	01.2024	6.465	ZAR 119.852	72	0	72	0,00
	03.2024	IDR 325.562	\$ 21	0	0	0	0,00
BRC	01.2024	€ 2.487	£ 2.159	4	0	4	0,00
	01.2024	278	\$ 300	0	(6)	(6)	0,00
	01.2024	KRW 258.460	200	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 14.093	€ 12.813	61	(3)	58	0,00
	01.2024	3.664	MXN 64.282	104	0	104	0,01
	01.2024	199	ZAR 3.697	3	0	3	0,00
	03.2024	3.898	IDR 60.599.446	29	0	29	0,00
CBK	01.2024	DKK 186.640	€ 25.043	4	0	4	0,00
	01.2024	HUF 85.075	\$ 243	0	(3)	(3)	0,00
	01.2024	IDR 3.085.708	200	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 1.700	€ 1.545	6	0	6	0,00
	01.2024	ZAR 4.388	\$ 233	0	(6)	(6)	0,00
	03.2024	\$ 200	IDR 3.086.499	0	0	0	0,00
	06.2024	15	KRW 19.554	0	0	0	0,00
DUB	01.2024	KRW 129.970	\$ 100	0	0	0	0,00
	02.2024	¥ 1.300.000	€ 8.274	0	(112)	(112)	(0,01)
GLM	01.2024	DKK 36.454	4.891	0	0	0	0,00
	01.2024	€ 2.939	DKK 21.910	0	0	0	0,00
	01.2024	5.483	£ 4.706	0	(53)	(53)	0,00
	01.2024	3.539	¥ 571.338	131	0	131	0,01
	01.2024	3.528	\$ 3.810	0	(80)	(80)	0,00
	01.2024	¥ 26.100	€ 165	0	(3)	(3)	0,00
	01.2024	\$ 628	MXN 10.978	16	0	16	0,00
	01.2024	ZAR 2.850	\$ 150	0	(5)	(5)	0,00
	03.2024	IDR 436.576	28	0	0	0	0,00
JPM	01.2024	€ 1.183	£ 1.025	0	0	0	0,00
	01.2024	65	\$ 70	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	HUF 871.211	2.481	0	(33)	(33)	0,00
	01.2024	\$ 250	IDR 3.846.750	0	0	0	0,00
	01.2024	100	KRW 129.616	0	0	0	0,00
	02.2024	5.349	BRL 26.234	39	0	39	0,00
	03.2024	CNH 1.074	\$ 149	0	(2)	(2)	0,00
	06.2024	KRW 277.205	214	0	(2)	(2)	0,00
MBC	01.2024	DKK 13.430	€ 1.802	0	0	0	0,00
	01.2024	€ 4.843	\$ 5.228	0	(112)	(112)	(0,01)
	03.2024	¥ 7.244.771	€ 44.868	0	(1.973)	(1.973)	(0,12)
MYI	01.2024	€ 1.134	£ 978	0	(6)	(6)	0,00
	01.2024	5.969	\$ 6.541	0	(49)	(49)	0,00
	01.2024	\$ 223.541	€ 203.400	1.084	0	1.084	0,06
	03.2024	IDR 3.855.935	\$ 251	1	0	1	0,00
	03.2024	\$ 250	IDR 3.874.125	2	0	2	0,00
	06.2024	KRW 20.389	\$ 16	0	0	0	0,00
RYL	02.2024	¥ 5.700.000	€ 36.183	0	(585)	(585)	(0,03)
SCX	01.2024	CAD 23.712	15.891	0	(386)	(386)	(0,02)
	01.2024	€ 16.778	¥ 2.597.000	0	(94)	(94)	(0,01)
	01.2024	£ 159.429	€ 183.631	4	(322)	(318)	(0,02)
	01.2024	\$ 1.989	MXN 34.924	58	0	58	0,00
	03.2024	IDR 284.903	\$ 19	0	0	0	0,00
	03.2024	TWD 330.611	10.629	0	(294)	(294)	(0,02)
	03.2024	\$ 3.547	INR 296.662	5	0	5	0,00

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
UAG	01.2024	DKK 60.331	€ 8.108	€ 15	€ 0	€ 15	0,00
	01.2024	€ 1.568	£ 1.351	0	(9)	(9)	0,00
	01.2024	¥ 6.280.000	€ 40.223	0	(182)	(182)	(0,01)
	01.2024	\$ 298	MXN 5.239	9	0	9	0,00
	03.2024	¥ 5.560.000	€ 36.334	329	0	329	0,02
	03.2024	\$ 3.372	INR 282.187	6	0	6	0,00
				€ 2.017	€ (4.955)	€ (2.938)	(0,18)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2023 standen fur die Anteilsklasse Institutional CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BPS	01.2024	€ 102.090	CHF 97.379	€ 2.684	€ 0	€ 2.684	0,16
BRC	01.2024	3.632	3.435	64	0	64	0,00
CBK	01.2024	100.937	96.869	3.288	0	3.288	0,20
DUB	01.2024	CHF 35	€ 37	0	(1)	(1)	0,00
GLM	01.2024	€ 107.252	CHF 103.168	3.749	0	3.749	0,22
MYI	01.2024	CHF 15	€ 16	0	0	0	0,00
RYL	01.2024	2.551	2.695	0	(49)	(49)	0,00
	01.2024	€ 5.667	CHF 5.341	79	0	79	0,01
TOR	01.2024	CHF 56	€ 60	0	(1)	(1)	0,00
UAG	01.2024	€ 20.065	CHF 19.075	459	0	459	0,03
				€ 10.323	€ (51)	€ 10.272	0,62
Summe OTC-Finanzderivate						€ 4.809	0,29
Summe Anlagen						€ 1.829.040	109,41
Sonstige Aktiva und Passiva						€ (157.327)	(9,41)
Nettovermogen						€ 1.671.713	100,00

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
 (b) Nullkuponwertpapier.
 (c) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfalligkeit dar.
 (d) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
 (e) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nachsten vertraglichen Kundigungstermin dar.
 (f) Mit dem Fonds verbunden.
 (g) Bedingt wandelbares Wertpapier.
 (h) Eingeschrankte Wertpapiere (31. Dezember 2022: null):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Falligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermogens
Deutsche Bank AG	2,129 %	24.11.2026	26.07.2023 - 03.08.2023	€ 5.519	€ 5.604	0,34

(i) Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von EUR 1.087 (31. Dezember 2022: EUR null) wurde zum 31. Dezember 2023 als Sicherheit gema den Rahmenvertragen und/oder globalen Rahmenvertragen fur Pensionsgeschafte verpfandet.

(j) Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von EUR 1.233 (31. Dezember 2022: EUR 4.360) und Barmittel in Hohe von EUR 3.318 (31. Dezember 2022: EUR 5.628) wurden zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten fur Finanzderivate gema den Rahmenvertragen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. verpfandet.

Barmittel in Hohe von EUR 34.315 (31. Dezember 2022: EUR 53.376) wurden zum 31. Dezember 2023 als Sicherheit fur borsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfandet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Markten notierte Kurse fur identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
	€	€	€	
Übertragbare Wertpapiere	0	€ 1.547.394	€ 233	€ 1.547.627
Investmentfonds	164.208	0	0	164.208
Pensionsgeschafte	0	97.581	0	97.581
Finanzderivate ⁽³⁾	15.051	4.573	0	19.624
Summen	€ 179.259	€ 1.649.548	€ 233	€ 1.829.040

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Bond Fund (Forts.)

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

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

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BPS	3,500 %	28.09.2023	TBD ⁽¹⁾	€ (1.031)	€ (1.041)	(0,06)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					€ (1.041)	(0,06)

⁽¹⁾ Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC-Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
BOA	€ (431)	€ 373	€ (58)	€ (136)	€ 0	€ (136)
BPS	2.192	(2.230)	(38)	(3.776)	1.243	(2.533)
BRC	(421)	420	(1)	(672)	250	(422)
CBK	2.752	(3.316)	(564)	(250)	0	(250)
DUB	(113)	0	(113)	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	3.440	(2.974)	466	(662)	553	(109)
GST	(600)	624	24	(1.966)	1.883	(83)
JPM	1	0	1	(3.086)	3.064	(22)
MBC	(2.085)	2.046	(39)	(236)	(390)	(626)
MYC	k. A.	k. A.	k. A.	(26)	70	44
MYI	1.032	(2.110)	(1.078)	(46)	37	(9)
RBC	k. A.	k. A.	k. A.	(30)	0	(30)
RYL	(555)	390	(165)	(198)	30	(168)
SCX	(1.029)	698	(331)	(313)	373	60
SSB	k. A.	k. A.	k. A.	2.746	(1.770)	976
TOR	(1)	0	(1)	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	627	(1.010)	(383)	(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. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	76,27	71,54
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	16,25	19,58
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,06	0,23
Investmentfonds	9,82	9,49
Pensionsgeschäfte	5,84	0,60
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,53	(1,69)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,35	(1,62)
OTC-Finanzderivate	0,29	(0,50)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,06)	k. A.

* Gemäß der Liste der Märkte, die die Kriterien für einen geregelten OGAW-Markt erfüllen, in Anlage 1 zum Verkaufsprospekt.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	0,01	0,01
Unternehmensanleihen und Wechsel	16,27	26,04
US-Regierungsbehörden	10,71	5,29
US-Schatzobligationen	4,94	2,26
Non-Agency-MBS	13,32	12,23
Forderungsbesicherte Wertpapiere	14,19	12,40
Staatsemissionen	23,09	20,18
Vorzugswertpapiere	0,01	0,07
Kurzfristige Instrumente	10,04	12,87
Investmentfonds	9,82	9,49
Pensionsgeschäfte	5,84	0,60
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,54	(1,69)
Verkaufsoptionen		
Future-Style-Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	(0,01)	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	k. A.	(0,13)
Zinsswaps	0,35	(1,49)
OTC-Finanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	k. A.	0,51
Verkaufsoptionen		
Zinsswapoptionen	(0,15)	(1,04)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Devisenterminkontrakte	(0,18)	0,07
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,62	(0,04)
Sonstige Aktiva und Passiva	(9,41)	2,37
Nettovermögen	100,00	100,00

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermö- gens
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,050 %	15.12.2031	¥ 1.860.000	€ (125)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,500	16.06.2026	\$ 27.600	(464)	(0,09)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,750	16.06.2031	15.100	(626)	(0,12)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.06.2024	23.000	305	0,06
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.06.2052	3.400	(252)	(0,05)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.09.2025	37.000	(199)	(0,04)
Zahlung	3-Month EUR-EURIBOR	0,500	09.02.2024	€ 52.200	148	0,03
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	20.03.2054	8.000	(900)	(0,17)
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.03.2034	30.650	1.635	0,31
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,250	20.03.2029	35.500	1.094	0,20
					€ 616	0,11
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					€ 724	0,13

(1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der jeweiligen Swap-Vereinbarung 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 als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, wie in den Bedingungen der jeweiligen Swap-Vereinbarung definiert.

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

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

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

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	01.2024	£ 130	€ 151	€ 1	€ 0	€ 1	0,00	
BPS	01.2024	€ 1.386	\$ 1.513	0	(16)	(16)	0,00	
	01.2024	£ 94	€ 109	1	0	1	0,00	
	01.2024	\$ 670	€ 611	4	0	4	0,00	
BRC	01.2024	€ 1.881	\$ 2.057	0	(19)	(19)	0,00	
	01.2024	¥ 20.200	€ 129	0	(1)	(1)	0,00	
	01.2024	\$ 342	€ 314	4	0	4	0,00	
GLM	01.2024	€ 2.035	\$ 2.198	0	(46)	(46)	(0,01)	
	01.2024	£ 978	€ 1.131	2	0	2	0,00	
	01.2024	\$ 58	MXN 1.019	2	0	2	0,00	
JPM	03.2024	CNH 452	\$ 63	0	(1)	(1)	0,00	
MBC	01.2024	€ 5.915	€ 6.467	0	(61)	(61)	(0,01)	
	01.2024	\$ 43.554	€ 39.609	193	(3)	190	0,03	
MYI	01.2024	582	€ 533	6	0	6	0,00	
SCX	01.2024	£ 9.716	11.191	0	(20)	(20)	0,00	
					€ 213	€ (167)	€ 46	0,01
Summe OTC-Finanzderivate						€ 46	0,01	
Summe Anlagen						€ 561.118	104,46	
Sonstige Aktiva und Passiva						€ (23.932)	(4,46)	
Nettovermögen						€ 537.186	100,00	

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

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

(a) Nullkuponwertpapier.

(b) Mit dem Fonds verbunden.

(c) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von EUR 8.413 (31. Dezember 2022: EUR 262) und Barmittel in Höhe von EUR null (31. Dezember 2022: EUR 1.150) wurden zum 31. Dezember 2023 Wertpapiere als Sicherheiten gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte verpfändet.

Barmittel in Höhe von EUR 8.072 (31. Dezember 2022: EUR 25.216) wurden zum 31. Dezember 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Credit Fund (Forts.)

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 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	€ 536.476	€ 39	€ 536.515
Investmentfonds	9.501	0	0	9.501
Pensionsgeschäfte	0	14.437	0	14.437
Finanzderivate ⁽³⁾	(104)	769	0	665
Summen	€ 9.397	€ 551.682	€ 39	€ 561.118

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

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

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten	
					Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BPS	1,000 %	28.09.2023	TBD ⁽¹⁾	€ (1.233)	€ (1.241)	(0,23)
	3,200	28.09.2023	TBD ⁽¹⁾	(161)	(162)	(0,03)
JML	2,000	14.11.2023	TBD ⁽¹⁾	(872)	(874)	(0,16)
	3,500	06.12.2023	TBD ⁽¹⁾	(5.158)	(5.171)	(0,96)
MBC	3,100	31.10.2023	TBD ⁽¹⁾	(724)	(728)	(0,14)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					€ (8.176)	(1,52)

⁽¹⁾ Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC-Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
BOA	€ 1	€ 0	€ 1	€ 60	€ 0	€ 60
BPS	(11)	0	(11)	40	0	40
BRC	(16)	0	(16)	15	0	15
CBK	k. A.	k. A.	k. A.	(4)	0	(4)
GLM	(42)	0	(42)	(1.545)	1.412	(133)
JPM	(1)	0	(1)	26	0	26
MBC	129	(300)	(171)	2.095	(1.900)	195
MYC	k. A.	k. A.	k. A.	(5)	0	(5)
MYI	6	0	6	(139)	(50)	(189)
RBC	k. A.	k. A.	k. A.	(30)	0	(30)
SCX	(20)	0	(20)	18	0	18
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. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	90,72	72,82
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	9,16	7,71
Sonstige übertragbare Wertpapiere	k. A.	0,07
Investmentfonds	1,77	8,31
Pensionsgeschäfte	2,69	7,31
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,02)	(0,47)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,13	(0,30)
OTC-Finanzderivate	0,01	0,12
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(1,52)	k. A.

* Gemäß der Liste der Märkte, die die Kriterien für einen geregelten OGAW-Markt erfüllen, in Anlage 1 zum Verkaufsprospekt.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	k. A.	1,36
Unternehmensanleihen und Wechsel	75,08	62,43
US-Regierungsbehörden	6,21	2,01
Non-Agency-MBS	3,36	4,11
Forderungsbesicherte Wertpapiere	4,25	5,19
Staatsemissionen	10,98	0,03
Kurzfristige Instrumente	k. A.	5,47
Investmentfonds	1,77	8,31
Pensionsgeschäfte	2,69	7,31
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,02)	(0,47)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,02	(0,19)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	k. A.	0,02
Zinsswaps	0,11	(0,13)
OTC-Finanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	k. A.	(0,24)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	k. A.	0,00
Devisenterminkontrakte	0,01	0,36
Sonstige Aktiva und Passiva	(4,46)	4,43
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
6,950 % fällig am 15.03.2034	\$ 9.500	€9.457	0,68	Bear Stearns Mortgage Funding Trust	\$ 2	€ 2	0,00	Dutch Property Finance BV	€ 6.409	€6.406	0,46
		24.239	1,75	Bridgegate Funding PLC	£ 24.122	27.996	2,02	4,702 % fällig am 28.10.2059	€ 15.359	15.401	1,11
Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		408.154	29,42	7,470 % fällig am 16.10.2062				4,852 % fällig am 28.04.2064			
WANDELANLEIHEN & WECHSEL				BX Trust				EuroMASTR PLC			
Corestate Capital Holding S.A. (8,000 % bar oder 9,000 % PIK)				7,429 % fällig am 15.05.2030	\$ 1.015	907	0,07	5,531 % fällig am 15.06.2040	£ 115	125	0,01
8,000 % fällig am 31.12.2026	€ 1.685	883	0,07	8,844 % fällig am 15.07.2034	895	810	0,06	First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust	\$ 141	67	0,01
^ (b)				9,944 % fällig am 15.07.2034	3.400	3.041	0,22	6,143 % fällig am 25.04.2036	46	35	0,00
Sunac China Holdings Ltd.				Chase Mortgage Finance Trust				First Horizon Mortgage Pass-Through Trust			
1,000 % fällig am 30.09.2032	\$ 398	28	0,00	3,847 % fällig am 25.03.2037	21	18	0,00	5,673 % fällig am 25.11.2037	17	12	0,00
		911	0,07	4,501 % fällig am 25.01.2036	178	144	0,01	Glenbeigh Issuer DAC	€ 11.384	11.376	0,82
				6,000 % fällig am 25.05.2037	96	40	0,00	4,916 % fällig am 24.03.2046	4.630	4.620	0,33
				ChaseFlex Trust				GSC Capital Corp. Mortgage Trust			
				5,000 % fällig am 25.07.2037	71	21	0,00	5,830 % fällig am 25.05.2036	\$ 59	50	0,00
				ChaseFlex Trust Multi-Class Mortgage Pass-Through				GSR Mortgage Loan Trust			
				Certificates Trust				5,500 % fällig am 25.06.2035	95	85	0,01
				4,204 % fällig am 25.08.2037	22	15	0,00	HarborView Mortgage Loan Trust			
				Citigroup Mortgage Loan Trust				4,041 % fällig am 19.06.2036	90	42	0,00
				3,840 % fällig am 25.03.2037	34	27	0,00	4,672 % fällig am 19.12.2035	172	81	0,01
				4,752 % fällig am 25.04.2037	119	92	0,01	5,927 % fällig am 19.12.2035	14	12	0,00
				5,500 % fällig am 25.12.2035	109	53	0,00	Harbour Energy PLC			
				5,800 % fällig am 25.12.2034	4	3	0,00	6,120 % fällig am 28.01.2054	£ 5.700	6.534	0,47
				6,250 % fällig am 25.11.2037	139	58	0,01	Hops Hill PLC			
				CitiMortgage Alternative Loan Trust				6,148 % fällig am 27.05.2054	831	959	0,07
				6,000 % fällig am 25.01.2037	206	164	0,01	HSI Asset Loan Obligation Trust			
				6,000 % fällig am 25.06.2037	344	272	0,02	6,000 % fällig am 25.06.2037	\$ 70	54	0,00
				Countrywide Alternative Loan Resecuritization Trust				Impac Secured Assets Trust			
				4,080 % fällig am 25.08.2037	55	24	0,00	5,770 % fällig am 25.11.2036	12	11	0,00
				6,000 % fällig am 25.08.2037	49	22	0,00	IndyMac Mortgage Loan Trust			
				Countrywide Alternative Loan Trust				3,355 % fällig am 25.06.2036	39	29	0,00
				3,879 % fällig am 25.05.2036	10	7	0,00	3,751 % fällig am 25.11.2035	79	66	0,01
				4,120 % fällig am 25.06.2037	41	34	0,00	3,940 % fällig am 25.06.2037	1.044	563	0,04
				5,237 % fällig am 25.09.2034	3	3	0,00	5,720 % fällig am 25.09.2037	3.672	3.349	0,24
				5,500 % fällig am 25.03.2035	5.019	4.003	0,29	6,090 % fällig am 25.10.2036	10.157	4.469	0,32
				5,500 % fällig am 25.11.2035	71	39	0,00	6,190 % fällig am 25.01.2035	46	29	0,00
				5,500 % fällig am 25.12.2035	62	31	0,00	6,250 % fällig am 25.11.2037	42	17	0,00
				5,500 % fällig am 25.02.2036	45	24	0,00	JPMorgan Alternative Loan Trust			
				5,750 % fällig am 25.04.2047	96	48	0,00	4,531 % fällig am 25.12.2036	4	3	0,00
				6,000 % fällig am 25.03.2036	198	81	0,01	5,950 % fällig am 25.10.2036	2.700	2.173	0,16
				6,000 % fällig am 25.05.2036	1.133	526	0,04	5,957 % fällig am 27.06.2037	161	101	0,01
				6,000 % fällig am 25.08.2036	234	125	0,01	6,500 % fällig am 25.03.2036	182	95	0,01
				6,000 % fällig am 25.04.2037	58	30	0,00	6,550 % fällig am 25.05.2036	3	3	0,00
				6,000 % fällig am 25.05.2037	782	331	0,02	Jubilee Place BV			
				6,000 % fällig am 25.08.2037	313	149	0,01	4,835 % fällig am 17.01.2059	€ 5.304	5.309	0,38
				6,250 % fällig am 25.07.2036	1.309	544	0,04	4,985 % fällig am 17.10.2057	1.115	1.118	0,08
				6,250 % fällig am 25.12.2036	20	8	0,00	Jupiter Mortgage PLC			
				6,500 % fällig am 25.12.2036	59	24	0,00	6,621 % fällig am 20.07.2060	£ 26.960	31.109	2,24
				6,500 % fällig am 25.08.2037	340	131	0,01	7,721 % fällig am 20.07.2060	8.760	10.093	0,73
				Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				Lavender Trust			
				5,950 % fällig am 25.04.2036	143	113	0,01	6,250 % fällig am 26.10.2036	\$ 162	73	0,01
				Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				Lehman Mortgage Trust			
				4,008 % fällig am 25.01.2036	24	20	0,00	4,505 % fällig am 25.12.2035	159	26	0,00
				4,110 % fällig am 20.02.2036	122	97	0,01	5,032 % fällig am 25.01.2036	45	37	0,00
				4,294 % fällig am 25.11.2037	77	62	0,01	Lehman XS Trust			
				4,430 % fällig am 25.09.2047	63	50	0,00	5,830 % fällig am 25.12.2036	678	588	0,04
				4,543 % fällig am 20.12.2035	52	40	0,00	Ludgate Funding PLC			
				4,970 % fällig am 20.09.2036	23	18	0,00	4,115 % fällig am 01.01.2061	€ 5.039	4.850	0,35
				5,750 % fällig am 25.12.2035	65	29	0,00	4,155 % fällig am 01.12.2060	3.065	2.949	0,21
				6,000 % fällig am 25.03.2037	92	36	0,00	Mansard Mortgages PLC			
				6,000 % fällig am 25.04.2037	14	6	0,00	5,989 % fällig am 15.12.2049	£ 839	955	0,07
				6,000 % fällig am 25.07.2037	161	63	0,01	MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust			
				6,070 % fällig am 25.03.2035	262	155	0,01	3,989 % fällig am 25.03.2035	\$ 11	9	0,00
				6,090 % fällig am 25.03.2035	14	11	0,00	Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust			
				6,210 % fällig am 25.02.2035	173	133	0,01	6,000 % fällig am 25.05.2037	124	87	0,01
				6,500 % fällig am 25.11.2036	255	79	0,01	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust			
				Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.				3,853 % fällig am 25.03.2036	263	129	0,01
				6,000 % fällig am 25.01.2036	160	90	0,01	Miravet SARL			
				6,620 % fällig am 25.09.2034	21	26	0,00	4,806 % fällig am 26.05.2065	€ 4.903	4.864	0,35
				Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust				Morgan Stanley Mortgage Loan Trust			
				5,770 % fällig am 25.08.2036	1.190	331	0,02	4,768 % fällig am 25.03.2036	\$ 99	55	0,01
				6,000 % fällig am 25.07.2036	180	80	0,01	5,962 % fällig am 25.06.2036	4.303	1.130	0,08
				6,500 % fällig am 25.10.2021	202	12	0,00	6,000 % fällig am 25.10.2037	112	55	0,01
				6,500 % fällig am 25.02.2022	513	56	0,01	6,201 % fällig am 25.02.2047	2.931	962	0,07
				Credit Suisse Mortgage Capital Trust				Mortimer BTL PLC			
				7,344 % fällig am 15.07.2032	1.024	853	0,06	0,000 % fällig am 22.12.2056	£ 5.800	6.710	0,48
				Deutsche ALT-B Securities Mortgage Loan Trust							
				5,770 % fällig am 25.04.2037	176	108	0,01				
				Deutsche Mortgage Securities, Inc. Re-REMIC							
				Trust Certificates							
				4,042 % fällig am 27.06.2037	2.861	2.232	0,16				

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Income Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Newgate Funding PLC				ALME Loan Funding DAC				First NLC Trust			
4,525 % fällig am 15.12.2050 €	179	176	0,01	4,715 % fällig am 15.01.2032 €	291	288	0,02	5,610 % fällig am 25.08.2037 \$	137	62	0,00
5,584 % fällig am 01.12.2050 £	1.013	1.142	0,08	Ameriqwest Mortgage Securities Trust				5,750 % fällig am 25.08.2037	46	21	0,00
6,340 % fällig am 15.12.2050	142	158	0,01	5,710 % fällig am 25.10.2036 \$	3.098	826	0,06	Fremont Home Loan Trust			
Nomura Resecuritization Trust				Ameriqwest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				5,590 % fällig am 25.01.2037	10.169	4.184	0,30
6,370 % fällig am 25.03.2037 \$	3.426	2.971	0,22	3,793 % fällig am 25.04.2034	1.412	1.229	0,09	5,620 % fällig am 25.11.2037	209	86	0,01
Primrose Residential DAC				6,190 % fällig am 25.07.2035	316	279	0,02	5,790 % fällig am 25.08.2036	181	53	0,00
4,876 % fällig am 24.10.2061 €	4.286	4.262	0,31	Aqueduct European CLO DAC				5,810 % fällig am 25.02.2037	635	193	0,01
Residential Accredit Loans, Inc. Trust				4,633 % fällig am 20.07.2030 €	2.287	2.270	0,16	6,340 % fällig am 25.11.2034	1.266	1.009	0,07
5,890 % fällig am 25.06.2037 \$	45	36	0,00	4,932 % fällig am 15.08.2034	1.000	985	0,07	6,400 % fällig am 25.04.2035	3.025	2.615	0,19
6,000 % fällig am 25.06.2036	54	38	0,00	Ares European CLO DAC				Golden Bar Securitisation SRL			
6,000 % fällig am 25.05.2037	44	31	0,00	4,625 % fällig am 15.10.2030	665	660	0,05	6,816 % fällig am 22.09.2043 €	1.700	1.723	0,12
6,250 % fällig am 25.02.2037	117	82	0,01	4,843 % fällig am 20.04.2032	2.100	2.067	0,15	Griffith Park CLO DAC			
Residential Asset Securitization Trust				5,122 % fällig am 21.10.2033	8.500	8.414	0,61	4,704 % fällig am 21.11.2031	3.286	3.234	0,23
6,000 % fällig am 25.02.2036	322	123	0,01	Argent Securities Trust				GSAA Home Equity Trust			
6,000 % fällig am 25.06.2036	145	56	0,01	5,620 % fällig am 25.09.2036 \$	844	246	0,02	5,772 % fällig am 25.11.2036 \$	123	33	0,00
6,000 % fällig am 25.11.2036	121	40	0,00	5,670 % fällig am 25.06.2036	455	109	0,01	GSAMP Trust			
6,000 % fällig am 25.03.2037	97	29	0,00	Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				5,570 % fällig am 25.12.2046	181	81	0,01
6,000 % fällig am 25.05.2037	631	298	0,02	6,110 % fällig am 25.01.2036	465	373	0,03	5,610 % fällig am 25.12.2036	832	396	0,03
6,250 % fällig am 25.11.2036	83	28	0,00	Asset-Backed Funding Certificates Trust				5,620 % fällig am 25.12.2046	498	224	0,02
Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust				6,470 % fällig am 25.06.2037	70	49	0,00	5,670 % fällig am 25.11.2036	187	80	0,01
6,000 % fällig am 25.10.2036	48	33	0,00	6,520 % fällig am 25.03.2034	111	96	0,01	5,700 % fällig am 25.12.2046	91	41	0,00
RMAC PLC				Aurium CLO DAC				5,770 % fällig am 25.09.2036	701	226	0,02
0,000 % fällig am 15.02.2047 £	11.100	12.851	0,93	4,635 % fällig am 16.04.2030 €	2.080	2.057	0,15	Harvest CLO DAC			
RMAC Securities PLC				4,635 % fällig am 15.10.2030	400	397	0,03	4,605 % fällig am 15.10.2031 €	1.368	1.345	0,10
4,220 % fällig am 12.06.2044 €	3.651	3.458	0,25	Bain Capital Euro CLO DAC				4,695 % fällig am 15.01.2031	782	776	0,06
5,509 % fällig am 12.06.2044 £	381	424	0,03	5,102 % fällig am 24.01.2033	400	397	0,03	4,872 % fällig am 18.11.2030	2.048	2.030	0,15
5,609 % fällig am 12.06.2044	3.775	4.157	0,30	Bastille Euro CLO DAC				4,943 % fällig am 20.10.2032	2.000	1.980	0,14
Shamrock Residential DAC				5,115 % fällig am 15.01.2034	8.200	8.097	0,58	HSI Asset Securitization Corp. Trust			
4,726 % fällig am 24.01.2061 €	7.579	7.554	0,55	Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				5,690 % fällig am 25.12.2036 \$	196	47	0,00
4,876 % fällig am 24.06.2071	13.919	13.853	1,00	4,812 % fällig am 25.10.2036 \$	33	14	0,00	5,810 % fällig am 25.12.2036	940	224	0,02
Southern Pacific Securities PLC				6,370 % fällig am 25.08.2034	1.033	904	0,07	5,845 % fällig am 25.05.2037	4.600	4.020	0,29
4,499 % fällig am 10.03.2044	2.167	2.131	0,15	Blackrock European CLO DAC				5,910 % fällig am 25.12.2036	544	131	0,01
Stratton Mortgage Funding PLC				4,825 % fällig am 15.12.2032 €	600	593	0,04	JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.			
7,721 % fällig am 20.07.2060 £	5.594	6.452	0,47	BlueMountain Fuji EUR CLO DAC				6,400 % fällig am 25.06.2035	4.968	4.069	0,29
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				4,615 % fällig am 15.07.2030	1.777	1.768	0,13	JPMorgan Mortgage Acquisition Trust			
4,669 % fällig am 25.02.2036 \$	51	37	0,00	4,875 % fällig am 15.01.2033	2.300	2.266	0,16	6,337 % fällig am 25.08.2036	88	45	0,00
5,906 % fällig am 25.10.2035	109	87	0,01	BNPP AM Euro CLO DAC				Jubilee CLO DAC			
SunTrust Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				4,615 % fällig am 15.10.2031	1.133	1.118	0,08	4,575 % fällig am 15.04.2030 €	661	657	0,05
5,068 % fällig am 25.02.2037	72	56	0,01	BNPP IP Euro CLO DAC				Lehman XS Trust			
TBW Mortgage-Backed Trust				4,755 % fällig am 15.10.2030	961	952	0,07	5,640 % fällig am 25.02.2037 \$	904	620	0,04
6,300 % fällig am 25.03.2037	8.300	1.650	0,12	Bosphorus CLO DAC				Mackay Shields Euro CLO DAC			
Tower Bridge Funding PLC				4,745 % fällig am 15.12.2030	596	591	0,04	4,923 % fällig am 20.10.2032 €	1.300	1.286	0,09
6,721 % fällig am 20.10.2064 £	10.108	11.735	0,85	Cairn CLO DAC				Man GLG Euro CLO DAC			
8,371 % fällig am 20.10.2064	2.300	2.678	0,19	4,618 % fällig am 31.01.2030	4.139	4.102	0,30	4,645 % fällig am 15.10.2030	357	355	0,03
Twin Bridges PLC				Carlyle Euro CLO DAC				4,835 % fällig am 15.01.2030	1.836	1.835	0,13
6,432 % fällig am 15.05.2056	9.100	10.524	0,76	4,632 % fällig am 15.08.2030	5.128	5.081	0,37	Marlay Park CLO DAC			
UBS Commercial Mortgage Trust				Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC				4,705 % fällig am 15.10.2030	1.141	1.133	0,08
6,909 % fällig am 15.02.2032 \$	7.520	6.751	0,49	4,715 % fällig am 15.07.2030	1.050	1.044	0,08	MASTR Asset-Backed Securities Trust			
Uropa Securities PLC				Carrington Mortgage Loan Trust				5,570 % fällig am 25.11.2036 \$	133	39	0,00
4,333 % fällig am 10.10.2040 €	1.612	1.478	0,11	5,730 % fällig am 25.02.2037 \$	136	114	0,01	5,770 % fällig am 25.08.2036	231	81	0,01
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				Centex Home Equity Loan Trust				5,950 % fällig am 25.06.2036	125	41	0,00
3,847 % fällig am 25.05.2037 \$	37	29	0,00	6,520 % fällig am 25.10.2035	4.024	3.561	0,26	5,950 % fällig am 25.08.2036	139	48	0,00
3,972 % fällig am 25.10.2036	27	21	0,00	Citigroup Mortgage Loan Trust				Merrill Lynch Mortgage Investors Trust			
4,063 % fällig am 25.12.2036	224	173	0,01	6,851 % fällig am 25.05.2036	126	44	0,00	4,471 % fällig am 25.11.2037	599	189	0,01
4,727 % fällig am 25.12.2035	6	5	0,00	Contego CLO BV				6,010 % fällig am 25.04.2047	1.504	555	0,04
6,250 % fällig am 25.10.2044	54	46	0,00	4,735 % fällig am 15.10.2030 €	1.297	1.286	0,09	Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust			
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust				Contego CLO DAC				5,580 % fällig am 25.02.2037	473	139	0,01
5,782 % fällig am 25.04.2047	342	240	0,02	4,642 % fällig am 23.01.2030	5.531	5.453	0,39	5,600 % fällig am 25.01.2037	96	39	0,00
6,000 % fällig am 25.07.2036	92	56	0,00	Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				5,610 % fällig am 25.10.2036	105	41	0,00
6,000 % fällig am 25.06.2037	24	20	0,00	5,750 % fällig am 25.12.2046 \$	3.057	2.587	0,19	5,650 % fällig am 25.03.2037	316	123	0,01
Wells Fargo Alternative Loan Trust				6,010 % fällig am 25.03.2036	979	773	0,06	5,670 % fällig am 25.09.2036	55	18	0,00
6,250 % fällig am 25.11.2037	28	22	0,00	Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust				5,670 % fällig am 25.02.2037	106	46	0,00
		291.596	21,02	3,201 % fällig am 25.01.2037	2.060	581	0,04	5,720 % fällig am 25.03.2037	316	123	0,01
				CVC Cordatus Loan Fund DAC				5,770 % fällig am 25.09.2036	325	104	0,01
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				4,652 % fällig am 21.07.2030 €	10.300	10.184	0,73	6,445 % fällig am 25.02.2035	2.379	1.600	0,12
Accunia European CLO DAC				4,782 % fällig am 15.08.2032	198	197	0,01	6,520 % fällig am 25.06.2033	3	2	0,00
4,915 % fällig am 15.07.2030 €	487	486	0,04	4,832 % fällig am 17.06.2032	1.300	1.284	0,09	Morgan Stanley Home Equity Loan Trust			
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust				4,852 % fällig am 26.08.2032	500	494	0,04	5,640 % fällig am 25.04.2037	252	119	0,01
5,690 % fällig am 25.10.2036 \$	1.854	621	0,05	Dryden Euro CLO DAC				Morgan Stanley Mortgage Loan Trust			
5,690 % fällig am 25.12.2036	408	97	0,01	4,752 % fällig am 15.05.2032	576	568	0,04	6,000 % fällig am 25.04.2037	2.266	740	0,05
5,750 % fällig am 25.07.2036	100	70	0,01	4,862 % fällig am 15.05.2034	299	295	0,02	6,010 % fällig am 25.02.2037	2.266	740	0,05
5,750 % fällig am 25.02.2037	2.756	1.055	0,08	Fieldstone Mortgage Investment Trust				6,465 % fällig am 25.09.2046	284	86	0,01
5,770 % fällig am 25.01.2037	6.819	3.325	0,24	6,250 % fällig am 25.12.2035 \$	9.291	7.319	0,53	Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust			
6,445 % fällig am 25.11.2033	685	605	0,04					6,532 % fällig am 25.10.2036	153	32	0,00
								NovaStar Mortgage Funding Trust			
								5,770 % fällig am 25.06.2036	80	51	0,00
								5,770 % fällig am 25.09.2036	146	55	0,00
								5,790 % fällig am 25.05.2036	252	224	0,02

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Oak Hill European Credit Partners DAC	€ 2.873	€ 2.845	0,21	5,750 % fällig am 25.06.2037	\$ 133	€ 80	0,01	KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
4,723 % fällig am 20.01.2032				6,145 % fällig am 25.06.2035	2.253	1.991	0,14	SCHATZWECHSEL DES EUROPÄISCHEN STABILITÄTSMECHANISMUS			
OCP Euro CLO DAC				6,470 % fällig am 25.09.2037	7.573	4.767	0,34	3,711 % fällig am 25.01.2024 (d)(e)	€ 1.700	€ 1.696	0,12
4,785 % fällig am 15.01.2032	3.566	3.548	0,26	Specialty Underwriting & Residential Finance Trust				DEUTSCHE SCHATZWECHSEL			
Option One Mortgage Loan Trust				5,770 % fällig am 25.09.2037	64	40	0,00	3,604 % fällig am 20.03.2024 (d)(e)	1.690	1.677	0,12
5,570 % fällig am 25.07.2036	\$ 10.280	4.299	0,31	St. Paul's CLO DAC				3,651 % fällig am 21.02.2024 (d)(e)	7.360	7.324	0,53
5,650 % fällig am 25.04.2037	13.110	6.691	0,48	4,745 % fällig am 17.07.2030	€ 1.491	1.478	0,11	3,655 % fällig am 20.03.2024 (d)(e)	9.500	9.428	0,68
5,690 % fällig am 25.01.2037	245	126	0,01	Structured Asset Investment Loan Trust				3,677 % fällig am 20.03.2024 (d)(e)	8.120	8.059	0,58
5,800 % fällig am 25.04.2037	679	293	0,02	5,620 % fällig am 25.09.2036	\$ 20	18	0,00				
Palmer Square European Loan Funding DAC				Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust							
4,685 % fällig am 15.10.2031	€ 5.127	5.045	0,36	7,220 % fällig am 25.04.2031	1.879	1.704	0,12				
Palmerston Park CLO DAC				Toro European CLO DAC							
4,625 % fällig am 18.04.2030	947	943	0,07	4,705 % fällig am 15.10.2030	€ 890	884	0,06				
Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				4,885 % fällig am 15.07.2030	560	561	0,04				
6,205 % fällig am 25.08.2035	\$ 355	312	0,02	4,908 % fällig am 12.01.2032	9.200	9.127	0,66				
Purple Finance CLO DAC				Voya Euro CLO DAC							
4,993 % fällig am 20.04.2032	€ 1.200	1.187	0,09	4,715 % fällig am 15.10.2030	3.644	3.611	0,26				
Renaissance Home Equity Loan Trust											
5,879 % fällig am 25.06.2037	\$ 3.494	868	0,06								
7,238 % fällig am 25.09.2037	210	81	0,01								
7,270 % fällig am 25.09.2037	141	105	0,01								
Residential Asset Mortgage Products Trust											
6,415 % fällig am 25.10.2035	3.000	2.257	0,16								
Residential Asset Securities Corp. Trust											
5,730 % fällig am 25.11.2036	659	548	0,04								
6,430 % fällig am 25.01.2036	3.300	2.722	0,20								
Rockford Tower Europe CLO DAC											
4,968 % fällig am 20.12.2031	€ 521	517	0,04								
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust											
5,650 % fällig am 25.07.2036	\$ 187	59	0,00								
5,790 % fällig am 25.07.2036	183	57	0,00								
5,950 % fällig am 25.07.2036	157	49	0,00								
5,970 % fällig am 25.03.2036	2.976	1.650	0,12								
5,970 % fällig am 25.05.2036	645	306	0,02								
Segovia European CLO DAC											
4,745 % fällig am 18.01.2031	€ 237	235	0,02								
4,873 % fällig am 20.07.2032	2.000	1.975	0,14								
SLM Student Loan Trust											
6,252 % fällig am 25.03.2026	\$ 13.052	11.697	0,84								
Soundview Home Loan Trust											
4,350 % fällig am 25.04.2035	1.650	1.472	0,11								
5,580 % fällig am 25.02.2037	257	64	0,00								
5,650 % fällig am 25.02.2037	380	96	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 Nettovermö-gens
COM	3,600 %	29.12.2023	02.01.2024	€ 133.900	Land Brandenburg 0,010 % fällig am 26.06.2028 Landesbank Baden-Wuerttemberg 0,010 % fällig am 08.04.2025	€ (80.782) (57.106)	€ 133.900	€ 133.954	9,66
FICC	2,600	29.12.2023	02.01.2024	\$ 4.501	U.S. Treasury Notes 4,875 % fällig am 30.11.2025	(4.156)	4.075	4.075	0,29
Summe Pensionsgeschäfte						€ (142.044)	€ 137.975	€ 138.029	9,95

(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 Nettovermö-gens
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Long	03.2024	204	€ 845	0,06
Euro-Schatz March Futures	Short	03.2024	3.569	(2.206)	(0,16)
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2024	1.006	3.493	0,25
U.S. Treasury 10-Year Ultra March Futures	Long	03.2024	662	3.309	0,24
United Kingdom Long Gilt March Futures	Short	03.2024	21	(170)	(0,01)
				€ 5.271	0,38
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				€ 5.271	0,38

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Income Bond Fund (Forts.)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

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

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2024	\$ 13.000	€ (116)	(0,01)
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2026	2.400	(17)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2028	1.100	16	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2025	200	3	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	8.700	66	0,00
				€ (48)	(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	\$ 686	€ 47	0,01
CDX.HY-41 5-Year Index	5,000	20.12.2028	16.830	716	0,05
CDX.IG-41 5-Year Index	1,000	20.12.2028	36.900	181	0,01
				€ 944	0,07

ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,250 %	20.03.2054	£ 2.300	€ 343	0,02
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,320	20.10.2033	900	91	0,01
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	5,000	20.03.2029	5.300	(346)	(0,02)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	15.06.2032	¥ 5.164.600	863	0,06
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,868	05.05.2032	\$ 15.100	(1.787)	(0,13)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,040	25.05.2032	7.800	(811)	(0,06)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,068	11.05.2032	15.400	(1.600)	(0,12)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,153	18.05.2032	15.400	(1.482)	(0,11)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,750	21.06.2053	39.900	3.180	0,23
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,000	21.06.2033	3.085	(99)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,300	06.03.2033	2.600	(60)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,300	14.06.2033	9.700	(177)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,370	12.07.2053	2.800	17	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,420	24.05.2033	7.600	(79)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,425	01.03.2033	40.200	(530)	(0,04)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,450	07.03.2033	5.000	(57)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	22.06.2030	12.200	(60)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2030	194.100	(2.417)	(0,17)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	21.06.2033	8.100	(20)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2033	248.300	(364)	(0,03)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,525	02.03.2030	1.800	(16)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,650	10.07.2033	4.600	40	0,00
Erhalt ⁽³⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,684	03.01.2034	1.200	(15)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,730	03.08.2033	1.300	21	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,735	07.08.2033	1.500	26	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	21.06.2025	74.000	(1.094)	(0,08)
Erhalt ⁽³⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2029	302.700	(949)	(0,07)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	15.03.2030	46.000	1.048	0,08
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	12.07.2033	4.000	67	0,00
Erhalt ⁽³⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	02.01.2034	1.200	(21)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,760	23.08.2033	4.700	93	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,800	10.03.2028	5.000	(7)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,800	05.09.2028	8.500	99	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,800	22.08.2030	1.200	17	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,800	30.08.2033	2.300	53	0,00
Erhalt ⁽³⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,810	02.01.2034	1.200	(27)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,830	12.10.2053	700	63	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,842	26.12.2033	1.200	(29)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,854	29.12.2033	2.200	(56)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,870	17.10.2053	700	67	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,880	16.10.2053	700	68	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,900	30.08.2033	4.700	144	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,950	19.12.2033	2.400	(78)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,030	04.10.2033	4.500	190	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,030	15.12.2033	2.200	(84)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,150	12.10.2033	2.100	110	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,175	10.10.2033	2.100	113	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,200	18.10.2033	1.800	100	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,220	20.10.2033	2.200	126	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,230	23.10.2033	1.100	64	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	22.11.2033	2.200	(118)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,255	23.10.2033	1.100	66	0,00

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,393 %	25.10.2033	\$ 1.100	€ 78	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,435	01.11.2033	1.100	82	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,450	31.10.2033	1.300	98	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,450	01.11.2033	2.200	168	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,874	02.01.2026	BRL 10.600	(8)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,899	02.01.2026	5.400	(3)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,939	02.01.2026	9.200	(4)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,998	04.01.2027	15.500	(1)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,037	04.01.2027	4.200	1	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,041	04.01.2027	17.100	2	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,052	02.01.2026	21.000	(3)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,085	02.01.2026	20.900	(1)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,090	04.01.2027	32.200	10	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,105	02.01.2026	20.700	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,138	04.01.2027	8.000	4	0,00
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,750	20.12.2025	CAD 23.100	330	0,02
Zahlung	3-Month EUR-EURIBOR	3,500	09.02.2024	€ 115.000	(289)	(0,02)
Zahlung ⁽³⁾	3-Month EUR-EURIBOR	3,150	30.01.2025	667.700	(745)	(0,05)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,360	07.08.2028	ZAR 26.500	21	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,380	04.08.2028	11.700	10	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,400	07.08.2028	26.500	23	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,410	31.07.2028	12.600	11	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,410	04.08.2028	28.300	25	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,410	07.08.2028	7.900	7	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,415	31.07.2028	10.100	9	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,415	04.08.2028	11.800	11	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,420	31.07.2028	37.700	35	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,421	04.08.2028	12.000	11	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,426	01.08.2028	15.200	14	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,428	31.07.2028	25.100	23	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,460	01.08.2028	25.700	26	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,460	02.08.2028	26.100	26	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,464	02.08.2028	26.100	26	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,543	04.08.2028	12.000	14	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,550	03.08.2028	24.200	28	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	20.09.2033	AUD 13.200	239	0,02
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,830	09.12.2052	€ 26.700	1.401	0,10
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,520	07.07.2027	9.600	(397)	(0,03)
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	20.03.2054	40.400	(4.173)	(0,30)
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	2,760	03.01.2029	1.800	(24)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,880	19.12.2028	2.600	(48)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,890	22.12.2033	2.100	(65)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,910	29.12.2033	1.400	(47)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,920	13.12.2028	3.100	(61)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,950	29.12.2028	1.700	(38)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,970	15.12.2033	2.200	(82)	(0,01)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,990	08.12.2033	1.800	(70)	(0,01)
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.03.2034	293.450	16.980	1,22
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,063	06.12.2033	1.300	(59)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,128	04.12.2033	1.000	(50)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,148	20.11.2033	1.600	(83)	(0,01)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,179	29.11.2028	1.300	(40)	0,00
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,250	20.03.2029	563.000	5.818	0,42
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,250	06.11.2033	1.600	(95)	(0,01)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,255	22.11.2028	1.200	(41)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,270	08.11.2028	2.600	(88)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	3,270	21.08.2033	1.600	108	0,01
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,280	22.11.2033	800	(51)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,305	27.11.2033	1.700	(111)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	3,450	20.10.2028	2.700	122	0,01
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,500	20.03.2026	11.300	(180)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,300	16.06.2028	MXN 20.600	(6)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,444	25.07.2028	48.100	(20)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,471	26.07.2028	24.200	(9)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,512	24.07.2028	36.400	(10)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,550	27.07.2028	12.300	(2)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,556	27.07.2028	73.000	(13)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,600	31.07.2028	23.500	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,620	28.07.2028	12.000	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,636	28.07.2028	23.800	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,640	28.07.2028	4.800	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,650	28.07.2028	12.100	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,660	28.07.2028	11.900	0	0,00
Erhalt	CPTFEMU	2,500	15.01.2025	€ 68.100	(64)	0,00
					€ 13.466	0,97
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					€ 14.362	1,03

(1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der jeweiligen Swap-Vereinbarung 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 Rückzahlungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Income Bond Fund (Forts.)

- (2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, wie in den Bedingungen der jeweiligen Swap-Vereinbarung definiert.
- (3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

VERKAUFSOPTIONEN

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermö-gens
BOA	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,288 %	19.01.2024	700	€ (3)	€ (3)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,738	19.01.2024	700	(3)	(1)	0,00
BPS	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,494	08.01.2024	1.200	(5)	(8)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,545	16.01.2024	2.400	(10)	(27)	0,00
CBK	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,994	08.01.2024	1.200	(5)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,995	16.01.2024	2.400	(10)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,235	22.01.2024	2.300	(9)	(7)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,685	22.01.2024	2.300	(9)	(6)	0,00
FAR	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,310	18.01.2024	1.000	(4)	(3)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,590	05.01.2024	1.600	(5)	(16)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,700	18.01.2024	1.000	(4)	(3)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,960	05.01.2024	1.600	(5)	0	0,00
GLM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,273	16.01.2024	1.300	(5)	(3)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,489	08.01.2024	1.300	(6)	(8)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,550	16.01.2024	1.100	(4)	(13)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,723	16.01.2024	1.300	(5)	(2)	0,00
JPM	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,989	08.01.2024	1.300	(6)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,000	16.01.2024	1.100	(4)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,215	22.01.2024	2.300	(8)	(6)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,285	19.01.2024	1.200	(4)	(4)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300	16.01.2024	2.300	(9)	(7)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,560	05.01.2024	2.300	(11)	(22)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,594	05.01.2024	2.300	(11)	(27)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,648	04.01.2024	2.300	(10)	(34)	(0,01)
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,665	22.01.2024	2.300	(8)	(7)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,735	19.01.2024	1.200	(5)	(2)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	16.01.2024	2.300	(9)	(3)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,010	05.01.2024	2.300	(11)	0	0,00
GST	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,044	05.01.2024	2.300	(11)	0	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,440	08.01.2024	2.600	(5)	(8)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,860	08.01.2024	2.600	(5)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,170	29.01.2024	1.200	(5)	(3)	0,00
MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,205	22.01.2024	1.300	(5)	(3)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	18.01.2024	1.200	(5)	(6)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,600	12.01.2024	1.100	(5)	(16)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,620	29.01.2024	1.200	(5)	(6)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,655	22.01.2024	1.300	(5)	(4)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	18.01.2024	1.200	(5)	(2)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,050	12.01.2024	1.100	(5)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,490	12.01.2024	1.600	(6)	(11)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,650	04.01.2024	2.200	(7)	(31)	(0,01)
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,890	12.01.2024	1.600	(6)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,030	04.01.2024	2.200	(7)	0	0,00
	UAG	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,455	08.01.2024	2.500	(11)	(13)
Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap		3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,475	08.01.2024	1.200	(5)	(7)	0,00
Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap		3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,600	12.01.2024	1.100	(5)	(16)	0,00
Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap		3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,670	04.01.2024	2.500	(11)	(40)	(0,01)
Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap		3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,955	08.01.2024	2.500	(11)	0	0,00
Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap		3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,975	08.01.2024	1.200	(5)	0	0,00
Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap		3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,050	12.01.2024	1.100	(5)	0	0,00
Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap		3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,120	04.01.2024	2.500	(11)	0	0,00
Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap		6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,330	15.01.2024	1.500	(6)	(4)	0,00
Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap		6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,740	15.01.2024	1.500	(6)	(2)	0,00
Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap		3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,344	18.01.2024	1.200	(5)	(5)	0,00
Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap		3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,744	18.01.2024	1.200	(5)	(2)	0,00
							€ (361)	€ (393)	(0,03)

(1) Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermö-gens
GST	ADLER Real Estate AG	5,000 %	20.12.2026	€ 1.200	€ (6)	€ (207)	€ (213)	(0,01)

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, wie in den Bedingungen der jeweiligen Swap-Vereinbarung definiert.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
BPS	01.2024	AUD	567	€ 342	€ 0	€ (9)	€ (9)	0,00
	01.2024	€	27.631	\$ 30.219	5	(286)	(281)	(0,02)
	01.2024	£	1.040	€ 1.206	6	0	6	0,00
	01.2024	\$	16.606	15.233	203	0	203	0,01
	01.2024		178	ZAR 3.304	2	0	2	0,00
	02.2024	TWD	493	\$ 16	0	(1)	(1)	0,00
	03.2024		1.267	41	0	(1)	(1)	0,00
	03.2024	\$	176	IDR 2.719.663	0	0	0	0,00
	01.2024	DKK	743	€ 100	0	0	0	0,00
	01.2024	€	5.285	\$ 5.785	0	(49)	(49)	0,00
BRC	01.2024	¥	54.300	€ 346	0	(2)	(2)	0,00
	01.2024	\$	14.632	13.484	241	0	241	0,02
	01.2024		1.473	TRY 44.155	3	(1)	2	0,00
	02.2024	TRY	59	\$ 2	0	0	0	0,00
	02.2024	\$	2.402	TRY 73.239	2	(8)	(6)	0,00
	03.2024		4.482	140.627	0	(36)	(36)	0,00
	04.2024		4.520	145.688	0	(55)	(55)	0,00
	01.2024	BRL	70.418	\$ 14.463	0	(31)	(31)	0,00
	01.2024	MXN	107.439	6.026	0	(263)	(263)	(0,02)
	01.2024	\$	17.800	€ 16.368	258	0	258	0,02
CBK	01.2024		5.650	MXN 103.209	378	0	378	0,03
	04.2024		14.463	BRL 71.131	54	0	54	0,00
	06.2024		15	KRW 18.727	0	0	0	0,00
	01.2024	€	12.574	¥ 2.029.876	467	0	467	0,03
	01.2024		4.924	\$ 5.317	0	(112)	(112)	(0,01)
	01.2024	MXN	78	4	0	0	0	0,00
	01.2024	\$	13.986	BRL 70.459	470	0	470	0,03
	01.2024		4.698	€ 4.283	31	0	31	0,00
	01.2024		9.404	MXN 164.936	265	0	265	0,02
	01.2024		891	TRY 27.198	11	0	11	0,00
GLM	01.2024		173	ZAR 3.226	3	0	3	0,00
	03.2024		1.168	IDR 17.978.700	0	(1)	(1)	0,00
	03.2024		804	TRY 25.236	0	(8)	(8)	0,00
	01.2024	£	5.678	€ 6.552	0	0	0	0,00
	02.2024	\$	6.855	INR 572.704	10	0	10	0,00
	02.2024		368	TRY 11.248	0	(1)	(1)	0,00
	03.2024	CNH	934	\$ 130	0	(2)	(2)	0,00
	03.2024	\$	1.422	IDR 21.956.651	2	0	2	0,00
	01.2024	€	2.885	\$ 3.160	0	(25)	(25)	0,00
	01.2024	MXN	5.043	271	0	(23)	(23)	0,00
JPM	01.2024	\$	2.858	€ 2.616	30	0	30	0,00
	03.2024	TWD	2.139	\$ 68	0	(3)	(3)	0,00
	03.2024	\$	1.735	IDR 26.743.584	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	€	2.517	\$ 2.716	0	(58)	(58)	0,00
	01.2024	£	1.049	€ 1.217	7	0	7	0,00
	01.2024	TRY	114	\$ 4	0	0	0	0,00
	01.2024	\$	382.891	€ 348.421	1.884	0	1.884	0,13
	02.2024		4	TRY 117	0	0	0	0,00
	03.2024		2.779	IDR 42.769.560	0	(5)	(5)	0,00
	06.2024		2	KRW 2.565	0	0	0	0,00
RBC	04.2024		13	MXN 236	0	0	0	0,00
	01.2024	¥	9.880.000	€ 63.248	0	(224)	(224)	(0,02)
RYL								
SCX	01.2024	CAD	3.090	2.071	0	(50)	(50)	0,00
	01.2024	£	121.097	139.477	0	(246)	(246)	(0,02)
UAG	03.2024	\$	155	IDR 2.380.042	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	TRY	4.128	\$ 140	1	0	1	0,00
	01.2024	\$	16	ZAR 313	1	0	1	0,00
	02.2024		140	TRY 4.257	0	(1)	(1)	0,00
				€ 4.334	€ (1.503)	€ 2.831	0,20	
Summe OTC-Finanzderivate						€ 2.225	0,16	
Summe Anlagen						€ 1.993.491	143,70	
Sonstige Aktiva und Passiva						€ (606.264)	(43,70)	
Nettovermögen						€ 1.387.227	100,00	

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

- * Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt
- ^ Das Wertpapier ist in Verzug.
- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
- (b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.
- (c) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Income Bond Fund (Forts.)

- (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) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,06 %):

Emittentenbeschreibung	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Corestate Capital Holding S.A.	22.08.2023	€ 0	€ 0	0,00
Deutsche Bank AG 2,129 % fällig am 24.11.2026	11.01.2023	2.385	2.377	0,17
Deutsche Bank AG 3,035 % fällig am 28.05.2032	29.07.2021	173	151	0,01
		€ 2.558	€ 2.528	0,18

- (i) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von EUR 4.450 (31. Dezember 2022: EUR null) wurden zum 31. Dezember 2023 Wertpapiere als Sicherheiten gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte verpfändet.

Barmittel in Höhe von EUR 49.537 (31. Dezember 2022: EUR 41.642) wurden zum 31. Dezember 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von EUR 317 (31. Dezember 2022: EUR 5.462) wurden zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten für Finanzderivate gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 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	€ 1.696.971	€ 1.173	€ 1.698.144
Investmentfonds	135.514	0	0	135.514
Pensionsgeschäfte	0	137.975	0	137.975
Finanzderivate ⁽³⁾	(1.531)	23.389	0	21.858
Summen	€ 133.983	€ 1.858.335	€ 1.173	€ 1.993.491

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

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

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BPS	3,200 %	28.09.2023	TBD ⁽¹⁾	€ (321)	€ (324)	(0,03)
BRC	3,250	30.11.2023	TBD ⁽¹⁾	(3.754)	(3.765)	(0,27)
JML	2,250	14.11.2023	TBD ⁽¹⁾	(179)	(179)	(0,01)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					€ (4.268)	(0,31)

⁽¹⁾ Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC-Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement ⁽¹⁾
BOA	€ (4)	€ 0	€ (4)	€ 149	€ (272)	€ (123)
BPS	(117)	0	(117)	275	(290)	(15)
BRC	95	0	95	175	0	175
CBK	361	(290)	71	(16)	0	(16)
FAR	(26)	0	(26)	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	1.014	(643)	371	(3.563)	3.382	(181)
GST	(221)	317	96	(289)	328	39
JPM	(74)	0	(74)	(2.314)	1.752	(562)
MBC	(22)	0	(22)	3.869	(3.429)	440
MYC	(82)	0	(82)	k. A.	k. A.	k. A.
MYI	1.828	(3.757)	(1.929)	(128)	0	(128)
RBC	k. A.	k. A.	k. A.	(168)	0	(168)
RYL	(224)	(40)	(264)	83	0	83
SCX	(297)	0	(297)	(42)	0	(42)
SSB	k. A.	k. A.	k. A.	428	(272)	156
UAG	(6)	0	(6)	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. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	54,60	60,94
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	67,81	19,96
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,00	0,44
Investmentfonds	9,77	9,96
Pensionsgeschäfte	9,95	8,90
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,38	0,20
Zentral abgerechnete Finanzderivate	1,03	(0,20)
OTC-Finanzderivate	0,16	(0,11)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,31)	k. A.

* Gemäß der Liste der Märkte, die die Kriterien für einen geregelten OGAW-Markt erfüllen, in Anlage 1 zum Verkaufsprospekt.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	0,88	2,26
Unternehmensanleihen und Wechsel	29,42	43,78
Wandelanleihen & Wechsel	0,07	0,11
US-Regierungsbehörden	47,18	6,78
US-Schatzobligationen	1,15	k. A.
Non-Agency-MBS	21,02	3,46
Forderungsbesicherte Wertpapiere	14,58	11,18
Staatsemissionen	1,48	1,15
Stammaktien	0,03	k. A.
Kurzfristige Instrumente	6,60	12,62
Investmentfonds	9,77	9,96
Pensionsgeschäfte	9,95	8,90
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,38	0,20
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	(0,01)	(0,02)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,07	0,16
Zinsswaps	0,97	(0,34)
OTC-Finanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	(0,03)	(0,24)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	(0,01)	(0,02)
Devisenterminkontrakte	0,20	0,15
Sonstige Aktiva und Passiva	(43,70)	(0,09)
Nettvermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Long Average Duration Fund (Forts.)

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Euro-OAT France Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2024	22	€ (58)	(0,01)
Euro-Schatz March Futures	Short	03.2024	1.498	(779)	(0,08)
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Short	03.2024	595	(847)	(0,09)
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Short	03.2024	1.074	(1.760)	(0,19)
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2024	570	1.354	0,15
U.S. Treasury 10-Year Ultra March Futures	Long	03.2024	342	753	0,08
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Short	03.2024	215	(1.002)	(0,11)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2024	107	(659)	(0,07)
				€ 6.847	0,74
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					
				€ 6.847	0,74

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

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

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
British Telecommunications PLC	1,000 %	20.12.2028	€ 100	€ 1	0,00

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt	Variable Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Zahlung ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS		5,500 %	20.03.2026	£ 15.000	€ 202	0,02
Zahlung ⁽³⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,085	13.02.2034	\$ 1.100	51	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,250	20.12.2053	5.300	(443)	(0,05)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,500	20.12.2033	6.300	247	0,03
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		4,611	31.10.2025	49.900	297	0,03
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR		2,750	20.03.2054	€ 9.500	(655)	(0,07)
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR		3,000	20.03.2034	72.000	3.006	0,32
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR		3,000	20.03.2039	19.800	1.134	0,12
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR		3,000	20.03.2044	4.800	333	0,04
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR		3,250	20.03.2029	20.200	(502)	(0,05)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		3,345	04.04.2044	5.300	373	0,04
						€ 4.043	0,44
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate							
						€ 4.044	0,44

⁽¹⁾ Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der jeweiligen Swap-Vereinbarung definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er 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 als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, wie in den Bedingungen der jeweiligen Swap-Vereinbarung definiert.

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

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

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

VERKAUFSOPTIONEN

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variable Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettvermögens
CBK	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,950 %	15.09.2025	16.000	€ (181)	€ (338)	(0,03)
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,950	15.09.2025	16.000	(181)	(79)	(0,01)
GLM	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,900	29.08.2025	4.500	(53)	(89)	(0,01)
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,900	29.08.2025	4.500	(54)	(21)	0,00
GST	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,800	01.09.2025	9.800	(115)	(181)	(0,02)
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,800	01.09.2025	9.800	(115)	(49)	(0,01)
							€ (699)	€ (757)	(0,08)

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	01.2024	€	\$	600	0	(14)	0,00
BOA	01.2024	\$	MXN	1.702	0	0	0,00
	02.2024		CNY	243	0	0	0,00
	03.2024	CNH	\$	4.904	0	(68)	(0,01)
	06.2024	KRW		2.441	0	(28)	0,00
BPS	01.2024	€		1.274	0	(14)	0,00
	01.2024	£	€	238	1	0	0,00
	01.2024	HUF	\$	523	0	(8)	0,00
	01.2024	KRW		50	0	(1)	0,00
	01.2024	\$	BRL	6.014	6	6	0,00
	01.2024		€	5.321	99	0	0,01
	01.2024		HUF	660	0	0	0,00
	01.2024		IDR	1.546.618	0	0	0,00
	01.2024		ZAR	41.523	25	0	0,00
	02.2024		CNY	434	0	0	0,00
BRC	01.2024	KRW	\$	100	0	0	0,00
	01.2024	\$	€	2.336	0	(3)	0,00
	01.2024		MXN	22.499	36	0	0,00
	01.2024		ZAR	1.849	2	2	0,00
	03.2024	CNY	\$	18	0	0	0,00
	03.2024	\$	IDR	20.976.731	10	0	0,00
CBK	01.2024	BRL	\$	1.185	0	(2)	0,00
	01.2024	HUF		203	0	(2)	0,00
	01.2024	IDR		100	0	0	0,00
	03.2024	CNY		1.833	0	(8)	0,00
	03.2024	ILS		40	0	0	0,00
	03.2024	\$	IDR	1.543.250	0	0	0,00
	04.2024		BRL	5.826	4	4	0,00
	06.2024	KRW	\$	1.579	0	(1)	0,00
DUB	01.2024	CAD	€	1.389	0	(9)	0,00
	01.2024	KRW	\$	50	0	0	0,00
GLM	01.2024	€	¥	201.891	46	0	0,01
	01.2024		\$	1.930	0	(41)	0,00
	01.2024	£	€	5.891	58	0	0,01
	01.2024	\$	MXN	21.907	21	0	0,00
	01.2024		ZAR	23.670	23	0	0,00
JPM	01.2024	£	€	1.009	0	0	0,00
	01.2024	HUF	\$	950	0	(11)	0,00
	01.2024	\$	IDR	2.308.050	0	0	0,00
	01.2024		KRW	64.807	0	0	0,00
	02.2024		BRL	9.072	13	0	0,00
	03.2024	CNH	\$	116	0	(2)	0,00
	06.2024	KRW		50	0	0	0,00
MBC	01.2024	€	£	869	0	(5)	0,00
	01.2024	\$	€	33.522	305	0	0,03
MYI	01.2024	€	\$	3.193	0	(42)	0,00
	01.2024	HUF		590	0	(9)	0,00
	01.2024	\$	€	1.044	13	0	0,00
	02.2024		CNY	254	0	0	0,00
	03.2024		IDR	1.549.650	1	0	0,00
RBC	03.2024	TWD	\$	468	0	(11)	0,00
SCX	01.2024	CAD	€	7.045	0	(143)	(0,02)
	01.2024	£		28.193	2	(49)	(0,01)
	01.2024	\$	MXN	12.224	20	0	0,00
	03.2024	CNY	\$	1.086	0	(2)	0,00
	03.2024	TWD		4.122	0	(113)	(0,01)
	03.2024	\$	IDR	13.653.162	5	0	0,00
	03.2024		INR	102.444	2	0	0,00
SSB	03.2024	TWD	\$	1.291	0	(24)	0,00
	03.2024	\$	INR	122.308	2	0	0,00
UAG	01.2024		MXN	1.834	3	0	0,00
	03.2024		INR	97.446	2	0	0,00
				€ 699	€ (610)	€ 89	0,01

Summe OTC-Finanzderivate

€ (668) (0,07)

Summe Anlagen

€ 991.235 107,28

Sonstige Aktiva und Passiva

€ (67.266) (7,28)

Nettovermögen

€ 923.969 100,00

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

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

- Wertpapier per Emissionstermin.
- Nullkuponwertpapier.
- Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Long Average Duration Fund (Forts.)

(e) Mit dem Fonds verbunden.

(f) Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von EUR 10.903 (31. Dezember 2022: EUR null) wurde zum 31. Dezember 2023 als Sicherheit gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte verpfändet.

(g) Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von EUR 84 (31. Dezember 2022: EUR null) und Barmittel in Höhe von EUR null (31. Dezember 2022: EUR 190) wurden zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten für Finanzderivate gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. verpfändet.

Barmittel in Höhe von EUR 743 (31. Dezember 2022: EUR null) wurden zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte erhalten.

Barmittel in Höhe von EUR 20.472 (31. Dezember 2022: EUR 4.192) wurden zum 31. Dezember 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 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	€ 888.522	€ 2.083	€ 890.605
Investmentfonds	38.073	0	0	38.073
Pensionsgeschäfte	0	52.334	0	52.334
Finanzderivate ⁽³⁾	9.008	1.215	0	10.223
Summen	€ 47.081	€ 942.071	€ 2.083	€ 991.235

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

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

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BRC	3,250 %	13.07.2023	TBD ⁽¹⁾	€ (5.175)	€ (5.254)	(0,57)
	3,250	31.07.2023	TBD ⁽¹⁾	(5.159)	(5.231)	(0,56)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					€ (10.485)	(1,13)

⁽¹⁾ Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC-Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
AZD	€ (14)	€ 0	€ (14)	€ k. A.	€ k. A.	€ k. A.
BOA	(96)	84	(12)	(20)	0	(20)
BPS	108	0	108	(57)	190	133
BRC	45	0	45	(84)	0	(84)
CBK	(426)	0	(426)	(44)	0	(44)
DUB	(9)	0	(9)	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	(3)	0	(3)	(46)	0	(46)
GST	(230)	0	(230)	(68)	0	(68)
JPM	k. A.	k. A.	k. A.	(85)	0	(85)
MBC	300	(470)	(170)	3	0	3
MYC	k. A.	k. A.	k. A.	4	0	4
MYI	(37)	0	(37)	33	0	33
RBC	(11)	0	(11)	27	0	27
RYL	k. A.	k. A.	k. A.	(3)	0	(3)
SCX	(278)	0	(278)	(8)	0	(8)
SSB	(22)	0	(22)	167	0	167
UAG	5	0	5	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. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	84,69	87,44
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	11,18	7,03
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,52	k. A.
Investmentfonds	4,12	4,49
Pensionsgeschäfte	5,66	1,36
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,74	(6,40)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,44	(7,11)
OTC-Finanzderivate	(0,07)	(0,16)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(1,13)	k. A.

* Gemäß der Liste der Märkte, die die Kriterien für einen geregelten OGAW-Markt erfüllen, in Anlage 1 zum Verkaufsprospekt.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	1,42	7,89
US-Regierungsbehörden	7,63	5,28
US-Schatzobligationen	3,94	3,51
Non-Agency-MBS	4,56	12,44
Forderungsbesicherte Wertpapiere	8,81	10,28
Staatsemissionen	69,23	53,89
Kurzfristige Instrumente	0,80	1,18
Investmentfonds	4,12	4,49
Pensionsgeschäfte	5,66	1,36
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,74	(6,40)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	k. A.	(0,09)
Zinsswaps	0,44	(7,02)
OTC-Finanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	k. A.	0,33
Verkaufsoptionen		
Devisenoptionen	k. A.	(0,04)
Zinsswapoptionen	(0,08)	(0,74)
Devisenterminkontrakte	0,01	0,29
Sonstige Aktiva und Passiva	(7,28)	13,35
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Short-Term Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE											
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL											
BANKEN UND FINANZEN											
American Honda Finance Corp. 6,094 % fällig am 22.11.2024	\$ 500	€453	0,23	Federation des Caisses Desjardins du Quebec 0,010 % fällig am 08.04.2026	€ 900	€ 842	0,44	3,629 % fällig am 06.04.2026	€ 1.700	€ 1.715	0,89
American Tower Corp. 0,450 % fällig am 15.01.2027	€ 600	549	0,28	2,000 % fällig am 31.08.2026	900	878	0,45	4,800 % fällig am 15.09.2025	\$ 400	360	0,19
1,375 % fällig am 04.04.2025	1.100	1.068	0,55	Hamburg Commercial Bank AG 1,375 % fällig am 27.05.2025	1.500	1.458	0,75	6,553 % fällig am 14.09.2026	600	547	0,28
ANZ New Zealand International Ltd. 0,895 % fällig am 23.03.2027	1.000	939	0,49	5,560 % fällig am 05.12.2025	600	600	0,31	Toronto-Dominion Bank 0,864 % fällig am 24.03.2027	€ 1.000	938	0,49
AyT Cedula de Cajas Fondo de Titulizacion de Activos 3,750 % fällig am 30.06.2025	1.100	1.104	0,57	Hana Bank 0,010 % fällig am 26.01.2026	1.000	937	0,48	3,250 % fällig am 27.04.2026	900	905	0,47
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 2,125 % fällig am 26.11.2025	919	898	0,46	3,750 % fällig am 04.05.2026	1.400	1.417	0,73	UniCredit Bank Czech Republic & Slovakia A/S 3,625 % fällig am 15.02.2026	900	906	0,47
2,875 % fällig am 16.07.2024	2.500	2.482	1,28	ING Bank Australia Ltd. 4,700 % fällig am 08.12.2025	AUD 2.400	1.484	0,77	Vseobecná Uverova Banka A/S 3,500 % fällig am 13.10.2026	900	908	0,47
Banco BPM SpA 1,500 % fällig am 02.12.2025	500	485	0,25	5,158 % fällig am 26.05.2025	1.200	743	0,38	Wells Fargo & Co. 1,338 % fällig am 04.05.2025	1.470	1.455	0,75
3,875 % fällig am 18.09.2026	900	917	0,47	ING Groep NV 0,125 % fällig am 29.11.2025	€ 300	290	0,15	Westpac Securities NZ Ltd. 1,777 % fällig am 14.01.2026	900	876	0,45
Banco Santander S.A. 4,734 % fällig am 21.11.2024	200	201	0,10	JAB Holdings BV 1,750 % fällig am 25.06.2026	700	675	0,35			87.660	45,29
Banco Santander Totta S.A. 3,750 % fällig am 11.09.2026	900	916	0,47	Komerční Banka A/S 0,010 % fällig am 20.01.2026	800	750	0,39	INDUSTRIEWERTE			
Bank of America Corp. 4,962 % fällig am 24.08.2025	1.600	1.607	0,83	Kookmin Bank 2,375 % fällig am 27.01.2026	1.000	984	0,51	Burberry Group PLC 1,125 % fällig am 21.09.2025	£ 1.100	1.189	0,61
Bank of Montreal 0,125 % fällig am 26.01.2027	1.000	918	0,47	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,375 % fällig am 09.03.2026	600	574	0,30	Carrier Global Corp. 4,375 % fällig am 29.05.2025	€ 500	505	0,26
1,000 % fällig am 05.04.2026	900	861	0,45	2,875 % fällig am 29.05.2026	600	605	0,31	Coca-Cola HBC Finance BV 1,000 % fällig am 14.05.2027	400	375	0,19
Bank of Nova Scotia 0,010 % fällig am 14.01.2027	1.000	917	0,47	Landesbank Baden-Wuerttemberg 2,000 % fällig am 24.02.2025	\$ 1.200	1.050	0,54	Comcast Corp. 0,250 % fällig am 20.05.2027	400	367	0,19
Banque Federative du Credit Mutuel S.A. 5,720 % fällig am 26.01.2025	£ 1.200	1.382	0,71	Liberty Mutual Finance Europe DAC 1,750 % fällig am 27.03.2024	€ 1.600	1.590	0,82	DH Europe Finance SARL 0,200 % fällig am 18.03.2026	400	376	0,19
Barclays PLC 3,375 % fällig am 02.04.2025	€ 600	598	0,31	Lloyds Bank PLC 0,125 % fällig am 18.06.2026	900	841	0,44	Eni SpA 3,625 % fällig am 19.05.2027	300	305	0,16
Bendigo & Adelaide Bank Ltd. 4,020 % fällig am 04.10.2026	900	923	0,48	Lloyds Banking Group PLC 0,500 % fällig am 12.11.2025	900	874	0,45	Haleon Netherlands Capital BV 1,250 % fällig am 29.03.2026	700	672	0,35
BNP Paribas S.A. 0,500 % fällig am 15.07.2025	1.200	1.178	0,61	3,500 % fällig am 01.04.2026	700	698	0,36	Heineken NV 3,625 % fällig am 15.11.2026	200	203	0,10
BNZ International Funding Ltd. 0,625 % fällig am 03.07.2025	2.700	2.595	1,34	Lseg Netherlands BV 4,125 % fällig am 29.09.2026	400	411	0,21	JDE Peet's NV 0,000 % fällig am 16.01.2026 (a)	800	748	0,39
CaixaBank S.A. 0,375 % fällig am 03.02.2025	900	869	0,45	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 0,500 % fällig am 01.10.2026	1.000	936	0,48	Medtronic Global Holdings S.C.A. 1,125 % fällig am 07.03.2027	400	378	0,20
4,625 % fällig am 16.05.2027	700	715	0,37	Mitsubishi HC Capital UK PLC 0,250 % fällig am 03.02.2025	1.000	961	0,50	Netflix, Inc. 3,625 % fällig am 15.05.2027	700	710	0,37
Canadian Imperial Bank of Commerce 0,010 % fällig am 07.10.2026	1.000	923	0,48	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 2,264 % fällig am 14.06.2025	600	595	0,31	Sandoz Finance BV 3,970 % fällig am 17.04.2027	300	306	0,16
0,375 % fällig am 10.03.2026	1.000	944	0,49	3,273 % fällig am 19.09.2025	900	895	0,46	Sartorius Finance BV 4,250 % fällig am 14.09.2026	800	819	0,42
3,250 % fällig am 31.03.2027	900	908	0,47	National Australia Bank Ltd. 5,820 % fällig am 17.06.2026	£ 600	693	0,36	Tesco Corporate Treasury Services PLC 0,875 % fällig am 29.05.2026	1.200	1.138	0,59
Cedulas TDA Fondo de Titulizacion de Activos 3,875 % fällig am 23.05.2025	2.800	2.816	1,45	National Bank of Canada 0,010 % fällig am 29.09.2026	€ 1.000	926	0,48			8.091	4,18
Cie de Financement Foncier S.A. 0,375 % fällig am 09.04.2027	1.000	926	0,48	0,125 % fällig am 27.01.2027	1.000	920	0,48	VERSORGUNGSUNTERNEHMEN			
Citigroup, Inc. 6,780 % fällig am 24.05.2025	\$ 1.700	1.543	0,80	Nationwide Building Society 4,473 % fällig am 10.11.2025	500	501	0,26	BP Capital Markets PLC 1,573 % fällig am 16.02.2027	400	382	0,20
Clydesdale Bank PLC 0,010 % fällig am 22.09.2026	€ 500	460	0,24	5,264 % fällig am 10.11.2026	\$ 900	830	0,43	Cadent Finance PLC 0,625 % fällig am 22.09.2024	500	488	0,25
Commonwealth Bank of Australia 0,500 % fällig am 27.07.2026	1.000	940	0,49	NatWest Group PLC 0,750 % fällig am 15.11.2025	€ 300	292	0,15	EnBW International Finance BV 3,625 % fällig am 22.11.2026	700	713	0,37
4,928 % fällig am 09.12.2026	\$ 2.600	2.360	1,22	7,472 % fällig am 10.11.2026	€ 700	656	0,34	Enel Finance International NV 0,000 % fällig am 28.05.2026 (a)	600	557	0,29
Coventry Building Society 0,125 % fällig am 20.06.2026	€ 1.000	932	0,48	Nomura Holdings, Inc. 2,648 % fällig am 16.01.2025	1.500	1.318	0,68	Fortum Oyj 1,625 % fällig am 27.02.2026	1.200	1.157	0,60
Credit Agricole Italia SpA 0,625 % fällig am 13.01.2026	900	857	0,44	Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % fällig am 01.10.2024	DKK 13.500	1.780	0,92	GAS Networks Ireland 0,125 % fällig am 04.12.2024	600	580	0,30
Credit Suisse AG 5,185 % fällig am 31.05.2024	1.600	1.606	0,83	PKO Bank Hipoteczny S.A. 2,125 % fällig am 25.06.2025	€ 1.000	981	0,51	Orsted A/S 3,625 % fällig am 01.03.2026	300	302	0,15
Credit Suisse Schweiz AG 3,390 % fällig am 05.12.2025	700	701	0,36	Prima Banka Slovensko A/S 4,250 % fällig am 06.10.2025	900	913	0,47	Verizon Communications, Inc. 0,875 % fällig am 08.04.2027	400	374	0,19
Deutsche Bank S.A. Espanola 3,625 % fällig am 23.11.2026	500	509	0,26	Royal Bank of Canada 0,010 % fällig am 21.01.2027	1.000	917	0,47	Vodafone Group PLC 0,900 % fällig am 24.11.2026	400	380	0,20
Deutsche Börse AG 3,875 % fällig am 28.09.2026	300	307	0,16	0,625 % fällig am 23.03.2026	900	855	0,44			4.933	2,55
Deutsche Pfandbriefbank AG 6,220 % fällig am 26.04.2024	£ 1.500	1.733	0,90	Santander UK Group Holdings PLC 6,833 % fällig am 21.11.2026	\$ 400	369	0,19	Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		100.684	52,02
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank, Frankfurt am Main 4,637 % fällig am 16.11.2026	€ 600	601	0,31	Societe Generale S.A. 1,125 % fällig am 23.01.2025	€ 400	389	0,20	NON-AGENCY-MBS			
				Sparebanken Soer Boligkredit A/S 0,010 % fällig am 26.10.2026	900	833	0,43	Atlas Funding PLC 6,120 % fällig am 25.07.2025	£ 1.122	1.296	0,67
				Standard Chartered PLC 1,214 % fällig am 23.03.2025 (c)	€ 1.500	1.349	0,70	Barley Hill PLC 6,118 % fällig am 27.08.2025	382	439	0,23
				Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0,267 % fällig am 18.06.2026	€ 1.000	929	0,48				
				3,602 % fällig am 16.02.2026	690	694	0,36				
				Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 2,550 % fällig am 10.03.2025	\$ 200	176	0,09				

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Cheshire PLC				FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				4,513 % fällig am 21.04.2036	2.542	2.549	1,32
6,120 % fällig am 20.08.2045	£ 637	€ 735	0,38	Accunia European CLO DAC				Silver Arrow S.A.			
Dilosk RMBS DAC				4,863 % fällig am 20.01.2031	2.924	2.897	1,50	4,273 % fällig am 15.02.2030	520	521	0,27
4,863 % fällig am 20.07.2061	€ 763	765	0,39	4,895 % fällig am 15.10.2030	202	202	0,10	4,313 % fällig am 15.09.2030	472	473	0,24
Domi BV				Asset-Backed European Securitisation Transaction				Toro European CLO DAC			
4,775 % fällig am 15.06.2051	90	90	0,05	Twenty-One BV				4,705 % fällig am 15.10.2030	371	368	0,19
4,882 % fällig am 15.11.2052	818	820	0,42	4,553 % fällig am 21.09.2031	471	472	0,24	Willow Park CLO DAC			
Dutch Property Finance BV				Autonorica FCT				4,805 % fällig am 15.01.2031	800	796	0,41
4,652 % fällig am 28.04.2059	576	574	0,30	4,346 % fällig am 26.01.2043	719	719	0,37		25.671	13,26	
4,702 % fällig am 28.10.2059	1.212			Bavarian Sky S.A.							
		1.212	0,63	4,269 % fällig am 20.03.2030	588	589	0,30	STAATSEMISSIONEN			
Eurosail PLC				Bavarian Sky UK PLC				Cassa Depositi e Prestiti SpA			
6,289 % fällig am 13.06.2045	£ 544	625	0,32	5,818 % fällig am 20.04.2031	£ 700	€ 810	0,42	5,750 % fällig am 05.05.2026	\$ 800	€ 724	0,37
Formentera Issuer PLC				Black Diamond CLO DAC				Land Nordrhein-Westfalen			
6,020 % fällig am 28.07.2047	1.133			4,853 % fällig am 20.01.2032	€ 121	120	0,06	3,150 % fällig am 20.11.2026	€ 600	610	0,32
		1.306	0,67	BlueMountain Fuji EUR CLO DAC				Ville de Paris			
Harbour Energy PLC				4,615 % fällig am 15.07.2030	494	491	0,25	0,010 % fällig am 02.01.2024	600	600	0,31
6,020 % fällig am 28.01.2054	489	565	0,29	BNPP AM Euro CLO DAC					1.934	1,00	
Hops Hill PLC				4,565 % fällig am 15.04.2031	200	197	0,10				
6,148 % fällig am 27.05.2054	302	349	0,18	Cairn CLO DAC				KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
Kinbane DAC				4,552 % fällig am 30.04.2031	946	935	0,48	COMMERCIAL PAPER			
4,685 % fällig am 25.09.2062	1.168			Cars Alliance Auto Loans Germany				Banco Santander S.A.			
	€	1.158	0,60	4,354 % fällig am 18.03.2035	900	902	0,47	4,045 % fällig am 06.06.2024	600	590	0,31
Lanebrook Mortgage Transaction PLC				Citizen Irish Auto Receivables Trust DAC				Bayer AG			
6,320 % fällig am 12.06.2057	£ 459	531	0,27	4,623 % fällig am 15.12.2032	538	541	0,28	4,279 % fällig am 30.08.2024	800	780	0,40
Mansard Mortgages PLC				Cumulus Static CLO DAC				SGS Nederland Holding BV			
5,989 % fällig am 15.12.2049	470	535	0,28	5,499 % fällig am 25.04.2033	300	300	0,16	4,339 % fällig am 15.01.2024	600	599	0,31
Mortimer BTL PLC				CVC Cordatus Loan Fund DAC				4,339 % fällig am 22.01.2024	600	599	0,31
0,000 % fällig am 22.12.2056	500	578	0,30	4,652 % fällig am 21.07.2030	533	527	0,27	4,481 % fällig am 24.01.2024	600	598	0,31
Precise Mortgage Funding PLC				Euro-Galaxy CLO DAC					3.166	1,64	
6,126 % fällig am 16.10.2056	28	33	0,02	4,693 % fällig am 11.04.2031	518	513	0,27				
Residential Mortgage Securities PLC				FCT CA Leasing				SCHATZWECHSEL DES EUROPÄISCHEN STABILITÄTSMESCHANISMUS			
6,470 % fällig am 20.06.2070	54	62	0,03	4,736 % fällig am 26.02.2042	480	481	0,25	3,873 % fällig am 08.02.2024 (a)(b)	110	110	0,06
Rochester Financing PLC				Ginkgo Auto Loans							
5,920 % fällig am 18.12.2044	640	733	0,38	4,576 % fällig am 25.07.2043	500	501	0,26	FRANZÖSISCHE SCHATZWECHSEL			
Stanlington PLC				Ginkgo Personal Loans				3,859 % fällig am 04.04.2024 (a)(b)	640	634	0,33
6,170 % fällig am 12.06.2045	715	825	0,43	4,666 % fällig am 23.09.2044	700	702	0,36	3,867 % fällig am 04.04.2024 (a)(b)	2.780	2.754	1,42
Stratton BTL Mortgage Funding PLC				Ginkgo Sales Finance					3.388	1,75	
5,951 % fällig am 20.01.2054	643	740	0,38	4,576 % fällig am 25.11.2049	589	591	0,31				
Stratton Mortgage Funding PLC				Harvest CLO DAC				UNGARISCHE SCHATZWECHSEL			
5,920 % fällig am 12.12.2043	303	347	0,18	4,566 % fällig am 26.06.2030	1.059	1.047	0,54	10,900 % fällig am 04.01.2024 (a)(b)	HUF 132.000	345	0,18
6,069 % fällig am 25.09.2051	2.025			4,695 % fällig am 15.01.2031	782	776	0,40				
		2.336	1,21	Jubilee CLO DAC				JAPANISCHE SCHATZWECHSEL			
Towd Point Mortgage Funding PLC				4,575 % fällig am 15.04.2030	94	94	0,05	(0,238) % fällig am 15.01.2024 (a)(b)	¥ 92.000	591	0,30
5,891 % fällig am 20.10.2051	1.700			Man GLG Euro CLO DAC				(0,226) % fällig am 15.01.2024 (a)(b)	268.000	1.721	0,89
		1.955	1,01	4,645 % fällig am 15.10.2030	536	533	0,28	(0,217) % fällig am 19.02.2024 (a)(b)	531.000	3.410	1,76
6,365 % fällig am 20.10.2051	656	758	0,39	4,835 % fällig am 15.01.2030	105	105	0,05	(0,198) % fällig am 19.02.2024 (a)(b)	59.000	379	0,20
6,570 % fällig am 20.05.2045	390	450	0,23	OCP Euro CLO DAC				(0,184) % fällig am 11.03.2024 (a)(b)	222.000	1.426	0,74
6,571 % fällig am 20.07.2045	572	662	0,34	4,785 % fällig am 15.01.2032	601	598	0,31	(0,177) % fällig am 11.03.2024 (a)(b)	248.000	1.593	0,82
6,690 % fällig am 20.02.2045	1.987			OZLME DAC					9.120	4,71	
		2.287	1,18	4,723 % fällig am 24.08.2030	1.428	1.414	0,73	SCHWEIZER SCHATZWECHSEL			
Tudor Rose Mortgages				Palmer Square European Loan Funding DAC				1,625 % fällig am 29.02.2024 (a)(b)	CHF 3.800	4.077	2,11
5,820 % fällig am 20.06.2048	1.276			0,000 % fällig am 15.05.2033	500	499	0,26	1,636 % fällig am 22.02.2024 (a)(b)	800	859	0,44
		1.465	0,76	4,685 % fällig am 15.10.2031	521	513	0,27		4.936	2,55	
Twin Bridges PLC				4,695 % fällig am 15.07.2031	710	702	0,36	Summe kurzfristige Instrumente		21.065	10,89
6,432 % fällig am 15.05.2056	500	578	0,30	4,745 % fällig am 15.04.2031	220	217	0,11	Summe übertragbare Wertpapiere	€ 174.163	89,99	
		24.809	12,82	PBD Germany Auto Lease Master S.A., Compartment							
				4,576 % fällig am 26.11.2030	883	885	0,46				
				Pony S.A. Compartment German Auto Loans							
				4,502 % fällig am 14.11.2032	500	501	0,26				
				Retail Automotive CP Germany UG							
				4,553 % fällig am 21.07.2034	589	590	0,30				
				Revocar UG							

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
BPS	3,650 %	29.12.2023	02.01.2024	€ 12.400	Bpifrance SACA 3,000 % fällig am 10.09.2026	€ (12.736)	€ 12.400	€ 12.405	6,41
Summe Pensionsgeschäfte						€ (12.736)	€ 12.400	€ 12.405	6,41

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Short-Term Fund (Forts.)

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month Euribor September Futures	Short	09.2025	78	€ (61)	(0,03)
3-Month Euribor September Futures	Long	09.2026	78	48	0,02
Euro-Bobl March Futures	Short	03.2024	118	(221)	(0,11)
Euro-Schatz March Futures	Short	03.2024	430	(290)	(0,15)
				€ (524)	(0,27)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				€ (524)	(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 INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2024	\$ 1.000	€ 0	0,00
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate				€ 0	0,00

⁽¹⁾ Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der jeweiligen Swap-Vereinbarung 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 als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, wie in den Bedingungen der jeweiligen Swap-Vereinbarung definiert.

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

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

DEWISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2024	¥ 740.000	€ 4.774	€ 16	€ 0	€ 16	0,01
BPS	01.2024	AUD 3.408	€ 2.056	€ 0	€ (49)	€ (49)	(0,03)
	01.2024	CHF 3.835	€ 4.022	€ 0	€ (104)	€ (104)	(0,05)
	01.2024	€ 643	\$ 702	€ 0	€ (8)	€ (8)	(0,01)
	01.2024	£ 410	€ 476	€ 2	€ 0	€ 2	0,00
	01.2024	HUF 18.239	\$ 52	€ 0	€ (1)	€ (1)	0,00
	01.2024	\$ 219	€ 200	€ 2	€ 0	€ 2	0,00
BRC	01.2024	2	HUF 819	€ 0	€ 0	€ 0	0,00
	01.2024	€ 887	£ 769	€ 0	€ 0	€ 0	0,00
	01.2024	£ 126	€ 145	€ 0	€ 0	€ 0	0,00
CBK	01.2024	\$ 377	€ 341	€ 0	€ 0	€ 0	0,00
	01.2024	CHF 673	€ 701	€ 0	€ (23)	€ (23)	(0,01)
	01.2024	HUF 3.152	\$ 9	€ 0	€ 0	€ 0	0,00
DUB	01.2024	\$ 30	CAD 41	€ 1	€ 0	€ 1	0,00
GLM	01.2024	€ 885	¥ 142.940	€ 33	€ 0	€ 33	0,02
JPM	01.2024	HUF 89.152	\$ 254	€ 0	€ (3)	€ (3)	0,00
MBC	01.2024	€ 679	£ 582	€ 0	€ (7)	€ (7)	0,00
	01.2024	HUF 21.822	\$ 62	€ 0	€ (1)	€ (1)	0,00
	01.2024	¥ 75.200	€ 479	€ 0	€ (4)	€ (4)	0,00
	01.2024	\$ 14.178	12.895	€ 64	€ 0	€ 64	0,03
	10.2024	DKK 13.040	1.755	€ 1	€ 0	€ 1	0,00
	01.2024	€ 2.402	¥ 380.000	€ 41	€ 0	€ 41	0,02
SCX	01.2024	£ 23.845	€ 27.464	€ 0	€ (49)	€ (49)	(0,03)
UAG	01.2024	€ 241	£ 208	€ 0	€ (1)	€ (1)	0,00
	02.2024	¥ 590.000	€ 3.698	€ 0	€ (112)	€ (112)	(0,05)
	03.2024	470.000	2.944	€ 0	€ (97)	€ (97)	(0,05)
				€ 160	€ (459)	€ (299)	(0,15)
Summe OTC-Finanzderivate						€ (299)	(0,15)
Summe Anlagen						€ 185.740	95,98
Sonstige Aktiva und Passiva						€ 7.774	4,02
Nettovermögen						€ 193.514	100,00

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

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

- (a) Nullkuponwertpapier.
 (b) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
 (c) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,48 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Standard Chartered PLC	1,214 %	23.03.2025	24.10.2022	€ 1.455	€ 1.349	0,70

Barmittel in Höhe von EUR 1.368 (31. Dezember 2022: EUR 6.376) wurden zum 31. Dezember 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von EUR 260 (31. Dezember 2022: EUR 20) wurden zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten für Finanzderivate gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 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	€ 174.163	€ 0	€ 174.163
Pensionsgeschäfte	0	12.400	0	12.400
Finanzderivate ⁽³⁾	(524)	(299)	0	(823)
Summen	€ (524)	€ 186.264	€ 0	€ 185.740

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

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

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

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC-Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
BOA	€ 16	€ 0	€ 16	€ 57	€ 0	€ 57
BPS	(158)	0	(158)	(9)	0	(9)
BRC	k. A.	k. A.	k. A.	(9)	0	(9)
CBK	(23)	0	(23)	77	0	77
DUB	1	0	1	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	33	0	33	k. A.	k. A.	k. A.
JPM	(3)	0	(3)	31	0	31
MBC	53	0	53	371	(230)	141
MYI	k. A.	k. A.	k. A.	(25)	0	(25)
RBC	41	0	41	(190)	20	(170)
SCX	(49)	0	(49)	1.972	(1.890)	82
UAG	(210)	260	50	(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. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	84,63	82,88
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	5,05	10,78
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,31	k. A.
Pensionsgeschäfte	6,41	3,99
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,27)	0,70
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,00	(0,45)
OTC-Finanzderivate	(0,15)	0,63

* Gemäß der Liste der Märkte, die die Kriterien für einen geregelten OGAW-Markt erfüllen, in Anlage 1 zum Verkaufsprospekt.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	52,02	56,35
US-Regierungsbehörden	k. A.	1,90
Non-Agency-MBS	12,82	14,24
Forderungsbesicherte Wertpapiere	13,26	6,88
Staatsemissionen	1,00	3,88
Kurzfristige Instrumente	10,89	10,41
Pensionsgeschäfte	6,41	3,99
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,27)	0,70
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Zinsswaps	k. A.	(0,45)
OTC-Finanzderivate		
Devisenterminkontrakte	(0,15)	0,63
Sonstige Aktiva und Passiva	4,02	1,47
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				
ÖSTERREICH				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
ams-OSRAM AG 10,500 % fällig am 30.03.2029	€ 1.600	€ 1.741	0,47	
Erste Group Bank AG 4,250 % fällig am 15.10.2027 (e)(g)	600	515	0,14	
Summe Österreich		2.256	0,61	
BELGIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
KBC Group NV 8,000 % fällig am 05.09.2028 (e)(g)	800	851	0,23	
Ontex Group NV 3,500 % fällig am 15.07.2026	2.200	2.128	0,58	
Summe Belgien		2.979	0,81	
CHINA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Yango Justice International Ltd. 8,250 % fällig am 25.11.2023 ^	\$ 300	2	0,00	
TSCHECHISCHE REPUBLIK				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
EP Infrastructure A/S 1,816 % fällig am 02.03.2031	€ 4.300	3.338	0,91	
FRANKREICH				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Accor S.A. 7,250 % fällig am 11.01.2029 (e)	700	763	0,21	
Altarea S.C.A. 1,875 % fällig am 17.01.2028	2.200	1.854	0,50	
Altice France S.A. 2,125 % fällig am 15.02.2025	1.200	1.160	0,32	
	500	483	0,13	
	1.400	1.115	0,30	
	1.200	963	0,26	
	1.000	799	0,22	
	700	626	0,17	
11,500 % fällig am 01.02.2027 (a)(h)	1.500	1.511	0,41	
BNP Paribas S.A. 7,750 % fällig am 16.08.2029 (e)(g)	\$ 900	834	0,23	
8,500 % fällig am 14.08.2028 (e)(g)	500	475	0,13	
CAB SELAS 3,375 % fällig am 01.02.2028	€ 1.900	1.698	0,46	
Cerba Healthcare SACA 3,500 % fällig am 31.05.2028	2.400	2.016	0,55	
Crown European Holdings S.A. 4,750 % fällig am 15.03.2029	1.300	1.327	0,36	
Electricité de France S.A. 2,625 % fällig am 01.12.2027 (e)	1.000	892	0,24	
	3.600	3.347	0,91	
	1.400	1.280	0,35	
	1.000	880	0,24	
	600	596	0,16	
	€ 100	106	0,03	
	2.200	2.479	0,67	
	\$ 200	203	0,05	
ELO SACA 6,000 % fällig am 22.03.2029	€ 300	305	0,08	
Eramet S.A. 7,000 % fällig am 22.05.2028	1.300	1.331	0,36	
Forvia SE 2,750 % fällig am 15.02.2027	4.400	4.223	1,14	
iliad S.A. 5,375 % fällig am 14.06.2027	2.700	2.780	0,76	
	1.400	1.440	0,39	
Loxam S.A.S. 2,875 % fällig am 15.04.2026	500	486	0,13	
	200	200	0,05	
	300	286	0,08	
	2.100	2.192	0,60	

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES
DEUTSCHLAND				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Ubisoft Entertainment S.A. 0,878 % fällig am 24.11.2027	€ 2.100	€ 1.793	0,49	
Unibail-Rodamco-Westfield SE 7,250 % fällig am 03.07.2028 (e)	900	903	0,25	
Vallourec SACA 8,500 % fällig am 30.06.2026	750	756	0,21	
Summe Frankreich		42.102	11,44	
DEUTSCHLAND				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Bayer AG 7,000 % fällig am 25.09.2083	2.500	2.587	0,70	
Cheplapharm Arzneimittel GmbH 3,500 % fällig am 11.02.2027	800	776	0,21	
	\$ 700	600	0,16	
	€ 1.400	1.495	0,41	
Clearstream Banking AG 0,000 % fällig am 01.12.2025 (c)	100	95	0,02	
Commerzbank AG 4,000 % fällig am 05.12.2030	2.000	1.968	0,53	
	100	106	0,03	
	£ 1.300	1.598	0,43	
CT Investment GmbH 5,500 % fällig am 15.04.2026	€ 800	797	0,22	
Ctec GmbH 5,250 % fällig am 15.02.2030	100	90	0,02	
Deutsche Bank AG 5,625 % fällig am 19.05.2031	500	507	0,14	
	\$ 300	279	0,08	
Douglas GmbH 6,000 % fällig am 08.04.2026	€ 2.300	2.280	0,62	
IHO Verwaltungs GmbH (3,875 % bar oder 4,625 % PIK) 3,875 % fällig am 15.05.2027 (b)	1.300	1.277	0,35	
IHO Verwaltungs GmbH (6,375 % bar oder 7,125 % PIK) 6,375 % fällig am 15.05.2029 (b) \$ 1.100	978	0,26		
IHO Verwaltungs GmbH (8,750 % bar oder 9,500 % PIK) 8,750 % fällig am 15.05.2028 (b) € 500	546	0,15		
Nidda Healthcare Holding GmbH 7,500 % fällig am 01.08.2026	2.800	2.891	0,79	
PrestigeBidCo GmbH 9,965 % fällig am 15.07.2027	500	509	0,14	
ProGroup AG 3,000 % fällig am 31.03.2026	2.100	2.047	0,56	
Schaeffler AG 3,375 % fällig am 12.10.2028	2.300	2.234	0,61	
TK Elevator Holdco GmbH 6,625 % fällig am 15.07.2028	900	834	0,23	
TK Elevator Midco GmbH 4,375 % fällig am 15.07.2027	2.100	2.037	0,55	
ZF Finance GmbH 2,000 % fällig am 06.05.2027	700	649	0,18	
	500	460	0,12	
	2.700	2.576	0,70	
	200	207	0,06	
Summe Deutschland		30.423	8,27	
IRLAND				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
AIB Group PLC 6,250 % fällig am 23.06.2025 (e)(g)	900	894	0,24	
Bank of Ireland Group PLC 6,750 % fällig am 01.03.2033	200	216	0,06	
	£ 600	723	0,20	
James Hardie International Finance DAC 3,625 % fällig am 01.10.2026	€ 200	198	0,05	
Permanent TSB Group Holdings PLC 3,000 % fällig am 19.08.2031	1.200	1.136	0,31	
Summe Irland		3.167	0,86	
ISRAEL				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Energian Israel Finance Ltd. 8,500 % fällig am 30.09.2033	\$ 2.000	1.736	0,47	

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES
ITALIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 1,875 % fällig am 09.01.2026	€ 2.900	€ 2.758	0,75	
	500	488	0,13	
	1.300	1.331	0,36	
	900	902	0,25	
	100	110	0,03	
Cerved Group SpA 6,000 % fällig am 15.02.2029	1.400	1.282	0,35	
FIS Fabbrica Italiana Sintetici SpA 5,625 % fällig am 01.08.2027	700	655	0,18	
Inter Media and Communication SpA 6,750 % fällig am 09.02.2027	800	773	0,21	
Intesa Sanpaolo SpA 4,198 % fällig am 01.06.2032	\$ 4.200	3.139	0,85	
5,875 % fällig am 01.09.2031 (e)(g)	€ 800	724	0,20	
Italmatch Chemicals SpA 9,393 % fällig am 06.02.2028	100	100	0,03	
	400	414	0,11	
Mundys SpA 1,875 % fällig am 12.02.2028	3.300	3.040	0,83	
Nexi SpA 2,125 % fällig am 30.04.2029	4.400	3.895	1,06	
Telecom Italia SpA 1,625 % fällig am 18.01.2029	600	520	0,14	
	3.000	2.812	0,77	
	2.000	2.135	0,58	
	4.800	5.346	1,45	
UniCredit SpA 5,459 % fällig am 30.06.2035	\$ 1.600	1.364	0,37	
	400	373	0,10	
Summe Italien		32.161	8,75	
JAPAN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
SoftBank Group Corp. 2,875 % fällig am 06.01.2027	€ 300	281	0,08	
	300	270	0,07	
	600	550	0,15	
	2.200	2.189	0,60	
Summe Japan		3.290	0,90	
JERSEY, KANALINSELN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
CPUK Finance Ltd. 4,875 % fällig am 28.02.2047	£ 1.600	1.793	0,49	
G City Europe Ltd. 4,250 % fällig am 11.09.2025	€ 700	645	0,17	
Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd. 3,250 % fällig am 12.11.2025	1.900	1.727	0,47	
Summe Jersey, Kanalinseln		4.165	1,13	
LUXEMBURG				
WANDELANLEIHEN & WECHSEL				
Corestate Capital Holding S.A. (8,000 % bar oder 9,000 % PIK) 8,000 % fällig am 31.12.2026 ^ (b)	43	23	0,01	
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Albion Financing SARL 5,250 % fällig am 15.10.2026	800	802	0,22	
Altice Financing S.A. 3,000 % fällig am 15.01.2028	1.900	1.702	0,46	
	400	356	0,10	
Altice France Holding S.A. 8,000 % fällig am 15.05.2027	450	260	0,07	
ARD Finance S.A. (5,000 % bar oder 5,750 % PIK) 5,000 % fällig am 30.06.2027 (b)	350	176	0,05	
ARD Finance S.A. (6,500 % bar oder 7,250 % PIK) 6,500 % fällig am 30.06.2027 (b) \$ 500	212	0,06		
Cidron Aida Finco SARL 5,000 % fällig am 01.04.2028	€ 600	579	0,16	
	£ 1.700	1.857	0,51	

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

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Cirsa Finance International SARL 4,500 % fällig am 15.03.2027	€ 4.100	€ 3.958	1,08	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV 1,875 % fällig am 31.03.2027	€ 6.200	€ 5.658	1,54	SCHWEIZ			
8,448 % fällig am 31.07.2028	250	254	0,07	3,750 % fällig am 09.05.2027	100	97	0,03	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
CPI Property Group S.A. 4,875 % fällig am 16.07.2025 (e)	300	89	0,02	7,375 % fällig am 15.09.2029	1.300	1.426	0,39	UBS Group AG 6,442 % fällig am 11.08.2028	\$ 1.550	€ 1.458	0,40
4,875 % fällig am 18.08.2026 (e)	300	90	0,02	United Group BV 3,625 % fällig am 15.02.2028	800	744	0,20	9,016 % fällig am 15.11.2033	600	668	0,18
Ephios Subco SARL 7,875 % fällig am 31.01.2031	900	933	0,25	4,000 % fällig am 15.11.2027	1.200	1.139	0,31	9,250 % fällig am 13.11.2028 (e)(g)	250	245	0,07
InPost S.A. 2,250 % fällig am 15.07.2027	700	652	0,18	Wintershall Dea Finance BV 2,499 % fällig am 20.04.2026 (e)	4.100	3.733	1,01	Summe Schweiz		2.371	0,65
LHMC Finco 2 SARL (7,250 % bar oder 8,000 % PIK) 7,250 % fällig am 02.10.2025 (b)	416	414	0,11	ZF Europe Finance BV 2,000 % fällig am 23.02.2026	500	478	0,13	GROSSBRITANNIEN			
Loarre Investments SARL 6,500 % fällig am 15.05.2029	2.400	2.371	0,64	3,000 % fällig am 23.10.2029	100	92	0,02	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Logicor Financing SARL 0,625 % fällig am 17.11.2025	200	187	0,05	6,125 % fällig am 13.03.2029	1.400	1.492	0,40	Barclays PLC 8,875 % fällig am 15.09.2027 (e)(g)	€ 600	692	0,19
2,250 % fällig am 13.05.2025	2.400	2.326	0,63	Ziggo BV 4,875 % fällig am 15.01.2030	\$ 400	323	0,09	9,625 % fällig am 15.12.2029 (e)(g)	\$ 600	566	0,15
Monitchem HoldCo S.A. 8,750 % fällig am 01.05.2028	400	410	0,11			33.933	9,22	BCP Modular Services Finance PLC 4,750 % fällig am 30.11.2028	€ 2.000	1.863	0,51
PLT Finance SARL 4,625 % fällig am 05.01.2026	1.400	1.396	0,38	KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				6,750 % fällig am 30.11.2029	500	413	0,11
Stena International S.A. 3,750 % fällig am 01.02.2025	400	399	0,11	Nouryon Finance BV 8,182 % fällig am 03.04.2028	€ 944	947	0,26	Bellis Acquisition Co. PLC 3,250 % fällig am 16.02.2026	€ 3.100	3.329	0,90
Summer BC Holdco SARL 5,750 % fällig am 31.10.2026	750	721	0,20	Summe Niederlande		34.880	9,48	Burford Capital PLC 5,000 % fällig am 01.12.2026	1.500	1.625	0,44
Telecom Italia Capital S.A. 6,375 % fällig am 15.11.2033	\$ 700	621	0,17	NORWEGEN				Deuce Finco PLC 5,500 % fällig am 15.06.2027	1.600	1.727	0,47
Trafigura Funding S.A. 3,875 % fällig am 02.02.2026	€ 700	669	0,18	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Gatwick Airport Finance PLC 4,375 % fällig am 07.04.2026	3.200	3.550	0,96
		21.434	5,83	PANAMA				Harbour Energy PLC 5,500 % fällig am 15.10.2026	\$ 1.400	1.240	0,34
Summe Luxemburg		21.457	5,84	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Heathrow Finance PLC 3,875 % fällig am 01.03.2027	€ 400	427	0,12
MULTINATIONAL				Carnival Corp. 7,000 % fällig am 15.08.2029	\$ 100	95	0,03	4,125 % fällig am 01.09.2029	1.214	1.215	0,33
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				SPANIEN				Iceland Bondco PLC 4,375 % fällig am 15.05.2028	100	97	0,03
Ardagh Packaging Finance PLC 2,125 % fällig am 15.08.2026	2.800	2.504	0,68	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				INEOS Finance PLC 2,125 % fällig am 15.11.2025	€ 500	485	0,13
Clarios Global LP 4,375 % fällig am 15.05.2026	900	896	0,24	Aedas Homes Opco SLU 4,000 % fällig am 15.08.2026	€ 700	663	0,18	2,875 % fällig am 01.05.2026	900	874	0,24
Summe multinational		3.400	0,92	Banco Santander S.A. 4,375 % fällig am 14.01.2026 (e)(g)	800	738	0,20	INEOS Quattro Finance PLC 2,500 % fällig am 15.01.2026	2.600	2.525	0,69
NIEDERLANDE				CaixaBank S.A. 5,875 % fällig am 09.10.2027 (e)(g)	600	583	0,16	8,500 % fällig am 15.03.2029	200	212	0,06
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Cellnex Finance Co. S.A. 2,000 % fällig am 15.09.2032	800	686	0,18	John Lewis PLC 4,250 % fällig am 18.12.2034	€ 540	453	0,12
ABN AMRO Bank NV 4,750 % fällig am 22.09.2027 (e)(g)	700	641	0,17	Grifols S.A. 2,250 % fällig am 15.11.2027	300	283	0,08	6,125 % fällig am 21.01.2025	400	461	0,12
Boels Topholding BV 6,250 % fällig am 15.02.2029	900	943	0,26	3,200 % fällig am 01.05.2025	3.600	3.532	0,96	Lloyds Banking Group PLC 4,947 % fällig am 27.06.2025 (e)(g)	€ 700	684	0,19
Citycon Treasury BV 1,250 % fällig am 08.09.2026 (i)	2.300	2.012	0,55	3,875 % fällig am 15.10.2028	1.600	1.466	0,40	7,500 % fällig am 27.09.2025 (e)(g)	\$ 600	533	0,14
Cooperatieve Rabobank UA 4,875 % fällig am 29.06.2029 (e)(g)	600	543	0,15	Grupo Antolin-Irausa S.A. 3,500 % fällig am 30.04.2028	1.700	1.300	0,35	Market Bidco Finco PLC 4,750 % fällig am 04.11.2027	€ 1.300	1.169	0,32
CTP NV 0,500 % fällig am 21.06.2025	1.600	1.509	0,41	Lorca Telecom Bondco S.A. 4,000 % fällig am 18.09.2027	1.800	1.762	0,48	5,500 % fällig am 04.11.2027	€ 1.500	1.530	0,42
Dufry One BV 2,000 % fällig am 15.02.2027	1.800	1.688	0,46	Summe Spanien		11.013	2,99	Pinnacle Bidco PLC 8,250 % fällig am 11.10.2028	€ 1.700	1.772	0,48
3,625 % fällig am 15.04.2026 CHF	1.700	1.822	0,49	SCHWEDEN				10,000 % fällig am 11.10.2028	€ 1.500	1.804	0,49
Energizer Gamma Acquisition BV 3,500 % fällig am 30.06.2029	€ 1.700	1.471	0,40	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				SIG PLC 5,250 % fällig am 30.11.2026	€ 200	181	0,05
GTCR W-2 Merger Sub LLC 8,500 % fällig am 15.01.2031	£ 2.200	2.753	0,75	Akelius Residential Property AB 2,249 % fällig am 17.05.2081	1.300	1.098	0,30	Thames Water Kemble Finance PLC 4,625 % fällig am 19.05.2026	£ 300	177	0,05
ING Groep NV 3,875 % fällig am 16.05.2027 (e)(g)	\$ 700	516	0,14	Castellum AB 3,125 % fällig am 02.12.2026 (e)	1.600	1.221	0,33	Travis Perkins PLC 3,750 % fällig am 17.02.2026	700	763	0,21
IPD BV 8,000 % fällig am 15.06.2028	€ 1.300	1.392	0,38	Dometic Group AB 2,000 % fällig am 29.09.2028	900	790	0,21	Virgin Media Secured Finance PLC 4,250 % fällig am 15.01.2030	5.000	5.060	1,38
OI European Group BV 6,250 % fällig am 15.05.2028	1.100	1.155	0,31	3,000 % fällig am 08.05.2026	500	493	0,13	Vmed O2 UK Financing PLC 3,250 % fällig am 31.01.2031	€ 700	646	0,17
Q-Park Holding BV 3,500 % fällig am 01.02.2025	1.200	1.161	0,32	Intrum AB 4,875 % fällig am 15.08.2025	1.400	1.313	0,36	4,000 % fällig am 31.01.2029	£ 1.600	1.641	0,45
Sagax Euro MTN NL BV 1,000 % fällig am 17.05.2029	100	82	0,02	9,250 % fällig am 15.03.2028 (i)	1.700	1.560	0,42	4,250 % fällig am 31.01.2031	\$ 200	158	0,04
Sigma Holdco BV 5,750 % fällig am 15.05.2026	900	810	0,22	Verisure Holding AB 3,250 % fällig am 15.02.2027	3.600	3.466	0,94	Zenith Finco PLC 6,500 % fällig am 30.06.2027	£ 800	754	0,20
Summer BidCo BV (9,000 % bar oder 9,750 % PIK) 9,000 % fällig am 15.11.2025 (b)	254	253	0,07	3,875 % fällig am 15.07.2026	2.000	1.969	0,54	Summe Großbritannien		40.921	11,13
				Verisure Midholding AB 5,250 % fällig am 15.02.2029	600	574	0,16	KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG			
				Summe Schweden		12.484	3,39	Lorca Holdco Ltd. 7,604 % fällig am 17.09.2027	€ 2.300	2.295	0,63
								Summe Großbritannien		40.921	11,13
								USA			
								UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
								American Airlines Pass-Through Trust 3,375 % fällig am 01.11.2028	\$ 892	740	0,20
								3,700 % fällig am 01.04.2028	1.740	1.467	0,40

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖG ENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖG ENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖG ENS
AT&T, Inc. 2,875 % fällig am 02.03.2025 (e)	€ 4.100	€ 3.950	1,07	Olympus Water U.S. Holding Corp. 3,875 % fällig am 01.10.2028	€ 2.900	€ 2.666	0,73	3,867 % fällig am 08.02.2024 (c)(d)	€ 300	€ 299	0,08
Avantor Funding, Inc. 3,875 % fällig am 15.07.2028	900	884	0,24	Organon & Co. 2,875 % fällig am 30.04.2028	2.000	1.842	0,50	3,869 % fällig am 08.02.2024 (c)(d)	2.940	2.929	0,80
Boxer Parent Co., Inc. 6,500 % fällig am 02.10.2025	600	601	0,16	Rio Oil Finance Trust 8,200 % fällig am 06.04.2028	\$ 1.275	1.183	0,32			12.953	3,53
Burford Capital Global Finance LLC 9,250 % fällig am 01.07.2031	\$ 300	289	0,08	SCIL LLC 9,500 % fällig am 15.07.2028 (i)	€ 600	641	0,18	FRANZÖSISCHE SCHATZWECHSEL			
Chemours Co. 4,000 % fällig am 15.05.2026	€ 1.600	1.580	0,43	Spectrum Brands, Inc. 4,000 % fällig am 01.10.2026	2.600	2.573	0,70	3,816 % fällig am 04.01.2024 (c)(d)	800	800	0,22
Coty, Inc. 3,875 % fällig am 15.04.2026	2.100	2.101	0,57	Standard Industries, Inc. 2,250 % fällig am 21.11.2026	3.300	3.131	0,85	3,818 % fällig am 04.01.2024 (c)(d)	2.010	2.010	0,55
Credit Suisse AG AT1 Claim	\$ 800	87	0,02	UGI International LLC 2,500 % fällig am 01.12.2029	1.400	1.196	0,33	3,823 % fällig am 04.01.2024 (c)(d)	1.280	1.280	0,35
Ford Motor Credit Co. LLC 3,625 % fällig am 17.06.2031	1.700	1.328	0,36	Venture Global LNG, Inc. 8,125 % fällig am 01.06.2028	\$ 900	824	0,22	3,853 % fällig am 04.04.2024 (c)(d)	500	495	0,13
Freedom Mortgage Corp. 12,000 % fällig am 01.10.2028	1.100	1.088	0,30	8,375 % fällig am 01.06.2031	900	815	0,22	3,854 % fällig am 14.02.2024 (c)(d)	300	299	0,08
Gap, Inc. 3,875 % fällig am 01.10.2031	900	672	0,18	WVG Acquisition Corp. 2,250 % fällig am 15.08.2031	€ 1.500	1.320	0,36	3,867 % fällig am 04.04.2024 (c)(d)	940	931	0,25
Graphic Packaging International LLC 2,625 % fällig am 01.02.2029	€ 200	186	0,05	Summe USA		33.438	9,09			18.768	5,11
IQVIA, Inc. 2,250 % fällig am 15.03.2029	800	735	0,20	KURZFRISTIGE INSTRUMENTE				AKTIEN			
Kronos International, Inc. 3,750 % fällig am 15.09.2025	1.600	1.539	0,42	SCHATZWECHSEL DES EUROPÄISCHEN				INVESTMENTFONDS			
				STABILITÄTSMECHANISMUS				BÖRSENGEHANDELTE FONDS			
				3,711 % fällig am 25.01.2024 (c)(d)	2.900	2.893	0,79	PIMCO ETFs plc - PIMCO			
				3,849 % fällig am 23.05.2024 (c)(d)	6.930	6.832	1,86	Euro Short Maturity			
								UCITS ETF (f)			
								184.900	18.291	4,97	
								Summe Investmentfonds			
								€ 18.291	4,97		
								Summe kurzfristige Instrumente			
								Summe übertragbare Wertpapiere			
								€ 306.261	83,27		

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft ⁽¹⁾	% des Nettovermö- gens
BPS	3,500 %	29.12.2023	02.01.2024	€ 30.300	Belgium Government International Bond 0,650 % fällig am 22.06.2071	€ (29.918)	€ 30.300	€ 30.312	8,24
Summe Pensionsgeschäfte						€ (29.918)	€ 30.300	€ 30.312	8,24

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl March Futures	Long	03.2024	165	€ 319	0,09
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Long	03.2024	1	0	0,00
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Long	03.2024	1	11	0,00
Euro-Schatz March Futures	Long	03.2024	591	384	0,11
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Short	03.2024	20	(38)	(0,01)
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Short	03.2024	136	(327)	(0,09)
U.S. Treasury 10-Year Ultra March Futures	Short	03.2024	29	(135)	(0,04)
United Kingdom Long Gilt March Futures	Long	03.2024	27	218	0,06
				€ 432	0,12
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				€ 432	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-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermö- gens
Cellnex Telecom S.A.	5,000 %	20.12.2030	€ 4.400	€ 212	0,05
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5,000	20.12.2027	100	22	0,01
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5,000	20.06.2028	1.000	70	0,02
United Group BV	5,000	20.12.2027	700	177	0,05
				€ 481	0,13

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
iTraxx Crossover 40 5-Year Index	5,000 %	20.12.2028	€ 35.300	€ 1.600	0,44

ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,250 %	20.03.2054	£ 400	€ (71)	(0,02)
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	5,000	20.03.2029	1.500	(99)	(0,03)
Zahlung ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	5,500	20.03.2026	4.400	70	0,02
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,000	16.12.2025	\$ 3.800	317	0,09
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,000	16.12.2030	3.000	447	0,12
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.06.2027	800	22	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,841	31.10.2024	1.300	(17)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,973	27.10.2024	1.300	(15)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,018	24.10.2024	1.300	(15)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,088	07.11.2024	400	(4)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,140	25.10.2024	1.300	(13)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,190	25.10.2024	1.300	(13)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,225	25.10.2024	1.300	(13)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,547	09.03.2033	€ 1.500	53	0,01
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	20.03.2054	200	(21)	(0,01)
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,250	20.03.2029	11.200	476	0,13
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,500	20.03.2026	1.100	15	0,00
					€ 1.119	0,30
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					€ 3.200	0,87

(1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der jeweiligen Swap-Vereinbarung 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 als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, wie in den Bedingungen der jeweiligen Swap-Vereinbarung definiert.

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

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

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

VERKAUFSOPTIONEN

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,721 %	08.04.2024	100	€ 0	€ 0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,721	08.04.2024	100	(1)	(1)	0,00
							€ (1)	€ (1)	0,00

(1) Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS		1,000 %	20.06.2027	€ 600	€ (81)	€ 69	€ (12)	0,00
GST	Deutsche Bank AG	5,000	20.06.2028	600	(12)	70	58	0,01
	EP Infrastructure A/S				€ (93)	€ 139	€ 46	0,01

(1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der jeweiligen Swap-Vereinbarung 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 als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, wie in den Bedingungen der jeweiligen Swap-Vereinbarung definiert.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BOA	01.2024	€ 373	£ 321	€ 0	€ (2)	€ (2)	0,00
BPS	01.2024	€ 866	\$ 945	€ 0	€ (11)	€ (11)	0,00
	01.2024	£ 1.252	€ 1.453	€ 8	€ 0	€ 8	0,00
	01.2024	\$ 457	€ 416	€ 3	€ 0	€ 3	0,00
GLM	01.2024	CHF 1.517	€ 1.577	€ 0	€ (55)	€ (55)	(0,02)
	01.2024	\$ 264	€ 241	€ 2	€ 0	€ 2	0,00
MBC	01.2024	€ 28.521	€ 25.944	€ 131	€ 0	€ 131	0,05
SCX	01.2024	£ 30.513	€ 35.144	€ 0	€ (62)	€ (62)	(0,02)
				€ 144	€ (130)	€ 14	0,01
Summe OTC-Finanzderivate						€ 59	0,02
Summe Anlagen						€ 358.543	97,49
Sonstige Aktiva und Passiva						€ 9.224	2,51
Nettovermogen						€ 367.767	100,00

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

- (a) Wertpapier per Emissionstermin.
 (b) Wertpapier mit Sachwertausschuttung.
 (c) Nullkuponwertpapier.
 (d) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfalligkeit dar.
 (e) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nachsten vertraglichen Kundigungstermin dar.
 (f) Mit dem Fonds verbunden.
 (g) Bedingt wandelbares Wertpapier.
 (h) Eingeschrankte Wertpapiere (31. Dezember 2022: null):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Falligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermogens
Altice France S.A.	11,500 %	01.02.2027	20.12.2023	€ 1.455	€ 1.511	0,41

- (i) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von EUR 1.895 (31. Dezember 2022: EUR null) wurden zum 31. Dezember 2023 Wertpapiere als Sicherheiten gema den Rahmenvertragen und/oder globalen Rahmenvertragen fur Pensionsgeschafte verpfandet.

Barmittel in Hohe von EUR 9.183 (31. Dezember 2022: EUR 2.986) wurden zum 31. Dezember 2023 als Sicherheit fur borsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfandet.

Barmittel in Hohe von EUR 20 (31. Dezember 2022: EUR null) wurden zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten fur Finanzderivate gema den Rahmenvertragen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. verpfandet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Markten notierte Kurse fur identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Ubertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 306.261	€ 0	€ 306.261
Investmentfonds	18.291	0	0	18.291
Pensionsgeschafte	0	30.300	0	30.300
Finanzderivate ⁽³⁾	932	2.759	0	3.691
Summen	€ 19.223	€ 339.320	€ 0	€ 358.543

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 Markten notierte Kurse fur identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Ubertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 157.222	€ 0	€ 157.222
Investmentfonds	8.700	0	0	8.700
Pensionsgeschafte	0	3.700	0	3.700
Finanzderivate ⁽³⁾	(769)	1.671	0	902
Summen	€ 7.931	€ 162.593	€ 0	€ 170.524

⁽¹⁾ Zwecks zusatzlicher Informationen siehe Erlauterung 3 in den Erlauterungen zum Abschluss.

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

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

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensionsgeschäften		% des Nettovermögens
					€	€	
BPS	4,500 %	22.11.2023	TBD ⁽¹⁾	€ (598)	€ (601)	(0,17)	
MYI	0,750 3,000	02.08.2023 02.08.2023	TBD ⁽¹⁾ TBD ⁽¹⁾	(632) (614)	(638) (619)	(0,17) (0,17)	
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					€ (1.858)	(0,51)	

⁽¹⁾ Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC-Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement ⁽¹⁾
BOA	€ (2)	€ 0	€ (2)	€ (11)	€ 0	€ (11)
BPS	(12)	20	8	(22)	0	(22)
BRC	k. A.	k. A.	k. A.	80	0	80
CBK	k. A.	k. A.	k. A.	19	0	19
GLM	(54)	0	(54)	(198)	0	(198)
GST	58	0	58	k. A.	k. A.	k. A.
MBC	131	(260)	(129)	230	0	230
MYI	k. A.	k. A.	k. A.	(8)	0	(8)
SCX	(62)	0	(62)	207	0	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. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	75,86	80,86
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	7,39	8,16
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,02	1,26
Investmentfonds	4,97	5,00
Pensionsgeschäfte	8,24	2,12
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,12	(0,40)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,87	0,74
OTC-Finanzderivate	0,02	0,17
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,51)	k. A.

* Gemäß der Liste der Märkte, die die Kriterien für einen geregelten OGAW-Markt erfüllen, in Anlage 1 zum Verkaufsprospekt.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Österreich	0,61	k. A.
Belgien	0,81	k. A.
Cayman-Inseln	k. A.	0,02
China	0,00	0,01
Tschechische Republik	0,91	1,23
Dänemark	k. A.	1,34
Frankreich	11,44	12,16
Deutschland	8,27	6,94
Irland	0,86	1,03
Insel Man	k. A.	1,03
Israel	0,47	k. A.
Italien	8,75	8,16
Japan	0,90	0,97
Jersey, Kanalinseln	1,13	1,28
Luxemburg	5,84	8,62
Multinational	0,92	0,53
Niederlande	9,48	6,59
Norwegen	0,49	k. A.
Panama	0,03	0,74
Spanien	2,99	2,40
Schweden	3,39	4,04
Schweiz	0,65	0,90
Großbritannien	11,13	12,74
USA	9,09	8,45
Kurzfristige Instrumente	5,11	11,10
Investmentfonds	4,97	5,00
Pensionsgeschäfte	8,24	2,12

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,12	(0,40)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,13	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,44	0,17
Zinsswaps	0,30	0,57
OTC-Finanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Zinsswapoptionen	0,00	(0,12)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,01	(0,02)
Devisenterminkontrakte	0,01	0,31
Sonstige Aktiva und Passiva	2,51	2,09
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO European Short-Term Opportunities Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE												
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL												
BANKEN UND FINANZEN												
ABN AMRO Bank NV				1,000 % fällig am 01.10.2053	DKK	2	0,00	Glenbeigh Issuer DAC				
4,375 % fällig am 22.09.2025 (d)(f) €	800	€ 767	0,59	1,500 % fällig am 01.10.2053		273	0,02	4,666 % fällig am 24.06.2050	€ 256	€ 256	0,20	
Banco Santander S.A.				2,000 % fällig am 01.10.2053	37.231	3.804	2,91	Harbour Energy PLC				
3,625 % fällig am 21.03.2029 (d)(f)	600	450	0,35	3,000 % fällig am 01.10.2053	29	4	0,00	6,020 % fällig am 28.01.2054	£ 489	565	0,43	
Bank of Ireland Group PLC				5,000 % fällig am 01.10.2053	20.800	2.807	2,15	Harmony French Home Loans				
7,500 % fällig am 19.05.2025 (d)(f)	300	305	0,23	Santander UK Group Holdings PLC				4,606 % fällig am 27.05.2062	€ 299	300	0,23	
Barclays PLC				6,534 % fällig am 10.01.2029 \$	800	750	0,57	Hops Hill PLC				
2,885 % fällig am 31.01.2027	900	886	0,68	Sirius Real Estate Ltd.				6,498 % fällig am 27.11.2054	£ 281	326	0,25	
Cooperatieve Rabobank UA				1,125 % fällig am 22.06.2026	€ 400	362	0,28	Jubilee Place BV				
4,875 % fällig am 29.06.2029 (d)(f)	200	181	0,14	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.				4,985 % fällig am 17.10.2057	€ 165	166	0,13	
Credit Suisse AG				3,629 % fällig am 06.04.2026	400	404	0,31	Landmark Mortgage Securities PLC				
5,185 % fällig am 31.05.2024	900	903	0,69	Virgin Money UK PLC				5,620 % fällig am 17.04.2044	£ 523	587	0,45	
Credit Suisse AG AT1 Claim				4,625 % fällig am 29.10.2028	500	500	0,38	Lanebrook Mortgage Transaction PLC				
Credit Suisse Schweiz AG				Volkswagen Bank GmbH				5,871 % fällig am 20.07.2058	450	516	0,40	
3,390 % fällig am 05.12.2025	€ 900	902	0,69	1,875 % fällig am 31.01.2024	2.700	2.695	2,06	6,320 % fällig am 12.06.2057	321	372	0,29	
CTP NV				Volkswagen Leasing GmbH				Miravet SARL				
0,500 % fällig am 21.06.2025	800	754	0,58	4,500 % fällig am 25.03.2026	400	409	0,31	4,806 % fällig am 26.05.2065	€ 452	448	0,34	
0,625 % fällig am 27.09.2026	500	450	0,34	Westpac Banking Corp.				Polaris PLC				
Deutsche Bank AG				3,457 % fällig am 04.04.2025	700	701	0,54	5,985 % fällig am 23.12.2058	£ 607	699	0,54	
3,875 % fällig am 12.02.2024	£ 500	576	0,44				5,995 % fällig am 23.10.2059	364	418	0,32		
DVI Deutsche Vermoögens- & Immobilienverwaltungs GmbH						33.568	25,70	Precise Mortgage Funding PLC				
2,500 % fällig am 25.01.2027	€ 1.400	1.206	0,92	INDUSTRIEWERTE				6,420 % fällig am 12.12.2055	194	224	0,17	
Ford Motor Credit Co. LLC				GN Store Nord A/S				Primrose Residential DAC				
1,744 % fällig am 19.07.2024	400	394	0,30	0,875 % fällig am 25.11.2024	1.300	1.246	0,95	4,626 % fällig am 24.03.2061	€ 2.337	2.330	1,78	
2,748 % fällig am 14.06.2024	£ 900	1.025	0,79	Prosus NV				4,876 % fällig am 24.10.2061	714	710	0,54	
Goldman Sachs Group, Inc.				3,257 % fällig am 19.01.2027	\$ 1.100	920	0,71	Residential Mortgage Securities PLC				
4,956 % fällig am 07.02.2025	€ 1.100	1.101	0,84	Silfin NV				6,470 % fällig am 20.06.2070	£ 375	433	0,33	
ING Groep NV				2,875 % fällig am 11.04.2027	€ 700	657	0,50	Resloc UK PLC				
4,875 % fällig am 16.05.2029 (d)(f) \$	200	150	0,12				2,823	2,16	5,499 % fällig am 15.12.2043	247	276	0,21
Jyske Realkredit A/S				VERSORGUNGSUNTERNEHMEN				Stanlington PLC				
0,500 % fällig am 01.10.2040	DKK 0	0	0,00	Electricite de France S.A.				6,170 % fällig am 12.06.2045	429	495	0,38	
1,000 % fällig am 01.10.2050	1	0	0,00	2,625 % fällig am 01.12.2027 (d)	800	713	0,55	Stratton Mortgage Funding PLC				
1,000 % fällig am 01.10.2053	0	0	0,00	2,875 % fällig am 15.12.2026 (d)	1.000	930	0,71	5,920 % fällig am 12.12.2043	424	486	0,37	
1,500 % fällig am 01.10.2050	0	0	0,00					6,069 % fällig am 25.09.2051	798	920	0,70	
LeasePlan Corp. NV						1.643	1,26	6,120 % fällig am 12.03.2052	458	529	0,41	
3,500 % fällig am 09.04.2025	€ 1.200	1.200	0,92	Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		38.034	29,12	6,121 % fällig am 20.07.2060	1.453	1.677	1,28	
Liberty Living Finance PLC				US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				Towd Point Mortgage Funding PLC				
2,625 % fällig am 28.11.2024	£ 1.200	1.347	1,03	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				5,891 % fällig am 20.10.2051	500	575	0,44	
Lloyds Banking Group PLC				4,000 % fällig am 01.02.2054 \$	3.050	2.614	2,00	6,570 % fällig am 20.05.2045	584	675	0,52	
6,942 % fällig am 07.08.2027	\$ 600	544	0,42	4,500 % fällig am 01.02.2054	10.100	8.869	6,79	6,571 % fällig am 20.07.2045	260	301	0,23	
Logicor Financing SARL				6,000 % fällig am 01.02.2054	2.900	2.666	2,04	Tower Bridge Funding PLC				
0,750 % fällig am 15.07.2024	€ 700	684	0,52			14.149	10,83	6,000 % fällig am 20.11.2063	500	576	0,44	
NatWest Group PLC				US-SCHATZOBIGATIONEN				Trinity Square PLC				
3,073 % fällig am 22.05.2028	\$ 200	168	0,13	U.S. Treasury Inflation Protected Securities (c)				6,070 % fällig am 15.07.2059	679	783	0,60	
4,269 % fällig am 22.03.2025	300	271	0,21	0,125 % fällig am 15.07.2031	1.492	1.202	0,92	Tudor Rose Mortgages				
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab				0,375 % fällig am 15.07.2025	7.266	6.373	4,88	5,820 % fällig am 20.06.2048	206	236	0,18	
0,500 % fällig am 01.10.2040	DKK 0	0	0,00	0,500 % fällig am 15.01.2028	873	748	0,57	Twin Bridges PLC				
1,000 % fällig am 01.10.2050	0	0	0,00	1,625 % fällig am 15.10.2027	2.493	2.240	1,72	6,470 % fällig am 12.12.2054	450	520	0,40	
1,000 % fällig am 01.10.2053	0	0	0,00	2,375 % fällig am 15.01.2025	490	440	0,34					
1,500 % fällig am 01.10.2050	21	2	0,00			11.003	8,43	FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
1,500 % fällig am 01.10.2053	599	62	0,05	NON-AGENCY-MBS				Adagio CLO DAC				
Nova Kreditna Banka Maribor d.d.				Alba PLC				4,685 % fällig am 15.10.2031	€ 300	296	0,23	
1,875 % fällig am 27.01.2025	€ 800	796	0,61	5,509 % fällig am 15.12.2038	£ 563	633	0,48	Ares European CLO DAC				
Nova Ljubljanska Banka d.d.				Atlas Funding PLC				4,745 % fällig am 15.10.2031	494	489	0,37	
3,650 % fällig am 19.11.2029	400	352	0,27	6,348 % fällig am 20.01.2061	97	112	0,09	Armada Euro CLO DAC				
10,750 % fällig am 28.11.2032	900	983	0,75	Barley Hill PLC				4,685 % fällig am 15.07.2031	696	689	0,53	
Nykredit Realkredit A/S				6,118 % fällig am 27.08.2058	191	219	0,17	Aurium CLO DAC				
0,500 % fällig am 01.10.2040	DKK 0	0	0,00	Canterbury Finance PLC				4,635 % fällig am 16.04.2030	198	196	0,15	
1,000 % fällig am 01.01.2024	1.700	228	0,18	6,046 % fällig am 16.05.2058	421	485	0,37	4,695 % fällig am 16.01.2031	998	987	0,76	
1,000 % fällig am 01.10.2050	2	0	0,00	Charter Mortgage Funding PLC				4,966 % fällig am 23.03.2032	754	748	0,57	
1,000 % fällig am 01.10.2053	2	0	0,00	5,796 % fällig am 16.01.2057	135	156	0,12	Bain Capital Euro CLO DAC				
1,500 % fällig am 01.10.2050	0	0	0,00	Cheshire PLC				4,733 % fällig am 20.01.2032	590	583	0,45	
1,500 % fällig am 01.10.2053	1.287	119	0,09	6,120 % fällig am 20.08.2045	212	245	0,19	BBVA Consumer Auto				
2,000 % fällig am 01.10.2053	42	5	0,00	Dilosk RMBS DAC				0,270 % fällig am 20.07.2031	66	65	0,05	
3,000 % fällig am 01.10.2053	2.130	268	0,21	4,638 % fällig am 20.12.2060	€ 731	732	0,56	Black Diamond CLO DAC				
3,500 % fällig am 01.10.2053	12.494	1.624	1,24	4,752 % fällig am 20.02.2060	331	332	0,25	4,853 % fällig am 20.01.2032	363	361	0,28	
5,000 % fällig am 01.10.2053	8.727	1.175	0,90	Domi BV				4,982 % fällig am 15.05.2032	489	482	0,37	
Permanent TSB Group Holdings PLC				4,775 % fällig am 15.06.2051	126	127	0,10	BlueMountain Fuji EUR CLO DAC				
5,250 % fällig am 30.06.2025	€ 600	600	0,46	Dutch Property Finance BV				1,050 % fällig am 15.01.2031	99	94	0,07	
Realkredit Danmark A/S				4,602 % fällig am 28.07.2058	621	620	0,47	4,615 % fällig am 15.07.2030	395	393	0,30	
1,000 % fällig am 01.01.2024	DKK 4.100	550	0,42	4,652 % fällig am 28.04.2059	648	646	0,49	4,685 % fällig am 15.01.2031	596	589	0,45	
1,000 % fällig am 01.10.2050	0	0	0,00	4,702 % fällig am 28.10.2059	693	693	0,53	4,875 % fällig am 15.01.2033	800	788	0,60	
				5,202 % fällig am 28.04.2050	235	234	0,18	BNPP AM Euro CLO DAC				
								4,615 % fällig am 15.10.2031	295	292	0,22	
								4,822 % fällig am 22.07.2032	800	790	0,60	

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Bridgepoint CLO DAC	€ 300	€ 298	0,23	Marzio Finance SRL	€ 466	€ 468	0,36	Slovenia Government International Bond	€ 1.200	€ 739	0,57
5,175 % fällig am 15.01.2034				4,955 % fällig am 28.02.2048				1,175 % fällig am 13.02.2062			
Bumper UK Finance PLC	£ 55	63	0,05	Palmer Square European Loan Funding DAC	956	941	0,72	South Korea Government International Bond	500	473	0,36
5,698 % fällig am 20.12.2030				4,685 % fällig am 15.10.2031	789	780	0,60	0,000 % fällig am 16.09.2025 (a)		16.786	12,85
Carlyle Euro CLO DAC	€ 401	397	0,30	4,695 % fällig am 15.07.2031	1.170	1.157	0,89				
4,632 % fällig am 15.08.2030				5,015 % fällig am 15.10.2031							
4,665 % fällig am 15.01.2031				Red & Black Auto Italy SRL	471	473	0,36				
4,892 % fällig am 15.08.2032				4,865 % fällig am 28.07.2034							
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC	783	773	0,59	Red & Black Auto Lease France	400	401	0,31				
4,686 % fällig am 25.01.2032				4,556 % fällig am 27.06.2035							
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.	1.098	1.083	0,83	Sculptor European CLO DAC	700	690	0,53				
4,752 % fällig am 15.11.2031				4,755 % fällig am 14.01.2032							
Citizen Irish Auto Receivables Trust DAC	99	99	0,08	Segovia European CLO DAC	158	157	0,12				
4,653 % fällig am 15.12.2029				4,745 % fällig am 18.01.2031	800	790	0,60				
Contego CLO DAC	498	491	0,38	4,873 % fällig am 20.07.2032							
4,642 % fällig am 23.01.2030				Silver Arrow Merfina SRL	234	234	0,18				
CVC Cordatus Loan Fund DAC	299	294	0,23	4,559 % fällig am 20.07.2033							
4,555 % fällig am 15.09.2031	1.796	1.772	1,36	Tikehau CLO DAC	600	593	0,45				
4,615 % fällig am 15.10.2031				4,844 % fällig am 04.08.2034							
Dryden Euro CLO DAC	398	392	0,30	Toro European CLO DAC	1.000	986	0,75				
4,625 % fällig am 15.04.2033				4,812 % fällig am 15.02.2034	1.200	1.191	0,91				
Harvest CLO DAC	400	379	0,29	4,908 % fällig am 12.01.2032							
1,040 % fällig am 15.07.2031	463	458	0,35	Voya Euro CLO DAC	254	252	0,19				
4,566 % fällig am 26.06.2030	586	576	0,44	4,715 % fällig am 15.10.2030		29.601	22,67				
4,605 % fällig am 15.10.2031	1.771	1.745	1,34								
4,673 % fällig am 20.10.2031	700	690	0,53								
4,725 % fällig am 15.07.2031	1.200	1.185	0,91								
4,815 % fällig am 15.01.2032											
Man GLG Euro CLO DAC	204	203	0,16								
4,645 % fällig am 15.10.2030	573	566	0,43								
4,775 % fällig am 15.10.2032											

AKTIEN			
VORZUGSWERTPAPIERE			
Nationwide Building Society	3.504	527	0,40
10,250 %			

KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
UNGARISCHE SCHATZWECHSEL			
10,900 % fällig am			
04.01.2024 (a)(b)	HUF 116.000	303	0,23
Summe kurzfristige Instrumente		303	0,23

Summe übertragbare Wertpapiere	€ 132.036	101,09	
--------------------------------	-----------	--------	--

AKTIEN			
INVESTMENTFONDS			
BÖRSENGEHANDELTE FONDS			
PIMCO ETFs plc - PIMCO			
Euro Short Maturity	77.600	7.680	5,88
UCITS ETF (e)			
Summe Investmentfonds	€ 7.680	5,88	

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
BPS	3,500 %	29.12.2023	02.01.2024	€ 1.000	Belgium Government International Bond 0,650 % fällig am 22.06.2071	€ (987)	€ 1.000	€ 1.000	0,77
Summe Pensionsgeschäfte						€ (987)	€ 1.000	€ 1.000	0,77

⁽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
3-Month Euribor September Futures	Short	09.2025	54	€ (42)	(0,03)
3-Month Euribor September Futures	Long	09.2026	54	33	0,03
Euro-Bobl March Futures	Long	03.2024	60	116	0,09
Euro-BTP Italy Government Bond March Futures	Short	03.2024	4	(16)	(0,01)
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2024	44	(191)	(0,15)
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Short	03.2024	11	(126)	(0,10)
Euro-Schatz March Futures	Long	03.2024	260	145	0,11
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Short	03.2024	75	(110)	(0,08)
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Short	03.2024	211	(511)	(0,39)
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2024	144	538	0,41
U.S. Treasury 10-Year Ultra March Futures	Short	03.2024	79	(411)	(0,31)
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Short	03.2024	15	(125)	(0,10)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Long	03.2024	6	66	0,05
United Kingdom Long Gilt March Futures	Short	03.2024	2	(16)	(0,01)
				€ (650)	(0,49)

VERKAUFSOPTIONEN

FUTURE-STYLE-OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
Call - EUREX Euro-Bund February 2024 Futures	€ 137,000	26.01.2024	6	€ (4)	€ (8)	(0,01)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					€ (658)	(0,50)

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO European Short-Term Opportunities Fund (Forts.)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
iTraxx Crossover 40 5-Year Index	(5,000) %	20.12.2028	€ 3.000	€ (131)	(0,10)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽²⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-41 5-Year Index	1,000 %	20.12.2028	\$ 1.700	€ 10	0,01
iTraxx Europe Main 40 5-Year Index	1,000	20.12.2028	€ 5.200	26	0,02
				€ 36	0,03

ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,250 %	20.03.2054	£ 200	€ (30)	(0,02)
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,865	13.02.2054	\$ 1.200	61	0,05
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,085	13.02.2034	5.000	(96)	(0,07)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,250	20.12.2053	3.000	87	0,07
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2033	6.900	(76)	(0,06)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	20.12.2025	1.400	2	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,827	15.12.2025	2.700	(23)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	10.08.2024	€ 800	(24)	(0,02)
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,819	19.12.2034	6.800	(499)	(0,38)
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,854	19.12.2039	3.100	(421)	(0,32)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	1,700	15.03.2073	300	21	0,01
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,547	09.03.2033	700	25	0,02
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	20.03.2054	8.200	(953)	(0,73)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,804	19.05.2033	2.700	189	0,14
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.03.2034	14.650	941	0,72
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.03.2044	200	(25)	(0,02)
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,250	20.03.2029	3.500	3	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,500	20.03.2026	42.400	(676)	(0,52)
					€ (1.494)	(1,15)
					€ (1.589)	(1,22)

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

⁽¹⁾ Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der jeweiligen Swap-Vereinbarung 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, wie in den Bedingungen der jeweiligen Swap-Vereinbarung 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 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 als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, wie in den Bedingungen der jeweiligen Swap-Vereinbarung definiert.

⁽⁴⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

VERKAUFSOPTIONEN

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,750 %	16.01.2024	2.700	€ (12)	€ (34)	(0,03)
GLM	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,900	29.08.2025	7.400	(88)	(147)	(0,11)
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,900	29.08.2025	7.400	(88)	(34)	(0,02)
MYC	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,008	17.12.2029	10.900	(352)	(142)	(0,11)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,008	17.12.2029	5.500	(342)	(127)	(0,10)
							€ (882)	€ (484)	(0,37)

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	03.2024	CNH 8.360	\$ 1.163	€ 0	€ (16)	€ (16)	(0,01)
	06.2024	KRW 777.610	598	0	(7)	(7)	(0,01)
BPS	01.2024	€ 139	DKK 1.035	0	0	0	0,00
	01.2024	745	\$ 815	0	(8)	(8)	(0,01)
	01.2024	£ 88	€ 102	1	0	1	0,00
	01.2024	HUF 32.217	\$ 92	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	\$ 365	€ 334	4	0	4	0,00
	01.2024	557	ZAR 10.326	6	0	6	0,01
BRC	01.2024	DKK 1.200	€ 161	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 1.893	1.728	15	0	15	0,01
	03.2024	300	IDR 4.661.496	2	0	2	0,00
CBK	01.2024	DKK 42.500	€ 5.702	1	0	1	0,00
	01.2024	HUF 2.276	\$ 7	0	0	0	0,00
	01.2024	MXN 2	0	0	0	0	0,00
GLM	01.2024	DKK 29.080	€ 3.902	0	0	0	0,00
	01.2024	€ 323	¥ 52.188	12	0	12	0,01
	01.2024	330	\$ 356	0	(7)	(7)	(0,01)
	01.2024	\$ 75	MXN 1.314	2	0	2	0,00
JPM	01.2024	HUF 77.433	\$ 220	0	(3)	(3)	0,00
	01.2024	\$ 506	MXN 8.703	5	0	5	0,01
	02.2024	450	BRL 2.207	3	0	3	0,00
MBC	01.2024	DKK 1.300	€ 174	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 14.531	13.216	66	0	66	0,05
MYI	01.2024	€ 779	£ 670	0	(6)	(6)	0,00
	01.2024	953	\$ 1.045	0	(7)	(7)	(0,01)
	01.2024	HUF 3.976	11	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 210	€ 195	5	0	5	0,00
RBC	04.2024	0	MXN 2	0	0	0	0,00
RYL	01.2024	€ 140	£ 122	0	0	0	0,00
SCX	01.2024	CAD 1.932	€ 1.295	0	(32)	(32)	(0,02)
	01.2024	£ 16.290	18.763	0	(34)	(34)	(0,02)
	03.2024	TWD 26.892	\$ 865	0	(24)	(24)	(0,02)
	03.2024	\$ 281	INR 23.477	0	0	0	0,00
UAG	01.2024	DKK 5.715	€ 768	1	0	1	0,00
	01.2024	€ 200	£ 172	0	(1)	(1)	0,00
	03.2024	\$ 267	INR 22.331	1	0	1	0,00
				€ 124	€ (146)	€ (22)	(0,02)
Summe OTC-Finanzderivate						€ (506)	(0,39)
Summe Anlagen						€ 137.963	105,63
Sonstige Aktiva und Passiva						€ (7.353)	(5,63)
Nettovermögen						€ 130.610	100,00

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

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

- (a) Nullkuponwertpapier.
- (b) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (c) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (d) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (e) Mit dem Fonds verbunden.
- (f) Bedingt wandelbares Wertpapier.

Barmittel in Höhe von EUR 1.867 (31. Dezember 2022: EUR 3.688) wurden zum 31. Dezember 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von EUR 39 (31. Dezember 2022: EUR 1.165) wurden zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten für Finanzderivate gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 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	€ 132.036	€ 0	€ 132.036
Investmentfonds	7.680	0	0	7.680
Pensionsgeschäfte	0	1.000	0	1.000
Finanzderivate ⁽³⁾	(105)	(2.648)	0	(2.753)
Summen	€ 7.575	€ 130.388	€ 0	€ 137.963

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO European Short-Term Opportunities Fund (Forts.)

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

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

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

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC-Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	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	(23)	0	(23)	(9)	(440)	(449)
BPS	(32)	0	(32)	(397)	360	(37)
BRC	17	0	17	(93)	0	(93)
CBK	1	0	1	(65)	290	225
CLY	k. A.	k. A.	k. A.	1	0	1
GLM	(174)	0	(174)	(80)	(169)	(249)
GST	k. A.	k. A.	k. A.	(312)	253	(59)
JPM	5	0	5	(326)	262	(64)
MBC	66	0	66	(27)	0	(27)
MYC	(269)	(244)	(513)	(309)	(253)	(562)
MYI	(8)	9	1	(18)	0	(18)
RYL	k. A.	k. A.	k. A.	6	0	6
SCX	(90)	30	(60)	6	0	6
SSB	k. A.	k. A.	k. A.	391	(328)	63
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. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	89,78	78,37
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	10,88	13,20
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,43	k. A.
Investmentfonds	5,88	8,90
Pensionsgeschäfte	0,77	2,08
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,50)	0,34
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(1,22)	(0,02)
OTC-Finanzderivate	(0,39)	(0,58)

* Gemäß der Liste der Märkte, die die Kriterien für einen geregelten OGAW-Markt erfüllen, in Anlage 1 zum Verkaufsprospekt.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	29,12	39,32
US-Regierungsbehörden	10,83	5,19
US-Schatzobligationen	8,43	2,49
Non-Agency-MBS	16,56	14,49
Forderungsbesicherte Wertpapiere	22,67	15,94
Staatsemissionen	12,85	7,09
Vorzugswertpapiere	0,40	0,30
Kurzfristige Instrumente	0,23	6,75
Investmentfonds	5,88	8,90
Pensionsgeschäfte	0,77	2,08
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,49)	0,34
Verkaufsoptionen		
Future-Style-Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	(0,01)	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,10)	(0,21)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,03	0,01
Zinsswaps	(1,15)	0,18

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
OTC-Finanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	k. A.	0,48
Verkaufsoptionen		
Zinsswapoptionen	(0,37)	(1,25)
Devisenterminkontrakte	(0,02)	0,19
Sonstige Aktiva und Passiva	(5,63)	(2,29)
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Advantage Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				
ARGENTINIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Argentina Government International Bond				
0,750 % fällig am 09.07.2030	\$ 254	\$ 100	0,02	
1,000 % fällig am 09.07.2029	3	1	0,00	
3,625 % fällig am 09.07.2035	91	30	0,01	
Summe Argentinien		131	0,03	
AUSTRALIEN				
NON-AGENCY-MBS				
RESIMAC Bastille Trust				
6,390 % fällig am 05.09.2057	36	36	0,01	
STAATSEMISSIONEN				
Australia Government International Bond				
0,500 % fällig am 21.09.2026	AUD 4.100	2.575	0,60	
0,750 % fällig am 21.11.2027	2.565	1.731	0,40	
1,000 % fällig am 21.12.2030	700	397	0,09	
1,250 % fällig am 21.05.2032	500	277	0,06	
1,750 % fällig am 21.06.2051	700	282	0,07	
2,500 % fällig am 21.05.2030	500	317	0,07	
4,500 % fällig am 21.04.2033	2.100	1.495	0,35	
		7.074	1,64	
Summe Australien		7.110	1,65	
BRASILIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd.				
0,000 % fällig am 29.01.2024 (c)(f)	\$ 254	9	0,00	
BULGARIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Bulgaria Government International Bond				
4,375 % fällig am 13.05.2031	€ 1.600	1.861	0,43	
KANADA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Air Canada Pass-Through Trust				
3,300 % fällig am 15.07.2031	\$ 372	335	0,08	
Fairfax Financial Holdings Ltd.				
2,750 % fällig am 29.03.2028	€ 400	422	0,10	
Royal Bank of Canada				
4,851 % fällig am 14.12.2026	\$ 1.000	1.008	0,23	
		1.765	0,41	
STAATSEMISSIONEN				
Canada Government International Bond				
2,750 % fällig am 01.12.2033	CAD 4.000	3.073	0,71	
Canadian Government Real Return Bond				
1,500 % fällig am 01.12.2044 (e)	2.607	1.957	0,45	
		5.030	1,16	
Summe Kanada		6.795	1,57	
CAYMAN-INSELN				
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
Atlas Senior Loan Fund Ltd.				
6,745 % fällig am 15.01.2031	\$ 801	802	0,19	
6,805 % fällig am 16.01.2030	608	607	0,14	
Bain Capital Credit CLO				
6,634 % fällig am 23.04.2031	1.140	1.141	0,26	
Barings CLO Ltd.				
6,667 % fällig am 20.01.2031	1.052	1.051	0,24	
CBAM Ltd.				
6,684 % fällig am 17.04.2031	1.238	1.236	0,29	
Dryden CLO Ltd.				
6,675 % fällig am 15.04.2031	1.353	1.353	0,31	
Dryden Senior Loan Fund				
6,852 % fällig am 15.08.2030	1.143	1.143	0,26	
OCP CLO Ltd.				
6,797 % fällig am 20.07.2029	755	755	0,18	
Octagon Loan Funding Ltd.				
6,809 % fällig am 18.11.2031	1.300	1.302	0,30	

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES
Venture CLO Ltd.				
6,535 % fällig am 15.04.2027	\$ 112	\$ 112	0,03	
6,727 % fällig am 20.07.2030	1.170	1.169	0,27	
Wind River CLO Ltd.				
6,707 % fällig am 18.07.2031	1.177	1.176	0,27	
		11.847	2,74	
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Gaci First Investment Co.				
4,750 % fällig am 14.02.2030	1.400	1.402	0,32	
4,875 % fällig am 14.02.2035	1.500	1.468	0,34	
5,125 % fällig am 14.02.2053	700	635	0,15	
KSA Sukuk Ltd.				
5,268 % fällig am 25.10.2028	400	416	0,10	
QNB Finance Ltd.				
1,375 % fällig am 26.01.2026	400	370	0,09	
Sands China Ltd.				
4,300 % fällig am 08.01.2026	200	192	0,04	
5,375 % fällig am 08.08.2025	400	395	0,09	
		4.878	1,13	
Summe Cayman-Inseln		16.725	3,87	
CHILE				
STAATSEMISSIONEN				
Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos				
4,500 % fällig am 01.03.2026 CLP	1.120.000	1.262	0,29	
CHINA				
STAATSEMISSIONEN				
China Government International Bond				
3,190 % fällig am 15.04.2053	CNY 2.000	300	0,07	
KOLUMBIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Colombia Government International Bond				
7,500 % fällig am 02.02.2034	\$ 1.900	2.010	0,47	
Colombian TES				
5,750 % fällig am 03.11.2027	COP 570.000	131	0,03	
Summe Kolumbien		2.141	0,50	
TSCHECHISCHE REPUBLIK				
STAATSEMISSIONEN				
Czech Republic Government International Bond				
0,950 % fällig am 15.05.2030	CZK 12.100	458	0,11	
DÄNEMARK				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Jyske Realkredit A/S				
1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 18.440	2.101	0,49	
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	1.138	137	0,03	
2,000 % fällig am 01.10.2047	0	0	0,00	
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab				
1,000 % fällig am 01.10.2050	42.893	4.751	1,10	
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	379	46	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	14.944	1.734	0,40	
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	10.540	1.213	0,28	
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	3.548	412	0,09	
1,500 % fällig am 01.10.2053	3.301	387	0,09	

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES
2,500 % fällig am 01.04.2036	DKK 0	\$ 0	0,00	
2,500 % fällig am 01.04.2047	0	0	0,00	
Summe Dänemark		10.781	2,49	
DOMINIKANISCHE REPUBLIK				
STAATSEMISSIONEN				
Dominican Republic Government International Bond				
4,875 % fällig am 23.09.2032	\$ 600	548	0,12	
6,500 % fällig am 15.02.2048	800	767	0,18	
Summe Dominikanische Republik		1.315	0,30	
FRANKREICH				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
BNP Paribas S.A.				
3,800 % fällig am 10.01.2024	300	300	0,07	
Societe Generale S.A.				
1,488 % fällig am 14.12.2026	2.800	2.579	0,60	
6,446 % fällig am 10.01.2029	900	932	0,22	
6,691 % fällig am 10.01.2034	1.000	1.057	0,24	
		4.868	1,13	
STAATSEMISSIONEN				
France Government International Bond				
0,100 % fällig am 25.07.2031 (e)	€ 1.774	1.933	0,45	
0,250 % fällig am 25.07.2024 (e)	1.888	2.072	0,48	
0,500 % fällig am 25.05.2072	100	46	0,01	
0,750 % fällig am 25.05.2052	3.550	2.249	0,52	
1,500 % fällig am 25.05.2050	200	161	0,04	
3,000 % fällig am 25.05.2054	400	434	0,10	
3,250 % fällig am 25.05.2045	200	231	0,05	
		7.126	1,65	
Summe Frankreich		11.994	2,78	
DEUTSCHLAND				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Deutsche Bank AG				
0,050 % fällig am 20.11.2024	3.800	4.069	0,94	
1,375 % fällig am 03.09.2026	400	423	0,10	
1,375 % fällig am 17.02.2032	400	364	0,09	
1,625 % fällig am 20.01.2027	2.500	2.597	0,60	
1,750 % fällig am 19.11.2030	400	384	0,09	
3,035 % fällig am 28.05.2032 (h)	\$ 1.050	878	0,20	
Summe Deutschland		8.715	2,02	
GUATEMALA				
STAATSEMISSIONEN				
Guatemala Government International Bond				
5,375 % fällig am 24.04.2032	400	388	0,09	
UNGARN				
STAATSEMISSIONEN				
Hungary Government International Bond				
5,000 % fällig am 22.02.2027	€ 100	116	0,03	
5,375 % fällig am 12.09.2033	1.300	1.538	0,36	
6,250 % fällig am 22.09.2032	\$ 1.500	1.604	0,37	
6,750 % fällig am 25.09.2052	500	561	0,13	
Magyar Export-Import Bank				
6,125 % fällig am 04.12.2027	2.100	2.140	0,49	
Summe Ungarn		5.959	1,38	
INDONESIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara				
3,000 % fällig am 30.06.2030	3.500	3.124	0,72	
STAATSEMISSIONEN				
Indonesia Government International Bond				
8,375 % fällig am 15.03.2034	IDR 22.982.000	1.688	0,39	
Summe Indonesien		4.812	1,11	

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS	% DES
IRLAND				
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
Accunia European CLO DAC 4,915 % fällig am 15.07.2030	€	365	\$ 403	0,09
Ares European CLO DAC 4,745 % fällig am 15.10.2031	1.086	1.188	0,27	
Armada Euro CLO DAC 4,685 % fällig am 15.07.2031	398	435	0,10	
Aurium CLO DAC 4,695 % fällig am 16.01.2031	1.097	1.199	0,28	
BNPP AM Euro CLO DAC 4,822 % fällig am 22.07.2032	1.000	1.090	0,25	
Cairn CLO DAC 4,552 % fällig am 30.04.2031	379	413	0,10	
Carlyle Euro CLO DAC 4,665 % fällig am 15.01.2031	992	1.085	0,25	
Dryden Euro CLO DAC 4,625 % fällig am 15.04.2033	696	758	0,18	
4,862 % fällig am 15.05.2034	998	1.086	0,25	
GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC 4,893 % fällig am 20.01.2032	1.000	1.093	0,25	
Harvest CLO DAC 4,566 % fällig am 26.06.2030	728	795	0,18	
4,673 % fällig am 20.10.2031	787	857	0,20	
4,725 % fällig am 15.07.2031	1.100	1.198	0,28	
4,815 % fällig am 15.01.2032	1.100	1.200	0,28	
Jubilee CLO DAC 4,565 % fällig am 15.04.2030	550	602	0,14	
4,615 % fällig am 15.04.2031	400	435	0,10	
Madison Park Euro Funding DAC 4,765 % fällig am 15.07.2032	1.100	1.199	0,28	
Man GLG Euro CLO DAC 4,615 % fällig am 15.12.2031	554	605	0,14	
Oak Hill European Credit Partners DAC 4,733 % fällig am 20.10.2031	1.097	1.199	0,28	
OCP Euro CLO DAC 4,882 % fällig am 22.09.2034	800	871	0,20	
Palmer Square European Loan Funding DAC 4,695 % fällig am 15.07.2031	868	948	0,22	
Sculptor European CLO DAC 4,755 % fällig am 14.01.2032	1.100	1.198	0,28	
		19.857	4,60	
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
AerCap Ireland Capital DAC 2,450 % fällig am 29.10.2026	\$	400	370	0,08
3,000 % fällig am 29.10.2028	500	457	0,11	
		827	0,19	
Summe Irland		20.684	4,79	
ISRAEL				
STAATSEMISSIONEN				
Israel Government International Bond 1,750 % fällig am 31.08.2025	ILS	2.100	564	0,13
2,000 % fällig am 31.03.2027	2.700	713	0,17	
4,500 % fällig am 17.01.2033	\$	2.200	2.095	0,48
5,000 % fällig am 30.10.2026	€	4.200	4.748	1,10
Summe Israel		8.120	1,88	
ITALIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
AMCO - Asset Management Co. SpA 4,625 % fällig am 06.02.2027	€	600	682	0,16
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 0,875 % fällig am 08.10.2027	1.300	1.340	0,31	
6,750 % fällig am 05.09.2027	400	463	0,11	
Intesa Sanpaolo SpA 5,125 % fällig am 29.08.2031	600	708	0,16	
		3.193	0,74	
STAATSEMISSIONEN				
Cassa Depositi e Prestiti SpA 5,750 % fällig am 05.05.2026	\$	600	600	0,14
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,350 % fällig am 15.09.2024	€	23.788	26.340	6,09
(e)				

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS	% DES
ITALY Government International Bond				
6,000 % fällig am 04.08.2028	£	1.000	\$ 1.340	0,31
			28.280	6,54
Summe Italien		31.473	7,28	
ELFENBEINKÜSTE				
STAATSEMISSIONEN				
Ivory Coast Government International Bond 5,250 % fällig am 22.03.2030	€	1.600	1.593	0,37
5,875 % fällig am 17.10.2031	700	695	0,16	
Summe Elfenbeinküste		2.288	0,53	
JAPAN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Nomura Holdings, Inc. 2,329 % fällig am 22.01.2027	\$	400	367	0,09
Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0,409 % fällig am 07.11.2029	€	1.300	1.227	0,28
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 5,520 % fällig am 13.01.2028	\$	1.200	1.229	0,28
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 0,010 % fällig am 15.10.2027	€	1.000	984	0,23
			3.807	0,88
STAATSEMISSIONEN				
Japan Government International Bond 0,005 % fällig am 01.10.2024	¥	1.050.000	7.452	1,72
0,100 % fällig am 10.03.2028 (e)	907.398	6.764	1,57	
0,100 % fällig am 10.03.2029 (e)	535.115	3.999	0,93	
0,500 % fällig am 20.03.2049	238.000	1.310	0,30	
0,700 % fällig am 20.06.2051	254.000	1.432	0,33	
1,500 % fällig am 20.09.2043	360.000	2.601	0,60	
		23.558	5,45	
Summe Japan		27.365	6,33	
KASACHSTAN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
KazMunayGas National Co. JSC 3,500 % fällig am 14.04.2033	\$	1.550	1.292	0,30
5,750 % fällig am 19.04.2047	200	176	0,04	
6,375 % fällig am 24.10.2048	400	377	0,09	
Summe Kasachstan		1.845	0,43	
LUXEMBURG				
AKTIEN				
STAMMAKTIEN				
DrillCo Holding Lux S.A. (b)	6.700	166	0,04	
DrillCo Holding Lux S.A. (b)(h)	16.048	399	0,09	
Summe Stammaktien		565	0,13	
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Aroundtown S.A. 0,375 % fällig am 15.04.2027	€	700	624	0,15
CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV- SIF Pan European Core Fund 0,900 % fällig am 12.10.2029	300	276	0,06	
Chile Electricity Lux MPC SARL 6,010 % fällig am 20.01.2033	\$	1.000	1.026	0,24
CPI Property Group S.A. 1,625 % fällig am 23.04.2027	€	700	570	0,13
1,750 % fällig am 14.01.2030	300	189	0,04	
FORESEA Holding S.A. 7,500 % fällig am 15.06.2030	\$	284	263	0,06
Logicor Financing SARL 0,625 % fällig am 17.11.2025	€	200	206	0,05
0,750 % fällig am 15.07.2024	300	324	0,08	
TMS Issuer SARL 5,780 % fällig am 23.08.2032	\$	800	837	0,19
		4.315	1,00	

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS	% DES
NON-AGENCY-MBS				
Miravet SARL 4,806 % fällig am 26.05.2065	€	452	\$ 495	0,11
Summe Luxemburg			5.375	1,24
MALAYSIA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Petronas Capital Ltd. 2,480 % fällig am 28.01.2032	\$	500	427	0,10
3,500 % fällig am 21.04.2030	200	188	0,04	
4,550 % fällig am 21.04.2050	200	184	0,04	
4,800 % fällig am 21.04.2060	200	190	0,05	
			989	0,23
STAATSEMISSIONEN				
Malaysia Government International Bond 3,519 % fällig am 20.04.2028	MYR	4.621	1.004	0,23
Summe Malaysia			1.993	0,46
MULTINATIONAL				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Preferred Term Securities Ltd. 6,039 % fällig am 23.06.2035	\$	949	912	0,21
NIEDERLANDE				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Cooperatieve Rabobank UA 3,758 % fällig am 06.04.2033	400	359	0,08	
CTP NV 0,500 % fällig am 21.06.2025	€	1.100	1.146	0,27
ING Groep NV 2,125 % fällig am 23.05.2026	500	541	0,13	
Prosus NV 1,207 % fällig am 19.01.2026	1.500	1.563	0,36	
3,257 % fällig am 19.01.2027	\$	1.600	1.479	0,34
			5.088	1,18
NON-AGENCY-MBS				
Jubilee Place BV 4,985 % fällig am 17.10.2057	€	413	457	0,10
Summe Niederlande			5.545	1,28
NEUSEELAND				
STAATSEMISSIONEN				
New Zealand Government International Bond 1,500 % fällig am 15.05.2031NZD	600	314	0,07	
NORWEGEN				
STAATSEMISSIONEN				
Kommunalbanken A/S 1,900 % fällig am 19.01.2027AUD	400	255	0,06	
Norway Government International Bond 1,750 % fällig am 13.03.2025	NOK	6.000	576	0,13
Summe Norwegen			831	0,19
PERU				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Banco de Credito del Peru S.A. 4,650 % fällig am 17.09.2024	PEN	1.700	446	0,11
Credicorp Capital Sociedad Titulizadora S.A. 10,100 % fällig am 15.12.2043	4.000	1.090	0,25	
			1.536	0,36
STAATSEMISSIONEN				
Peru Government International Bond 8,200 % fällig am 12.08.2026	2.100	603	0,14	
Summe Peru			2.139	0,50
PHILIPPINEN				
STAATSEMISSIONEN				
Philippines Government International Bond 6,250 % fällig am 14.01.2036	PHP	21.000	362	0,08

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Advantage Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES
POLEN				
STAATSEMISSIONEN				
Poland Government International Bond				
3,875 % fällig am 14.02.2033	€ 1.300	\$ 1.497	0,35	
4,250 % fällig am 14.02.2043	900	1.049	0,24	
4,875 % fällig am 04.10.2033	\$ 400	406	0,09	
5,500 % fällig am 16.11.2027	100	104	0,03	
5,500 % fällig am 04.04.2053	300	314	0,07	
Summe Polen		3.370	0,78	
PORTUGAL				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Banco Espirito Santo S.A.				
4,000 % fällig am 21.01.2019 ^	€ 1.900	577	0,14	
4,750 % fällig am 15.01.2018 ^	600	182	0,04	
Summe Portugal		759	0,18	
KATAR				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
QatarEnergy				
2,250 % fällig am 12.07.2031	\$ 200	170	0,04	
3,300 % fällig am 12.07.2051	200	147	0,03	
Summe Katar		317	0,07	
RUMÄNIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Romania Government International Bond				
1,375 % fällig am 02.12.2029	€ 360	328	0,08	
1,750 % fällig am 13.07.2030	1.300	1.165	0,27	
2,000 % fällig am 28.01.2032	100	86	0,02	
2,000 % fällig am 14.04.2033	800	663	0,15	
2,124 % fällig am 16.07.2031	300	265	0,06	
2,625 % fällig am 02.12.2040	100	74	0,02	
2,750 % fällig am 14.04.2041	200	149	0,03	
2,875 % fällig am 13.04.2042	500	375	0,09	
6,375 % fällig am 18.09.2033	500	585	0,13	
6,625 % fällig am 27.09.2029	800	947	0,22	
Summe Rumänien		4.637	1,07	
RUSSLAND				
STAATSEMISSIONEN				
Russia Government International Bond				
1,125 % fällig am 20.11.2027 ^	500	224	0,05	
7,700 % fällig am 23.03.2033 ^	RUB 33.500	138	0,03	
Summe Russland		362	0,08	
SAUDI-ARABIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Saudi Arabia Government International Bond				
3,250 % fällig am 22.10.2030	\$ 200	186	0,04	
4,750 % fällig am 18.01.2028	1.200	1.214	0,28	
4,875 % fällig am 18.07.2033	1.300	1.329	0,31	
5,000 % fällig am 18.01.2053	900	850	0,20	
Summe Saudi-Arabien		3.579	0,83	
SERBIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Serbia Government International Bond				
1,650 % fällig am 03.03.2033	€ 700	574	0,14	
2,050 % fällig am 23.09.2036	400	309	0,07	
3,125 % fällig am 15.05.2027	2.500	2.647	0,61	
Summe Serbien		3.530	0,82	
SINGAPUR				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
CapitaLand Ascendas REIT				
0,750 % fällig am 23.06.2028	1.000	948	0,22	
STAATSEMISSIONEN				
Singapore Government International Bond				
2,250 % fällig am 01.08.2036	SGD 890	641	0,15	
3,375 % fällig am 01.09.2033	260	209	0,05	
		850	0,20	
Summe Singapur		1.798	0,42	

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES
SLOWENIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Nova Kreditna Banka Maribor d.d.				
1,875 % fällig am 27.01.2025	€ 400	\$ 440	0,10	
Nova Ljubljanska Banka d.d.				
3,400 % fällig am 05.02.2030	400	383	0,09	
Summe Slowenien		823	0,19	
SÜDAFRIKA				
STAATSEMISSIONEN				
South Africa Government International Bond				
5,375 % fällig am 24.07.2044	\$ 300	240	0,05	
5,750 % fällig am 30.09.2049	200	160	0,04	
Summe Südafrika		400	0,09	
SÜDKOREA				
STAATSEMISSIONEN				
South Korea Government International Bond				
2,000 % fällig am 10.06.2031	KRW 1.018.830	730	0,17	
2,125 % fällig am 10.06.2027	680.000	510	0,12	
2,375 % fällig am 10.12.2028	3.873.730	2.902	0,67	
2,625 % fällig am 10.06.2028	981.020	745	0,17	
3,250 % fällig am 10.03.2028	975.810	768	0,18	
3,250 % fällig am 10.06.2033	1.160.490	906	0,21	
3,250 % fällig am 10.09.2042	347.960	275	0,06	
4,250 % fällig am 10.12.2032	4.950.810	4.155	0,96	
5,500 % fällig am 10.03.2028	640.000	541	0,13	
Summe Südkorea		11.532	2,67	
SPANIEN				
FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
BBVA Consumer Auto				
0,270 % fällig am 20.07.2031	€ 81	88	0,02	
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Banco Santander S.A.				
1,849 % fällig am 25.03.2026	\$ 200	185	0,05	
3,496 % fällig am 24.03.2025	800	784	0,18	
		969	0,23	
STAATSEMISSIONEN				
Autonomous Community of Catalonia				
4,220 % fällig am 26.04.2035	€ 300	340	0,08	
Spain Government International Bond				
1,450 % fällig am 31.10.2071	500	279	0,06	
3,450 % fällig am 30.07.2066	2.000	2.072	0,48	
		2.691	0,62	
Summe Spanien		3.748	0,87	
SUPRANATIONAL				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Asian Development Bank				
6,150 % fällig am 25.02.2030	INR 252.300	2.905	0,67	
SCHWEIZ				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
UBS Group AG				
4,125 % fällig am 24.09.2025	\$ 200	196	0,05	
6,327 % fällig am 22.12.2027	300	309	0,07	
6,373 % fällig am 15.07.2026	500	506	0,12	
6,537 % fällig am 12.08.2033	300	320	0,07	
7,000 % fällig am 30.09.2027	£ 300	399	0,09	
7,750 % fällig am 01.03.2029	€ 1.900	2.422	0,56	
9,016 % fällig am 15.11.2033	\$ 500	615	0,14	
Summe Schweiz		4.767	1,10	
THAILAND				
STAATSEMISSIONEN				
Thailand Government International Bond				
3,390 % fällig am 17.06.2037	THB 30.641	951	0,22	
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Masdar Abu Dhabi Future Energy Co.				
4,875 % fällig am 25.07.2033	\$ 1.800	1.787	0,41	

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES
MDGH GMTN RSC Ltd.				
5,500 % fällig am 28.04.2033	\$ 200	\$ 212	0,05	
Summe Vereinigte Arabische Emirate		1.999	0,46	
GROSSBRITANNIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Antofagasta PLC				
2,375 % fällig am 14.10.2030	400	328	0,08	
Barclays PLC				
6,224 % fällig am 09.05.2034	600	623	0,14	
7,437 % fällig am 02.11.2033	300	336	0,08	
Haleon UK Capital PLC				
3,125 % fällig am 24.03.2025	700	684	0,16	
HSBC Holdings PLC				
2,251 % fällig am 22.11.2027	400	367	0,09	
4,041 % fällig am 13.03.2028	200	193	0,04	
4,583 % fällig am 19.06.2029	1.000	970	0,22	
5,887 % fällig am 14.08.2027	400	406	0,09	
Nationwide Building Society				
2,972 % fällig am 16.02.2028	1.300	1.210	0,28	
NatWest Group PLC				
5,076 % fällig am 27.01.2030	1.100	1.084	0,25	
Santander UK Group Holdings PLC				
2,469 % fällig am 11.01.2028	500	456	0,11	
6,534 % fällig am 10.01.2029	1.300	1.347	0,31	
7,482 % fällig am 29.08.2029	£ 1.000	1.387	0,32	
Standard Chartered PLC				
0,991 % fällig am 12.01.2025	\$ 800	799	0,18	
2,608 % fällig am 12.01.2028	600	549	0,13	
2,678 % fällig am 29.06.2032	400	326	0,08	
2,819 % fällig am 30.01.2026	400	387	0,09	
TP ICAP Finance PLC				
2,625 % fällig am 18.11.2028	£ 400	427	0,10	
		11.879	2,75	
NON-AGENCY-MBS				
Alba PLC				
5,509 % fällig am 17.03.2039	783	968	0,22	
Canada Square Funding PLC				
6,000 % fällig am 17.06.2058	539	684	0,16	
Eurosail PLC				
5,489 % fällig am 13.03.2045	125	159	0,04	
Great Hall Mortgages PLC				
5,469 % fällig am 18.03.2039	9	12	0,00	
5,479 % fällig am 18.06.2039	120	152	0,03	
5,812 % fällig am 18.06.2039	\$ 82	81	0,02	
Paragon Mortgages PLC				
6,270 % fällig am 15.05.2045	£ 88	112	0,03	
Polaris PLC				
5,985 % fällig am 23.12.2058	467	594	0,14	
Resloc UK PLC				
5,499 % fällig am 15.12.2043	445	549	0,13	
Ripon Mortgages PLC				
5,920 % fällig am 28.08.2056	2.667	3.390	0,78	
RMAC PLC				
0,000 % fällig am 15.02.2047	1.500	1.918	0,44	
RMAC Securities PLC				
5,509 % fällig am 12.06.2044	508	624	0,14	
Stratton Mortgage Funding PLC				
6,069 % fällig am 25.09.2051	798	1.017	0,24	
6,120 % fällig am 12.03.2052	515	657	0,15	
6,121 % fällig am 20.07.2060	1.104	1.408	0,33	
Towd Point Mortgage Funding PLC				
6,571 % fällig am 20.07.2045	832	1.064	0,25	
Trinity Square PLC				
6,070 % fällig am 15.07.2059	509	649	0,15	
		14.038	3,25	
STAATSEMISSIONEN				
United Kingdom Gilt				
0,125 % fällig am 22.03.2024 (e)	5.611	7.088	1,64	
0,125 % fällig am 22.03.2051 (e)	295	300	0,07	
0,125 % fällig am 22.03.2068 (e)	166	159	0,03	
0,625 % fällig am 22.11.2042 (e)	178	221	0,05	
0,625 % fällig am 22.10.2050	1.300	732	0,17	

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
1,250 % fällig am 31.07.2051	£ 370	\$ 251	0,06	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust	\$ 241	\$ 205	0,05
1,500 % fällig am 31.07.2053	300	213	0,05	7-Eleven, Inc.	\$ 100	\$ 99	0,02	GSR Mortgage Loan Trust			
		8.964	2,07	0,800 % fällig am 10.02.2024				5,750 % fällig am 25.02.2036	143	125	0,03
Summe Großbritannien		34.881	8,07	Ally Financial, Inc.	400	401	0,09	HarborView Mortgage Loan Trust			
				American Tower Corp.	500	475	0,11	4,082 % fällig am 19.06.2036	161	71	0,02
USA				Bank of America Corp.	€ 700	751	0,17	Lehman XS Trust	185	163	0,04
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				3,384 % fällig am 02.04.2026	\$ 600	584	0,14	Morgan Stanley Capital Trust	1.300	1.289	0,30
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust				4,962 % fällig am 24.08.2025	€ 600	666	0,15	Residential Accredit Loans, Inc. Trust			
5,750 % fällig am 25.07.2036	\$ 85	66	0,01	Bayer U.S. Finance LLC	\$ 400	390	0,09	6,000 % fällig am 25.06.2036	255	196	0,04
6,070 % fällig am 25.02.2036	107	105	0,02	4,250 % fällig am 15.12.2025				6,000 % fällig am 25.09.2036	274	117	0,03
6,130 % fällig am 25.11.2035	157	160	0,04	Charter Communications Operating LLC	300	260	0,06	Residential Asset Securitization Trust	930	706	0,16
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				2,250 % fällig am 15.01.2029	300	260	0,06	Sequoia Mortgage Trust			
4,724 % fällig am 25.07.2036	5	5	0,00	3,950 % fällig am 30.06.2062	800	504	0,12	3,701 % fällig am 20.01.2047	15	9	0,00
Carrington Mortgage Loan Trust				5,125 % fällig am 01.07.2049	500	407	0,09	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust			
5,690 % fällig am 25.01.2037	1.100	778	0,18	Credit Suisse AG AT1 Claim	300	36	0,01	4,471 % fällig am 25.10.2036	60	32	0,01
Citigroup Mortgage Loan Trust				Doctors Co. An Interinsurance Exchange	100	80	0,02	5,790 % fällig am 25.10.2035	140	128	0,03
4,254 % fällig am 25.10.2037	494	475	0,11	4,500 % fällig am 18.01.2032				5,910 % fällig am 25.05.2037	25	21	0,00
5,990 % fällig am 25.03.2036	1.001	901	0,21	Ford Motor Credit Co. LLC	£ 100	126	0,03	Structured Asset Mortgage Investments Trust			
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				2,748 % fällig am 14.06.2024	\$ 500	479	0,11	5,830 % fällig am 25.07.2046	407	336	0,08
5,610 % fällig am 25.08.2037	762	686	0,16	3,375 % fällig am 13.11.2025	200	197	0,05	5,870 % fällig am 25.05.2036	190	150	0,03
5,610 % fällig am 25.06.2047	228	205	0,05	3,664 % fällig am 08.09.2024	500	494	0,11	5,890 % fällig am 25.04.2036	13	12	0,00
5,670 % fällig am 25.06.2047	948	849	0,20	5,125 % fällig am 16.06.2025	300	273	0,06	6,310 % fällig am 19.10.2033	2	1	0,00
5,930 % fällig am 25.04.2047	1.267	1.149	0,27	GA Global Funding Trust				Structured Asset Securities Corp.			
5,990 % fällig am 25.12.2036	2.765	2.579	0,60	2,250 % fällig am 06.01.2027	100	96	0,02	5,750 % fällig am 25.01.2036	135	112	0,03
First Franklin Mortgage Loan Trust				Goldman Sachs Group, Inc.	€ 800	884	0,21	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust			
6,190 % fällig am 25.11.2035	99	91	0,02	4,452 % fällig am 30.04.2024	500	553	0,13	5,760 % fällig am 25.10.2036	483	388	0,09
First NLC Trust				4,956 % fällig am 07.02.2025				WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
5,540 % fällig am 25.08.2037	383	190	0,04	JPMorgan Chase & Co.	\$ 1.300	1.260	0,29	4,063 % fällig am 25.12.2036	56	48	0,01
GSAMP Trust				2,595 % fällig am 24.02.2026	1.300	1.279	0,30	6,030 % fällig am 25.11.2045	123	111	0,03
5,620 % fällig am 25.12.2046	181	90	0,02	4,080 % fällig am 26.04.2026				6,412 % fällig am 25.06.2042	1	1	0,00
5,700 % fällig am 25.12.2046	91	45	0,01	Morgan Stanley	€ 1.000	1.080	0,25	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
5,950 % fällig am 25.09.2036	3.036	1.082	0,25	2,103 % fällig am 08.05.2026				6,000 % fällig am 25.06.2037	381	337	0,08
Home Equity Asset Trust				Organon & Co.	100	102	0,02				
6,565 % fällig am 25.05.2035	344	339	0,08	2,875 % fällig am 30.04.2028					8.509	1,97	
HSI Asset Securitization Corp. Trust				Pacific Gas & Electric Co.	\$ 100	90	0,02	US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
5,810 % fällig am 25.12.2036	198	52	0,01	2,100 % fällig am 01.08.2027	100	96	0,02	Fannie Mae			
6,085 % fällig am 25.01.2036	2.300	2.123	0,49	3,150 % fällig am 01.01.2026	100	97	0,02	3,000 % fällig am 01.03.2060	391	345	0,08
Long Beach Mortgage Loan Trust				3,450 % fällig am 01.07.2025	100	73	0,02	3,500 % fällig am 01.01.2059	1.233	1.120	0,26
6,115 % fällig am 25.11.2035	20	20	0,00	3,950 % fällig am 01.12.2047	100	73	0,02	5,852 % fällig am 25.06.2036	15	15	0,01
Massachusetts Educational Financing Authority				4,000 % fällig am 01.12.2046	100	85	0,02	Freddie Mac			
6,590 % fällig am 25.04.2038	29	29	0,01	4,550 % fällig am 01.07.2030	100	95	0,02	0,000 % fällig am 15.01.2038			
MASTR Asset-Backed Securities Trust				Penske Truck Leasing Co. LP	1.400	1.375	0,32	(a)	225	12	0,00
5,680 % fällig am 25.05.2037	250	238	0,05	3,950 % fällig am 10.03.2025				5,334 % fällig am 15.01.2038	225	222	0,05
5,770 % fällig am 25.08.2036	278	107	0,02	Principal Life Global Funding	300	288	0,07	Ginnie Mae			
5,950 % fällig am 25.06.2036	3.511	1.283	0,30	1,375 % fällig am 10.01.2025				3,000 % fällig am 20.07.2046 - 20.05.2047	8	8	0,00
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				Southern California Edison Co.	300	297	0,07	5,777 % fällig am 20.12.2062	274	272	0,06
5,600 % fällig am 25.10.2036	633	551	0,13	1,100 % fällig am 01.04.2024				Ginnie Mae, TBA			
5,600 % fällig am 25.01.2037	1.871	831	0,19					3,000 % fällig am 01.02.2054	2.700	2.447	0,57
5,720 % fällig am 25.03.2037	686	294	0,07	KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				Uniform Mortgage-Backed Security			
5,950 % fällig am 25.06.2036	1.311	690	0,16	CenturyLink, Inc.	591	410	0,09	2,500 % fällig am 01.02.2051 - 01.01.2052	1.914	1.632	0,38
New Century Home Equity Loan Trust				7,720 % fällig am 15.03.2027				3,000 % fällig am 01.10.2042 - 01.10.2049	1.490	1.345	0,31
6,190 % fällig am 25.03.2035	377	370	0,08	NON-AGENCY-MBS				3,500 % fällig am 01.10.2034 - 01.07.2050	836	787	0,18
NovaStar Mortgage Funding Trust				Ashford Hospitality Trust	1.051	1.038	0,24	4,000 % fällig am 01.09.2040 - 01.06.2050	493	474	0,11
5,770 % fällig am 25.09.2036	194	81	0,02	6,434 % fällig am 15.04.2035	304	300	0,07	4,500 % fällig am 01.04.2041	58	58	0,01
Option One Mortgage Loan Trust				6,534 % fällig am 15.06.2035				5,500 % fällig am 01.07.2037 - 01.04.2039	141	144	0,03
5,610 % fällig am 25.03.2037	300	265	0,06	Banc of America Funding Trust	44	33	0,01	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
RAAC Trust				5,852 % fällig am 20.10.2036				2,500 % fällig am 01.02.2054	6.100	5.197	1,20
6,970 % fällig am 25.09.2047	388	372	0,09	Barclays Commercial Mortgage Securities Trust	1.361	1.340	0,31	3,500 % fällig am 01.02.2054	1.800	1.653	0,38
Residential Asset Mortgage Products Trust				6,659 % fällig am 15.07.2037				4,000 % fällig am 01.01.2054	17.800	16.841	3,90
6,110 % fällig am 25.01.2036	310	287	0,07	Chase Mortgage Finance Trust	37	30	0,01	4,500 % fällig am 01.02.2054	21.800	21.147	4,89
6,520 % fällig am 25.09.2035	1.300	1.119	0,26	4,523 % fällig am 25.07.2037				5,000 % fällig am 01.01.2054	29.600	29.298	6,78
Residential Asset Securities Corp. Trust				Citigroup Commercial Mortgage Trust	946	894	0,21	5,500 % fällig am 01.02.2054	23.300	23.405	5,42
6,030 % fällig am 25.04.2036	51	50	0,01	3,251 % fällig am 10.05.2035				6,000 % fällig am 01.02.2054	24.300	24.675	5,71
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust				Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.	20	19	0,00	6,500 % fällig am 01.02.2054	39.700	40.682	9,41
5,970 % fällig am 25.05.2036	397	208	0,05	3,906 % fällig am 25.05.2035							
6,130 % fällig am 25.08.2035	593	474	0,11	Countrywide Alternative Loan Trust							
6,430 % fällig am 25.01.2036	30	27	0,01	5,892 % fällig am 20.03.2046	19	16	0,00				
Soundview Home Loan Trust				5,892 % fällig am 20.05.2046	23	20	0,00				
6,030 % fällig am 25.05.2036	474	455	0,10	6,000 % fällig am 25.03.2036	375	169	0,04				
Structured Asset Investment Loan Trust				6,000 % fällig am 25.05.2037	197	92	0,02				
5,620 % fällig am 25.09.2036	20	20	0,00								
6,090 % fällig am 25.01.2036	1.872	1.723	0,40								
6,250 % fällig am 25.08.2033	9	8	0,00								
Texas Natural Gas Securitization Finance Corp.											
5,102 % fällig am 01.04.2035	200	204	0,05								
		21.676	5,01								

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Advantage Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
US-SCHATZobligationen				KURZFRISTIGE INSTRUMENTE				INVESTMENTFONDS			
US-SCHATZobligationen				ARGENTINISCHE SCHATZWECHSEL				ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
U.S. Treasury Bonds				(34,368) % fällig am				PIMCO Select Funds plc -			
1,625 % fällig am 15.11.2050	\$ 1.300	\$775	0,18	20.05.2024 (c)(d)	ARS 4.433	\$ 7	0,00	PIMCO US Dollar Short-			
1,875 % fällig am 15.02.2041	9.000	6.475	1,50					Term Floating			
2,875 % fällig am 15.05.2052	300	239	0,05	UNGARISCHE SCHATZWECHSEL				NAV Fund (g)	1.218.209	\$ 12.139	2,81
4,000 % fällig am 15.11.2052	400	395	0,09	10,900 % fällig am				PIMCO Specialty Funds			
U.S. Treasury Inflation Protected Securities (e)				04.01.2024 (c)(d)	HUF 1.771.000	5.115	1,18	Ireland p.l.c. - PIMCO	446.527	6.071	1,40
0,125 % fällig am 15.04.2025	3.157	3.044	0,70	JAPANISCHE SCHATZWECHSEL				China Bond Fund (g)			
0,125 % fällig am 15.07.2030	2.040	1.844	0,43	(0,211) % fällig am				Summe Investmentfonds	\$ 18.210	4,21	
0,125 % fällig am 15.07.2031	1.263	1.123	0,26	29.01.2024 (c)(d)	¥ 202.000	1.433	0,33				
0,125 % fällig am 15.01.2032	3.996	3.512	0,81	(0,207) % fällig am							
0,250 % fällig am 15.01.2025	6.755	6.557	1,52	05.02.2024 (c)(d)	1.428.000	10.131	2,35				
0,250 % fällig am 15.02.2050	1.197	781	0,18	(0,193) % fällig am							
0,500 % fällig am 15.01.2028	10.228	9.681	2,24	29.01.2024 (c)(d)	38.000	270	0,06				
0,625 % fällig am 15.07.2032	1.694	1.549	0,36	(0,189) % fällig am							
0,750 % fällig am 15.07.2028	2.084	1.995	0,46	05.02.2024 (c)(d)	292.000	2.071	0,48				
1,125 % fällig am 15.01.2033	3.925	3.716	0,86			13.905	3,22				
U.S. Treasury Notes				Summe kurzfristige Instrumente		19.027	4,40				
2,875 % fällig am 30.04.2025	9.300	9.099	2,11								
3,500 % fällig am 15.02.2033	1.300	1.261	0,29	Summe übertragbare Wertpapiere		\$ 558.153	129,12				
4,000 % fällig am 29.02.2028	300	301	0,07								
		52.347	12,11								
Summe USA		268.766	62,17								

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft ⁽¹⁾	% des Nettovermö- gens
FICC	2,600 %	29.12.2023	02.01.2024	\$ 534	U.S. Treasury Notes 4,875 % fällig am 30.11.2025	\$ (545)	\$ 534	\$ 534	0,12
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (545)	\$ 534	\$ 534	0,12

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month Euribor March Futures	Long	03.2024	154	\$ 26	0,01
3-Month Euribor March Futures	Long	03.2025	154	139	0,03
3-Month Euribor September Futures	Short	09.2024	308	(203)	(0,05)
3-Month SOFR December Futures	Long	03.2024	7	(33)	(0,01)
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2025	326	(427)	(0,10)
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2024	25	(3)	0,00
3-Month SOFR June Futures	Long	09.2025	82	122	0,03
3-Month SOFR March Futures	Long	06.2024	276	112	0,03
3-Month SOFR September Futures	Short	12.2024	87	(56)	(0,01)
3-Month SOFR September Futures	Long	12.2025	82	122	0,03
Australia Government 3-Year Note March Futures	Short	03.2024	28	(20)	(0,01)
Australia Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2024	136	(317)	(0,07)
Canada Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2024	6	22	0,01
Euro-Bobl March Futures	Short	03.2024	55	(118)	(0,03)
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Short	03.2024	5	(63)	(0,02)
Euro-OAT France Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2024	149	(666)	(0,15)
Euro-Schatz March Futures	Short	03.2024	14	(10)	0,00
Japan Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2024	16	(138)	(0,03)
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Short	03.2024	10	(21)	(0,01)
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Short	03.2024	229	(619)	(0,14)
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Short	03.2024	94	(332)	(0,08)
U.S. Treasury 10-Year Ultra March Futures	Short	03.2024	67	(381)	(0,09)
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Short	03.2024	24	(222)	(0,05)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Long	03.2024	3	37	0,01
United Kingdom Long Gilt March Futures	Short	03.2024	220	(1.971)	(0,46)
				\$ (5.020)	(1,16)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (5.020)	(1,16)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

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

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000 %	20.06.2025	\$ 400	\$ 8	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	\$ 4.600	\$ (47)	(0,01)
CDX.IG-41 10-Year Index	(1,000)	20.12.2033	56.300	(652)	(0,15)
iTraxx Europe Main 40 10-Year Index	(1,000)	20.12.2033	€ 6.500	(92)	(0,02)
				\$ (791)	(0,18)

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	\$ 500	\$ 3	0,00
CDX.IG-41 5-Year Index	1,000	20.12.2028	54.800	376	0,09
				\$ 379	0,09

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	3,000 %	17.06.2027	£ 11.700	\$ 28	0,01
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,000	17.06.2035	2.500	(6)	0,00
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,250	20.03.2054	800	133	0,03
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,500	20.03.2034	25.800	2.708	0,63
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	5,000	20.03.2029	18.700	714	0,16
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	5,500	20.03.2026	900	29	0,01
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,250	20.03.2029	INR 109.640	2	0,00
Zahlung	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,500	20.03.2029	602.600	21	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,500	20.03.2034	56.810	(4)	0,00
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.12.2028	¥ 250.000	(34)	(0,01)
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	17.03.2031	230.000	(57)	(0,01)
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,050	15.12.2031	440.000	(68)	(0,02)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	19.06.2039	280.000	251	0,06
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,550	14.09.2028	570.000	(56)	(0,01)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,789	23.01.2033	1.356.000	(81)	(0,02)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,800	15.06.2052	300.000	298	0,07
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,850	20.09.2033	130.000	(4)	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	2,750	20.03.2029	SGD 11.645	(82)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,000	15.06.2027	\$ 10.400	844	0,19
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,000	15.06.2029	10.080	(492)	(0,11)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,249	31.08.2024	9.500	465	0,11
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,250	15.12.2026	10.200	933	0,21
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,298	25.08.2024	8.100	406	0,09
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,430	31.03.2024	200	6	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,500	18.12.2024	200	14	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,500	15.12.2028	9.900	(1.182)	(0,27)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,518	20.01.2029	800	(86)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,630	20.01.2029	2.300	(234)	(0,05)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,630	26.01.2029	500	(50)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.06.2024	10.740	72	0,02
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.06.2027	19.230	265	0,06
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,850	21.04.2024	21.900	522	0,12
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	15.12.2051	2.000	(753)	(0,17)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,209	31.03.2024	2.236	71	0,02
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,400	21.06.2024	600	(17)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,750	21.06.2053	1.080	(74)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,841	31.10.2024	400	(6)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,910	14.11.2024	900	(12)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,920	17.10.2024	1.200	(18)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,965	30.11.2026	16.400	400	0,09
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,968	30.06.2024	13.100	(307)	(0,07)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,973	27.10.2024	600	(8)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,993	13.10.2024	400	(6)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,018	24.10.2024	500	(7)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,070	15.11.2032	2.500	83	0,02
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,083	15.11.2032	2.300	74	0,02
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,086	15.11.2032	2.600	56	0,01

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Advantage Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermö- gens
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,088 %	07.11.2024	\$ 300	\$ (3)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,100	09.09.2029	600	(13)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,106	15.11.2032	1.900	57	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,139	15.11.2032	2.400	66	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,140	25.10.2024	600	(7)	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,150	13.05.2025	32.800	229	0,05
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,163	30.09.2029	3.100	(72)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,173	15.11.2032	1.700	44	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,174	15.11.2032	1.800	45	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,190	25.10.2024	600	(7)	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,200	13.05.2025	2.700	25	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,203	05.10.2053	220	(6)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,225	25.10.2024	500	(5)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,225	30.09.2029	2.100	(43)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,240	03.10.2053	600	(11)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,250	21.06.2028	7.400	38	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,250	20.12.2053	9.600	(1.160)	(0,27)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,454	30.06.2029	2.900	(37)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2030	100	1	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2033	31.271	1.208	0,28
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,650	22.11.2024	1.000	(9)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,650	05.12.2024	1.300	(12)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	21.11.2024	1.600	(13)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	11.12.2024	900	(7)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	21.06.2025	9.600	134	0,03
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.12.2028	11.104	(354)	(0,08)
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	02.01.2034	150	(3)	0,00
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2034	8.620	22	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,800	22.08.2030	200	3	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,810	02.01.2034	150	(4)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,842	26.12.2033	400	(11)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,854	29.12.2033	600	(17)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,857	31.03.2030	4.000	59	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,898	30.06.2029	3.200	37	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,950	19.12.2033	500	(18)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,981	30.11.2027	8.600	103	0,02
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,988	30.11.2027	9.200	238	0,05
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,000	20.03.2054	1.600	(29)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,030	15.12.2033	500	(21)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,159	31.03.2025	14.500	209	0,05
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,193	30.11.2027	3.000	60	0,01
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,228	30.08.2025	5.300	(22)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	20.12.2025	54.396	(215)	(0,05)
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	20.03.2034	7.200	73	0,02
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,435	01.11.2033	310	26	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,450	31.10.2033	1.100	92	0,02
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,450	01.11.2033	600	50	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,291	04.01.2027	1.600	29	0,01
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,220	03.03.2025	6.700	(288)	(0,07)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2025	2.600	(112)	(0,03)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2030	1.600	(90)	(0,02)
Erhalt	3-Month CAD-Bank Bill	1,750	16.12.2046	1.400	122	0,03
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,900	18.12.2029	3.700	(243)	(0,06)
Erhalt	3-Month CAD-Bank Bill	3,250	15.03.2033	1.900	26	0,01
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,250	21.06.2033	5.700	174	0,04
Erhalt	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,250	21.06.2053	2.400	(146)	(0,03)
Zahlung ⁽⁴⁾	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,500	10.05.2025	45.500	(73)	(0,02)
Erhalt	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,750	20.12.2033	4.600	(176)	(0,04)
Zahlung ⁽⁴⁾	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	4,600	30.08.2025	6.700	47	0,01
Zahlung	3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,283	14.02.2027	1.700	(73)	(0,02)
Zahlung	3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,294	10.02.2027	4.400	(178)	(0,04)
Zahlung	3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,300	15.02.2027	1.700	(72)	(0,02)
Zahlung	3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,343	16.05.2027	1.300	(51)	(0,01)
Zahlung	3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,500	15.09.2026	900	(45)	(0,01)
Erhalt ⁽⁴⁾	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,250	20.03.2029	CNY 80.920	(64)	(0,02)
Zahlung ⁽⁴⁾	3-Month KRW-KORIBOR	3,250	20.03.2029	KRW 1.508.010	6	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	0,528	17.03.2024	NZD 350	(1)	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	3,250	21.03.2028	2.600	(252)	(0,06)
Zahlung	3-Month NZD-BBR	3,750	15.06.2027	4.100	20	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	4,000	14.06.2024	24.900	(80)	(0,02)
Zahlung ⁽⁴⁾	3-Month NZD-BBR	4,750	20.03.2025	12.400	(15)	0,00
Zahlung ⁽⁴⁾	3-Month NZD-BBR	5,250	20.03.2025	11.700	20	0,00
Zahlung	3-Month SEK-STIBOR	0,500	19.06.2024	SEK 12.700	(35)	(0,01)
Zahlung	3-Month SEK-STIBOR	1,000	19.06.2029	16.100	(145)	(0,03)
Erhalt	6-Month AUD-BBR-BBSW	1,250	17.06.2030	AUD 5.700	466	0,11
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	1,750	16.03.2027	1.900	(90)	(0,02)
Erhalt	6-Month AUD-BBR-BBSW	1,750	16.06.2031	1.750	176	0,04
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,000	21.06.2033	14.600	109	0,02
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,250	15.09.2032	1.100	0	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,250	15.03.2033	12.400	(88)	(0,02)
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	15.09.2032	22.500	143	0,03
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,750	20.12.2033	28.700	401	0,09

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,054 %	27.05.2050	€ 200	\$ 52	0,01
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,064	17.11.2052	500	168	0,04
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,450	15.12.2035	300	73	0,02
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	10.08.2024	500	(17)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	12.04.2027	1.400	(90)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	11.05.2027	900	(54)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,700	11.04.2027	700	(44)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027	1.600	(79)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	18.05.2027	700	(34)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	11.04.2024	3.900	10	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	13.04.2024	8.800	25	0,01
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	17.05.2024	1.800	5	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	26.04.2024	1.300	7	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	28.04.2024	1.300	6	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	03.05.2024	1.200	6	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	21.09.2037	1.400	18	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	20.03.2054	16.200	(1.846)	(0,43)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,880	19.12.2028	200	(4)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,890	22.12.2033	100	(3)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,910	29.12.2033	400	(15)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,920	13.12.2028	100	(2)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,950	29.12.2028	600	(15)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,990	08.12.2033	100	(4)	0,00
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	19.03.2027	17.660	223	0,05
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	15.03.2033	7.860	(104)	(0,02)
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.03.2034	54.510	3.187	0,74
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,063	06.12.2033	100	(5)	0,00
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,250	20.03.2029	37.100	1.182	0,27
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,255	22.11.2028	1.200	(45)	(0,01)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,280	22.11.2033	300	(21)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	3,300	03.10.2033	500	39	0,01
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,305	27.11.2033	400	(29)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	3,370	09.10.2028	1.600	73	0,02
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,500	20.03.2026	22.100	312	0,07
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,536	18.09.2025	26.000	(275)	(0,06)
Erhalt	6-Month NOK-NIBOR	1,635	18.03.2025	NOK 6.200	32	0,01
Erhalt	6-Month NOK-NIBOR	1,993	12.11.2024	4.200	25	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	4,870	07.07.2025	MXN 41.500	(83)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,080	26.02.2025	10.500	(33)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,380	25.02.2025	12.300	(42)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,415	25.02.2025	300	(1)	0,00
					\$ 7.491	1,73
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ 7.087	1,64

(1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der jeweiligen Swap-Vereinbarung 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, wie in den Bedingungen der jeweiligen Swap-Vereinbarung 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 als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, wie in den Bedingungen der jeweiligen Swap-Vereinbarung definiert.

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

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

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

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Nettvermö- gens
BOA	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,750 %	15.07.2024	8.600	\$ 17	\$ 6	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,180	11.01.2024	1.900	54	203	0,04
BRC	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500	26.03.2024	10.500	14	0	0,00
DUB	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,750	10.07.2024	37.800	103	27	0,01
FAR	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500	26.03.2024	11.300	17	0	0,00
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500	26.03.2024	11.100	17	0	0,00
JPM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500	26.03.2024	13.000	17	1	0,00
MYC	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500	26.03.2024	12.200	17	1	0,00
							\$ 256	\$ 238	0,05

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Advantage Fund (Forts.)

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermö-gens
BPS	Put - OTC France Government International Bond 0,750 % fällig am 25.05.2052	€ 97,000	23.05.2025	800	\$ 61	\$ 328	0,08

VERKAUFSOPTIONEN

DEVISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermö-gens
GLM	Put - OTC USD versus TWD	TWD 31,000	04.03.2024	580	\$ (8)	\$ (17)	(0,01)
JPM	Put - OTC USD versus TWD	31,000	01.03.2024	1.401	(19)	(40)	(0,01)
					\$ (27)	\$ (57)	(0,02)

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermö-gens
BOA	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,310 %	11.01.2024	16.900	\$ (55)	\$ (392)	(0,09)
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	5,250	15.07.2024	8.600	(9)	(2)	0,00
BPS	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,545	16.01.2024	300	(1)	(4)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,995	16.01.2024	300	(1)	0	0,00
	Put - OTC 25-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,451	23.05.2025	800	(61)	(304)	(0,07)
DUB	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,790	08.04.2024	1.700	(13)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,790	08.04.2024	1.700	(13)	(25)	(0,01)
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	5,250	10.07.2024	37.800	(57)	(9)	0,00
FAR	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,489	08.01.2024	400	(2)	(3)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,550	16.01.2024	200	(1)	(2)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,989	08.01.2024	400	(2)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,000	16.01.2024	200	(1)	0	0,00
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,697	02.04.2024	2.000	(16)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,697	02.04.2024	2.000	(16)	(32)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,721	08.04.2024	600	(5)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,721	08.04.2024	600	(5)	(9)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,215	22.01.2024	500	(2)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,285	19.01.2024	500	(2)	(2)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300	16.01.2024	600	(3)	(2)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,560	05.01.2024	300	(2)	(3)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,594	05.01.2024	300	(1)	(4)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,648	04.01.2024	100	0	(2)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,665	22.01.2024	500	(2)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,735	19.01.2024	500	(2)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	16.01.2024	600	(3)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,010	05.01.2024	300	(2)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,044	05.01.2024	300	(1)	0	0,00
JPM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	0,820	16.12.2024	4.600	(33)	(5)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,205	22.01.2024	500	(2)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,655	22.01.2024	500	(2)	(2)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,650	04.01.2024	900	(3)	(14)	(0,01)
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,030	04.01.2024	900	(3)	0	0,00
MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,455	08.01.2024	300	(1)	(2)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,600	12.01.2024	300	(1)	(5)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,670	04.01.2024	100	0	(2)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,955	08.01.2024	300	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,050	12.01.2024	300	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,120	04.01.2024	100	0	0	0,00
							\$ (325)	\$ (832)	(0,19)

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermö-gens
GST	South Korea Government International Bond	(1,000) %	20.12.2028	\$ 1.000	\$ (29)	\$ (4)	\$ (33)	0,00
MYC	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.12.2028	1.000	(29)	(5)	(34)	(0,01)
					\$ (58)	\$ (9)	\$ (67)	(0,01)

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermö-gens
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)	14	4	0,00
CBK	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	500	(12)	18	6	0,00
					\$ (34)	\$ 50	\$ 16	0,00

- (1) Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der jeweiligen Swap-Vereinbarung 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, wie in den Bedingungen der jeweiligen Swap-Vereinbarung 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 als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, wie in den Bedingungen der jeweiligen Swap-Vereinbarung definiert.

CROSS-CURRENCY SWAPS

Kontrahent	Erhalt	Zahlung	Fälligkeits- datum	Nennbetrag erhaltener Währung	Nennbetrag gelieferter Währung	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermö- gens
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	\$ (1)	\$ 2	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)	18	17	0,01
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)	18	7	0,00
						\$ (9)	\$ 35	\$ 26	0,01

ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermö- gens
BOA	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500 %	20.09.2028	MYR 3.320	\$ 17	\$ (15)	\$ 2	0,00
GST	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	20.09.2028	32.480	121	(99)	22	0,01
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,600	20.09.2028	4.230	0	(1)	(1)	(0,01)
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	20.09.2033	13.530	86	(64)	22	0,01
JPM	Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	5,960	11.02.2029	COP 15.800	0	0	0	0,00
						\$ 224	\$ (179)	\$ 45	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	01.2024	\$ 694	AUD 1.048	\$ 21	\$ 0	\$ 21	0,01
	03.2024	1.719	CNH 12.391	31	0	31	0,01
BOA	01.2024	COP 2.851.625	\$ 746	10	0	10	0,00
	01.2024	£ 659	836	0	(4)	(4)	0,00
	01.2024	PEN 3.691	995	0	(2)	(2)	0,00
	01.2024	\$ 368	AUD 556	12	0	12	0,00
	01.2024	709	COP 2.851.625	26	0	26	0,01
	01.2024	7.378	¥ 1.088.722	350	0	350	0,08
	01.2024	448	NOK 4.762	21	0	21	0,00
	01.2024	854	NZD 1.401	33	0	33	0,01
	02.2024	8.586	CNY 60.682	0	(6)	(6)	0,00
	03.2024	IDR 1.569.517	\$ 100	0	(2)	(2)	0,00
	03.2024	\$ 2.113	CNH 15.305	49	0	49	0,01
	03.2024	735	COP 2.851.625	0	(10)	(10)	0,00
	03.2024	47	INR 3.947	0	0	0	0,00
	04.2024	340	KZT 171.575	27	0	27	0,01
	06.2024	KRW 64.801	\$ 50	0	(1)	(1)	0,00
BPS	01.2024	DKK 25.830	3.810	0	(19)	(19)	0,00
	01.2024	€ 1.230	1.342	0	(17)	(17)	0,00
	01.2024	£ 1.468	1.863	0	(9)	(9)	0,00
	01.2024	HUF 62.063	177	0	(2)	(2)	0,00
	01.2024	KRW 130.724	100	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	PEN 323	87	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 674	AUD 1.000	9	0	9	0,00
	01.2024	256	BRL 1.252	2	0	2	0,00
	01/2024	4.083	€ 3.745	55	0	55	0,01
	01/2024	4	HUF 1.426	0	0	0	0,00
	01/2024	50	IDR 773.309	0	0	0	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Advantage Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	01.2024	\$	2.483	ZAR	46.025	\$ 31	0,01
	02.2024	CNY	30	\$	4	0	0,00
	02.2024	TWD	19.350		609	(31)	(0,01)
	02.2024	\$	15.245	CNY	108.220	56	0,01
	03.2024	CNH	15.792	\$	2.176	(54)	(0,01)
	03.2024	IDR	5.320.995		347	2	0,00
	03.2024	INR	91.173		1.093	1	0,00
	03.2024	TWD	15.745		501	0	0,00
	03.2024	\$	3.134	CNH	22.574	54	0,01
	03.2024		276	IDR	4.255.165	0	0,00
	03.2024		164	INR	13.711	0	0,00
	03.2024		15	THB	538	0	0,00
	06.2024	KRW	1.793.286	\$	1.373	(23)	(0,01)
BRC	01.2024		129.230		100	0	0,00
	01.2024	\$	2.167	PLN	9.474	242	0,06
	01.2024		99	ZAR	1.849	2	0,00
	03.2024	CNH	5.631	\$	792	(3)	0,00
	03.2024	\$	50	IDR	776.911	0	0,00
	03.2024		1	THB	23	0	0,00
	06.2024	KRW	1.775.575	\$	1.360	(22)	(0,01)
CBK	01.2024	AUD	312		211	(2)	0,00
	01.2024	BRL	45.762		9.398	(23)	(0,01)
	01.2024	CHF	1.625		1.873	(59)	(0,01)
	01.2024	DKK	3.120		454	(9)	0,00
	01.2024	HUF	2.802		8	0	0,00
	01.2024	IDR	771.427		50	0	0,00
	01.2024	¥	379.100		2.685	(6)	0,00
	01.2024	MXN	1.096		60	(5)	0,00
	01.2024	\$	496	AUD	737	7	0,00
	01.2024		481	£	380	3	0,00
	01.2024		296	MXN	5.220	11	0,00
	01.2024		108	NOK	1.152	6	0,00
	01.2024		128	PLN	515	3	0,00
	02.2024		260	BRL	1.278	2	0,00
	03.2024	CNH	20.502	\$	2.891	(5)	0,00
	03.2024	CNY	1.954		275	(1)	0,00
	03.2024	PEN	1.220		324	(5)	0,00
	03.2024	\$	596	BRL	2.950	8	0,00
	03.2024		896	CNH	6.406	9	0,00
	03.2024		1.416	IDR	22.295.057	30	0,01
	04.2024		9.136	BRL	44.935	38	0,01
	04.2024		1.038	VND	25.691.912	29	0,01
	06.2024	KRW	960.756	\$	745	(3)	0,00
DUB	01.2024	HUF	71.734		193	(14)	0,00
	01.2024	\$	52	CNY	369	0	0,00
	03.2024		1.011	CNH	7.284	18	0,00
	03.2024		969	SGD	1.283	7	0,00
	06.2024	KRW	1.919.550	\$	1.475	(20)	0,00
GLM	01.2024	AUD	707		474	(9)	0,00
	01.2024	DKK	34.220		5.048	(25)	(0,01)
	01.2024	\$	8.630	BRL	43.477	320	0,07
	01.2024		3.598	CHF	3.153	150	0,03
	01.2024		445	£	349	0	0,00
	01.2024		8.633	MXN	151.401	267	0,06
	01.2024		1.060	PLN	4.246	19	0,00
	03.2024	CNH	16.517	\$	2.290	(43)	(0,01)
	03.2024	\$	656	CNH	4.736	13	0,00
	03.2024		372	IDR	5.706.207	0	0,00
	03.2024		310	TWD	9.607	8	0,00
JPM	01.2024	HUF	155.620	\$	443	(7)	0,00
	01.2024	\$	100	IDR	1.538.700	0	0,00
	01.2024		50	KRW	64.807	0	0,00
	02.2024	CNY	50.028	\$	6.965	(108)	(0,03)
	02.2024	\$	422	BRL	2.072	3	0,00
	02.2024		16.775	INR	1.401.374	27	0,01
	03.2024	IDR	4.788.647	\$	309	(2)	0,00
	03.2024	TWD	19.486		627	(19)	0,00
	03.2024	\$	579	CNH	4.145	6	0,00
	03.2024		49	INR	4.110	0	0,00
	03.2024		700	TWD	21.715	18	0,00
	06.2024	KRW	2.103.169	\$	1.620	(17)	0,00
	10.2024	¥	110.000		890	78	0,02
MBC	01.2024	CAD	4.884		3.609	(95)	(0,02)
	01.2024	¥	234.600		1.646	(19)	0,00
	01.2024	\$	326	AUD	492	10	0,00
	01.2024		1.025	DKK	7.080	25	0,01
	01.2024		1.106	€	1.011	11	0,00
	01.2024		376	HUF	137.894	21	0,01
	02.2024	CNY	2.049	\$	284	(5)	0,00
	02.2024	\$	495	CNY	3.568	10	0,00
	03.2024	CNH	25.348	\$	3.500	(80)	(0,02)
	03.2024	TWD	487		15	(1)	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens		
	03.2024	\$	506	CNH	3.601	\$ 3	\$ 0	\$ 3	0,00
	03.2024		1.005	PHP	56.229	10	0	10	0,00
	10.2024	¥	340.000	\$	2.725	217	0	217	0,05
MYI	01.2024	DKK	1.735		257	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	€	28.634		31.472	0	(166)	(166)	(0,04)
	01.2024	HUF	704		2	0	0	0	0,00
	01.2024	MYR	557		119	0	(2)	(2)	0,00
	01.2024	\$	3.512	CNY	25.236	53	0	53	0,01
	01.2024		2	€	2	0	0	0	0,00
	01.2024		2.805	¥	413.568	130	0	130	0,03
	02.2024		12.311	CNY	87.698	89	0	89	0,02
	03.2024		1.544	CNH	11.133	29	0	29	0,01
	03.2024		3.094	IDR	47.687.837	4	(6)	(2)	0,00
	03.2024		214	ILS	772	1	0	1	0,00
	06.2024	KRW	1.103.551	\$	848	0	(11)	(11)	0,00
	10.2024	¥	600.000		4.906	480	0	480	0,11
RBC	03.2024	\$	213	IDR	3.292.435	1	0	1	0,00
	04.2024		12	MXN	216	0	0	0	0,00
RYL	01.2024	AUD	707	\$	475	0	(7)	(7)	0,00
SCX	01.2024	MYR	204		44	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	\$	3.618	CNY	25.996	55	0	55	0,01
	01.2024		2.817	SEK	29.255	87	0	87	0,02
	02.2024	CNY	25.887	\$	3.608	0	(52)	(52)	(0,01)
	02.2024	\$	21	CNY	151	0	0	0	0,00
	03.2024	IDR	788.880	\$	50	0	(1)	(1)	0,00
	03.2024	TWD	46.401		1.495	0	(42)	(42)	(0,01)
	03.2024	\$	1.407	CNH	10.187	32	0	32	0,01
	03.2024		1.072	HKD	8.353	0	0	0	0,00
	03.2024		292	IDR	4.500.602	2	(2)	0	0,00
	03.2024		158	INR	13.251	0	0	0	0,00
	03.2024		1.557	THB	53.823	30	0	30	0,01
	03.2024		920	TWD	28.601	28	0	28	0,01
	06.2024	KRW	915.660	\$	705	0	(7)	(7)	0,00
SOG	02.2024	\$	812	RON	3.722	14	0	14	0,00
	03.2024	TWD	5.202	\$	165	0	(7)	(7)	0,00
SSB	01.2024	CLP	214.482		243	0	(3)	(3)	0,00
	01.2024	\$	439	£	349	6	0	6	0,00
	03.2024		299	INR	24.955	0	0	0	0,00
TOR	01.2024		4.637	¥	680.116	191	0	191	0,04
	02.2024	¥	1.720.000	\$	11.624	0	(635)	(635)	(0,15)
	03.2024	IDR	780.507		49	0	(1)	(1)	0,00
	03.2024	\$	682	CNH	4.927	13	0	13	0,00
UAG	01.2024	£	7.618	\$	9.641	0	(71)	(71)	(0,02)
	01.2024	HUF	6.200		17	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	\$	209	BRL	1.033	4	0	4	0,00
	01.2024		173	HUF	63.543	10	0	10	0,00
	01.2024		100	MXN	1.769	4	0	4	0,00
	01.2024		2.483	NOK	26.491	126	0	126	0,03
	01.2024		317	SEK	3.180	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024		1.029	ZAR	19.639	44	0	44	0,01
	03.2024		762	CZK	16.964	0	(5)	(5)	0,00
						\$ 3.854	\$ (1.832)	\$ 2.022	0,47

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 31. Dezember 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	01.2024	AUD	1.630	\$	1.079	\$ 0	\$ (33)	(0,01)	
BOA	01.2024		865		572	0	(18)	(18)	0,00
	01.2024	£	254		322	0	(2)	(2)	0,00
	01.2024	¥	517.889		3.509	0	(166)	(166)	(0,04)
	01.2024	NOK	1.165		110	0	(5)	(5)	0,00
	01.2024	NZD	652		397	0	(16)	(16)	0,00
BPS	01.2024	DKK	1.531		226	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	€	923		1.013	1	(8)	(7)	0,00
	01.2024	£	507		643	0	(3)	(3)	0,00
	01.2024	¥	368.245		2.510	0	(104)	(104)	(0,02)
BRC	01.2024	\$	2.844	CHF	2.481	105	0	105	0,02
CBK	01.2024	NOK	282	\$	26	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	SEK	26		2	0	0	0	0,00
	01.2024	\$	4.492	CHF	3.914	160	0	160	0,04
	01.2024		0	DKK	2	0	0	0	0,00
	01.2024		191	€	173	0	0	0	0,00
	01.2024		0	NOK	0	0	0	0	0,00
GLM	01.2024	CAD	3.527	\$	2.595	0	(80)	(80)	(0,02)
	01.2024	\$	40.629	CHF	35.605	1.696	0	1.696	0,39
MBC	01.2024	AUD	986	\$	654	0	(19)	(19)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Advantage Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	01.2024	CAD 281	\$ 207	\$ 0	\$ (5)	\$ (5)	0,00
	01.2024	€ 21.904	24.083	0	(119)	(119)	(0,03)
	01.2024	£ 148	188	0	0	0	0,00
MYI	01.2024	¥ 196.728	1.334	0	(62)	(62)	(0,01)
	01.2024	\$ 39.511	CHF 34.490	1.490	0	1.490	0,34
SCX	01.2024	SEK 8.947	\$ 861	0	(27)	(27)	(0,01)
UAG	01.2024	DKK 2.031	298	0	(3)	(3)	0,00
	01.2024	£ 2.754	3.485	0	(26)	(26)	(0,01)
	01.2024	NOK 6.483	608	0	(31)	(31)	(0,01)
				\$ 3.452	\$ (729)	\$ 2.723	0,63

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilklassen 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
AZD	01.2024	AUD 2.977	\$ 1.972	\$ 0	\$ (60)	\$ (60)	(0,01)
BOA	01.2024	£ 249	316	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	¥ 977.859	6.626	0	(314)	(314)	(0,07)
	01.2024	NOK 2.138	201	0	(10)	(10)	0,00
	01.2024	NZD 817	497	0	(20)	(20)	(0,01)
BPS	01.2024	DKK 2.850	420	0	(2)	(2)	0,00
	01.2024	€ 14	15	0	0	0	0,00
	01.2024	£ 949	1.204	0	(6)	(6)	0,00
	01.2024	¥ 626.927	4.274	0	(175)	(175)	(0,04)
	01.2024	\$ 2.131	€ 1.954	27	0	27	0,01
BRC	01.2024	0	CHF 0	0	0	0	0,00
CBK	01.2024	€ 6	\$ 7	0	0	0	0,00
	01.2024	NOK 517	48	0	(3)	(3)	0,00
	01.2024	SEK 48	5	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 0	DKK 1	0	0	0	0,00
	01.2024	11	€ 10	0	0	0	0,00
	01.2024	0	NOK 1	0	0	0	0,00
GLM	01.2024	CAD 6.655	\$ 4.897	0	(151)	(151)	(0,04)
	01.2024	CHF 1.952	2.227	0	(93)	(93)	(0,02)
	01.2024	DKK 3.776	557	0	(3)	(3)	0,00
MBC	01.2024	AUD 2.328	1.543	0	(46)	(46)	(0,01)
	01.2024	CAD 378	279	0	(7)	(7)	0,00
	01.2024	€ 20	22	0	0	0	0,00
	01.2024	¥ 16.937	119	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	\$ 1.012	€ 922	6	0	6	0,00
MYI	01.2024	¥ 371.455	\$ 2.520	0	(117)	(117)	(0,03)
	01.2024	\$ 75.622	€ 68.802	398	0	398	0,09
SCX	01.2024	SEK 16.648	\$ 1.603	0	(49)	(49)	(0,01)
UAG	01.2024	AUD 1.129	749	0	(22)	(22)	(0,01)
	01.2024	£ 5.158	6.528	0	(48)	(48)	(0,01)
	01.2024	NOK 11.895	1.115	0	(56)	(56)	(0,01)
	01.2024	\$ 39.650	€ 36.047	178	0	178	0,04
				\$ 609	\$ (1.184)	\$ (575)	(0,13)

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilklasse 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	01.2024	AUD 782	\$ 518	\$ 0	\$ (16)	\$ (16)	0,00
BOA	01.2024	782	517	0	(16)	(16)	0,00
	01.2024	£ 136	172	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	¥ 237.879	1.612	0	(76)	(76)	(0,02)
	01.2024	NZD 253	154	0	(6)	(6)	0,00
BPS	01.2024	\$ 13.953	NOK 148.353	657	0	657	0,15
	01.2024	AUD 95	\$ 65	0	0	0	0,00
	01.2024	DKK 756	112	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	€ 396	432	0	(5)	(5)	0,00
	01.2024	£ 233	296	0	(2)	(2)	0,00
BRC	01.2024	¥ 175.550	1.196	0	(50)	(50)	(0,01)
	01.2024	DKK 1.004	147	0	(2)	(2)	0,00
	01.2024	\$ 0	CHF 0	0	0	0	0,00
CBK	01.2024	€ 190	\$ 209	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	£ 72	91	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	SEK 12	1	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 0	DKK 2	0	0	0	0,00
	01.2024	6.550	NOK 70.101	354	0	354	0,08
GLM	01.2024	CAD 1.750	\$ 1.290	0	(37)	(37)	(0,01)
	01.2024	CHF 492	561	0	(23)	(23)	(0,01)
	01.2024	\$ 7	NOK 74	0	0	0	0,00
JPM	01.2024	CAD 111	\$ 84	0	0	0	0,00
MBC	01.2024	132	98	0	(3)	(3)	0,00
	01.2024	€ 10.310	11.336	0	(56)	(56)	(0,01)
	01.2024	¥ 16.187	114	0	(1)	(1)	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	01.2024	\$ 230	NOK 2.506	\$ 17	\$ 0	\$ 17	0,00
MYI	01.2024	¥ 90.362	\$ 613	0	(28)	(28)	(0,01)
SCX	01.2024	SEK 4.137	398	0	(12)	(12)	0,00
UAG	01.2024	£ 1.266	1.603	0	(12)	(12)	0,00
	01.2024	\$ 20.502	NOK 218.539	1.021	0	1.021	0,23
				\$ 2.049	\$ (349)	\$ 1.700	0,39
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 5.567	1,29

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,000 % fällig am 01.01.2039	\$ 7.000	\$ (6.277)	(1,45)
2,000 % fällig am 01.01.2054	27.750	(22.685)	(5,25)
3,000 % fällig am 01.03.2054	2.500	(2.217)	(0,52)
5,500 % fällig am 01.01.2054	10.900	(10.948)	(2,53)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (42.127)	(9,75)
Summe Anlagen		\$ 542.404	125,47
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (110.114)	(25,47)
Nettovermögen		\$ 432.290	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) 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) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,46 %):

Emittentenbeschreibung	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Netto- vermögens
Deutsche Bank AG 3,035 % fällig am 28.05.2032	21.06.2021	\$ 1.061	\$ 878	0,20
DrillCo Holding Lux S.A.	08.06.2023	321	399	0,09
		\$ 1.382	\$ 1.277	0,29

Ein Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von USD null (31. Dezember 2022: USD 1.525) war zum 31. Dezember 2023 als Sicherheit gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 14.326 (31. Dezember 2022: USD 13.884) waren zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 870 (31. Dezember 2022: USD 1.120) waren zum 31. Dezember 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 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	\$ 556.360	\$ 1.793	\$ 558.153
Investmentfonds	18.210	0	0	18.210
Pensionsgeschäfte	0	534	0	534
Finanzderivate ⁽³⁾	(3.319)	10.953	0	7.634
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(42.127)	0	(42.127)
Summen	\$ 14.891	\$ 525.720	\$ 1.793	\$ 542.404

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Advantage Fund (Forts.)

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 442.801	\$ 831	\$ 443.632
Investmentfonds	18.242	0	0	18.242
Pensionsgeschäfte	0	1.408	0	1.408
Finanzderivate ⁽³⁾	4.652	(41)	0	4.611
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(28.813)	0	(28.813)
Summen	\$ 22.894	\$ 415.355	\$ 831	\$ 439.080

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

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

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

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
AZD	\$ (55)	\$ 0	\$ (55)	\$ 7	\$ 0	\$ 7
BOA	332	(270)	62	1.000	(730)	270
BOM	k. A.	k. A.	k. A.	24	0	24
BPS	(275)	280	5	(629)	560	(69)
BRC	326	(230)	96	272	0	272
BSH	k. A.	k. A.	k. A.	3	0	3
CBK	559	(600)	(41)	1.063	(1.120)	(57)
CLY	k. A.	k. A.	k. A.	(8)	0	(8)
DUB	(17)	(50)	(67)	(125)	20	(105)
FAR	(5)	0	(5)	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	1.938	(1.980)	(42)	150	(370)	(220)
GST	10	0	10	4	0	4
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	(4)	0	(4)
IND	k. A.	k. A.	k. A.	110	0	110
JPM	(82)	0	(82)	1.248	(760)	488
MBC	(127)	320	193	264	(90)	174
MYC	(42)	0	(42)	(5)	0	(5)
MYI	2.281	(2.710)	(429)	(909)	540	(369)
RBC	1	0	1	116	0	116
RYL	(7)	0	(7)	(2)	0	(2)
SCX	41	0	41	992	(910)	82
SOG	7	0	7	77	(70)	7
SSB	3	0	3	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	(432)	270	(162)	6	0	6
UAG	1.111	(1.380)	(269)	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. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	74,54	65,89
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	54,44	41,33
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,14	0,88
Investmentfonds	4,21	4,44
Pensionsgeschäfte	0,12	0,34
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(1,16)	1,08
Zentral abgerechnete Finanzderivate	1,64	(0,87)
Freiverkehrsfinanzderivate	1,29	0,91
Leerverkaufte Wertpapiere	(9,75)	(7,03)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	k. A.	(0,37)

* Gemäß der Liste der Märkte, die die Kriterien für einen geregelten OGAW-Markt erfüllen, in Anlage 1 zum Verkaufsprospekt.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Argentinien	0,03	0,02
Australien	1,65	1,74
Brasilien	0,00	0,76
Bulgarien	0,43	k. A.
Kanada	1,57	0,73
Cayman-Inseln	3,87	5,78
Chile	0,29	0,56
China	0,07	k. A.
Kolumbien	0,50	0,02
Tschechische Republik	0,11	0,10
Dänemark	2,49	2,67
Dominikanische Republik	0,30	0,16
Frankreich	2,78	2,83
Deutschland	2,02	2,33
Guatemala	0,09	0,10
Hongkong	k. A.	0,21
Ungarn	1,38	0,03
Indonesien	1,11	1,10
Irland	4,79	5,34
Israel	1,88	0,98
Italien	7,28	7,32
Elfenbeinküste	0,53	0,35
Japan	6,33	4,40
Kasachstan	0,43	k. A.
Luxemburg	1,24	0,67
Malaysia	0,46	0,98
Mexiko	k. A.	0,28
Marokko	k. A.	0,37
Multinational	0,21	0,25
Niederlande	1,28	1,59
Neuseeland	0,07	0,07
Norwegen	0,19	0,20
Peru	0,50	1,68
Philippinen	0,08	0,08
Polen	0,78	0,03
Portugal	0,18	0,09
Katar	0,07	0,08
Rumänien	1,07	0,63
Russland	0,08	0,20
Saudi-Arabien	0,83	k. A.
Serbien	0,82	0,88
Singapur	0,42	0,20
Slowenien	0,19	0,18
Südafrika	0,09	0,09
Südkorea	2,67	0,78
Spanien	0,87	1,04
Supranational	0,67	0,71
Schweiz	1,10	1,64
Thailand	0,22	0,26
Vereinigte Arabische Emirate	0,46	0,05
Großbritannien	8,07	9,05
USA	62,17	45,54
Kurzfristige Instrumente	4,40	2,95
Investmentfonds	4,21	4,44
Pensionsgeschäfte	0,12	0,34
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(1,16)	1,09
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	k. A.	(0,01)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,18)	(0,15)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,09	k. A.
Zinsswaps – Basiswaps	k. A.	0,01
Zinsswaps	1,73	(0,73)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,05	0,05
Optionen auf Wertpapiere	0,08	0,08
Verkaufsoptionen		
Devisenoptionen	(0,02)	k. A.
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	(0,19)	(0,27)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzkauf	(0,01)	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,00	0,01
Cross-Currency Swaps	0,01	0,00
Zinsswaps	0,01	0,00
Devisenterminkontrakte	0,47	0,37
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,89	0,68
Leerverkaufte Wertpapiere	(9,75)	(7,03)
Sonstige Aktiva und Passiva	(25,47)	(6,97)
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE											
AUSTRALIEN											
NON-AGENCY-MBS											
RESIMAC Bastille Trust				OZLM Ltd.				1,000 % fällig am 01.10.2053			
6,390 % fällig am 05.09.2057	\$	631	0,00	6,682 % fällig am 16.05.2030	\$	5.206	0,04	1,500 % fällig am 01.10.2053	DKK	34.560	0,03
				6,827 % fällig am 20.01.2031		3.129	0,02	2,000 % fällig am 01.10.2053		8.425	0,01
				Palmer Square CLO Ltd.				2,000 % fällig am 01.10.2050		0	0,00
				6,794 % fällig am 17.01.2031		2.466	0,02	2,500 % fällig am 01.04.2036		0	0,00
				Regatta Funding Ltd.				2,500 % fällig am 01.04.2047		0	0,00
				6,914 % fällig am 17.10.2030		6.595	0,05	3,000 % fällig am 01.07.2046		0	0,00
				Sound Point CLO Ltd.				4,820 % fällig am 01.01.2038		0	0,00
				6,741 % fällig am 26.07.2031		1.191	0,01	Summe Dänemark		264.682	2,02
				Venture CLO Ltd.				FINNLAND			
				6,535 % fällig am 15.04.2027		837	0,01	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
						141.720	1,08	Nordea Kiinnitysluotopankki Oyj			
				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL							
				Avolon Holdings Funding Ltd.				0,625 % fällig am 23.05.2025	€	1.000	0,01
				2,528 % fällig am 18.11.2027		431	0,00	FRANKREICH			
				Summe Australien		204.061	1,56	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
								BNP Paribas S.A.			
								2,219 % fällig am 09.06.2026	\$	5.200	0,04
								Dexia Credit Local S.A.			
								0,000 % fällig am 21.01.2028			
								(c)	€	9.100	0,07
								0,500 % fällig am 17.01.2025		2.300	0,02
								Societe Generale S.A.			
								1,488 % fällig am 14.12.2026	\$	21.700	0,15
								2,226 % fällig am 21.01.2026		24.200	0,18
								2,797 % fällig am 19.01.2028		17.500	0,12
								6,446 % fällig am 10.01.2029		3.100	0,02
								6,691 % fällig am 10.01.2034		25.400	0,21
								Summe Frankreich		279.665	2,14
								DEUTSCHLAND			
								UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
								Aareal Bank AG			
								0,625 % fällig am 14.02.2025	\$	800	0,01
								Deutsche Bank AG			
								0,050 % fällig am 20.11.2024	€	19.600	0,16
								1,375 % fällig am 03.09.2026		32.100	0,26
								1,375 % fällig am 17.02.2032		14.300	0,10
								1,625 % fällig am 20.01.2027		8.100	0,07
								1,750 % fällig am 19.11.2030		20.500	0,15
								1,875 % fällig am 23.02.2028		5.900	0,05
								2,625 % fällig am 16.12.2024	£	23.600	0,22
								3,729 % fällig am 14.01.2032 (h)	\$	2.000	0,01
								3,961 % fällig am 26.11.2025		26.750	0,20
								4,100 % fällig am 13.01.2026		1.800	0,01
								IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK)			
								3,750 % fällig am 15.09.2026 (b)	€	12.050	0,10
								Kreditanstalt fuer Wiederaufbau			
								5,000 % fällig am 19.03.2024	AUD	1.500	0,01
								Summe Deutschland		176.102	1,35
								UNGARN			
								STAATSEMISSIONEN			
								Hungary Government International Bond			
								3,000 % fällig am 27.10.2027	HUF	117.500	0,90
								5,000 % fällig am 22.02.2027	€	4.100	0,04
								6,250 % fällig am 22.09.2032	\$	17.200	0,14
								7,625 % fällig am 29.03.2041		100	0,00
								Summe Ungarn		23.558	0,18
								INTERNATIONALE KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG			
								Project Mercury			
								8,127 % fällig am 11.08.2030	€	25.000	0,21

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS							
IRLAND				IRLAND				IRLAND										
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE										
Accunia European CLO DAC 4,915 % fällig am 15.07.2030	€	4.290	\$ 4.735	0,04	4,908 % fällig am 12.01.2032	€	9.300	\$ 10.192	0,08	Japan Finance Organization for Municipalities 0,625 % fällig am 02.09.2025	\$	1.400	\$ 1.305	0,01				
Adagio CLO DAC 4,685 % fällig am 15.10.2031	10.250	11.169	0,08	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL		633.892	4,85	Japan Government International Bond 0,005 % fällig am 01.02.2024	¥	700.000	4,966	0,04	0,005 % fällig am 01.03.2024	15.550.000	110.326	0,84		
Aqueduct European CLO DAC 4,633 % fällig am 20.07.2030	9.527	10.447	0,08	AerCap Ireland Capital DAC 1,650 % fällig am 29.10.2024	\$	5.450	5,263	0,04	0,005 % fällig am 01.04.2024	8.140.000	57,762	0,44	0,005 % fällig am 01.05.2024	5.580.000	39.600	0,30		
Ares European CLO DAC 4,575 % fällig am 15.04.2030	6.807	7.460	0,06	1,750 % fällig am 29.10.2024	5.300	5.121	0,03	0,005 % fällig am 01.10.2024	17.912.450	127,122	0,97	0,100 % fällig am 10.03.2028 (e)	14.755.458	110,001	0,84			
4,625 % fällig am 15.10.2030	14.907	16.347	0,12	2,450 % fällig am 29.10.2026	200	185	0,00	0,200 % fällig am 20.06.2036	362.750	2,369	0,02	0,500 % fällig am 20.09.2046	8.768.000	50,253	0,39			
4,745 % fällig am 15.10.2031	23.787	26.029	0,20	3,000 % fällig am 29.10.2028	900	822	0,01	0,500 % fällig am 20.03.2049	11.468.000	63,119	0,48	0,700 % fällig am 20.03.2049	7.461.650	43,424	0,33			
4,843 % fällig am 20.04.2032	9.100	9.894	0,08	3,500 % fällig am 15.01.2025	1.300	1.271	0,01	0,700 % fällig am 20.06.2051	202.000	1,139	0,01	1,000 % fällig am 20.03.2052	70.000	425	0,00			
Armada Euro CLO DAC 4,685 % fällig am 15.07.2031	8.952	9.784	0,07	NON-AGENCY-MBS		12.662	0,09	1,300 % fällig am 20.06.2052	500.000	3,268	0,03	1,500 % fällig am 20.09.2043	11.670.000	84,317	0,65			
Aurium CLO DAC 4,695 % fällig am 16.01.2031	28.733	31.397	0,24	Bruegel DAC 4,762 % fällig am 22.05.2031	€	339	359	0,00	Summe Irland		650.247	4,97	Tokyo Metropolitan Government 0,750 % fällig am 16.07.2025	\$	18.600	17,458	0,13	
Avoca CLO DAC 4,785 % fällig am 15.10.2032	9.800	10.692	0,08	European Loan Conduit DAC 4,994 % fällig am 17.02.2030	3.058	3.334	0,03			3.693	0,03	Summe Japan		995.834	7,62			
Bain Capital Euro CLO DAC 4,733 % fällig am 20.01.2032	12.296	13.417	0,10	ISRAEL									JERSEY, KANALINSELN					
Black Diamond CLO DAC 4,982 % fällig am 15.05.2032	5.276	5.755	0,04	STAATSEMISSIONEN									UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Blackrock European CLO DAC 4,585 % fällig am 15.10.2031	10.606	11.533	0,09	Israel Government International Bond 1,000 % fällig am 31.03.2030	800	188	0,00	G City Europe Ltd. 4,250 % fällig am 11.09.2025	€	10.000	10,175	0,08	LUXEMBURG					
BlueMountain Fuji EUR CLO DAC 4,685 % fällig am 15.01.2031	11.174	12.209	0,09	2,000 % fällig am 31.03.2027	87.900	23.197	0,18					UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL						
BNPP AM Euro CLO DAC 4,822 % fällig am 22.07.2032	12.700	13.847	0,11	4,500 % fällig am 17.01.2033	\$	11.300	10,761	0,08	Aroundtown S.A. 0,000 % fällig am 16.07.2026 (c)	11.000	10,228	0,08	0,375 % fällig am 15.04.2027	1.700	1,515	0,01		
Cairn CLO BV 4,745 % fällig am 15.10.2031	16.389	17.808	0,14	5,000 % fällig am 30.10.2026	€	109.000	123,229	0,94	5,375 % fällig am 21.03.2029	\$	2.700	2,226	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	184	0,00
Carlyle Euro CLO DAC 4,632 % fällig am 15.08.2030	5.648	6.183	0,05	Summe Israel		157.375	1,20	ITALIEN					CPI Property Group S.A. 1,625 % fällig am 23.04.2027	16.100	13,110	0,10		
4,892 % fällig am 15.08.2032	3.200	3.488	0,03	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL									1,750 % fällig am 14.01.2030	17.000	10,733	0,08		
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd. 4,752 % fällig am 15.11.2031	11.479	12.505	0,10	AMCO - Asset Management Co. SpA 0,750 % fällig am 20.04.2028	300	292	0,00	2,750 % fällig am 12.05.2026	1.400	1,295	0,01	2,750 % fällig am 22.01.2028	£	1.000	898	0,01		
Contego CLO DAC 4,642 % fällig am 23.01.2030	6.279	6.837	0,05	4,625 % fällig am 06.02.2027	17.500	19.891	0,15	Logicor Financing SARL 0,625 % fällig am 17.11.2025	€	4.600	4,743	0,03	0,750 % fällig am 15.07.2024	5.200	5,612	0,04		
CVC Cordatus Loan Fund DAC 4,652 % fällig am 21.07.2030	20.067	21.917	0,17	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 0,875 % fällig am 08.10.2027	8.000	8.250	0,06	0,750 % fällig am 13.05.2025	2.000	2,142	0,02	2,250 % fällig am 13.05.2025	2.000	2,142	0,02			
Dryden Euro CLO DAC 4,625 % fällig am 15.04.2033	6.566	7.148	0,05	2,000 % fällig am 29.01.2024	26.600	29.342	0,23	Sberbank of Russia Via SB Capital S.A. 5,125 % fällig am 29.10.2022	\$	500	30	0,00	Summe Luxemburg		66.359	0,51		
4,862 % fällig am 15.05.2034	23.408	25.466	0,19	2,625 % fällig am 28.04.2025	2.800	3.019	0,02					MALAYSIA						
Griffith Park CLO DAC 4,704 % fällig am 21.11.2031	14.240	15.481	0,12	6,750 % fällig am 05.09.2027	12.000	13.881	0,11	STAATSEMISSIONEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL						
Harvest CLO DAC 4,566 % fällig am 26.06.2030	6.583	7.193	0,05	Intesa Sanpaolo SpA 5,125 % fällig am 29.08.2031	17.600	20.762	0,16	Cassa Depositi e Prestiti SpA 5,750 % fällig am 05.05.2026	\$	21.500	21,485	0,16	Petronas Capital Ltd. 2,480 % fällig am 28.01.2032	\$	5.500	4,701	0,04	
4,673 % fällig am 20.10.2031	15.251	16.598	0,13	Nexti SpA 1,625 % fällig am 30.04.2026	6.639	6.974	0,06	Italy Government International Bond 6,000 % fällig am 04.08.2028	£	5.684	7,619	0,06	3,500 % fällig am 21.04.2030	8.600	8,081	0,06		
4,725 % fällig am 15.07.2031	9.850	10.725	0,08	STAATSEMISSIONEN				29.104	0,22			4,550 % fällig am 21.04.2050	6.100	5,614	0,04			
4,815 % fällig am 15.01.2032	22.300	24.320	0,19	Summe Italien		131.515	1,01	4,800 % fällig am 21.04.2060	5.000	4,751	0,04	Summe Malaysia		108.797	0,83			
Jubilee CLO DAC 4,565 % fällig am 15.04.2030	19.072	20.881	0,16	JAPAN								MEXIKO						
4,615 % fällig am 15.04.2031	1.100	1.197	0,01	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL								STAATSEMISSIONEN						
Laurelin DAC 4,713 % fällig am 20.10.2031	14.251	15.588	0,12	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 1,412 % fällig am 17.07.2025	\$	29.800	28,128	0,21	Malaysia Government International Bond 3,519 % fällig am 20.04.2028	MYR	394.244	85,650	0,65	4,000 % fällig am 15.03.2115	€	800	685	0,01
Madison Park Euro Funding DAC 4,715 % fällig am 15.01.2032	22.900	24.928	0,19	2,193 % fällig am 25.02.2025	33.700	32.569	0,25	Development Bank of Japan, Inc. 1,750 % fällig am 28.08.2024	\$	13.400	13,104	0,10	5,000 % fällig am 27.04.2051	\$	7.800	6,791	0,05	
4,765 % fällig am 15.07.2032	7.300	7.955	0,06	Nissan Motor Co. Ltd. 3,522 % fällig am 17.09.2025	2.100	2.023	0,02	1,875 % fällig am 02.10.2024	12.800	12,490	0,10	Summe Mexiko		7.476	0,06			
Man GLG Euro CLO DAC 4,775 % fällig am 15.10.2032	9.835	10.732	0,08	Nomura Holdings, Inc. 2,329 % fällig am 22.01.2027	11.100	10.182	0,08											
Oak Hill European Credit Partners DAC 4,733 % fällig am 20.10.2031	24.038	26.261	0,20	Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0,010 % fällig am 10.09.2025	€	43.700	45,616	0,35										
OCP Euro CLO DAC 4,882 % fällig am 22.09.2034	22.300	24.283	0,19	0,409 % fällig am 07.11.2029	26.500	25.010	0,19											
Palmer Square European Loan Funding DAC 4,685 % fällig am 15.10.2031	11.036	11.997	0,09	2,440 % fällig am 18.06.2024	\$	26.400	26,016	0,20										
4,695 % fällig am 15.07.2031	3.157	3.445	0,03	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 5,520 % fällig am 13.01.2028	35.700	36.561	0,28											
4,745 % fällig am 15.04.2031	14.471	15.763	0,12	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 0,010 % fällig am 15.10.2027	€	34.800	34,244	0,26										
Sculptor European CLO DAC 4,755 % fällig am 14.01.2032	35.800	38.981	0,30	STAATSEMISSIONEN														
Segovia European CLO DAC 4,873 % fällig am 20.07.2032	13.700	14.942	0,11	Development Bank of Japan, Inc. 1,750 % fällig am 28.08.2024	\$	13.400	13,104	0,10										
Tikehau CLO DAC 4,844 % fällig am 04.08.2034	10.600	11.574	0,09	1,875 % fällig am 02.10.2024	12.800	12,490	0,10											
Toro European CLO DAC 4,812 % fällig am 15.02.2034	22.750	24.789	0,19															

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
MULTINATIONAL				PORTUGAL				BESCHREIBUNG			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Preferred Term Securities Ltd. 5,956 % fällig am 22.12.2036 \$	8.587	\$ 8.115	0,06	Banco Espirito Santo S.A. 4,000 % fällig am 21.01.2019 ^	€ 6.900	\$ 2.096	0,02	2,125 % fällig am 10.06.2027	KRW 16.365.000	\$ 12.273	0,09
6,046 % fällig am 22.03.2038	2.913	2.621	0,02	4,750 % fällig am 15.01.2018 ^	1.900	577	0,00	2,375 % fällig am 10.12.2027	14.900.000	11.233	0,08
Summe multinational		10.736	0,08	Summe Portugal		2.673	0,02	2,375 % fällig am 10.12.2028	113.474.130	85.023	0,65
NIEDERLANDE				KATAR				BESCHREIBUNG			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
ABN AMRO Bank NV 1,125 % fällig am 12.01.2032	€ 300	293	0,00	QatarEnergy 2,250 % fällig am 12.07.2031	\$ 8.000	6.821	0,05	2,625 % fällig am 10.06.2028	79.616.800	60.509	0,46
Cooperative Rabobank UA 3,758 % fällig am 06.04.2033	\$ 2.300	2.066	0,02	3,300 % fällig am 12.07.2051	5.100	3.736	0,03	3,250 % fällig am 10.03.2028	26.805.520	21.088	0,16
CTP NV 0,625 % fällig am 27.09.2026	€ 10.500	10.444	0,08	Summe Katar		10.557	0,08	3,250 % fällig am 10.06.2033	50.045.520	39.069	0,30
0,875 % fällig am 20.01.2026	14.100	14.453	0,11	RUMÄNIEN				3,250 % fällig am 10.09.2042	11.134.180	8.788	0,07
1,500 % fällig am 27.09.2031	6.500	5.608	0,04	STAATSEMISSIONEN				4,250 % fällig am 10.12.2032	166.494.540	139.727	1,07
Sagax Euro MTN NL BV 1,625 % fällig am 24.02.2026	11.900	12.476	0,10	Romania Government International Bond 1,375 % fällig am 02.12.2029	€ 6.560	5.987	0,04	5,500 % fällig am 10.03.2028	14.900.000	12.610	0,10
Summe Niederlande		45.340	0,35	1,750 % fällig am 13.07.2030	16.600	14.872	0,11	Summe Südkorea		433.976	3,32
NON-AGENCY-MBS				SAUDI-ARABIEN				SPANIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
Domi BV 4,775 % fällig am 15.06.2051	90	100	0,00	Saudi Arabian Oil Co. 2,250 % fällig am 24.11.2030	\$ 12.600	10.851	0,08	BBVA Consumer Auto 0,270 % fällig am 20.07.2031	€ 2.917	3.153	0,02
Dutch Property Finance BV 4,602 % fällig am 28.07.2054	197	218	0,00	3,250 % fällig am 24.11.2050	6.500	4.629	0,04	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
4,602 % fällig am 28.07.2058	13.146	14.487	0,11	3,500 % fällig am 24.11.2070	1.600	1.104	0,01	Banco Santander S.A. 1,849 % fällig am 25.03.2026	\$ 5.800	5.372	0,04
Eurosaill BV 5,485 % fällig am 17.10.2040	8	9	0,00	Summe Rumänien		102.236	0,78	6,607 % fällig am 07.11.2028	12.800	13.639	0,11
Jubilee Place BV 4,815 % fällig am 17.07.2058	9.711	10.742	0,08	STAATSEMISSIONEN				NON-AGENCY-MBS			
4,985 % fällig am 17.10.2057	5.226	5.791	0,05	Saudi Arabia Government International Bond 3,250 % fällig am 22.10.2030	3.100	2.880	0,02	Fondo de Titulizacion de Activos Santander Hipotecario 4,125 % fällig am 18.01.2049	€ 328	359	0,00
Summe Niederlande		31.347	0,24	4,750 % fällig am 18.01.2028	32.400	32.774	0,25	Fondo de Titulizacion de Activos UCI 4,065 % fällig am 15.09.2041	648	703	0,01
NEUSEELAND				SINGAPUR				STAATSEMISSIONEN			
STAATSEMISSIONEN				STAATSEMISSIONEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Auckland Council 1,000 % fällig am 19.01.2027	5.800	6.097	0,04	Singapore Government International Bond 2,250 % fällig am 01.08.2036	SGD 16.910	12.186	0,10	Autonomous Community of Catalonia 4,220 % fällig am 26.04.2035	3.900	4.426	0,03
New Zealand Government International Bond 1,500 % fällig am 15.05.2031 NZD	22.600	11.833	0,09	4,875 % fällig am 18.07.2033	33.500	34.259	0,26	Autonomous Community of Madrid 1,571 % fällig am 30.04.2029	1.300	1.349	0,01
2,000 % fällig am 20.09.2025	1.313	828	0,01	5,000 % fällig am 18.01.2053	2.700	2.549	0,02	Spain Government International Bond 1,450 % fällig am 31.10.2071	7.375	4.117	0,03
Summe Neuseeland		18.758	0,14	Summe Saudi-Arabien		89.046	0,68	1,900 % fällig am 31.10.2052	2.700	2.065	0,02
NORWEGEN				SLOWENIEN				ÜBERNATIONAL			
STAATSEMISSIONEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Kommunalbanken A/S 0,625 % fällig am 20.04.2026	€ 600	632	0,00	Nova Kreditna Banka Maribor d.d. 1,875 % fällig am 27.01.2025	€ 11.200	12.317	0,09	Europäische Investitionsbank 4,600 % fällig am 30.01.2037	CAD 1.050	839	0,01
1,900 % fällig am 19.01.2027 AUD	22.000	14.001	0,11	Nova Ljubljanska Banka d.d. 3,400 % fällig am 05.02.2030 (i)	3.500	3.356	0,03	Inter-American Development Bank 2,500 % fällig am 14.04.2027	AUD 15.200	9.856	0,07
5,250 % fällig am 15.07.2024	3.300	2.259	0,02	3,650 % fällig am 19.11.2029	8.300	8.072	0,06	Summe Supranational		10.695	0,08
Norway Government International Bond 1,250 % fällig am 17.09.2031 NOK	1.900	162	0,00	Summe Slowenien		23.745	0,18	SCHWEDEN			
1,750 % fällig am 13.03.2025	86.700	8.330	0,06	STAATSEMISSIONEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
1,750 % fällig am 17.02.2027	1.100	103	0,00	South Korea Government International Bond 1,375 % fällig am 10.12.2029	KRW 16.465.950	11.578	0,09	Molnlycke Holding AB 1,875 % fällig am 28.02.2025	€ 400	432	0,00
2,000 % fällig am 26.04.2028	7.300	684	0,01	1,500 % fällig am 10.12.2030	14.561.570	10.132	0,08	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Summe Norwegen		26.171	0,20	2,000 % fällig am 10.06.2031	30.643.570	21.946	0,17	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
PERU				SÜDKOREA				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
STAATSEMISSIONEN				STAATSEMISSIONEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Peru Government International Bond 2,780 % fällig am 01.12.2060	\$ 6.000	3.755	0,03	Summe Südkorea		52.184	0,40	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
3,230 % fällig am 28.07.2121	4.200	2.622	0,02	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
5,940 % fällig am 12.02.2029 PEN	5.817	1.571	0,01	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
6,150 % fällig am 12.08.2032	40.948	10.814	0,08	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Summe Peru		18.762	0,14	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
POLEN				SÜDKOREA				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
STAATSEMISSIONEN				STAATSEMISSIONEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Poland Government International Bond 3,875 % fällig am 14.02.2033	€ 15.400	17.740	0,13	Summe Südkorea		52.184	0,40	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
4,250 % fällig am 14.02.2043	3.400	3.962	0,03	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
4,875 % fällig am 04.10.2033	\$ 6.400	6.504	0,05	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
5,500 % fällig am 16.11.2027	2.700	2.807	0,02	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
5,500 % fällig am 04.04.2053	5.800	6.063	0,05	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Summe Polen		37.076	0,28	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	
SCHWEIZ												
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL												
Credit Suisse AG				Canada Square Funding PLC				4,500 % fällig am 07.06.2028	£ 23.100	\$ 30.710	0,24	
0,250 % fällig am 05.01.2026	€ 11.800	\$ 12.240	0,09	6,000 % fällig am 17.06.2058	£ 14.562	\$ 18.478	0,14					
UBS Group AG				6,170 % fällig am 17.06.2058	233	297	0,00				86.179	0,66
2,193 % fällig am 05.06.2026	\$ 400	381	0,00	6,470 % fällig am 17.12.2057	4.403	5.633	0,04	Summe Großbritannien			770.139	5,89
2,875 % fällig am 02.04.2032	€ 19.700	20.372	0,16	Eurohome UK Mortgages PLC				USA				
3,091 % fällig am 14.05.2032	\$ 27.800	23.690	0,18	5,490 % fällig am 15.06.2044	109	137	0,00	FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
3,869 % fällig am 12.01.2029	12.550	11.842	0,09	Eurosail PLC				Accredited Mortgage Loan Trust				
4,194 % fällig am 01.04.2031	1.600	1.491	0,01	4,165 % fällig am 15.12.2044	€ 116	127	0,00	5,730 % fällig am 25.09.2036	\$ 1.091	1.077	0,01	
4,488 % fällig am 12.05.2026	1.500	1.478	0,01	4,198 % fällig am 13.03.2045	375	407	0,00	ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust				
4,550 % fällig am 17.04.2026	400	395	0,00	5,489 % fällig am 13.03.2045	€ 33	42	0,00	5,590 % fällig am 25.07.2036	4	2	0,00	
6,373 % fällig am 15.07.2026	900	911	0,01	6,039 % fällig am 13.09.2045	774	974	0,01	5,730 % fällig am 25.12.2036	5.848	3.189	0,03	
6,442 % fällig am 11.08.2028	30.600	31.797	0,24	6,289 % fällig am 13.06.2045	41	51	0,00	5,770 % fällig am 25.07.2036	2.139	706	0,01	
6,537 % fällig am 12.08.2033	5.700	6.086	0,05	Great Hall Mortgages PLC				6,265 % fällig am 25.01.2035	688	637	0,01	
7,375 % fällig am 07.09.2033	€ 6.900	10.149	0,08	4,062 % fällig am 18.03.2039	€ 123	136	0,00	6,370 % fällig am 25.12.2034	909	823	0,01	
7,750 % fällig am 01.03.2029	€ 15.900	20.266	0,16	4,082 % fällig am 18.06.2038	€ 57	63	0,00	6,370 % fällig am 25.08.2035	3.908	3.789	0,03	
Summe Schweiz		141.098	1,08	5,579 % fällig am 18.03.2039	€ 4.670	5.728	0,04	Ameritrust Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
THAILAND				5,812 % fällig am 18.06.2039	\$ 33	32	0,00	6,220 % fällig am 25.01.2036	600	580	0,01	
STAATSEMISSIONEN				Ludgate Funding PLC				6,445 % fällig am 25.07.2035	800	757	0,01	
Thailand Government International Bond				4,115 % fällig am 01.01.2061	€ 416	442	0,00	6,520 % fällig am 25.11.2034	554	541	0,00	
3,390 % fällig am 17.06.2037	THB 945.547	29.360	0,23	Mansard Mortgages PLC				Amortizing Residential Collateral Trust				
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE				5,989 % fällig am 15.12.2049	€ 4.909	6.177	0,05	6,170 % fällig am 25.10.2031	24	23	0,00	
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Newgate Funding PLC				Amresco Residential Securities Corp. Mortgage Loan Trust				
MDGH GMTN RSC Ltd.				4,195 % fällig am 01.12.2050	€ 1.493	1.517	0,01	6,410 % fällig am 25.06.2029	40	38	0,00	
5,500 % fällig am 28.04.2033	\$ 7.000	7.435	0,06	4,205 % fällig am 01.12.2050	395	415	0,00	Argent Securities Trust				
GROSSBRITANNIEN				4,525 % fällig am 15.12.2050	610	661	0,01	5,770 % fällig am 25.07.2036	5.890	5.134	0,04	
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				5,175 % fällig am 15.12.2050	1.816	1.864	0,02	Asset-Backed Funding Certificates Trust				
Barclays PLC				5,425 % fällig am 15.12.2050	3.170	3.086	0,02	6,170 % fällig am 25.06.2034	227	222	0,00	
2,885 % fällig am 31.01.2027	€ 13.900	15.107	0,12	5,509 % fällig am 01.12.2050	€ 557	685	0,01	Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				
3,125 % fällig am 17.01.2024	€ 800	1.019	0,01	5,510 % fällig am 01.12.2050	465	569	0,01	5,401 % fällig am 25.06.2035	1.322	1.293	0,01	
4,375 % fällig am 12.01.2026	\$ 2.200	2.171	0,02	5,549 % fällig am 01.12.2050	332	395	0,00	6,085 % fällig am 25.02.2036	2.094	2.048	0,02	
6,496 % fällig am 13.09.2027	23.600	24.272	0,19	6,340 % fällig am 15.12.2050	2.279	2.798	0,02	6,110 % fällig am 25.12.2034	2	2	0,00	
6,515 % fällig am 26.06.2024	AUD 4.000	2.744	0,02	6,590 % fällig am 15.12.2050	2.030	2.408	0,02	6,130 % fällig am 25.10.2032	1	1	0,00	
Haleon UK Capital PLC				Paragon Mortgages PLC				6,470 % fällig am 25.11.2042	15	15	0,00	
3,125 % fällig am 24.03.2025	\$ 16.600	16.220	0,12	5,861 % fällig am 15.11.2038	\$ 20	19	0,00	6,520 % fällig am 25.08.2037	2.058	1.791	0,01	
HSBC Holdings PLC				6,270 % fällig am 15.05.2045	£ 1.828	2.334	0,02	Centex Home Equity Loan Trust				
2,848 % fällig am 04.06.2031	9.900	8.521	0,07	Polaris PLC				5,930 % fällig am 25.07.2032	15	14	0,00	
2,999 % fällig am 10.03.2026	1.300	1.261	0,01	5,985 % fällig am 23.12.2058	4.204	5.347	0,04	Citigroup Mortgage Loan Trust				
3,973 % fällig am 22.05.2030	21.700	20.288	0,16	Residential Mortgage Securities PLC				5,530 % fällig am 25.07.2045	59	40	0,00	
4,041 % fällig am 13.03.2028	7.300	7.037	0,05	6,470 % fällig am 20.06.2070	14.610	18.660	0,14	5,764 % fällig am 25.01.2037	126	52	0,00	
4,583 % fällig am 19.06.2029	19.600	19.021	0,15	Resloc UK PLC				5,890 % fällig am 25.01.2037	399	391	0,00	
4,755 % fällig am 09.06.2028	11.200	11.042	0,08	5,499 % fällig am 15.12.2043	49	61	0,00	7,250 % fällig am 25.05.2036	1.282	666	0,01	
5,210 % fällig am 11.08.2028	19.400	19.394	0,15	5,559 % fällig am 15.12.2043	2.347	2.780	0,02	Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				
John Lewis PLC				5,578 % fällig am 15.12.2043	\$ 124	120	0,00	5,860 % fällig am 25.06.2037	2.797	2.762	0,02	
6,125 % fällig am 21.01.2025	€ 100	127	0,00	Ripon Mortgages PLC				Countrywide Asset-Backed Certificates				
Lloyds Banking Group PLC				5,920 % fällig am 28.08.2056	£ 72.353	91.962	0,70	6,150 % fällig am 25.12.2036	116	89	0,00	
4,650 % fällig am 24.03.2026	\$ 1	1	0,00	RMAC Securities PLC				Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				
Nationwide Building Society				4,200 % fällig am 12.06.2044	€ 786	830	0,01	5,610 % fällig am 25.06.2037	1.343	1.239	0,01	
2,972 % fällig am 16.02.2028	8.800	8.191	0,06	5,489 % fällig am 12.06.2044	€ 324	402	0,00	5,610 % fällig am 25.07.2037	702	639	0,01	
NatWest Group PLC				5,509 % fällig am 12.06.2044	222	273	0,00	5,610 % fällig am 25.08.2037	506	503	0,00	
5,076 % fällig am 27.01.2030	19.200	18.922	0,14	Southern Pacific Financing PLC				5,690 % fällig am 25.08.2037	15.000	13.477	0,10	
NatWest Markets PLC				5,607 % fällig am 10.03.2044	446	561	0,00	5,690 % fällig am 25.09.2037	394	401	0,00	
0,125 % fällig am 12.11.2025	€ 7.721	8.038	0,06	Stratton Mortgage Funding PLC				5,690 % fällig am 25.06.2047	11.455	10.831	0,08	
Santander UK Group Holdings PLC				6,120 % fällig am 12.03.2052	14.315	18.249	0,14	5,790 % fällig am 25.05.2047	7.634	5.284	0,04	
6,534 % fällig am 10.01.2029	\$ 1.900	1.968	0,02	6,121 % fällig am 20.07.2060	37.229	47.452	0,36	5,870 % fällig am 25.09.2047	2.115	1.978	0,02	
7,482 % fällig am 29.08.2029	£ 24.800	34.409	0,26	Towd Point Mortgage Funding PLC				5,990 % fällig am 25.12.2036	5.251	4.897	0,04	
Santander UK PLC				6,365 % fällig am 20.10.2051	10.235	13.061	0,10	5,990 % fällig am 25.09.2046	3.570	3.365	0,03	
5,770 % fällig am 12.02.2027	16.900	21.582	0,16	6,571 % fällig am 20.07.2045	18.730	23.943	0,18	6,130 % fällig am 25.08.2035	1.599	1.551	0,01	
Standard Chartered PLC				Trinity Square PLC				6,160 % fällig am 25.05.2036	1.681	1.661	0,01	
0,991 % fällig am 12.01.2025	\$ 13.400	13.384	0,10	6,070 % fällig am 15.07.2059	13.065	16.654	0,13	6,310 % fällig am 25.10.2047	2.501	2.393	0,02	
1,822 % fällig am 23.11.2025	28.100	27.070	0,21	Twin Bridges PLC				6,445 % fällig am 25.01.2036	4.412	4.285	0,03	
2,608 % fällig am 12.01.2028	12.700	11.623	0,09	6,070 % fällig am 12.03.2055	10.000	12.701	0,10	6,520 % fällig am 25.11.2034	38	37	0,00	
2,678 % fällig am 29.06.2032	600	488	0,00	Uropa Securities PLC				Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.				
TP ICAP Finance PLC				5,540 % fällig am 10.10.2040	45	56	0,00	6,190 % fällig am 25.07.2034	80	79	0,00	
2,625 % fällig am 18.11.2028	€ 9.800	10.465	0,08	Warwick Finance Residential Mortgages PLC				Countrywide Asset-Backed Certificates, Inc.				
Summe Großbritannien		304.365	2,33	0,000 % fällig am 21.12.2049 (c)	1	5.837	0,05	5,270 % fällig am 25.02.2035	252	238	0,00	
NON-AGENCY-MBS				6,170 % fällig am 21.12.2049	29.110	37.205	0,29	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.				
Alba PLC				6,870 % fällig am 21.12.2049	7.280	9.204	0,07	5,077 % fällig am 25.01.2032	12	12	0,00	
4,085 % fällig am 15.12.2038	€ 90	96	0,00	7,370 % fällig am 21.12.2049	3.640	4.576	0,04	Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust				
5,509 % fällig am 15.12.2038	€ 4.122	5.121	0,04	7,870 % fällig am 21.12.2049	2.080	2.606	0,02	5,590 % fällig am 25.11.2036	30	13	0,00	
Brass PLC				8,370 % fällig am 21.12.2049	2.080	2.561	0,02	CSAB Mortgage-Backed Trust				
5,940 % fällig am 16.11.2066	2.977	3.802	0,03	Summe		379.595	2,90	6,672 % fällig am 25.06.2036	198	57	0,00	
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				STAATSEMISSIONEN								
United Kingdom Gilt				0,625 % fällig am 22.10.2050	46.810	26.357	0,20	Delta Funding Home Equity Loan Trust				
1,250 % fällig am 31.07.2051	31.025	21.078	0,16	1,250 % fällig am 31.07.2051	31.025	21.078	0,16	6,116 % fällig am 15.08.2030	8	8	0,00	
1,500 % fällig am 31.07.2053 (i)	11.300	8.034	0,06	Summe				Ellington Loan Acquisition Trust				
								6,570 % fällig am 25.05.2037	291	280	0,00	

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
EMC Mortgage Loan Trust				New Century Home Equity Loan Trust				Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust			
6,210 % fällig am 25.05.2040	\$ 11	\$ 11	0,00	3,699 % fällig am 20.06.2031	\$ 163	\$ 147	0,00	5,815 % fällig am 25.01.2037	\$ 4.875	4.705	0,04
Encore Credit Receivables Trust				Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust							
6,370 % fällig am 25.01.2036	6.000	5.698	0,04	6,100 % fällig am 25.02.2036	3.934	3.533	0,03			303.638	2,32
Fieldstone Mortgage Investment Trust				Nomura Resecuritization Trust				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
5,697 % fällig am 25.11.2036	1.992	1.154	0,01	3,950 % fällig am 26.12.2037	948	805	0,01	7-Eleven, Inc.			
First Franklin Mortgage Loan Trust				NovaStar Mortgage Funding Trust				0,800 % fällig am 10.02.2024	12.300	12.231	0,09
5,690 % fällig am 25.12.2037	2.395	2.262	0,02	2,907 % fällig am 25.01.2036	109	107	0,00	American Tower Corp.			
Fremont Home Loan Trust				5,810 % fällig am 25.01.2037	1.354	478	0,00	2,950 % fällig am 15.01.2025	14.600	14.254	0,11
5,605 % fällig am 25.10.2036	2.130	1.870	0,01	6,010 % fällig am 25.05.2036	3.600	3.394	0,03	3,800 % fällig am 15.08.2029	7.400	7.033	0,05
5,610 % fällig am 25.01.2037	2.329	1.148	0,01	Option One Mortgage Loan Trust				Aviation Capital Group LLC			
6,180 % fällig am 25.06.2035	4.763	4.569	0,04	5,610 % fällig am 25.01.2037	709	443	0,00	4,125 % fällig am 01.08.2025	23.600	22.924	0,18
GSAA Home Equity Trust				5,610 % fällig am 25.03.2037	2.630	2.007	0,02	Bank of America Corp.			
5,930 % fällig am 25.04.2047	303	145	0,00	5,650 % fällig am 25.04.2037	14.222	6.789	0,05	1,949 % fällig am 27.10.2026	€ 17.600	18.883	0,14
5,950 % fällig am 25.06.2036	2.762	790	0,01	5,690 % fällig am 25.04.2037	3.711	2.594	0,02	3,384 % fällig am 02.04.2026	\$ 11.800	11.483	0,09
6,070 % fällig am 25.03.2037	283	111	0,00	5,690 % fällig am 25.05.2037	4.639	2.748	0,02	4,916 % fällig am 22.09.2026	€ 6.200	6.880	0,05
6,070 % fällig am 25.05.2047	107	65	0,00	6,150 % fällig am 25.11.2034	47	46	0,00	4,962 % fällig am 24.08.2025	15.400	17.090	0,13
GSAMP Trust				6,340 % fällig am 25.05.2035	3.867	3.235	0,03	5,202 % fällig am 25.04.2029	\$ 27.100	27.285	0,21
5,600 % fällig am 25.12.2046	7.911	4.231	0,03	Owin Mortgage Loan Trust				Bayer U.S. Finance LLC			
5,610 % fällig am 25.12.2036	5.827	3.064	0,02	5,757 % fällig am 25.05.2037	1.551	1.193	0,01	4,250 % fällig am 15.12.2025	5.700	5.557	0,04
5,700 % fällig am 25.12.2046	6.932	3.438	0,03	Park Place Securities, Inc.				British Airways Pass-Through Trust			
5,750 % fällig am 25.06.2036	119	115	0,00	6,205 % fällig am 25.09.2035	164	160	0,00	3,300 % fällig am 15.06.2034	5.271	4.696	0,04
5,970 % fällig am 25.05.2046	442	413	0,00	People's Choice Home Loan Securities Trust				Broadcom, Inc.			
6,145 % fällig am 25.11.2035	2.179	2.065	0,02	6,820 % fällig am 25.01.2035	97	93	0,00	2,450 % fällig am 15.02.2031	200	171	0,00
Home Equity Asset Trust				Renaissance Home Equity Loan Trust				Charter Communications Operating LLC			
6,030 % fällig am 25.08.2036	337	329	0,00	5,340 % fällig am 25.01.2037	15.587	5.287	0,04	3,750 % fällig am 15.02.2028	10.900	10.298	0,08
6,390 % fällig am 25.02.2033	2	2	0,00	5,879 % fällig am 25.06.2037	19.229	5.276	0,04	3,850 % fällig am 01.04.2061	5.100	3.183	0,02
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust				5,893 % fällig am 25.06.2037	9.958	2.739	0,02	4,500 % fällig am 01.02.2024	3.800	3.794	0,03
5,630 % fällig am 25.11.2036	5.955	5.210	0,04	6,170 % fällig am 25.08.2032	1	1	0,00	5,125 % fällig am 01.07.2049	600	488	0,00
5,790 % fällig am 25.04.2037	3.007	2.576	0,02	Residential Asset Mortgage Products Trust				6,384 % fällig am 23.10.2035	6.000	6.097	0,05
HSI Asset Securitization Corp. Trust				5,910 % fällig am 25.12.2036	449	434	0,00	7,289 % fällig am 01.02.2024	7.700	7.700	0,06
6,010 % fällig am 25.02.2036	1.836	1.794	0,01	6,150 % fällig am 25.12.2035	3.448	3.024	0,02	Citigroup, Inc.			
Humboldt Americas LLC				Residential Asset Securities Corp. Trust				3,290 % fällig am 17.03.2026 (h)	33.100	32.241	0,25
0,000 % fällig am 31.07.2022 COP	20.000.000	4.478	0,03	6,175 % fällig am 25.11.2035	600	576	0,00	Corebridge Financial, Inc.			
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust				Saxon Asset Securities Trust				3,500 % fällig am 04.04.2025	7.500	7.317	0,06
5,690 % fällig am 25.08.2036	\$ 2.679	1.875	0,01	5,670 % fällig am 25.05.2047	7.795	6.807	0,05	Credit Suisse AG AT1 Claim	1.200	144	0,00
5,730 % fällig am 25.08.2036	168	167	0,00	5,780 % fällig am 25.09.2037	2.011	1.898	0,02	Dell International LLC			
5,740 % fällig am 25.08.2036	8.000	7.272	0,06	Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust				6,020 % fällig am 15.06.2026	1.407	1.441	0,01
5,950 % fällig am 25.04.2036	4.535	4.430	0,03	5,570 % fällig am 25.12.2036	5	3	0,00	Doctors Co. An Interinsurance Exchange			
Lehman ABS Mortgage Loan Trust				5,590 % fällig am 25.12.2036	81	19	0,00	4,500 % fällig am 18.01.2032	3.900	3.110	0,02
5,560 % fällig am 25.06.2037	88	56	0,00	5,600 % fällig am 25.05.2037	144	106	0,00	Energy Transfer LP			
Lehman XS Trust				6,190 % fällig am 25.10.2035	523	432	0,00	4,500 % fällig am 15.04.2024	1.300	1.295	0,01
5,022 % fällig am 25.04.2037	1	3	0,00	6,295 % fällig am 25.10.2035	2.208	2.030	0,02	Ford Motor Credit Co. LLC			
Long Beach Mortgage Loan Trust				SG Mortgage Securities Trust				2,748 % fällig am 14.06.2024	£ 2.600	3.270	0,02
5,770 % fällig am 25.05.2036	3.678	1.982	0,02	5,790 % fällig am 25.07.2036	3.109	676	0,01	2,900 % fällig am 16.02.2028	\$ 700	629	0,00
6,030 % fällig am 25.10.2034	538	515	0,00	SLM Student Loan Trust				3,375 % fällig am 13.11.2025	2.700	2.585	0,02
6,745 % fällig am 25.02.2035	6.545	6.387	0,05	4,356 % fällig am 25.10.2039	€ 150	154	0,00	3,664 % fällig am 08.09.2024	1.100	1.083	0,01
Louisiana Local Government Environmental Facilities & Community Development Authority				4,475 % fällig am 15.12.2033	832	851	0,01	3,815 % fällig am 02.11.2027	1.400	1.308	0,01
5,048 % fällig am 01.12.2034	6.600	6.759	0,05	Soundview Home Loan Trust				4,389 % fällig am 08.01.2026	1.000	973	0,01
MASTR Asset-Backed Securities Trust				5,620 % fällig am 25.03.2037	\$ 545	508	0,00	4,687 % fällig am 09.06.2025	600	590	0,00
5,670 % fällig am 25.08.2036	16.133	5.930	0,05	5,640 % fällig am 25.07.2037	1.762	1.506	0,01	5,584 % fällig am 18.03.2024	2.400	2.397	0,02
MASTR Specialized Loan Trust				5,640 % fällig am 25.08.2037	242	204	0,00	GA Global Funding Trust			
7,120 % fällig am 25.06.2043	183	191	0,00	5,650 % fällig am 25.07.2037	148	127	0,00	2,250 % fällig am 06.01.2027	9.400	8.543	0,07
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				5,670 % fällig am 25.06.2037	6.217	4.382	0,03	GLP Capital LP			
5,630 % fällig am 25.09.2037	12	2	0,00	5,680 % fällig am 25.06.2037	11.991	7.918	0,06	5,250 % fällig am 01.06.2025	1.500	1.496	0,01
6,190 % fällig am 25.05.2036	166	163	0,00	5,875 % fällig am 25.12.2036	5.895	5.749	0,04	5,300 % fällig am 15.01.2029	2.500	2.487	0,02
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				5,970 % fällig am 25.10.2036	8.229	7.708	0,06	Goldman Sachs Group, Inc.			
5,530 % fällig am 25.05.2037	218	185	0,00	5,970 % fällig am 25.11.2036	5.166	4.863	0,04	4,452 % fällig am 30.04.2024	€ 18.600	20.555	0,16
5,600 % fällig am 25.01.2037	2.591	1.151	0,01	6,220 % fällig am 25.03.2036	822	806	0,01	4,956 % fällig am 07.02.2025	6.800	7.519	0,06
5,610 % fällig am 25.10.2036	2.988	1.290	0,01	6,370 % fällig am 25.10.2037	4.995	3.924	0,03	6,079 % fällig am 24.01.2025	\$ 19.000	18.993	0,15
5,700 % fällig am 25.10.2036	10.069	5.278	0,04	Specialty Underwriting & Residential Finance Trust				HCA, Inc.			
5,720 % fällig am 25.07.2036	471	414	0,00	5,076 % fällig am 25.12.2036	223	212	0,00	5,375 % fällig am 01.09.2026	2.170	2.181	0,02
5,790 % fällig am 25.09.2036	4.297	1.838	0,01	Structured Asset Investment Loan Trust				JPMorgan Chase & Co.			
5,970 % fällig am 25.04.2036	4.357	4.088	0,03	6,090 % fällig am 25.01.2036	2.786	2.565	0,02	2,595 % fällig am 24.02.2026	21.600	20.929	0,16
6,145 % fällig am 25.09.2035	477	447	0,00	6,745 % fällig am 25.11.2034	1.953	1.944	0,02	4,080 % fällig am 26.04.2026	33.800	33.268	0,25
7,720 % fällig am 25.03.2033	47	45	0,00	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				Lehman Brothers Holdings, Inc.			
9,270 % fällig am 25.02.2047	1.253	1.021	0,01	5,605 % fällig am 25.07.2036	136	136	0,00	0,000 % fällig am 25.05.2010 ^	8.800	15	0,00
Morgan Stanley Home Equity Loan Trust				6,957 % fällig am 25.04.2035	5	5	0,00	5,625 % fällig am 24.01.2013 ^	12.700	25	0,00
5,640 % fällig am 25.04.2037	3.523	1.833	0,01	Terwin Mortgage Trust				6,200 % fällig am 26.09.2014 ^	9.800	20	0,00
5,700 % fällig am 25.04.2037	10.771	5.612	0,04	6,410 % fällig am 25.11.2033	4	4	0,00	7,875 % fällig am 08.05.2018 ^	£ 14.000	86	0,00
Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital Trust				Texas Natural Gas Securitization Finance Corp.				Morgan Stanley			
5,520 % fällig am 25.11.2036	2	1	0,00	5,169 % fällig am 01.04.2041	11.000	11.388	0,09	2,103 % fällig am 08.05.2026	€ 30.000	32.401	0,25
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust				2,630 % fällig am 18.02.2026	\$ 11.600	11.232	0,09
5,750 % fällig am 25.04.2037	103	50	0,00	5,620 % fällig am 25.01.2037	2.580	2.176	0,02	Organon & Co.			
5,930 % fällig am 25.02.2037	174	37	0,00	Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust				2,875 % fällig am 30.04.2028	€ 3.400	3.459	0,03
6,000 % fällig am 25.02.2037	131	74	0,00	4,290 % fällig am 25.10.2036	48	17	0,00	4,125 % fällig am 30.04.2028	\$ 4.900	4.515	0,03
6,190 % fällig am 25.04.2037	292	82	0,00					Pacific Gas & Electric Co.			
								2,100 % fällig am 01.08.2027	500	451	0,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES	
		MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS			MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS			MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS
2,950 % fällig am 01.03.2026	\$ 1.900	\$ 1.801	0,01	Banc of America Funding Trust				5,870 % fällig am 25.05.2036	\$ 68	\$ 59	0,00
3,150 % fällig am 01.01.2026	5.300	5.086	0,04	4,443 % fällig am 20.10.2046	\$ 99	\$ 82	0,00	5,890 % fällig am 25.07.2046	49	40	0,00
3,300 % fällig am 01.12.2027	800	747	0,01	5,061 % fällig am 20.01.2047	101	87	0,00	5,892 % fällig am 20.03.2046	1.502	1.219	0,01
3,400 % fällig am 15.08.2024	1.300	1.279	0,01	5,490 % fällig am 20.02.2036	211	197	0,00	5,930 % fällig am 25.11.2036	5.537	4.505	0,04
3,450 % fällig am 01.07.2025	400	387	0,00	5,750 % fällig am 25.11.2035	6	5	0,00	5,932 % fällig am 20.05.2046	2.368	2.004	0,02
3,750 % fällig am 01.07.2028	1.500	1.406	0,01	5,792 % fällig am 20.02.2047	563	486	0,00	6,000 % fällig am 25.03.2036	1.799	814	0,01
4,000 % fällig am 01.12.2046	1.600	1.175	0,01	5,920 % fällig am 20.11.2035	87	78	0,00	6,000 % fällig am 25.02.2037	177	78	0,00
4,250 % fällig am 15.03.2046	800	617	0,00	Banc of America Mortgage Trust				6,030 % fällig am 25.02.2037	836	674	0,01
4,300 % fällig am 15.03.2045	1.500	1.178	0,01	5,998 % fällig am 25.09.2033	6	5	0,00	6,110 % fällig am 25.11.2035	10	8	0,00
4,500 % fällig am 01.07.2040	800	678	0,01	6,330 % fällig am 25.09.2035	5	4	0,00	6,112 % fällig am 20.11.2035	349	321	0,00
4,600 % fällig am 15.06.2043	1.000	826	0,01	BCAP LLC Trust				6,112 % fällig am 20.12.2035	1.546	1.391	0,01
4,750 % fällig am 15.02.2044	200	167	0,00	4,705 % fällig am 26.01.2047	244	232	0,00	6,132 % fällig am 20.11.2035	27	25	0,00
4,950 % fällig am 01.07.2050	600	514	0,00	5,250 % fällig am 26.04.2037	537	308	0,00	6,150 % fällig am 25.10.2046	715	514	0,01
Penske Truck Leasing Co. LP				5,810 % fällig am 25.01.2037	23	21	0,00	6,220 % fällig am 25.07.2036	268	122	0,00
3,450 % fällig am 01.07.2024	4.800	4.743	0,04	5,910 % fällig am 25.05.2047	156	147	0,00	6,250 % fällig am 25.11.2036	118	89	0,00
Principal Life Global Funding				Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust				6,250 % fällig am 25.08.2037	454	225	0,00
1,375 % fällig am 10.01.2025	7.200	6.918	0,05	3,877 % fällig am 25.05.2047	93	84	0,00	6,457 % fällig am 25.03.2037	182	100	0,00
Sabine Pass Liquefaction LLC				4,091 % fällig am 25.05.2034	68	57	0,00	6,500 % fällig am 25.08.2032	3	3	0,00
5,750 % fällig am 15.05.2024	1.082	1.082	0,01	4,393 % fällig am 25.08.2033	5	5	0,00	6,512 % fällig am 25.11.2035	301	256	0,00
Southern California Edison Co.				5,453 % fällig am 25.02.2034	8	7	0,00	7,010 % fällig am 25.11.2035	244	197	0,00
1,100 % fällig am 01.04.2024	5.700	5.638	0,04	5,500 % fällig am 25.08.2033	34	31	0,00	7,052 % fällig am 25.11.2035	233	202	0,00
6,266 % fällig am 01.04.2024	2.900	2.901	0,02	5,561 % fällig am 25.05.2034	63	57	0,00	Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust			
T-Mobile USA, Inc.				5,611 % fällig am 25.10.2033	25	23	0,00	3,695 % fällig am 25.04.2035	125	89	0,00
5,050 % fällig am 15.07.2033	10.900	10.989	0,08	6,043 % fällig am 25.02.2036	36	31	0,00	3,991 % fällig am 25.09.2033	10	8	0,00
Wells Fargo & Co.				7,660 % fällig am 25.02.2036	47	40	0,00	4,042 % fällig am 20.04.2036	894	797	0,01
3,908 % fällig am 25.04.2026	8.700	8.533	0,07	Bear Stearns ALT-A Trust				4,126 % fällig am 20.09.2036	48	41	0,00
		463.270	3,54	4,180 % fällig am 25.03.2036	217	132	0,00	4,366 % fällig am 19.01.2034	33	29	0,00
				4,196 % fällig am 25.11.2036	440	197	0,00	4,703 % fällig am 20.02.2036	0	2	0,00
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				4,235 % fällig am 25.08.2036	1.198	606	0,01	4,765 % fällig am 25.11.2034	126	114	0,00
CenturyLink, Inc.				4,255 % fällig am 25.08.2036	10	6	0,00	5,500 % fällig am 25.11.2035	63	31	0,00
7,720 % fällig am 15.03.2027	9.085	6.298	0,05	4,488 % fällig am 25.05.2035	39	37	0,00	5,750 % fällig am 25.07.2037	308	151	0,00
Organon & Co.				4,492 % fällig am 25.11.2036	2.537	1.324	0,01	5,930 % fällig am 25.05.2035	385	309	0,00
8,472 % fällig am 02.06.2028	5.933	5.955	0,04	4,600 % fällig am 25.11.2035	443	338	0,00	6,000 % fällig am 25.07.2036	290	152	0,00
		12.253	0,09	4,730 % fällig am 25.09.2035	1.516	899	0,01	6,000 % fällig am 25.05.2037	1.063	483	0,00
				5,151 % fällig am 25.01.2036	1.022	951	0,01	6,050 % fällig am 25.04.2035	175	160	0,00
KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL				5,790 % fällig am 25.02.2034	104	97	0,00	6,050 % fällig am 25.04.2035	10	9	0,00
American Municipal Power, Inc., Ohio Revenue Bonds, (BABs), Series 2010				6,190 % fällig am 25.08.2035	8.579	8.109	0,06	6,110 % fällig am 25.03.2035	1.048	926	0,01
6,270 % fällig am 15.02.2050	90	98	0,00	Bear Stearns Mortgage Funding Trust				6,130 % fällig am 25.02.2035	210	191	0,00
American Municipal Power, Inc., Ohio Revenue Bonds, Series 2010				5,630 % fällig am 25.12.2046	342	286	0,00	6,150 % fällig am 25.02.2035	88	74	0,00
7,734 % fällig am 15.02.2033	100	118	0,00	Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust				6,170 % fällig am 25.02.2036	3	1	0,00
7,834 % fällig am 15.02.2041	1.700	2.127	0,02	3,993 % fällig am 26.12.2046	1.422	1.075	0,01	6,230 % fällig am 25.09.2034	21	19	0,00
Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Bonds, Series 2021				Chase Mortgage Finance Trust				6,500 % fällig am 25.12.2037	672	289	0,00
3,850 % fällig am 01.06.2050	3.560	3.300	0,03	4,114 % fällig am 25.03.2037	505	470	0,00	6,500 % fällig am 25.11.2047	506	259	0,00
Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Notes, (ST APPROP Insured), Series 2021				4,523 % fällig am 25.07.2037	37	30	0,00	7,884 % fällig am 20.02.2036	11	10	0,00
2,346 % fällig am 01.06.2030	200	172	0,00	4,885 % fällig am 25.03.2037	47	45	0,00	7,884 % fällig am 20.02.2036	19	16	0,00
Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Notes, Series 2021				5,342 % fällig am 25.02.2037	110	107	0,00	Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust			
2,687 % fällig am 01.06.2030	6.000	5.192	0,04	Citigroup Mortgage Securities Trust				5,830 % fällig am 25.03.2035	552	503	0,01
2,787 % fällig am 01.06.2031	4.400	3.730	0,03	6,000 % fällig am 25.04.2037	59	48	0,00	6,000 % fällig am 25.03.2035	37	36	0,00
3,037 % fällig am 01.06.2032	8.045	6.785	0,05	Citigroup Mortgage Loan Trust				Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.			
Los Angeles County, California Public Works Financing Authority Revenue Bonds, (BABs), Series 2010				5,322 % fällig am 25.08.2035	61	58	0,00	6,050 % fällig am 25.03.2032	34	32	0,00
7,618 % fällig am 01.08.2040	2.800	3.466	0,03	5,737 % fällig am 25.08.2036	9.237	3.870	0,03	6,500 % fällig am 25.04.2033	3	3	0,00
Municipal Electric Authority of Georgia Revenue Bonds, (BABs), Series 2010				6,980 % fällig am 25.05.2035	5	5	0,00	Credit Suisse First Boston Mortgage-Backed Pass-Through Certificates			
6,655 % fällig am 01.04.2057	286	326	0,00	7,780 % fällig am 25.10.2035	8	8	0,00	4,858 % fällig am 25.07.2033	3	3	0,00
New Jersey Transportation Trust Fund Authority Revenue Bonds, (BABs), Series 2010				Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust			
5,754 % fällig am 15.12.2028	200	204	0,00	5,252 % fällig am 25.08.2035	221	204	0,00	6,079 % fällig am 25.04.2037	65	18	0,00
		25.518	0,20	5,972 % fällig am 25.09.2035	106	104	0,00	Credit Suisse Mortgage Capital Trust			
NON-AGENCY-MBS				7,198 % fällig am 25.09.2035	10	10	0,00	3,850 % fällig am 25.09.2057	8.649	8.231	0,06
Adjustable Rate Mortgage Trust				Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. Mortgage Pass-Through Certificates				4,146 % fällig am 25.06.2050	4.362	3.725	0,03
4,820 % fällig am 25.09.2035	48	42	0,00	4,150 % fällig am 25.09.2035	464	411	0,00	DBGS Mortgage Trust			
6,620 % fällig am 25.03.2035	534	454	0,00	CitiMortgage Alternative Loan Trust				6,254 % fällig am 15.06.2033	1.120	1.029	0,01
American Home Mortgage Assets Trust				6,000 % fällig am 25.01.2037	288	254	0,00	Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust			
5,660 % fällig am 25.05.2046	240	199	0,00	6,000 % fällig am 25.02.2037	1.521	1.279	0,01	5,710 % fällig am 25.08.2036	1.493	1.365	0,01
5,680 % fällig am 25.10.2046	64	34	0,00	Commercial Mortgage Trust				5,770 % fällig am 25.03.2037	1.624	1.452	0,01
5,850 % fällig am 25.09.2046	696	625	0,01	3,545 % fällig am 10.02.2036	28.500	26.618	0,20	5,770 % fällig am 25.09.2047	2.606	2.218	0,02
5,932 % fällig am 25.11.2046	7.390	2.082	0,02	3,590 % fällig am 10.11.2047	15.500	15.177	0,12	5,800 % fällig am 25.08.2037	2.625	2.078	0,02
American Home Mortgage Investment Trust				Countrywide Alternative Loan Trust				5,850 % fällig am 25.08.2047	3.366	2.716	0,02
7,430 % fällig am 25.09.2035	3.449	1.468	0,01	4,394 % fällig am 25.10.2035	9	7	0,00	Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust			
				5,250 % fällig am 25.06.2035	161	123	0,00	3,354 % fällig am 25.10.2035	0	0	0,00
				5,500 % fällig am 25.09.2035	788	573	0,01	Deutsche ALT-B Securities Mortgage Loan Trust			
				5,500 % fällig am 25.11.2035	1.412	943	0,01	5,570 % fällig am 25.10.2036	6	5	0,00
				5,652 % fällig am 20.02.2047	4.646	3.581	0,03	Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust			
				5,667 % fällig am 20.12.2046	2.246	1.933	0,02	5,660 % fällig am 19.10.2036	1.206	996	0,01
				5,680 % fällig am 25.05.2035	30	27	0,00	6,310 % fällig am 19.09.2044	29	26	0,00
				5,682 % fällig am 20.07.2046	228	183	0,00	First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust			
				5,710 % fällig am 25.06.2036	894	792	0,01	5,850 % fällig am 25.04.2035	65	63	0,00
				5,752 % fällig am 20.09.2046	1.195	873	0,01	6,250 % fällig am 25.11.2036	155	48	0,00
				5,790 % fällig am 25.02.2047	120	112	0,00	6,250 % fällig am 25.08.2037	165	69	0,00
				5,810 % fällig am 25.05.2047	3.156	2.689	0,02	First Horizon Mortgage Pass-Through Trust			
				5,820 % fällig am 25.05.2037	529	182	0,00	5,464 % fällig am 25.08.2035	50	36	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
GreenPoint Mortgage Funding Trust				MASTR Alternative Loan Trust				5,850 % fällig am 25.06.2036	\$ 40	\$ 39	0,00
5,830 % fällig am 25.01.2037	\$ 596	\$ 524	0,01	5,870 % fällig am 25.03.2036	\$ 676	\$ 74	0,00	5,870 % fällig am 25.10.2036	2.282	1.962	0,02
5,890 % fällig am 25.04.2036	278	237	0,00	MASTR Asset Securitization Trust				5,890 % fällig am 25.05.2036	444	299	0,00
5,910 % fällig am 25.06.2045	41	39	0,00	6,000 % fällig am 25.06.2036	144	84	0,00	5,890 % fällig am 25.09.2047	1.973	1.637	0,01
6,010 % fällig am 25.04.2036	182	174	0,00	Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Certificates				5,910 % fällig am 25.05.2036	2.221	1.747	0,01
6,010 % fällig am 25.11.2045	62	55	0,00	6,176 % fällig am 15.11.2031	35	33	0,00	5,910 % fällig am 25.05.2046	2.459	856	0,01
6,110 % fällig am 25.09.2046	1.019	832	0,01	Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust				5,910 % fällig am 25.09.2047	21	18	0,00
6,150 % fällig am 25.10.2046	1.279	931	0,01	5,916 % fällig am 15.12.2030	36	34	0,00	5,970 % fällig am 19.07.2035	22	21	0,00
GreenPoint Mortgage Funding Trust Pass-Through Certificates				6,020 % fällig am 20.10.2029	15	15	0,00	5,990 % fällig am 25.05.2046	47	28	0,00
5,725 % fällig am 25.10.2033	6	6	0,00	Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust				6,030 % fällig am 25.02.2036	278	228	0,00
GS Mortgage Securities Corp. Trust				5,790 % fällig am 25.01.2037	8.585	2.516	0,02	6,050 % fällig am 19.07.2034	18	16	0,00
6,559 % fällig am 15.07.2031	5.000	4.169	0,03	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				6,130 % fällig am 19.09.2032	15	15	0,00
GSMSC Pass-Through Trust				4,757 % fällig am 25.12.2034	113	106	0,00	6,170 % fällig am 19.03.2034	4	4	0,00
7,500 % fällig am 25.10.2036	51	8	0,00	5,214 % fällig am 25.06.2037	13	12	0,00	6,412 % fällig am 25.12.2035	68	54	0,00
GSR Mortgage Loan Trust				5,307 % fällig am 25.02.2033	62	56	0,00	6,512 % fällig am 25.08.2047	1.130	913	0,01
4,240 % fällig am 25.06.2034	19	19	0,00	6,130 % fällig am 25.06.2028	11	10	0,00	Structured Asset Securities Corp.			
4,489 % fällig am 25.11.2035	14	13	0,00	Merrill Lynch Mortgage-Backed Securities Trust				5,750 % fällig am 25.01.2036	68	56	0,00
4,630 % fällig am 25.01.2036	33	30	0,00	3,628 % fällig am 25.04.2037	586	505	0,01	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust			
4,836 % fällig am 25.09.2035	32	30	0,00	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust				5,760 % fällig am 25.10.2036	501	403	0,00
5,500 % fällig am 25.01.2037	99	129	0,00	3,732 % fällig am 15.05.2048	8.100	7.841	0,06	TBW Mortgage-Backed Trust			
5,700 % fällig am 25.05.2037	9.606	4.742	0,04	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				6,130 % fällig am 25.01.2037	26	7	0,00
6,000 % fällig am 25.03.2032	0	0	0,00	3,278 % fällig am 25.11.2037	473	315	0,00	Thornburg Mortgage Securities Trust			
6,780 % fällig am 25.03.2033	13	13	0,00	4,581 % fällig am 25.11.2035	24	17	0,00	3,826 % fällig am 25.09.2037	11	11	0,00
6,970 % fällig am 25.04.2032	73	59	0,00	5,730 % fällig am 25.04.2035	143	134	0,00	6,720 % fällig am 25.06.2037	526	479	0,00
HarborView Mortgage Loan Trust				MortgageIT Securities Corp. Mortgage Loan Trust				6,765 % fällig am 25.06.2037	1.254	1.051	0,01
4,209 % fällig am 19.07.2035	48	35	0,00	5,930 % fällig am 25.06.2047	3.891	3.208	0,03	6,815 % fällig am 25.06.2037	1.439	1.245	0,01
4,725 % fällig am 19.08.2036	19	18	0,00	New Century Alternative Mortgage Loan Trust				6,815 % fällig am 25.06.2047	929	812	0,01
5,660 % fällig am 19.09.2037	474	403	0,00	6,173 % fällig am 25.07.2036	4.841	1.042	0,01	6,815 % fällig am 25.06.2047	2	2	0,00
5,862 % fällig am 19.12.2036	285	240	0,00	New Residential Mortgage Loan Trust				6,865 % fällig am 25.03.2037	636	521	0,01
5,870 % fällig am 19.09.2046	544	476	0,00	3,500 % fällig am 25.12.2057	2.021	1.934	0,02	Towd Point Mortgage Trust			
5,880 % fällig am 19.12.2036	8.416	6.724	0,05	4,389 % fällig am 25.10.2035	28	15	0,00	3,750 % fällig am 25.05.2058	8.233	7.964	0,06
5,950 % fällig am 19.03.2036	114	105	0,00	Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust				Verus Securitization Trust			
5,970 % fällig am 19.01.2036	312	189	0,00	0,523 % fällig am 25.09.2046	1.306	458	0,00	1,829 % fällig am 25.10.2066	6.166	5.381	0,04
6,170 % fällig am 19.01.2035	84	74	0,00	Residential Accredit Loans, Inc. Trust				WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
6,970 % fällig am 19.10.2035	214	145	0,00	4,261 % fällig am 25.08.2035	39	15	0,00	3,315 % fällig am 25.05.2037	901	700	0,01
7,012 % fällig am 19.10.2035	376	205	0,00	5,620 % fällig am 25.02.2047	403	146	0,00	3,596 % fällig am 25.03.2036	951	820	0,01
HSI Asset Loan Obligation Trust				5,770 % fällig am 25.06.2037	934	866	0,01	3,835 % fällig am 25.08.2035	25	23	0,00
6,000 % fällig am 25.06.2037	32	28	0,00	5,790 % fällig am 25.03.2047	1.435	1.271	0,01	3,847 % fällig am 25.05.2037	1.237	1.058	0,01
Impac CMB Trust				5,830 % fällig am 25.06.2046	4.580	1.086	0,01	3,864 % fällig am 25.03.2036	45	41	0,00
6,110 % fällig am 25.03.2035	6	5	0,00	5,890 % fällig am 25.04.2046	3.480	984	0,01	4,009 % fällig am 25.03.2033	6	6	0,00
6,470 % fällig am 25.07.2033	2	2	0,00	5,970 % fällig am 25.08.2037	456	415	0,00	4,172 % fällig am 25.09.2036	221	189	0,00
Impac Secured Assets Trust				6,000 % fällig am 25.06.2036	344	265	0,00	4,272 % fällig am 25.12.2036	433	378	0,00
5,990 % fällig am 25.01.2037	3.759	3.102	0,02	6,288 % fällig am 25.11.2037	1.567	1.281	0,01	4,335 % fällig am 27.02.2034	62	58	0,00
IndyMac Mortgage Loan Trust				Residential Asset Securitization Trust				4,379 % fällig am 25.03.2034	4	4	0,00
3,265 % fällig am 25.01.2036	40	37	0,00	5,750 % fällig am 25.02.2036	1.738	1.320	0,01	4,397 % fällig am 25.12.2046	18	16	0,00
3,355 % fällig am 25.06.2036	154	129	0,00	5,750 % fällig am 25.04.2037	1.117	532	0,01	4,469 % fällig am 25.09.2036	2.571	2.147	0,02
3,478 % fällig am 25.03.2036	480	337	0,00	5,870 % fällig am 25.01.2046	11	3	0,00	4,821 % fällig am 25.06.2033	33	32	0,00
3,494 % fällig am 25.10.2035	97	78	0,00	6,000 % fällig am 25.07.2037	774	313	0,00	4,926 % fällig am 25.12.2035	216	193	0,00
3,551 % fällig am 25.03.2036	1.779	1.292	0,01	6,500 % fällig am 25.08.2036	1.093	315	0,00	5,255 % fällig am 25.08.2034	57	54	0,00
3,674 % fällig am 25.08.2035	86	63	0,00	Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust				5,662 % fällig am 25.09.2033	5	5	0,00
4,699 % fällig am 25.12.2034	47	45	0,00	5,091 % fällig am 25.09.2035	221	147	0,00	5,892 % fällig am 25.10.2046	2.175	1.814	0,02
5,830 % fällig am 25.02.2037	1.446	1.333	0,01	6,500 % fällig am 25.03.2032	7	7	0,00	5,907 % fällig am 25.09.2033	9	8	0,00
5,870 % fällig am 25.06.2046	847	657	0,01	Sequoia Mortgage Trust				5,930 % fällig am 25.04.2045	14	14	0,00
5,950 % fällig am 25.06.2037	107	97	0,00	3,701 % fällig am 20.01.2047	246	160	0,00	5,992 % fällig am 25.06.2046	556	497	0,01
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust				3,917 % fällig am 20.07.2037	609	448	0,00	6,010 % fällig am 25.12.2045	13	13	0,00
0,559 % fällig am 15.04.2047 (a)	11.023	6	0,00	6,164 % fällig am 20.04.2035	22	21	0,00	6,012 % fällig am 25.02.2046	1.376	1.208	0,01
JPMorgan Alternative Loan Trust				6,170 % fällig am 19.10.2026	20	19	0,00	6,012 % fällig am 25.08.2046	71	64	0,00
5,500 % fällig am 25.11.2036	12	5	0,00	6,172 % fällig am 20.07.2033	116	106	0,00	6,050 % fällig am 25.07.2045	225	212	0,00
5,623 % fällig am 25.12.2035	641	473	0,00	6,232 % fällig am 20.10.2027	2	2	0,00	6,050 % fällig am 25.10.2045	63	60	0,00
5,950 % fällig am 25.10.2036	2.749	2.443	0,02	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				6,090 % fällig am 25.01.2045	130	125	0,00
5,957 % fällig am 27.06.2037	133	92	0,00	4,021 % fällig am 25.11.2035	42	37	0,00	6,110 % fällig am 25.01.2045	40	37	0,00
JPMorgan Mortgage Trust				4,562 % fällig am 25.07.2035	710	604	0,01	6,210 % fällig am 25.11.2034	155	145	0,00
4,528 % fällig am 25.08.2034	62	59	0,00	4,672 % fällig am 25.08.2035	87	75	0,00	6,212 % fällig am 25.11.2042	22	20	0,00
4,658 % fällig am 25.02.2036	369	270	0,00	5,475 % fällig am 25.12.2035	376	272	0,00	6,262 % fällig am 25.01.2047	330	292	0,00
4,704 % fällig am 25.02.2036	122	83	0,00	5,736 % fällig am 25.09.2034	165	156	0,00	6,290 % fällig am 25.11.2045	264	239	0,00
4,735 % fällig am 25.11.2033	54	49	0,00	5,790 % fällig am 25.10.2035	335	306	0,00	6,290 % fällig am 25.12.2045	3.106	2.795	0,02
4,856 % fällig am 25.06.2036	196	142	0,00	5,910 % fällig am 25.05.2037	8	7	0,00	6,412 % fällig am 25.08.2042	0	0	0,00
4,917 % fällig am 25.07.2035	34	32	0,00	5,926 % fällig am 25.09.2034	3	3	0,00	6,512 % fällig am 25.10.2046	8	8	0,00
5,044 % fällig am 25.07.2035	76	73	0,00	6,478 % fällig am 25.02.2034	44	42	0,00	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
5,789 % fällig am 25.12.2034	169	157	0,00	6,624 % fällig am 25.04.2034	32	31	0,00	5,500 % fällig am 25.04.2035	116	94	0,00
Lehman XS Trust				Structured Asset Mortgage Investments Trust				5,952 % fällig am 25.07.2046	438	267	0,00
4,369 % fällig am 25.05.2046	148	0	0,00	3,743 % fällig am 25.05.2047	2.274	1.816	0,02	6,000 % fällig am 25.07.2036	63	42	0,00
5,830 % fällig am 25.12.2036	2.350	2.251	0,02	5,590 % fällig am 25.08.2036	1.495	1.279	0,01	Washington Mutual MSC Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
Luminent Mortgage Trust				5,650 % fällig am 25.01.2037	1.857	1.566	0,01	4,661 % fällig am 25.06.2033	3	3	0,00
5,830 % fällig am 25.12.2036	203	185	0,00	5,790 % fällig am 25.01.2037	1.065	937	0,01	Wells Fargo Alternative Loan Trust			
5,870 % fällig am 25.10.2046	341	299	0,00	5,830 % fällig am 25.09.2047	1.439	1.292	0,01	5,674 % fällig am 28.12.2037	212	190	0,00
MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust								6,250 % fällig am 25.07.2037	376	320	0,00
5,386 % fällig am 21.11.2034	75	71	0,00								
				</							

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Fund (Forts.)

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	5,470 %	02.01.2024	03.01.2024	\$ 76.000	U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 31.05.2029	\$ (77.604)	\$ 76.000	\$ 76.012	0,58
CEW	4,960	27.12.2023	03.01.2024	CAD 100.000	Province of Alberta 2,050 % fällig am 01.06.2030	(15.562)	75.838	75.933	0,58
					Province of Quebec 2,850 % fällig am 01.12.2053	(61.993)			
	4,970	28.12.2023	04.01.2024	110.000	Province of Ontario 2,050 % - 2,650 % fällig am 02.06.2030 - 02.12.2050	(84.805)	83.422	83.527	0,64
FICC	2,600	29.12.2023	02.01.2024	\$ 14.614	U.S. Treasury Notes 4,875 % fällig am 30.11.2025	(14.906)	14.614	14.617	0,11
	5,330	29.12.2023	02.01.2024	78.700	U.S. Treasury Notes 1,375 % - 1,500 % fällig am 30.11.2028 - 31.12.2028	(80.274)	78.700	78.700	0,60
IND	5,215	18.12.2023	03.01.2024	£ 34.000	United Kingdom Inflation-Linked Gilt 3,750 % fällig am 22.10.2053	(45.099)	43.343	43.421	0,33
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (380.243)	\$ 371.917	\$ 372.210	2,84

⁽¹⁾ Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month Euribor March Futures	Long	03.2024	4.786	\$ 818	0,01
3-Month Euribor March Futures	Long	03.2025	4.786	4.314	0,03
3-Month Euribor September Futures	Short	09.2024	9.572	(6.299)	(0,05)
3-Month SOFR December Futures	Long	03.2024	222	(1.031)	(0,01)
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2025	10.214	(13.397)	(0,10)
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2024	832	(132)	0,00
3-Month SOFR June Futures	Long	09.2025	2.550	3.817	0,03
3-Month SOFR March Futures	Long	06.2024	8.536	3.496	0,03
3-Month SOFR September Futures	Short	12.2024	2.601	(1.662)	(0,01)
3-Month SOFR September Futures	Long	12.2025	2.553	3.808	0,03
Australia Government 3-Year Note March Futures	Short	03.2024	1.037	(755)	(0,01)
Australia Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2024	4.222	(9.529)	(0,07)
Canada Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2024	698	1.981	0,01
Euro-Bobl March Futures	Short	03.2024	1.366	(2.975)	(0,02)
Euro-BTP Italy Government Bond March Futures	Long	03.2024	2.168	10.404	0,08
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Long	03.2024	207	395	0,00
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Long	03.2024	17	215	0,00
Euro-OAT France Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2024	3.106	(13.643)	(0,10)
Euro-Schatz March Futures	Short	03.2024	516	(384)	0,00
Japan Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2024	194	(1.590)	(0,01)
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Short	03.2024	1.203	(2.835)	(0,02)
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Short	03.2024	2.688	(9.917)	(0,08)
U.S. Treasury 10-Year Ultra March Futures	Short	03.2024	643	(2.913)	(0,02)
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Long	03.2024	36	354	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2024	66	(748)	(0,01)
United Kingdom Long Gilt March Futures	Short	03.2024	3.863	(33.316)	(0,26)
				\$ (71.524)	(0,55)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (71.524)	(0,55)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

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

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Netto- vermögens
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000 %	20.06.2026	\$ 800	\$ 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 Netto- vermögens
CDX.IG-39 10-Year Index	(1,000) %	20.12.2032	\$ 2.060	\$ (27)	0,00
CDX.IG-40 10-Year Index	(1,000)	20.06.2033	63.070	(715)	(0,01)
CDX.IG-41 10-Year Index	(1,000)	20.12.2033	813.500	(9.560)	(0,07)
				\$ (10.302)	(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.IG-39 5-Year Index	1,000 %	20.12.2027	\$ 1.400	\$ 19	0,00
CDX.IG-40 5-Year Index	1,000	20.06.2028	16.600	94	0,00
CDX.IG-41 5-Year Index	1,000	20.12.2028	2.695.700	17.575	0,14
iTraxx Europe Main 40 5-Year Index	1,000	20.12.2028	€ 48.600	479	0,00
				\$ 18.167	0,14

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	3,000 %	17.06.2027	£ 357.180	\$ 849	0,01
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,000	17.06.2035	77.260	(171)	0,00
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,250	20.03.2054	24.600	4.095	0,03
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,500	20.03.2034	602.100	61.998	0,47
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	5,000	20.03.2029	575.670	23.745	0,18
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	5,500	20.03.2026	120.600	(3.835)	(0,03)
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,250	20.03.2029	INR 7.875.990	110	0,00
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,500	20.03.2029	2.854.640	101	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,500	20.03.2034	1.775.710	(125)	0,00
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	17.03.2031	¥ 14.710.000	(3.874)	(0,03)
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,050	15.12.2031	19.820.000	(2.302)	(0,02)
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,200	19.06.2029	6.440.000	(2.013)	(0,02)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	19.06.2039	13.160.000	10.413	0,08
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,450	15.12.2051	770.000	391	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,550	14.09.2028	23.400.000	(2.281)	(0,02)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,800	15.06.2052	3.460.000	3.434	0,03
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,850	20.09.2033	2.070.000	(68)	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	2,750	20.03.2029	SGD 350.490	(2.373)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,400	15.01.2028	\$ 578.050	(75.558)	(0,58)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,000	15.06.2029	16.880	(799)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,249	31.08.2024	178.000	4.926	0,04
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,250	15.12.2026	444.500	40.890	0,31
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,298	25.08.2024	155.100	4.235	0,03
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,360	17.09.2024	53.950	1.411	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,430	31.03.2024	256.050	(10.256)	(0,08)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,488	15.08.2031	25.600	(3.755)	(0,03)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,500	15.12.2028	233.690	(27.917)	(0,21)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,518	20.01.2029	9.430	(1.011)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,630	20.01.2029	63.600	(6.461)	(0,05)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.06.2024	610.261	7.206	0,06
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.06.2025	6.500	1	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.06.2027	632.731	13.551	0,10
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.06.2052	25.110	(1.787)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	15.12.2051	66.000	(24.756)	(0,19)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,750	21.06.2053	71.610	(4.566)	(0,03)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,841	31.10.2024	14.900	(217)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,910	14.11.2024	25.900	(352)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,920	17.10.2024	31.800	(478)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,965	30.11.2026	565.100	13.665	0,10
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,973	27.10.2024	17.400	(233)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,993	13.10.2024	9.500	(132)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,000	21.06.2033	34.180	(496)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,018	24.10.2024	13.000	(175)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,050	08.09.2029	11.300	(276)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,088	07.11.2024	10.800	(124)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,100	09.09.2029	31.000	(667)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,100	15.11.2032	42.410	(1.067)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,140	25.10.2024	14.200	(165)	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,150	13.05.2025	971.400	6.775	0,05
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,163	30.09.2029	37.000	(862)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,190	25.10.2024	13.700	(154)	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,200	13.05.2025	78.400	736	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,225	25.10.2024	14.200	(155)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,225	30.09.2029	5.200	(122)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,250	21.06.2028	16.280	(200)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,250	20.12.2053	230.900	(28.030)	(0,21)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,300	31.05.2027	100.800	2.187	0,02
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,300	14.06.2033	34.000	(689)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,454	30.06.2029	82.000	(1.037)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,470	22.02.2030	15.800	(204)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	22.06.2030	32.300	(176)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2030	2.800	19	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2033	898.208	39.124	0,30
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,525	02.03.2030	16.200	(160)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,650	22.11.2024	24.600	(225)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,650	05.12.2024	31.200	(281)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	21.11.2024	38.900	(314)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	11.12.2024	22.800	(177)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750 %	21.06.2025	\$ 186.000	\$ 2.602	0,02
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.12.2028	314.900	(10.179)	(0,08)
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2034	121.990	175	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,800	10.03.2028	10.300	(18)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,830	12.10.2053	2.800	276	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,849	31.03.2030	15.900	238	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,857	31.03.2030	82.200	1.207	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,898	30.06.2029	66.300	768	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,950	13.09.2033	24.420	944	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,951	31.03.2030	33.000	694	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,981	30.11.2027	107.800	1.289	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,988	30.11.2027	63.700	777	0,01
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,000	20.03.2054	57.200	(1.097)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,050	10.10.2028	77.200	1.466	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,159	31.03.2025	214.600	3.180	0,02
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,170	03.10.2033	21.100	1.237	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,175	10.10.2033	14.500	857	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,193	30.11.2027	193.700	3.878	0,03
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,220	20.10.2033	21.200	1.340	0,01
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,228	30.08.2025	205.300	(886)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	20.12.2025	997.819	(5.035)	(0,04)
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	20.03.2034	197.750	1.903	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,435	01.11.2033	9.200	760	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,450	01.11.2033	19.900	1.672	0,01
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,235	04.03.2025	CAD 57.400	(2.411)	(0,02)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2025	89.200	(2.063)	(0,02)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2030	207.300	(15.735)	(0,12)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,713	02.10.2029	81.100	(6.009)	(0,05)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,900	18.12.2029	107.300	(7.976)	(0,06)
Erhalt	3-Month CAD-Bank Bill	2,500	28.01.2052	700	(15)	0,00
Erhalt	3-Month CAD-Bank Bill	3,250	15.03.2033	88.700	1.198	0,01
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,250	21.06.2033	71.300	1.998	0,02
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,250	21.06.2053	2.900	271	0,00
Zahlung ⁽⁴⁾	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,500	10.05.2025	1.348.900	(2.103)	(0,02)
Erhalt ⁽⁴⁾	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,500	01.06.2032	55.800	(1.149)	(0,01)
Erhalt	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,750	20.12.2033	143.400	(5.479)	(0,04)
Zahlung ⁽⁴⁾	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	4,600	30.08.2025	255.100	1.810	0,01
Zahlung	3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,283	14.02.2027	CHF 47.000	(2.022)	(0,02)
Zahlung	3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,294	10.02.2027	19.900	(805)	(0,01)
Zahlung	3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,343	16.05.2027	31.300	(1.234)	(0,01)
Zahlung ⁽⁴⁾	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,250	20.03.2029	CNY 275.190	219	0,00
Zahlung ⁽⁴⁾	3-Month KRW-KORIBOR	3,250	20.03.2029	KRW 16.971.380	66	0,00
Zahlung ⁽⁴⁾	3-Month KRW-KORIBOR	3,500	20.03.2034	5.365.160	38	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	0,528	17.03.2024	NZD 10.000	(73)	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	3,750	15.06.2027	102.300	(185)	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	4,000	14.06.2024	624.400	(1.373)	(0,01)
Zahlung ⁽⁴⁾	3-Month NZD-BBR	5,000	20.03.2025	324.700	253	0,00
Zahlung ⁽⁴⁾	3-Month NZD-BBR	5,250	20.03.2025	15.800	27	0,00
Zahlung	3-Month SEK-STIBOR	0,500	19.06.2024	SEK 260.100	(992)	(0,01)
Zahlung	3-Month SEK-STIBOR	1,000	19.06.2029	56.700	(573)	0,00
Erhalt	6-Month AUD-BBR-BBSW	1,250	17.06.2030	AUD 128.300	16.631	0,13
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	1,750	16.03.2027	92.600	(4.369)	(0,03)
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,000	21.06.2033	454.100	3.604	0,03
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,250	15.09.2032	40.100	(5)	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,250	15.03.2033	206.600	(1.662)	(0,01)
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	15.09.2032	866.100	5.797	0,04
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,750	20.12.2033	766.800	11.446	0,09
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	1,913	30.01.2029	CZK 158.300	(624)	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,054	27.05.2050	€ 7.450	3.376	0,03
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,064	17.11.2052	17.650	9.306	0,07
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	10.08.2024	12.500	(414)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	12.04.2027	34.400	(2.223)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	11.05.2027	24.400	(1.471)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,700	11.04.2027	19.200	(1.215)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	30.03.2024	76.900	(666)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027	41.000	(2.036)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	18.05.2027	18.100	(888)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	11.04.2024	103.300	266	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	13.04.2024	218.700	631	0,01
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	17.05.2024	55.200	166	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	26.04.2024	32.200	177	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	28.04.2024	38.500	178	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	03.05.2024	32.900	151	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	21.09.2037	55.870	(325)	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	20.03.2054	457.400	(51.154)	(0,39)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,970	15.12.2033	21.000	(870)	(0,01)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,990	08.12.2033	27.600	(1.190)	(0,01)
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	19.03.2027	489.180	5.969	0,05
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	15.03.2033	221.155	(2.932)	(0,02)
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.03.2034	1.423.870	78.833	0,60
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,179	29.11.2028	26.900	(912)	(0,01)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,250 %	20.03.2029	€ 1.249.580	\$ 44.108	0,34
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	3,300	03.10.2033	600	47	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	3,450	20.10.2028	28.200	1.403	0,01
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,500	20.03.2026	1.556.600	22.638	0,17
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,535	18.09.2025	909.200	(9.593)	(0,07)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	4,870	07.07.2025	MXN 393.200	(1.811)	(0,01)
					\$ 112.884	0,86
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ 120.788	0,92

- (1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps, 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 Verbindlichkeiten, 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, wie in den 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 Verbindlichkeiten, 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. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BOA	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,750 %	15.07.2024	230.900	\$ 462	\$ 164	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,180	11.01.2024	49.700	1.420	5.318	0,04
BRC	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500	26.03.2024	220.900	298	6	0,00
DUB	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,750	10.07.2024	1.210.100	3.297	861	0,01
FAR	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500	26.03.2024	500.000	750	13	0,00
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500	26.03.2024	260.000	402	7	0,00
JPM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500	26.03.2024	428.200	546	11	0,00
MYC	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500	26.03.2024	408.500	564	11	0,00
							\$ 7.739	\$ 6.391	0,05

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BPS	Put - OTC France Government International Bond 0,750 % fällig am 25.05.2052	€ 97,000	23.05.2025	26.800	\$ 2.027	\$ 11.007	0,08

VERKAUFSOPTIONEN

DEISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens
GLM	Put - OTC USD versus TWD	TWD 31,000	04.03.2024	18.458	\$ (257)	\$ (537)	0,00
JPM	Put - OTC USD versus TWD	31,000	01.03.2024	43.637	(590)	(1.255)	(0,01)
					\$ (847)	\$ (1.792)	(0,01)

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BOA	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,310 %	11.01.2024	441.600	\$ (1.424)	\$ (10.237)	(0,08)
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	5,250	15.07.2024	230.900	(231)	(55)	0,00
BPS	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,494	08.01.2024	3.500	(16)	(26)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,545	16.01.2024	7.750	(35)	(97)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,994	08.01.2024	3.500	(16)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,995	16.01.2024	7.750	(35)	(2)	0,00
	Put - OTC 25-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,451	23.05.2025	26.800	(2.027)	(10.171)	(0,08)
CBK	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,690	02.04.2024	33.700	(265)	(9)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,690	02.04.2024	33.700	(265)	(540)	(0,01)

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens	
DUB	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,235 %	22.01.2024	19.500	\$ (80)	\$ (62)	0,00	
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,685	22.01.2024	19.500	(80)	(57)	0,00	
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,790	08.04.2024	39.000	(300)	(13)	0,00	
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,790	08.04.2024	39.000	(300)	(579)	(0,01)	
FAR	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	5,250	10.07.2024	1.210.100	(1.815)	(285)	(0,01)	
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,688	02.04.2024	14.400	(113)	(4)	0,00	
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,688	02.04.2024	14.400	(113)	(231)	0,00	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,273	16.01.2024	5.300	(23)	(15)	0,00	
GLM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,489	08.01.2024	5.750	(27)	(41)	0,00	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,550	16.01.2024	5.450	(24)	(70)	0,00	
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,723	16.01.2024	5.300	(23)	(9)	0,00	
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,989	08.01.2024	5.750	(27)	0	0,00	
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,000	16.01.2024	5.450	(24)	(1)	0,00	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,697	02.04.2024	6.300	(49)	(2)	0,00	
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,697	02.04.2024	6.300	(49)	(100)	0,00	
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,721	08.04.2024	15.300	(115)	(5)	0,00	
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,721	08.04.2024	15.300	(115)	(237)	0,00	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,215	22.01.2024	3.900	(16)	(11)	0,00	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300	16.01.2024	13.800	(59)	(46)	0,00	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,560	05.01.2024	9.900	(51)	(104)	0,00	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,594	05.01.2024	9.900	(49)	(126)	0,00	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,648	04.01.2024	4.050	(18)	(66)	0,00	
	GST	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,665	22.01.2024	3.900	(16)	(13)	0,00
		Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	16.01.2024	13.800	(59)	(19)	0,00
Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap		3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,010	05.01.2024	9.900	(51)	0	0,00	
Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap		3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,044	05.01.2024	9.900	(49)	0	0,00	
Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap		6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,440	08.01.2024	26.600	(61)	(93)	0,00	
Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap		6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,860	08.01.2024	26.600	(61)	(1)	0,00	
JPM		Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	0,820	16.12.2024	123.600	(873)	(147)	0,00
		Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,170	29.01.2024	24.600	(106)	(77)	0,00
		Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,205	22.01.2024	5.200	(21)	(14)	0,00
		Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,600	12.01.2024	8.000	(37)	(126)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,620	29.01.2024	24.600	(106)	(126)	0,00	
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,655	22.01.2024	5.200	(21)	(18)	0,00	
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,050	12.01.2024	8.000	(37)	(2)	0,00	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,490	12.01.2024	11.000	(44)	(85)	0,00	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,650	04.01.2024	1.600	(6)	(25)	0,00	
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,890	12.01.2024	11.000	(44)	(7)	0,00	
MYC	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,030	04.01.2024	1.600	(6)	0	0,00	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,455	08.01.2024	9.250	(45)	(52)	0,00	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,475	08.01.2024	2.400	(11)	(16)	0,00	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,670	04.01.2024	5.350	(25)	(96)	0,00	
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,955	08.01.2024	9.250	(45)	0	0,00	
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,975	08.01.2024	2.400	(11)	0	0,00	
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,120	04.01.2024	5.350	(25)	0	0,00	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,330	15.01.2024	10.200	(43)	(27)	0,00	
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,740	15.01.2024	10.200	(43)	(18)	0,00	
	UAG	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,344	18.01.2024	25.300	(123)	(128)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,744	18.01.2024	25.300	(123)	(45)	0,00	
							\$ (9.876)	\$ (24.336)	(0,19)	

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

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

Kontrahent	Referenzinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Netto- vermögens
GST	South Korea Government International Bond	(1,000) %	20.12.2028	\$ 29.900	\$ (880)	\$ (123)	\$ (1.003)	(0,01)
MYC	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.12.2028	30.500	(869)	(155)	(1.024)	(0,01)
					\$ (1.749)	\$ (278)	\$ (2.027)	(0,02)

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

Kontrahent	Referenzinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BOA	Italy Government International Bond	1,000 %	20.06.2025	\$ 11.810	\$ (285)	\$ 419	\$ 134	0,00
BRC	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	17.350	(421)	619	198	0,00
CBK	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	4.020	(97)	143	46	0,00
					\$ (803)	\$ 1.181	\$ 378	0,00

⁽¹⁾ Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den 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 Verbindlichkeiten, 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, wie in den Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann (i) zahlt der Fonds entweder dem Sicherungnehmer einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps 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 Verbindlichkeiten, 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
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	\$ 527	\$ (211)	\$ 316	0,01
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)	332	306	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)	326	121	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	(86)	201	0,00
						\$ 583	\$ 361	\$ 944	0,01

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 %	20.09.2028	MYR 123.500	\$ 653	\$ (571)	\$ 82	0,00
GST	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	20.09.2028	1.013.770	3.822	(3.150)	672	0,01
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,600	20.09.2028	360.850	(37)	(72)	(109)	0,00
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	20.09.2033	275.030	1.742	(1.296)	446	0,00
						\$ 6.180	\$ (5.089)	\$ 1.091	0,01

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens	
AZD	01.2024	AUD	225.680	\$ 149.555	\$ 0	\$ (4.468)	(0,04)	
	01.2024	NZD	280	177	0	0	0,00	
	03.2024	CNH	205.765	28.548	0	(515)	(515)	0,00
BOA	01.2024	£	36.720	46.562	0	(250)	(250)	0,00
	01.2024	HUF	490.778	1.401	0	(14)	(14)	0,00
	01.2024	¥	35.060.597	237.588	0	(11.262)	(11.262)	(0,09)
	01.2024	\$	503	MXN 8.564	0	0	0	0,00
	01.2024		3.645	NOK 38.753	172	0	172	0,00
	02.2024		600	CNY 4.239	0	0	0	0,00
	03.2024	CNH	289.610	\$ 39.985	0	(920)	(920)	(0,01)
	03.2024	IDR	52.579.111	3.344	0	(65)	(65)	0,00
	03.2024	\$	469	IDR 7.316.971	5	0	5	0,00
	03.2024		22.735	INR 1.902.402	47	0	47	0,00
BPS	06.2024	KRW	2.916.036	\$ 2.241	0	(28)	(28)	0,00
	01.2024	CAD	25.454	18.809	0	(497)	(497)	0,00
	01.2024	DKK	885.802	130.660	0	(641)	(641)	(0,01)
	01.2024	€	2.182.038	2.401.917	0	(9.025)	(9.025)	(0,07)
	01.2024	£	73.997	93.860	0	(474)	(474)	0,00
	01.2024	HUF	3.075.654	8.744	0	(144)	(144)	0,00
	01.2024	¥	20.443.153	139.430	0	(5.669)	(5.669)	(0,04)
	01.2024	KRW	2.693.250	2.050	0	(31)	(31)	0,00
	01.2024	\$	38.313	AUD 57.267	771	0	771	0,01
	01.2024		1.200	BRL 5.908	16	0	16	0,00
	01.2024		1.449	CAD 1.952	31	0	31	0,00
	01.2024		7.522	DKK 51.395	101	(5)	96	0,00
	01.2024		130.001	€ 118.628	1.122	(51)	1.071	0,01
	01.2024		8.066	£ 6.324	13	(17)	(4)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
	01.2024	\$	83	HUF 28.729	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2024		2.500	IDR 38.668.747	9	0	0,00
	01.2024		316.358	¥ 46.562.600	14.129	0	0,11
	01.2024		58.889	ZAR 1.091.704	728	0	0,01
	02.2024	TWD	1.481.818	\$ 46.582	0	(2.390)	(0,02)
	02.2024	\$	1.065	CNY 7.559	4	0	0,00
	03.2024	CNH	197.990	\$ 27.510	0	(455)	0,00
	03.2024	IDR	82.393.995	5.376	33	0	0,00
	03.2024	INR	2.761.129	33.095	29	0	0,00
	03.2024	¥	45.124.593	306.523	0	(16.520)	(0,13)
	03.2024	TWD	874.637	27.793	0	(1.188)	(0,01)
	03.2024	\$	10.950	CNH 79.516	282	0	0,00
	03.2024		3.192	IDR 49.199.829	0	(2)	0,00
	03.2024		79.001	INR 6.607.916	132	0	0,00
	03.2024		478	THB 16.602	12	0	0,00
BRC	06.2024	KRW	133.024.898	\$ 102.005	0	(1.545)	(0,01)
	01.2024		3.036.905	2.350	5	0	0,00
	01.2024	NZD	20.075	12.350	0	(361)	0,00
	01.2024	\$	2.934	AUD 4.467	115	0	0,00
	01.2024		23.981	CAD 32.610	753	0	0,01
	01.2024		437	CHF 380	15	0	0,00
	01.2024		670	PLN 2.931	75	0	0,00
	01.2024		2.283	ZAR 42.518	39	0	0,00
	02.2024	¥	166.090.000	\$ 1.119.224	0	(68.263)	(0,52)
	03.2024		37.025.407	251.426	0	(13.637)	(0,11)
	03.2024	SGD	1.428	1.085	0	(2)	0,00
	03.2024	THB	415	12	0	0	0,00
	03.2024	\$	1.099	IDR 17.092.146	9	0	0,00
	03.2024		498	SGD 661	5	0	0,00
	04.2024	¥	8.140.195	\$ 66.630	8.100	0	0,06
	05.2024		5.580.000	45.133	4.834	0	0,04
CBK	06.2024	KRW	121.149.405	92.821	0	(1.485)	(0,01)
	01.2024	BRL	425.843	87.460	0	(205)	0,00
	01.2024	CHF	53.783	61.979	0	(1.956)	(0,02)
	01.2024	COP	20.000.000	4.886	0	(247)	0,00
	01.2024	DKK	70.595	10.233	0	(231)	0,00
	01.2024	£	25.156	31.899	0	(171)	0,00
	01.2024	HUF	1.041.415	2.973	0	(36)	0,00
	01.2024	IDR	33.942.783	2.205	3	0	0,00
	01.2024	¥	10.502.300	74.383	0	(159)	0,00
	01.2024	\$	9.532	AUD 14.175	142	0	0,00
	01.2024		2.283	CAD 3.103	71	0	0,00
	01.2024		411	CHF 358	15	0	0,00
	01.2024		20.759	DKK 142.220	322	0	0,00
	01.2024		14.795	€ 13.614	247	0	0,00
	01.2024		8.776	£ 6.941	72	0	0,00
	01.2024		4.050	¥ 574.200	25	0	0,00
	01.2024		60.897	MXN 1.078.457	2.503	0	0,02
	01.2024		446	NOK 4.774	24	0	0,00
	01.2024		4.841	PLN 19.441	102	0	0,00
	01.2024	ZAR	31.146	\$ 1.652	0	(49)	0,00
	03.2024	CNH	553.640	78.036	0	(162)	0,00
	03.2024	ILS	72.830	20.004	0	(268)	0,00
	03.2024	PEN	63.669	16.908	0	(247)	0,00
	03.2024	TWD	1.382	45	0	(1)	0,00
	03.2024	\$	18.761	BRL 92.917	252	0	0,00
	03.2024		2.205	IDR 33.951.493	0	(4)	0,00
	04.2024		87.460	BRL 430.155	365	0	0,00
	06.2024	KRW	29.186.588	\$ 22.642	0	(77)	0,00
	06.2024	\$	37	KRW 47.337	0	0	0,00
DUB	01.2024	CAD	210.200	\$ 158.853	0	(562)	(0,01)
	01.2024	KRW	1.754.595	1.350	0	(4)	0,00
	01.2024	\$	16	CNY 113	0	0	0,00
	03.2024	CNH	137.834	\$ 19.128	0	(340)	0,00
	03.2024	IDR	20.612	1	0	0	0,00
	03.2024	SGD	24.712	18.670	0	(131)	0,00
	03.2024	\$	491	IDR 7.661.853	6	0	0,00
	06.2024	KRW	127.823.921	\$ 98.203	0	(1.298)	(0,01)
FAR	01.2024	\$	28	KRW 36.132	0	0	0,00
	06.2024	KRW	36.132	\$ 28	0	0	0,00
GLM	01.2024	AUD	23.592	15.818	0	(283)	0,00
	01.2024	CAD	346.515	254.987	0	(7.833)	(0,06)
	01.2024	DKK	799.095	117.876	0	(573)	(0,01)
	01.2024	£	34.000	43.434	91	0	0,00
	01.2024	HKD	5	1	0	0	0,00
	01.2024	¥	50.298.600	357.325	0	(406)	0,00
	01.2024	MXN	243	13	0	(1)	0,00
	01.2024	\$	83.890	BRL 422.610	3.110	0	0,02
	01.2024		8.144	CAD 10.765	21	0	0,00
	01.2024		1.980	CHF 1.735	83	0	0,00
	01.2024		3.098	£ 2.432	2	0	0,00
	01.2024		68.581	MXN 1.202.760	2.126	0	0,02

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
	01.2024	\$	1.456	NZD 2.339	\$ 25	\$ 0	0,00
	01.2024		34.582	PLN 138.468	623	0	0,00
	01.2024		423	SEK 4.285	2	0	0,00
	01.2024	ZAR	3.381	\$ 178	0	(7)	0,00
	02.2024	BRL	485	100	0	0	0,00
	03.2024	CNH	584.527	81.177	0	(1.384)	(0,01)
	03.2024	SGD	2.453	1.853	0	(13)	0,00
	03.2024	\$	9.387	IDR 144.420.161	0	(22)	0,00
	03.2024		9.869	TWD 305.730	244	0	0,00
JPM	01.2024	HUF	6.673.185	\$ 19.017	0	(267)	0,00
	01.2024	MXN	14.945	868	0	(10)	0,00
	01.2024	\$	2.650	IDR 40.775.550	0	(5)	0,00
	01.2024		2.054	KRW 2.657.118	0	(1)	0,00
	02.2024	CNY	15.389	\$ 2.143	0	(33)	0,00
	02.2024	TWD	79.507	2.482	0	(145)	0,00
	02.2024	\$	12.047	BRL 59.086	97	0	0,00
	03.2024	IDR	159.621.638	\$ 10.296	0	(55)	0,00
	03.2024	TWD	2.371.234	76.268	0	(2.304)	(0,02)
	03.2024	\$	5.458	IDR 84.268.424	6	0	0,00
	03.2024		22.193	INR 1.855.380	26	0	0,00
	03.2024		120	SGD 159	1	0	0,00
	03.2024		21.818	TWD 676.362	551	0	0,00
	06.2024	KRW	129.859.293	\$ 100.084	3	(1.005)	(0,01)
	10.2024	¥	7.740.000	62.332	5.242	0	0,04
MBC	01.2024	AUD	96.610	64.046	0	(1.889)	(0,02)
	01.2024	DKK	53.330	7.829	0	(76)	0,00
	01.2024	£	7.587	9.660	0	(12)	0,00
	01.2024	HUF	81.656	232	0	(4)	0,00
	01.2024	¥	1.425.000	9.848	0	(266)	0,00
	01.2024	\$	33.994	DKK 234.755	803	0	0,01
	01.2024		47.834	€ 43.831	595	0	0,00
	01.2024		14.041	£ 11.102	112	0	0,00
	01.2024		1.447	HUF 539.426	107	0	0,00
	01.2024		4.785	¥ 682.000	55	0	0,00
	02.2024	¥	700.018	\$ 5.675	688	0	0,01
	03.2024		15.550.388	127.046	15.775	0	0,12
	03.2024	\$	6.598	CNH 46.685	0	(4)	0,00
	03.2024		6.658	IDR 102.640.355	0	(2)	0,00
	03.2024		14	TWD 435	1	0	0,00
	10.2024	¥	10.172.450	\$ 81.581	6.549	0	0,05
MYI	01.2024	CAD	15.455	11.721	0	0	0,00
	01.2024	€	555	617	3	0	0,00
	01.2024	£	400	511	1	0	0,00
	01.2024	HUF	81.277	231	0	(4)	0,00
	01.2024	¥	13.318.308	90.337	0	(4.192)	(0,03)
	01.2024	MYR	28.198	6.043	0	(111)	0,00
	01.2024	NOK	9	1	0	0	0,00
	01.2024	NZD	26	16	0	0	0,00
	01.2024	SGD	775	587	0	0	0,00
	01.2024	\$	1.080	CNY 7.758	16	0	0,00
	01.2024		1.104	€ 994	0	(6)	0,00
	01.2024		2.756	£ 2.158	0	(5)	0,00
	01.2024		0	NOK 2	0	0	0,00
	01.2024		90	NZD 143	0	0	0,00
	01.2024		761	ZAR 13.974	2	0	0,00
	02.2024		1.659	CNY 11.907	25	0	0,00
	03.2024	CNH	196.354	\$ 27.228	0	(506)	0,00
	03.2024	¥	31.500.000	216.515	0	(9.238)	(0,07)
	03.2024	\$	63.655	IDR 981.841.514	113	(99)	0,00
	06.2024	KRW	73.634.048	\$ 56.613	0	(705)	(0,01)
RBC	04.2024	\$	98	MXN 1.725	3	0	0,00
RYL	01.2024	AUD	23.608	\$ 15.870	0	(242)	0,00
	01.2024	HUF	1.501	4	0	0	0,00
	01.2024	NZD	507	314	0	(7)	0,00
	01.2024	\$	1.165	CAD 1.558	17	0	0,00
	01.2024		501	NZD 806	10	0	0,00
SCX	01.2024	€	98.436	\$ 107.414	0	(1.349)	(0,01)
	01.2024	£	280.669	355.012	0	(2.796)	(0,02)
	01.2024	MYR	401.032	85.855	0	(1.658)	(0,01)
	01.2024	SEK	29.050	2.797	0	(86)	0,00
	01.2024	\$	1.112	CNY 7.992	17	0	0,00
	01.2024		772	¥ 112.500	27	0	0,00
	02.2024	CNY	7.958	\$ 1.109	0	(16)	0,00
	03.2024	CNH	192.772	26.628	0	(600)	(0,01)
	03.2024	IDR	26.614.760	1.696	0	(30)	0,00
	03.2024	THB	957.289	27.695	0	(537)	(0,01)
	03.2024	TWD	1.555.986	50.077	0	(1.481)	(0,01)
	03.2024	\$	5.624	IDR 87.193.901	49	(18)	0,00
	03.2024		48.301	INR 4.039.389	72	0	0,00
	03.2024		29.888	TWD 929.615	915	0	0,01
SOG	06.2024	KRW	62.476.417	\$ 48.130	0	(503)	0,00
	02.2024	RON	1.298	283	0	(5)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
SSB	01.2024	\$ 769	£ 611	\$ 10	\$ 0	\$ 10	0,00
TOR	03.2024	CNH 93.229	\$ 12.913	0	(255)	(255)	0,00
	03.2024	IDR 22.667.083	1.436	0	(34)	(34)	0,00
	03.2024	SGD 505	381	0	(3)	(3)	0,00
UAG	01.2024	CAD 139.774	103.045	0	(2.969)	(2.969)	(0,02)
	01.2024	DKK 374.675	55.005	0	(533)	(533)	0,00
	01.2024	£ 116.642	147.547	0	(1.153)	(1.153)	(0,01)
	01.2024	HKD 7	1	0	0	0	0,00
	01.2024	HUF 295.156	803	0	(48)	(48)	0,00
	01.2024	¥ 1.403.127	9.578	0	(381)	(381)	0,00
	01.2024	MXN 47.854	2.703	0	(110)	(110)	0,00
	01.2024	\$ 20.639	NOK 220.164	1.043	0	1.043	0,01
	01.2024	8.727	ZAR 166.587	370	0	370	0,00
	03.2024	CZK 40.670	\$ 1.827	11	0	11	0,00
				\$ 75.377	\$ (192.352)	\$ (116.975)	(0,89)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2023 standen fur die Anteilsklasse Institutional CAD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BRC	01.2024	\$ 12.098	CAD 16.451	\$ 380	\$ 0	\$ 380	0,01
CBK	01.2024	10.873	14.780	337	0	337	0,00
MBC	01.2024	1.302	1.762	35	0	35	0,00
MYI	01.2024	1.269	1.674	0	0	0	0,00
UAG	01.2024	12.042	16.334	347	0	347	0,00
				\$ 1.099	\$ 0	\$ 1.099	0,01

Zum 31. Dezember 2023 standen fur die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Institutional CHF (Hedged) ausschuttend, Investor CHF (Hedged) thesaurierend, Class E CHF (Hedged) thesaurierend, Class W CHF (Hedged) thesaurierend und Class W CHF (Hedged) ausschuttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BPS	01.2024	CHF 122	\$ 142	\$ 0	\$ (3)	\$ (3)	0,00
	01.2024	\$ 1.019	CHF 875	21	0	21	0,00
BRC	01.2024	CHF 314	\$ 361	0	(13)	(13)	0,00
	01.2024	\$ 27.666	CHF 24.130	1.020	0	1.020	0,01
CBK	01.2024	CHF 534	\$ 614	0	(20)	(20)	0,00
	01.2024	\$ 177.752	CHF 154.864	6.344	0	6.344	0,05
GLM	01.2024	CHF 195	\$ 223	0	(8)	(8)	0,00
	01.2024	\$ 246.528	CHF 216.040	10.292	0	10.292	0,08
MYI	01.2024	CHF 43	\$ 49	0	(2)	(2)	0,00
	01.2024	\$ 247.920	CHF 216.416	9.347	0	9.347	0,07
SCX	01.2024	84	72	2	0	2	0,00
UAG	01.2024	50.315	43.904	1.876	0	1.876	0,01
				\$ 28.902	\$ (46)	\$ 28.856	0,22

Zum 31. Dezember 2023 standen fur die Anteilsklassen Institutional EUR (Currency Exposure) thesaurierend, Institutional GBP (Currency Exposure) thesaurierend, Institutional USD (Currency Exposure) thesaurierend, Institutional USD (Currency Exposure) ausschuttend, Class E USD (Currency Exposure) thesaurierend, Class E USD (Currency Exposure) ausschuttend und H Institutional USD (Currency Exposure) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
AZD	01.2024	\$ 5.382	AUD 8.124	\$ 163	\$ 0	\$ 163	0,00
BOA	01.2024	COP 2.967.380	\$ 772	6	0	6	0,00
	01.2024	PEN 1.112	301	1	0	1	0,00
	01.2024	\$ 22.100	CNY 156.799	47	0	47	0,00
	01.2024	5.647	£ 4.459	38	0	38	0,00
	01.2024	36.782	¥ 5.427.905	1.743	0	1.743	0,01
	01.2024	1.384	NZD 2.271	54	0	54	0,00
	01.2024	299	PEN 1.112	2	0	2	0,00
	02.2024	767	COP 2.967.380	0	(6)	(6)	0,00
	02.2024	301	PEN 1.112	0	(1)	(1)	0,00
BPS	01.2024	€ 2.007	\$ 2.198	0	(20)	(20)	0,00
	01.2024	¥ 68.149	473	0	(11)	(11)	0,00
	01.2024	\$ 596	DKK 4.044	3	0	3	0,00
	01.2024	20.567	€ 18.850	261	0	261	0,00
	01.2024	4.046	£ 3.190	20	0	20	0,00
	01.2024	9.779	¥ 1.439.232	436	0	436	0,00
BRC	01.2024	CHF 0	\$ 0	0	0	0	0,00
	01.2024	CNY 37.216	5.243	0	(13)	(13)	0,00
	01.2024	MYR 2.428	529	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 695	CHF 604	23	0	23	0,00
	01.2024	153	CNY 1.081	0	0	0	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermogens
CBK	01.2024	\$ 737	COP 2.967.380	\$ 29	\$ 0	\$ 29	0,00
	01.2024	519	¥ 75.415	16	0	16	0,00
	01.2024	522	MYR 2.428	6	0	6	0,00
	01.2024	1.611	THB 56.684	50	0	50	0,00
	01.2024	AUD 1.139	\$ 769	0	(8)	(8)	0,00
	01.2024	CAD 1.984	1.487	0	(18)	(18)	0,00
	01.2024	DKK 1	0	0	0	0	0,00
	01.2024	£ 1.788	2.265	0	(14)	(14)	0,00
	01.2024	MXN 43.239	2.551	0	(2)	(2)	0,00
	01.2024	NOK 1	0	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 476	AUD 716	12	0	12	0,00
	01.2024	7.265	CNY 51.499	9	0	9	0,00
	01.2024	3.587	€ 3.292	51	(1)	50	0,00
	01.2024	8.648	KRW 11.144.114	0	(54)	(54)	0,00
DUB GLM	01.2024	102	NOK 1.095	5	0	5	0,00
	01.2024	648	SEK 6.742	21	0	21	0,00
	02.2024	2.539	MXN 43.239	2	0	2	0,00
	01.2024	93	SGD 123	1	0	1	0,00
	01.2024	CLP 241.555	\$ 274	0	(3)	(3)	0,00
	01.2024	MYR 12.270	2.640	0	(30)	(30)	0,00
	01.2024	\$ 17.766	CAD 24.143	546	0	546	0,01
	01.2024	3.409	CHF 2.988	142	0	142	0,00
	01.2024	21.571	CNY 152.344	0	(53)	(53)	0,00
	01.2024	1.184	CZK 26.206	0	(11)	(11)	0,00
	01.2024	790	DKK 5.357	4	0	4	0,00
	01.2024	478	HUF 167.467	6	0	6	0,00
	01.2024	909	ILS 3.389	32	0	32	0,00
	01.2024	2.642	MYR 12.270	29	0	29	0,00
JPM MBC	01.2024	1.448	PLN 5.790	24	0	24	0,00
	02.2024	273	CLP 241.555	3	0	3	0,00
	02.2024	2.647	MYR 12.270	34	0	34	0,00
	01.2024	11	SGD 14	0	0	0	0,00
	01.2024	€ 11.681	\$ 12.823	0	(84)	(84)	0,00
	01.2024	¥ 892.318	6.261	0	(72)	(72)	0,00
	01.2024	\$ 2.977	AUD 4.491	88	0	88	0,00
	01.2024	2.796	CAD 3.783	74	0	74	0,00
	01.2024	275	CLP 241.555	1	0	1	0,00
	01.2024	528	CNY 3.740	0	0	0	0,00
	01.2024	633	¥ 90.536	9	0	9	0,00
	01.2024	655	KRW 849.670	0	0	0	0,00
	01.2024	2.508	MXN 43.239	45	0	45	0,00
	01.2024	1.267	CAD 1.671	0	0	0	0,00
MYI	01.2024	154.247	€ 140.336	811	0	811	0,01
	01.2024	13.986	¥ 2.061.874	649	0	649	0,01
	01.2024	1.444	SGD 1.926	17	0	17	0,00
	01.2024	453	IDR 7.016.330	3	0	3	0,00
	01.2024	CNY 6.637	\$ 937	0	0	0	0,00
	01.2024	TWD 3.920	126	0	(3)	(3)	0,00
	01.2024	\$ 22.515	CNY 159.799	56	0	56	0,00
	01.2024	629	¥ 90.385	13	0	13	0,00
	01.2024	2.127	SEK 22.093	66	0	66	0,00
	01.2024	KRW 8.690	\$ 7	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 2.843	IDR 44.204.227	24	0	24	0,00
	01.2024	23.116	¥ 3.390.770	951	0	951	0,01
	01.2024	1.775	AUD 2.675	51	0	51	0,00
	01.2024	0	CZK 10	0	0	0	0,00
01.2024	21.931	£ 17.330	161	0	161	0,00	
01.2024	459	NOK 4.898	23	0	23	0,00	
				\$ 6.861	\$ (404)	\$ 6.457	0,05

Zum 31. Dezember 2023 standen fur die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschuttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) ausschuttend, G Retail EUR (Hedged) ausschuttend, Class R EUR (Hedged) thesaurierend, Class T EUR (Hedged) thesaurierend, Class W EUR (Hedged) thesaurierend und Class W EUR (Hedged) ausschuttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermogens
BPS	01.2024	€ 30.967	\$ 33.820	\$ 0	\$ (395)	\$ (395)	0,00
	01.2024	\$ 1.268.505	€ 1.152.383	4.772	(5)	4.767	0,04
BRC	01.2024	1.263.641	1.148.995	5.887	0	5.887	0,04
CBK	01.2024	€ 4.942	\$ 5.448	8	(19)	(11)	0,00
	01.2024	\$ 4.087	€ 3.758	65	0	65	0,00
MBC	01.2024	€ 5.760	\$ 6.254	0	(110)	(110)	0,00
	01.2024	\$ 1.276.965	€ 1.168.080	13.651	0	13.651	0,10
				\$ 24.383	\$ (529)	\$ 23.854	0,18

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Fund (Forts.)

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend, Investor GBP (Hedged) thesaurierend, 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 Netto- vermögens	
BOA	01.2024	£	302 \$	382	\$ 0	\$ (3)	0,00	
	01.2024	\$	20.861 £	16.462	125	0	0,00	
BPS	01.2024		23.898	18.841	122	(1)	0,00	
BRC	01.2024		410	325	3	0	0,00	
CBK	01.2024	£	480 \$	607	0	(5)	0,00	
	01.2024	\$	1.326 £	1.048	10	0	0,00	
GLM	01.2024		53	41	0	0	0,00	
MBC	01.2024	£	407 \$	518	0	(1)	0,00	
	01.2024	\$	9.991 £	7.906	88	0	0,00	
MYI	01.2024	£	139 \$	175	0	(2)	0,00	
	01.2024	\$	37 £	29	0	0	0,00	
SCX	01.2024		136.191	107.671	1.073	0	0,01	
SSB	01.2024		88.970	70.507	916	0	0,01	
UAG	01.2024	£	804 \$	1.007	0	(19)	0,00	
	01.2024	\$	136.154 £	107.583	997	0	0,01	
					\$ 3.334	\$ (31)	\$ 3.303	0,03

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional NOK (Hedged) thesaurierend, Investor NOK (Hedged) thesaurierend und Class W NOK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens	
BOA	01.2024	\$	61.219 NOK	650.913	\$ 2.885	\$ 2.885	0,02	
BPS	01.2024	NOK	138 \$	14	0	0	0,00	
	01.2024	\$	582 NOK	5.987	8	0	0,00	
CBK	01.2024		68.281	730.632	3.673	0	0,03	
GLM	01.2024	NOK	50 \$	5	0	0	0,00	
	01.2024	\$	510 NOK	5.579	39	0	0,00	
MBC	01.2024	NOK	209 \$	19	0	(1)	0,00	
	01.2024	\$	1.212 NOK	13.136	82	0	0,00	
MYI	01.2024	NOK	1.446 \$	135	0	(8)	0,00	
	01.2024	\$	2 NOK	18	0	0	0,00	
RYL	01.2024	NOK	314 \$	29	0	(2)	0,00	
	01.2024	\$	2.327 NOK	25.359	170	0	0,00	
UAG	01.2024		99.094	1.055.907	4.894	0	0,04	
					\$ 11.751	\$ (11)	\$ 11.740	0,09

Zum 31. Dezember 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 Netto- vermögens	
BOA	01.2024	\$	28.602 NZD	46.943	\$ 1.120	\$ 0	0,01	
BPS	01.2024		26.967	43.856	801	0	0,01	
BRC	01.2024		28.752	46.736	840	0	0,01	
CBK	01.2024		2.468	3.998	63	0	(0,01)	
MBC	01.2024	NZD	84 \$	52	0	(1)	0,00	
MYI	01.2024		143	90	0	0	0,00	
	01.2024	\$	24 NZD	38	0	0	0,00	
RYL	01.2024		1.772	2.896	62	0	0,00	
					\$ 2.886	\$ (1)	\$ 2.885	0,02

Zum 31. Dezember 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 Netto- vermögens	
BOA	01.2024	SEK	1.084 \$	104	\$ 0	\$ (4)	0,00	
	01.2024	\$	16.928 SEK	176.568	596	0	0,01	
BRC	01.2024	SEK	1.002 \$	98	0	(2)	0,00	
CBK	01.2024		4.807	464	0	(13)	0,00	
	01.2024	\$	1.970 SEK	20.557	70	0	0,00	
GLM	01.2024	SEK	2.904 \$	281	0	(7)	0,00	
MBC	01.2024		1.975	194	1	(3)	0,00	
SCX	01.2024		402	39	0	(1)	0,00	
	01.2024	\$	18.313 SEK	190.197	564	0	0,00	
UAG	01.2024	SEK	510 \$	50	0	0	0,00	
	01.2024	\$	18.470 SEK	190.628	450	0	0,00	
					\$ 1.681	\$ (30)	\$ 1.651	0,01

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilklassen Institutional SGD (Hedged) thesaurierend, Institutional SGD (Hedged) ausschüttend, M Retail SGD (Hedged) ausschüttend II und Class W SGD (Hedged) ausschüttend II die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
DUB	01.2024	\$ 66.534	SGD 88.444	\$ 534	\$ 0	\$ 534	0,00
GLM	01.2024	SGD 649	\$ 484	0	(8)	(8)	0,00
	01.2024	\$ 1.026	SGD 1.376	17	0	17	0,00
JPM	01.2024	14.323	19.102	162	0	162	0,00
MBC	01.2024	SGD 24.460	\$ 18.299	0	(249)	(249)	0,00
	01.2024	\$ 784	SGD 1.047	10	0	10	0,00
	02.2024	SGD 81	\$ 61	0	0	0	0,00
	02.2024	\$ 685	SGD 903	1	(1)	0	0,00
MYI	01.2024	62.121	82.865	716	0	716	0,01
	02.2024	94	123	0	0	0	0,00
TOR	01.2024	58.914	78.607	694	0	694	0,01
				\$ 2.134	\$ (258)	\$ 1.876	0,02
Summe Freiverkehrsfinaizderivate						\$ (43.598)	(0,33)

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Fannie Mae, TBA			
2,000 % fällig am 01.02.2039	\$ 95.000	\$ (85.277)	(0,65)
Ginnie Mae, TBA			
4,000 % fällig am 01.02.2054	7.500	(7.168)	(0,06)
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,000 % fällig am 01.01.2039	104.400	(93.618)	(0,72)
2,000 % fällig am 01.01.2054	210.150	(171.798)	(1,31)
2,000 % fällig am 01.02.2054	449.000	(367.478)	(2,81)
3,000 % fällig am 01.02.2054	37.800	(33.478)	(0,26)
3,000 % fällig am 01.03.2054	43.000	(38.131)	(0,29)
5,500 % fällig am 01.01.2054 (g)	132.500	(133.080)	(1,01)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (930.028)	(7,11)
Summe Anlagen		\$ 15.694.315	120,01
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (2.617.053)	(20,01)
Nettovermögen		\$ 13.077.262	100,00

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

- * Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt
- ^ Das Wertpapier ist in Verzug.
- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
- (b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.
- (c) Nullkuponwertpapier.
- (d) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (e) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (f) Mit dem Fonds verbunden.
- (g) Das zum 31. Dezember 2023 leerverkaufte Wertpapier ist durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.
- (h) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,40 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Citigroup, Inc.	3,290 %	17.03.2026	10.03.2022	\$ 33.100	\$ 32.241	0,25
Deutsche Bank AG	3,729	14.01.2032	21.01.2021	2.004	1.677	0,01
				\$ 35.104	\$ 33.918	0,26

- (i) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 2.151 (31. Dezember 2022: USD 1.610) und Barmittel in Höhe von USD 323 (31. Dezember 2022: USD null) waren zum 31. Dezember 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 394.447 (31. Dezember 2022: USD 312.124) waren zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 103.060 (31. Dezember 2022: USD 142.980) waren zum 31. Dezember 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Fund (Forts.)

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 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	\$ 14.901.954	\$ 33.617	\$ 14.935.571
Investmentfonds	875.438	435.751	0	1.311.189
Pensionsgeschäfte	0	371.917	0	371.917
Finanzderivate ⁽³⁾	(50.364)	56.030	0	5.666
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(930.028)	0	(930.028)
Summen	\$ 825.074	\$ 14.835.624	\$ 33.617	\$ 15.694.315

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 11.352.524	\$ 8.573	\$ 11.361.097
Investmentfonds	322.306	798.673	0	1.120.979
Pensionsgeschäfte	0	1.346.970	0	1.346.970
Finanzderivate ⁽³⁾	73.477	(414.644)	0	(341.167)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(721.316)	0	(721.316)
Summen	\$ 395.783	\$ 12.362.207	\$ 8.573	\$ 12.766.563

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

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

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Netto- vermögens
BPS	3,500 %	28.09.2023	TBD ⁽¹⁾	€ (295)	\$ (328)	0,00
JML	(1,000)	14.11.2023	TBD ⁽¹⁾	(261)	(289)	0,00
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (617)	0,00

⁽¹⁾ Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
AZD	\$ (4.504)	\$ 5.510	\$ 1.006	\$ (1.118)	\$ 1.920	\$ 802
BOA	(10.306)	9.930	(376)	(61.601)	51.870	(9.731)
BPS	(14.522)	19.830	5.308	2.102	(1.850)	252
BRC	(61.368)	56.470	(4.898)	1.917	(1.260)	657
CBK	10.530	(12.210)	(1.680)	57.544	(56.500)	1.044
CLY	k. A.	k. A.	k. A.	(438)	0	(438)
DUB	(1.810)	1.710	(100)	(789)	220	(569)
FAR	(358)	0	(358)	(224)	0	(224)
FBF	k. A.	k. A.	k. A.	40	0	40
GLM	5.715	(7.530)	(1.815)	(7.627)	6.700	(927)
GST	(88)	710	622	(287)	280	(7)
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	(120)	140	20
IND	k. A.	k. A.	k. A.	2.835	(2.760)	75
JPM	392	(910)	(518)	3.194	(3.600)	(406)
MBC	35.995	(42.350)	(6.355)	(13.437)	11.460	(1.977)
MYC	(1.021)	1.360	339	(35)	350	315
MYI	(3.178)	1.180	(1.998)	(9.902)	7.130	(2.772)
RBC	6	0	6	(363)	320	(43)
RYL	8	0	8	2	0	2
SCX	(6.224)	6.360	136	(36.806)	34.940	(1.866)
SOG	19	0	19	394	(300)	94
SSB	926	(800)	126	2.274	(1.930)	344
TOR	1.353	(1.250)	103	(12.186)	12.810	624
UAG	4.837	(4.470)	367	(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. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	67,03	67,82
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	47,18	30,98
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,00	0,69
Investmentfonds	10,03	9,82
Pensionsgeschäfte	2,84	11,79
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,55)	0,62
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,92	(2,82)
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,33)	(0,79)
Leerverkaufte Wertpapiere	(7,11)	(6,32)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	0,00	(0,01)

* Gemäß der Liste der Märkte, die die Kriterien für einen geregelten OGAW-Markt erfüllen, in Anlage 1 zum Verkaufsprospekt.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Australien	1,56	1,53
Österreich	k. A.	0,07
Brasilien	k. A.	0,00
Kanada	1,31	0,68
Cayman-Inseln	1,95	2,31
China	0,07	0,01
Tschechische Republik	0,00	0,00
Dänemark	2,02	2,36
Finnland	0,01	0,01
Frankreich	2,14	2,98
Deutschland	1,35	2,15
Hongkong	k. A.	0,25
Ungarn	0,18	0,04
International	0,21	k. A.
Irland	4,97	5,70
Israel	1,20	0,46
Italien	1,01	1,23
Japan	7,62	6,06
Jersey, Kanalinseln	0,08	0,08
Luxemburg	0,51	0,55
Malaysia	0,83	0,60
Mexiko	0,06	0,12
Multinational	0,08	0,10
Niederlande	0,59	1,10
Neuseeland	0,14	0,21
Norwegen	0,20	0,27
Peru	0,14	0,52
Polen	0,28	0,03
Portugal	0,02	0,01
Katar	0,08	0,13
Rumänien	0,78	0,51
Saudi-Arabien	0,68	0,14
Serbien	k. A.	0,22
Singapur	0,14	k. A.
Slowenien	0,18	0,19
Südafrika	k. A.	0,00
Südkorea	3,32	0,98
Spanien	0,70	0,96
Supranational	0,08	0,20
Schweden	0,00	0,00
Schweiz	1,08	1,25
Thailand	0,23	0,29
Vereinigte Arabische Emirate	0,06	0,07
Großbritannien	5,89	8,24
USA	53,69	39,76
Kurzfristige Instrumente	18,77	17,12
Investmentfonds	10,03	9,82
Pensionsgeschäfte	2,84	11,79
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,55)	0,63
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	k. A.	(0,01)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,00	(0,03)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,08)	(0,13)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,14	k. A.
Zinsswaps — Basisswaps	k. A.	0,01
Zinsswaps	0,86	(2,67)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,05	0,05
Optionen auf Wertpapiere	0,08	0,09

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Devisenoptionen	(0,01)	k. A.
Zinsswapoptionen	(0,19)	(0,28)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	(0,02)	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Cross-Currency Swaps	0,01	0,00
Zinsswaps	0,01	(0,01)
Devisenterminkontrakte	(0,89)	(1,70)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,63	1,07
Leerverkaufte Wertpapiere	(7,11)	(6,32)
Sonstige Aktiva und Passiva	(20,01)	(11,79)
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond ESG Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
T-Mobile USA, Inc.				2,500 % fällig am 15.01.2029	\$	4.227	0,12	JPMorgan Alternative Loan Trust			
5,050 % fällig am 15.07.2033	\$ 7.600	\$ 7.662	0,22	3,875 % fällig am 15.04.2029		826	0,03	5,950 % fällig am 25.10.2036	\$ 219	\$ 195	0,01
		41.837	1,18					JPMorgan Mortgage Trust			
VERSORGUNGSUNTERNEHMEN				U.S. Treasury Notes							
AES Corp.				0,375 % fällig am 30.09.2027	2.900	2.544	0,07	5,652 % fällig am 25.08.2035	96	93	0,00
5,450 % fällig am 01.06.2028	11.700	11.902	0,33	0,625 % fällig am 30.11.2027	12.800	11.284	0,32	6,000 % fällig am 25.06.2037	762	313	0,01
Electricite de France S.A.				0,750 % fällig am 31.01.2028	11.700	10.317	0,29	Lehman XS Trust			
6,250 % fällig am 23.05.2033	4.000	4.333	0,12	2,875 % fällig am 30.04.2025	4.200	4.109	0,11	6,512 % fällig am 25.03.2047	420	360	0,01
6,900 % fällig am 23.05.2053	3.000	3.399	0,10			228.754	6,43	Ludgate Funding PLC			
National Grid PLC				NON-AGENCY-MBS							
5,809 % fällig am 12.06.2033	3.800	3.996	0,11	American Home Mortgage Assets Trust				5,574 % fällig am 01.01.2061	£ 1.766	2.175	0,06
New York State Electric & Gas Corp.				5,660 % fällig am 25.10.2046	1.034	547	0,02	6,014 % fällig am 01.01.2061	2.040	2.513	0,07
5,650 % fällig am 15.08.2028	4.000	4.105	0,12	5,952 % fällig am 25.10.2046	78	53	0,00	Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust			
Pacific Gas & Electric Co.				American Home Mortgage Investment Trust				3,489 % fällig am 25.10.2047	\$ 10.384	3.263	0,09
6,700 % fällig am 01.04.2053	8.000	8.703	0,24	7,430 % fällig am 25.09.2035	167	71	0,00	Miravet SARL			
Southern Power Co.				Atlas Funding PLC				4,806 % fällig am 26.05.2065	€ 1.226	1.343	0,04
0,900 % fällig am 15.01.2026	6.000	5.530	0,16	6,120 % fällig am 25.07.2058	£ 1.646	2.100	0,06	Mortimer BTL PLC			
Verizon Communications, Inc.				Atrium Hotel Portfolio Trust				5,920 % fällig am 23.06.2053	£ 2.012	2.550	0,07
5,050 % fällig am 09.05.2033	5.400	5.512	0,15	6,589 % fällig am 15.12.2036	\$ 4.844	4.609	0,13	New Residential Mortgage Loan Trust			
		47.480	1,33	Bear Stearns ALT-A Trust				3,500 % fällig am 25.12.2057	\$ 870	832	0,02
Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		698.682	19,62	Bear Stearns Mortgage Funding Trust				Paragon Mortgages PLC			
KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL											
California State General Obligation Bonds, Series 2023				5,810 % fällig am 25.06.2047	928	784	0,02	6,270 % fällig am 15.05.2045	£ 70	90	0,00
5,125 % fällig am 01.03.2038	3.600	3.643	0,10	Brass PLC				Polaris PLC			
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN											
Fannie Mae				5,940 % fällig am 16.11.2066	£ 248	317	0,01	5,985 % fällig am 23.12.2058	1.448	1.842	0,05
3,000 % fällig am 01.03.2060	1.007	887	0,02	Canada Square Funding PLC				Residential Accredited Loans, Inc. Trust			
3,500 % fällig am 01.01.2059	617	560	0,02	6,000 % fällig am 17.06.2058	1.618	2.053	0,06	5,770 % fällig am 25.06.2037	\$ 258	239	0,01
Freddie Mac				6,170 % fällig am 17.06.2058	2.944	3.749	0,10	6,000 % fällig am 25.06.2036	344	265	0,01
3,500 % fällig am 01.05.2048	5.140	4.806	0,14	6,470 % fällig am 17.12.2057	1.340	1.714	0,05	6,288 % fällig am 25.11.2037	234	192	0,01
4,000 % fällig am 01.06.2048	3.740	3.613	0,10	Charter Mortgage Funding PLC				Residential Mortgage Securities PLC			
Ginnie Mae				5,796 % fällig am 16.01.2057	431	550	0,02	6,470 % fällig am 20.06.2070	£ 1.070	1.367	0,04
3,000 % fällig am 20.07.2046 - 20.05.2047	20	19	0,00	Chase Mortgage Finance Trust				RESIMAC Bastille Trust			
4,500 % fällig am 20.06.2053	199	194	0,01	4,523 % fällig am 25.07.2037	\$ 7	5	0,00	6,390 % fällig am 05.09.2057	\$ 32	32	0,00
6,464 % fällig am 20.04.2067	185	185	0,01	Citigroup Commercial Mortgage Trust				RESIMAC Premier			
Ginnie Mae, TBA				3,209 % fällig am 10.05.2049	2.100	1.988	0,06	6,524 % fällig am 07.02.2052	397	397	0,01
3,000 % fällig am 01.02.2054	20.800	18.848	0,53	Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				Ripon Mortgages PLC			
Uniform Mortgage-Backed Security				4,907 % fällig am 25.12.2035	327	217	0,01	5,920 % fällig am 28.08.2056	£ 12.378	15.733	0,44
2,500 % fällig am 01.12.2051 - 01.03.2052	46.409	39.519	1,11	Commercial Mortgage Trust				RMAC PLC			
3,000 % fällig am 01.07.2052	8.069	7.144	0,20	3,590 % fällig am 10.11.2047	2.000	1.958	0,05	0,000 % fällig am 15.02.2047	12.767	16.328	0,46
3,500 % fällig am 01.03.2047 - 01.04.2053	28.356	26.093	0,73	3,611 % fällig am 10.08.2049	1.000	929	0,03	RMAC Securities PLC			
4,000 % fällig am 01.07.2048 - 01.07.2053	147.912	139.968	3,93	4,228 % fällig am 10.05.2051	1.700	1.598	0,04	5,509 % fällig am 12.06.2044	32	39	0,00
4,500 % fällig am 01.08.2052 - 01.07.2053	161.958	157.108	4,41	Countryside Alternative Loan Trust				Sequoia Mortgage Trust			
5,000 % fällig am 01.02.2053	144.365	142.914	4,01	5,500 % fällig am 25.11.2034	106	103	0,00	3,917 % fällig am 20.07.2037	\$ 184	136	0,00
5,500 % fällig am 01.02.2053	93.478	93.902	2,64	5,710 % fällig am 25.06.2036	70	62	0,00	Stratton Mortgage Funding PLC			
6,000 % fällig am 01.01.2053	39.416	40.048	1,12	5,890 % fällig am 25.07.2046	412	335	0,01	6,069 % fällig am 25.09.2051	£ 2.332	2.972	0,08
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				5,950 % fällig am 25.08.2047	727	637	0,02	6,120 % fällig am 12.03.2052	1.832	2.336	0,07
2,500 % fällig am 01.01.2054	13.000	11.061	0,31	6,250 % fällig am 25.12.2036	1.033	454	0,01	6,121 % fällig am 20.07.2060	2.703	3.445	0,10
5,000 % fällig am 01.01.2054	62.700	62.048	1,74	Countryside Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				Structured Asset Securities Corp.			
5,500 % fällig am 01.01.2054	70.100	70.417	1,98	6,000 % fällig am 25.07.2036	246	129	0,00	5,750 % fällig am 25.01.2036	\$ 135	112	0,00
6,000 % fällig am 01.02.2054	129.800	131.803	3,70	6,000 % fällig am 25.12.2036	602	246	0,01	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust			
6,500 % fällig am 01.02.2054	319.700	327.605	9,20	6,000 % fällig am 25.03.2037	598	290	0,01	5,760 % fällig am 25.10.2036	278	224	0,01
		1.278.742	35,91	6,010 % fällig am 25.04.2046	1.851	537	0,01	TBW Mortgage-Backed Trust			
US-SCHATZOBIGATIONEN											
U.S. Treasury Bonds				6,050 % fällig am 25.03.2035	311	256	0,01	5,965 % fällig am 25.07.2037	2.296	706	0,02
1,625 % fällig am 15.11.2050	10.100	6.020	0,17	6,150 % fällig am 25.03.2035	67	59	0,00	Towd Point Mortgage Funding PLC			
1,875 % fällig am 15.02.2041	42.500	30.578	0,86	6,500 % fällig am 25.11.2047	92	47	0,00	6,365 % fällig am 20.10.2051	£ 542	691	0,02
2,875 % fällig am 15.05.2052	6.900	5.496	0,16	Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust				6,571 % fällig am 20.07.2045	937	1.197	0,03
4,000 % fällig am 15.11.2052	5.200	5.132	0,14	5,770 % fällig am 25.09.2047	697	593	0,02	Trinity Square PLC			
U.S. Treasury Inflation Protected Securities (c)				6,030 % fällig am 25.08.2036	3.835	3.451	0,10	6,070 % fällig am 15.07.2059	1.527	1.947	0,05
0,125 % fällig am 15.10.2024	3.837	3.754	0,11	Dutch Property Finance BV				Twin Bridges PLC			
0,125 % fällig am 15.04.2025	25.133	24.238	0,68	4,602 % fällig am 28.07.2058	€ 2.139	2.358	0,07	6,070 % fällig am 12.03.2055	2.483	3.154	0,09
0,125 % fällig am 15.07.2031	21.696	19.300	0,54	EMF-UK PLC				Uropa Securities PLC			
0,125 % fällig am 15.01.2032	28.081	24.679	0,69	6,319 % fällig am 13.03.2046	£ 177	224	0,01	5,690 % fällig am 10.10.2040	258	299	0,01
0,250 % fällig am 15.01.2025	32.215	31.272	0,88	Eurohome UK Mortgages PLC				WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
0,500 % fällig am 15.01.2028	10.602	10.036	0,28	5,490 % fällig am 15.06.2044	18	23	0,00	3,858 % fällig am 25.02.2037	\$ 2.628	2.293	0,06
0,625 % fällig am 15.07.2032	1.588	1.452	0,04	EuroMASTR PLC				4,172 % fällig am 25.09.2036	57	48	0,00
1,125 % fällig am 15.01.2033	35.222	33.345	0,94	5,531 % fällig am 15.06.2040	43	52	0,00	4,615 % fällig am 25.10.2035	77	69	0,00
				First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust				5,662 % fällig am 25.09.2033	39	36	0,00
				6,250 % fällig am 25.11.2036	\$ 32	10	0,00	6,012 % fällig am 25.02.2046	249	218	0,01
				Genesis Mortgage Funding PLC				Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
				6,420 % fällig am 15.09.2059	£ 6.181	7.906	0,22	5,500 % fällig am 25.04.2035	286	231	0,01
				GSR Mortgage Loan Trust					114.432	3,21	
				4,489 % fällig am 25.11.2035	\$ 46	45	0,00	FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
				5,349 % fällig am 25.10.2035	21	20	0,00	Accunia European CLO DAC			
				Impac Secured Assets Trust				4,915 % fällig am 15.07.2030	€ 304	336	0,01
				5,990 % fällig am 25.01.2037	436	360	0,01	ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust			
				IndyMac Mortgage Loan Trust				6,370 % fällig am 25.12.2034	\$ 101	91	0,00
				4,699 % fällig am 25.12.2034	115	109	0,00	6,370 % fällig am 25.08.2035	1.331	1.290	0,04
				5,810 % fällig am 25.11.2036	2.332	2.298	0,06				

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Adagio CLO DAC				4,673 % fällig am 20.10.2031	€ 1.181	\$ 1.285	0,04	Saxon Asset Securities Trust			
4,685 % fällig am 15.10.2031	€ 2.400	\$ 2.615	0,07	4,725 % fällig am 15.07.2031	3.300	3.593	0,10	2,011 % fällig am 25.05.2035	\$ 2.780	\$ 2.606	0,07
Apidos CLO				4,815 % fällig am 15.01.2032	4.700	5.126	0,14	Sculptor European CLO DAC			
6,687 % fällig am 20.04.2031	\$ 5.581	5.581	0,16	Home Equity Asset Trust				4,755 % fällig am 14.01.2032	€ 4.900	5.335	0,15
Aqueduct European CLO DAC				6,145 % fällig am 25.02.2036	\$ 738	713	0,02	Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust			
4,633 % fällig am 20.07.2030	€ 1.969	2.159	0,06	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust				6,190 % fällig am 25.10.2035	\$ 5.600	4.626	0,13
Ares CLO Ltd.				5,690 % fällig am 25.04.2037	247	187	0,01	Segovia European CLO DAC			
6,825 % fällig am 15.10.2030	\$ 3.996	4.000	0,11	7,420 % fällig am 25.03.2035	1.295	1.178	0,03	4,873 % fällig am 20.07.2032	€ 2.700	2.945	0,08
Ares European CLO DAC				HSI Asset Securitization Corp. Trust				Soundview Home Loan Trust			
4,745 % fällig am 15.10.2031	€ 2.665	2.916	0,08	4,713 % fällig am 25.01.2037	1.435	1.084	0,03	5,875 % fällig am 25.12.2036	\$ 1.300	1.268	0,04
4,843 % fällig am 20.04.2032	4.100	4.458	0,13	IndyMac Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust				5,970 % fällig am 25.11.2036	898	846	0,02
Argent Securities Trust				4,652 % fällig am 25.03.2035	1.611	1.571	0,04	Steele Creek CLO Ltd.			
5,830 % fällig am 25.04.2036	\$ 4.991	1.621	0,05	KKR CLO Ltd.				6,905 % fällig am 15.10.2030	5.060	5.058	0,14
Atlas Senior Loan Fund Ltd.				6,835 % fällig am 15.01.2031	2.608	2.608	0,07	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust			
6,805 % fällig am 16.01.2030	1.777	1.774	0,05	Laurelin DAC				5,995 % fällig am 25.07.2036	1.073	1.023	0,03
Aurium CLO DAC				4,713 % fällig am 20.10.2031	€ 1.425	1.559	0,04	Terwin Mortgage Trust			
4,695 % fällig am 16.01.2031	€ 4.789	5.233	0,15	LCM Loan Income Fund Income Note Issuer Ltd.				6,410 % fällig am 25.11.2033	4	4	0,00
Bain Capital Euro CLO DAC				6,735 % fällig am 16.07.2031	\$ 4.264	4.264	0,12	TIAA CLO Ltd.			
4,733 % fällig am 20.01.2032	1.967	2.147	0,06	Long Beach Mortgage Loan Trust				6,877 % fällig am 20.07.2031	2.436	2.436	0,07
Bayview Financial Asset Trust				6,070 % fällig am 25.01.2036	673	586	0,02	Toro European CLO DAC			
6,970 % fällig am 25.03.2037	\$ 93	95	0,00	LT Autorahoitus DAC				4,812 % fällig am 15.02.2034	€ 5.000	5.448	0,15
Benefit Street Partners CLO Ltd.				4,534 % fällig am 18.07.2033	€ 5.545	6.144	0,17	4,885 % fällig am 15.07.2030	115	128	0,00
6,777 % fällig am 20.01.2031	2.197	2.199	0,06	Madison Park Euro Funding DAC				Trinitas CLO Ltd.			
Black Diamond CLO DAC				4,715 % fällig am 15.01.2032	3.200	3.483	0,10	6,777 % fällig am 20.07.2031	\$ 2.528	2.529	0,07
4,982 % fällig am 15.05.2032	€ 4.592	5.009	0,14	4,765 % fällig am 15.07.2032	5.200	5.666	0,16	Venture CLO Ltd.			
BlueMountain Fuji EUR CLO DAC				Madison Park Funding Ltd.				6,535 % fällig am 15.04.2027	56	56	0,00
4,685 % fällig am 15.01.2031	1.987	2.170	0,06	0,000 % fällig am 29.07.2030	\$ 1.929	1.929	0,05	6,777 % fällig am 20.01.2029	1.736	1.737	0,05
4,875 % fällig am 15.01.2033	2.850	3.101	0,09	Man GLG Euro CLO DAC				6,915 % fällig am 15.01.2032	3.000	2.994	0,08
BNPP AM Euro CLO DAC				4,775 % fällig am 15.10.2032	€ 4.965	5.418	0,15	Voya CLO Ltd.			
4,822 % fällig am 22.07.2032	4.800	5.234	0,15	MASTR Asset-Backed Securities Trust				6,805 % fällig am 15.10.2031	11.100	11.085	0,31
Bridgepoint CLO DAC				5,790 % fällig am 25.08.2036	\$ 12.198	4.514	0,13	Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust			
5,175 % fällig am 15.01.2034	3.400	3.729	0,11	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				5,815 % fällig am 25.01.2037	2.475	2.389	0,07
Cairn CLO BV				5,710 % fällig am 25.02.2037	622	187	0,01	Wind River CLO Ltd.			
4,745 % fällig am 15.10.2031	1.299	1.412	0,04	6,190 % fällig am 25.05.2036	166	163	0,01	6,707 % fällig am 18.07.2031	905	905	0,03
Carlyle Euro CLO DAC				Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust							
4,665 % fällig am 15.01.2031	2.182	2.386	0,07	5,540 % fällig am 25.10.2036	794	343	0,01				
4,892 % fällig am 15.08.2032	3.000	3.270	0,09	5,570 % fällig am 25.11.2036	5.681	2.649	0,08				
Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd.				5,720 % fällig am 25.07.2036	59	52	0,00				
6,634 % fällig am 17.04.2031	\$ 3.141	3.139	0,09	6,070 % fällig am 25.12.2034	478	430	0,01	Adif Alta Velocidad			
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.				6,145 % fällig am 25.09.2035	3.148	2.951	0,08	0,550 % fällig am 31.10.2031	€ 5.000	4.513	0,13
4,752 % fällig am 15.11.2031	€ 1.497	1.631	0,05	6,430 % fällig am 25.09.2034	650	643	0,02	Auckland Council			
Carlyle U.S. CLO Ltd.				Morgan Stanley Structured Trust				0,250 % fällig am 17.11.2031	5.000	4.537	0,13
6,835 % fällig am 15.01.2030	\$ 3.171	3.171	0,09	5,770 % fällig am 25.06.2037	2.720	2.485	0,07	Australia Government International Bond			
Catamaran CLO Ltd.				Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd.				0,500 % fällig am			
6,774 % fällig am 22.04.2030	2.903	2.903	0,08	6,717 % fällig am 20.04.2031	2.500	2.498	0,07	21.09.2026	AUD 5.800	3.642	0,10
Cedar Funding CLO Ltd.				New Century Home Equity Loan Trust				1,000 % fällig am 21.12.2030	2.600	1.472	0,04
6,764 % fällig am 17.07.2031	4.400	4.400	0,12	6,235 % fällig am 25.02.2035	2.343	2.264	0,06	1,250 % fällig am 21.05.2032	1.200	665	0,02
CIFC Funding Ltd.				Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust				1,750 % fällig am 21.06.2051	1.400	565	0,02
6,640 % fällig am 24.04.2031	2.965	2.965	0,08	6,100 % fällig am 25.02.2036	3.934	3.533	0,10	4,500 % fällig am 21.04.2033	6.000	4.271	0,12
6,709 % fällig am 27.04.2031	2.282	2.281	0,06	Northwoods Capital Ltd.				Autonomous Community of Andalusia			
6,844 % fällig am 16.11.2030	4.179	4.182	0,12	6,758 % fällig am 19.04.2031	4.567	4.572	0,13	0,500 % fällig am 30.04.2031	€ 4.000	3.676	0,10
6,864 % fällig am 17.10.2031	6.600	6.604	0,19	NovaStar Mortgage Funding Trust				4,220 % fällig am 26.04.2035	200	227	0,01
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				5,670 % fällig am 25.01.2037	2.445	864	0,02	Autonomous Community of Catalonia			
5,610 % fällig am 25.07.2037	1.923	1.750	0,05	6,010 % fällig am 25.05.2036	1.700	1.603	0,05	0,420 % fällig am 30.04.2031	4.200	3.854	0,11
5,690 % fällig am 25.09.2037	164	167	0,01	OCF CLO Ltd.				BNG Bank NV			
5,720 % fällig am 25.02.2036	545	514	0,01	6,797 % fällig am 20.07.2029	1.950	1.951	0,06	0,250 % fällig am 12.01.2032	4.000	3.658	0,10
5,930 % fällig am 25.04.2047	5.554	5.036	0,14	OCF Euro CLO DAC				3,300 % fällig am			
6,445 % fällig am 25.01.2036	1.954	1.898	0,05	4,882 % fällig am 22.09.2034	€ 2.700	2.940	0,08	17.07.2028	AUD 3.000	1.961	0,05
CVC Cordatus Loan Fund DAC				Option One Mortgage Loan Trust				Bpifrance Financement S.A.			
4,661 % fällig am 27.01.2031	€ 5.587	6.088	0,17	5,610 % fällig am 25.01.2037	\$ 248	155	0,00	2,000 % fällig am 02.09.2030	€ 4.200	4.454	0,12
Dryden Euro CLO DAC				5,610 % fällig am 25.03.2037	1.113	769	0,02	Canada Government International Bond			
4,862 % fällig am 15.05.2034	1.248	1.357	0,04	5,650 % fällig am 25.04.2037	2.964	1.415	0,04	2,750 % fällig am			
Encore Credit Receivables Trust				OZLM Ltd.				01.12.2033	CAD 31.300	24.047	0,67
6,160 % fällig am 25.07.2035	\$ 422	406	0,01	6,674 % fällig am 17.07.2029	1.162	1.161	0,03	Canadian Government Real Return Bond			
Fremont Home Loan Trust				6,682 % fällig am 16.05.2030	2.150	2.148	0,06	1,500 % fällig am			
6,180 % fällig am 25.06.2035	122	117	0,00	6,902 % fällig am 30.10.2030	789	790	0,02	01.12.2044 (c)	549	412	0,01
Greenwood Park CLO Ltd.				Palmer Square CLO Ltd.				Cassa Depositi e Prestiti SpA			
6,665 % fällig am 15.04.2031	2.267	2.269	0,06	6,755 % fällig am 16.07.2031	3.241	3.246	0,09	5,750 % fällig am 05.05.2026	\$ 5.300	5.296	0,15
Griffith Park CLO DAC				Palmer Square European Loan Funding DAC				China Government International Bond			
4,704 % fällig am 21.11.2031	€ 996	1.083	0,03	4,685 % fällig am 15.10.2031	€ 5.040	5.479	0,15	3,190 % fällig am			
GSAMP Trust				4,695 % fällig am 15.07.2031	3.710	4.048	0,11	15.04.2053	CNY 28.440	4.268	0,12
5,970 % fällig am 25.05.2046	\$ 1.237	1.157	0,03	Renaissance Home Equity Loan Trust				Communaute Francaise de Belgique			
6,190 % fällig am 25.11.2035	3.800	3.082	0,09	5,762 % fällig am 25.08.2036	\$ 708	282	0,01	3,750 % fällig am 22.06.2033	€ 16.300	19.080	0,54
Harvest CLO DAC				Residential Asset Securities Corp. Trust				CPPIB Capital, Inc.			
4,566 % fällig am 26.06.2030	€ 2.117	2.313	0,07	6,130 % fällig am 25.12.2035	4.997	4.803	0,14	1,500 % fällig am			
4,605 % fällig am 15.10.2031	3.126	3.396	0,10					23.06.2028	AUD 2.300	1.385	0,04
								Development Bank of Japan, Inc.			
								1,875 % fällig am 02.10.2024	\$ 3.900	3.806	0,11
								2,125 % fällig am 01.09.2026	€ 6.000	6.511	0,18

STAATSEMISSIONEN

283.485 7,96

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond ESG Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
France Government International Bond				Poland Government International Bond				KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
0,000 % fällig am 25.11.2029 (a)	€ 9.900	\$ 9.596	0,27	3,875 % fällig am 14.02.2033	€ 7.700	\$ 8.870	0,25	COMMERCIAL PAPER			
0,750 % fällig am 25.05.2052	7.700	4.879	0,14	4,250 % fällig am 14.02.2043	900	1.049	0,03	AT+T, Inc.			
2,000 % fällig am 25.11.2032	6.200	6.596	0,18	4,875 % fällig am 04.10.2033	\$ 2.200	2.236	0,06	5,700 % fällig am 19.03.2024	\$ 12.700	\$ 12.540	0,35
Hungary Government International Bond				5,500 % fällig am 16.11.2027	600	624	0,02	Southern California Edison			
5,000 % fällig am 22.02.2027	900	1.039	0,03	5,500 % fällig am 04.04.2053	1.600	1.672	0,05	5,800 % fällig am 02.01.2024	6.000	5.996	0,17
6,250 % fällig am 22.09.2032	\$ 9.500	10.160	0,28	Region of Ile de France							
Israel Government International Bond				2,230 % fällig am 19.07.2032	€ 6.000	6.300	0,18				
2,000 % fällig am 31.03.2027	ILS 7.800	2.058	0,06	Bundesrepublik Deutschland							
3,800 % fällig am 13.05.2060	\$ 1.700	1.224	0,03	0,000 % fällig am 15.08.2031 (a)	53.800	51.478	1,44				
4,500 % fällig am 17.01.2033	2.100	2.000	0,06	Romania Government International Bond				HUNGARY TREASURY BILLS			
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro				1,375 % fällig am 02.12.2029	1.170	1.068	0,03	10,900 % fällig am 04.01.2024 (a)(b)	HUF 6.097.000	17.610	0,49
4,000 % fällig am 30.10.2031	€ 20.000	23.024	0,65	2,000 % fällig am 28.01.2032	200	171	0,00	JAPAN TREASURY BILLS			
Japan Finance Organization for Municipalities				2,000 % fällig am 14.04.2033	5.600	4.644	0,13	(0,305) % fällig am 09.01.2024 (a)(b)	¥ 3.533.000	25.061	0,70
0,010 % fällig am 02.02.2028	3.600	3.561	0,10	2,124 % fällig am 16.07.2031	100	88	0,00	(0,271) % fällig am 09.01.2024 (a)(b)	6.782.000	48.107	1,35
Japan Government International Bond				2,125 % fällig am 07.03.2028	18.400	18.487	0,52	(0,269) % fällig am 09.01.2024 (a)(b)	2.259.000	16.024	0,45
0,005 % fällig am 01.03.2024	¥ 4.110.000	29.160	0,82	2,625 % fällig am 02.12.2040	500	373	0,01	(0,260) % fällig am 09.01.2024 (a)(b)	26.000	184	0,01
0,005 % fällig am 01.04.2024	1.690.000	11.992	0,34	2,750 % fällig am 14.04.2041	600	447	0,01	(0,253) % fällig am 26.02.2024 (a)(b)	26.038.000	184.736	5,19
0,005 % fällig am 01.05.2024	1.370.000	9.723	0,27	2,875 % fällig am 13.04.2042	2.000	1.500	0,04	(0,245) % fällig am 04.03.2024 (a)(b)	0	105.505	2,96
0,005 % fällig am 01.10.2024	6.820.000	48.400	1,36	3,750 % fällig am 07.02.2034	2.100	2.001	0,06	(0,238) % fällig am 15.01.2024 (a)(b)	2.347.000	16.648	0,47
0,100 % fällig am 10.03.2028 (c)	2.989.457	22.286	0,63	6,625 % fällig am 27.09.2029	8.600	10.175	0,29	(0,226) % fällig am 15.01.2024 (a)(b)	1.333.000	9.456	0,27
0,200 % fällig am 20.06.2036	500.000	3.265	0,09	Serbia Government International Bond				(0,225) % fällig am 26.02.2024 (a)(b)	7.422.000	52.658	1,48
0,500 % fällig am 20.09.2046	477.000	2.734	0,08	1,000 % fällig am 23.09.2028	3.100	2.898	0,08	(0,216) % fällig am 22.01.2024 (a)(b)	11.514.000	81.678	2,29
0,500 % fällig am 20.03.2049	2.600.000	14.310	0,40	1,650 % fällig am 03.03.2033	3.000	2.460	0,07	(0,215) % fällig am 19.02.2024 (a)(b)	5.340.000	37.885	1,06
0,700 % fällig am 20.12.2048	132.000	768	0,02	2,050 % fällig am 23.09.2036	2.550	1.966	0,05	(0,211) % fällig am 29.01.2024 (a)(b)	11.162.000	79.184	2,22
0,700 % fällig am 20.06.2051	1.502.000	8.469	0,24	Singapore Government International Bond				(0,197) % fällig am 22.01.2024 (a)(b)	1.116.000	7.917	0,22
1,300 % fällig am 20.06.2052	620.000	4.053	0,11	2,250 % fällig am 01.08.2036 SGD	4.410	3.178	0,09	(0,193) % fällig am 29.01.2024 (a)(b)	38.000	269	0,01
1,400 % fällig am 20.09.2052	260.000	1.739	0,05	3,375 % fällig am 01.09.2033	2.050	1.645	0,05	(0,188) % fällig am 11.03.2024 (a)(b)	2.962.000	21.017	0,59
1,500 % fällig am 20.09.2043	3.270.000	23.626	0,66	Societe Du Grand Paris EPIC				(0,184) % fällig am 11.03.2024 (a)(b)	813.000	5.769	0,16
Kommunalbanken A/S				0,700 % fällig am 15.10.2060	€ 4.400	2.080	0,06	(0,151) % fällig am 11.03.2024 (a)(b)	875.000	6.209	0,18
1,900 % fällig am 19.01.2027 AUD	800	509	0,01	South Korea Government International Bond							
Korea Housing Finance Corp.				1,375 % fällig am 10.12.2029 KRW	7.771.200	5.464	0,15				
0,010 % fällig am 29.06.2026	€ 1.300	1.329	0,04	2,000 % fällig am 10.06.2031	34.358.800	0	0,69				
3,714 % fällig am 11.04.2027	5.000	5.632	0,16		0	24.607	0,69				
4,475 % fällig am 06.04.2026 AUD	10.900	7.365	0,21	2,375 % fällig am 10.12.2028	6.642.280	4.977	0,14				
Malaysia Government International Bond				2,625 % fällig am 10.06.2028	7.131.400	5.420	0,15				
3,519 % fällig am 20.04.2028 MYR	104.662	22.738	0,64	3,250 % fällig am 10.03.2028	7.093.580	5.581	0,16				
Mexico Government International Bond				3,250 % fällig am 10.06.2033	31.594.560	0	0,69				
5,000 % fällig am 27.04.2051	\$ 500	435	0,01		0	24.665	0,69				
Ministeries van de Vlaamse Gemeenschap				3,250 % fällig am 10.09.2042	2.914.800	2.301	0,06				
0,875 % fällig am 21.03.2046	€ 3.800	2.603	0,07	4,250 % fällig am 10.12.2032	26.799.020	0	0,63				
New Zealand Government International Bond					0	22.491	0,63				
1,500 % fällig am 15.05.2031 NZD	1.500	785	0,02	Spain Government International Bond							
Ontario Teachers' Finance Trust				1,000 % fällig am 30.07.2042	€ 3.200	2.366	0,07				
0,900 % fällig am 20.05.2041	€ 1.400	1.069	0,03	1,450 % fällig am 31.10.2071	500	279	0,01				
1,850 % fällig am 03.05.2032	4.000	4.036	0,11	3,450 % fällig am 30.07.2066	9.600	9.943	0,28				
Peru Government International Bond				Svensk Exportkredit AB							
2,780 % fällig am 01.12.2060	\$ 1.500	939	0,03	2,000 % fällig am 30.06.2027	5.500	5.941	0,17				
5,940 % fällig am 12.02.2029 PEN	4.800	1.296	0,04	Thailand Government International Bond							
6,150 % fällig am 12.08.2032	2.100	555	0,02	3,390 % fällig am 17.06.2037 THB	241.295	7.493	0,21				
				Tokyo Metropolitan Government							
				2,625 % fällig am 29.05.2024	\$ 400	396	0,01				
				United Kingdom Gilt							
				1,250 % fällig am 31.07.2051	£ 7.100	4.824	0,14				
				1,500 % fällig am 31.07.2053	7.500	5.333	0,15				
						653.744	18,36				
								Summe kurzfristige Instrumente		734.453	20,62
								Summe Übertragbare Wertpapiere	\$ 3.995.935	112,21	

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft ⁽¹⁾	% des Netto- vermögens
BOS	5,490 %	02.01.2024	03.01.2024	\$ 91.000	U.S. Treasury Notes 0,750 % fällig am 30.04.2026	\$ (92.883)	\$ 91.000	\$ 91.014	2,56
FICC	2,600	29.12.2023	02.01.2024	2.258	U.S. Treasury Notes 4,875 % fällig am 30.11.2023	(2.303)	2.258	2.258	0,06
	5,330	29.12.2023	02.01.2024	72.700	U.S. Treasury Notes 5,330 % fällig am 30.11.2028	(74.154)	72.700	72.700	2,04
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (169.340)	\$ 165.958	\$ 165.972	4,66

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
3-Month Euribor March Futures	Long	03.2024	1.282	\$ 220	0,01
3-Month Euribor March Futures	Long	03.2025	1.282	1.155	0,03
3-Month Euribor September Futures	Short	09.2024	2.564	(1.687)	(0,05)

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
3-Month SOFR December Futures	Long	03.2024	47	\$ (218)	(0,01)
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2025	2.602	(3.409)	(0,10)
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2024	214	(30)	0,00
3-Month SOFR June Futures	Long	09.2025	650	972	0,03
3-Month SOFR March Futures	Long	06.2024	2.202	895	0,03
3-Month SOFR September Futures	Short	12.2024	688	(440)	(0,01)
3-Month SOFR September Futures	Long	12.2025	650	969	0,03
Australia Government 3-Year Note March Futures	Short	03.2024	73	(53)	0,00
Australia Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2024	877	(1.979)	(0,06)
Canada Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2024	409	661	0,02
Euro-Bobl March Futures	Short	03.2024	1.083	(2.359)	(0,07)
Euro-BTP Italy Government Bond March Futures	Long	03.2024	400	1.986	0,06
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Long	03.2024	88	168	0,01
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Short	03.2024	15	(190)	(0,01)
Euro-OAT France Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2024	13	53	0,00
Euro-Schatz March Futures	Short	03.2024	94	(70)	0,00
Japan Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2024	69	(581)	(0,02)
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Short	03.2024	68	(184)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Short	03.2024	710	(2.533)	(0,07)
U.S. Treasury 10-Year Ultra March Futures	Short	03.2024	166	(946)	(0,03)
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Long	03.2024	20	196	0,01
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Long	03.2024	175	1.964	0,06
United Kingdom Long Gilt March Futures	Short	03.2024	937	(8.043)	(0,23)
				\$ (13.483)	(0,38)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					
				\$ (13.483)	(0,38)

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 Netto- vermögens
Zahlung ⁽¹⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,000 %	17.06.2027	£ 95.700	\$ 227	0,01
Erhalt ⁽¹⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,000	17.06.2035	20.700	(46)	0,00
Zahlung ⁽¹⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,250	20.03.2054	13.800	2.297	0,06
Zahlung ⁽¹⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,500	20.03.2034	153.050	15.814	0,44
Zahlung ⁽¹⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	5,000	20.03.2029	165.300	6.979	0,20
Erhalt ⁽¹⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	5,500	20.03.2026	30.200	(965)	(0,03)
Erhalt ⁽¹⁾	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,250	20.03.2029	INR 2.217.490	31	0,00
Zahlung ⁽¹⁾	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,500	20.03.2029	440.980	16	0,00
Erhalt ⁽¹⁾	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,500	20.03.2034	280.960	(20)	0,00
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.12.2028	¥ 180.000	(14)	0,00
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	17.03.2031	1.500.000	(209)	(0,01)
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,035	29.11.2029	1.500.000	(161)	(0,01)
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,050	15.12.2031	3.010.000	(443)	(0,01)
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,200	19.06.2029	1.060.000	(119)	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	19.06.2039	430.000	202	0,01
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,450	15.12.2051	505.230	(192)	(0,01)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,550	14.09.2028	4.600.000	(449)	(0,01)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,850	20.09.2033	820.000	(27)	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	1,200	20.09.2053	20.000	(6)	0,00
Erhalt ⁽¹⁾	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	2,750	20.03.2029	SGD 100.811	(704)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,684	30.04.2025	\$ 900	28	0,00
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,696	30.04.2025	900	28	0,00
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,710	30.04.2025	1.000	31	0,00
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,714	30.04.2025	1.900	59	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,500	16.06.2028	5.300	(43)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,430	31.03.2024	33.000	(307)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,500	15.12.2028	20.200	(500)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,500	15.06.2052	13.400	(2.129)	(0,06)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,518	20.01.2029	12.300	(344)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,545	20.01.2029	8.200	(231)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,630	20.01.2029	10.300	(298)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,630	26.01.2029	2.300	(65)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.06.2024	139.200	1.631	0,05
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.06.2052	27.180	(887)	(0,03)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	15.12.2051	26.100	(3.652)	(0,10)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,841	31.10.2024	3.000	(44)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,910	14.11.2024	3.000	(41)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,920	17.10.2024	5.600	(84)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,965	30.11.2026	67.260	1.975	0,05
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,993	13.10.2024	9.600	(133)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,018	24.10.2024	2.500	(34)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,048	15.11.2032	8.100	285	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,050	08.09.2029	14.000	(342)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,080	23.02.2053	3.070	(167)	(0,01)

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond ESG Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,088 %	07.11.2024	\$ 5.400	\$ (62)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,089	15.11.2032	100	3	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,100	09.09.2029	2.400	(52)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,104	15.11.2032	2.990	91	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,139	15.11.2032	7.830	216	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,140	25.10.2024	2.500	(29)	0,00
Erhalt ⁽¹⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,150	13.05.2025	277.800	1.943	0,05
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,163	30.09.2029	6.800	(158)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,174	15.11.2032	12.000	299	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,190	25.10.2024	2.500	(28)	0,00
Erhalt ⁽¹⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,200	13.05.2025	22.500	211	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,224	30.06.2024	7.091	136	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,225	25.10.2024	2.600	(28)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,225	30.09.2029	800	(19)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,250	21.06.2028	5.800	(166)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,250	20.12.2053	64.100	(7.771)	(0,22)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,454	30.06.2029	3.610	(46)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,470	22.02.2030	4.900	(63)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	22.06.2030	4.400	(24)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2033	255.525	10.536	0,30
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,521	30.11.2027	19.640	(100)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,525	02.03.2030	700	(7)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,650	22.11.2024	4.600	(42)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,650	05.12.2024	6.200	(56)	0,00
Erhalt ⁽¹⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,684	03.01.2034	5.500	(77)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	21.11.2024	5.100	(41)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	11.12.2024	5.200	(40)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	21.06.2025	38.900	659	0,02
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.12.2028	79.700	(2.625)	(0,07)
Erhalt ⁽¹⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	02.01.2034	1.950	(38)	0,00
Zahlung ⁽¹⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2034	43.640	151	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,800	10.03.2028	5.800	(10)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,800	05.09.2028	2.580	33	0,00
Erhalt ⁽¹⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,810	02.01.2034	1.950	(48)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,842	26.12.2033	1.600	(43)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,849	31.03.2030	3.000	45	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,854	29.12.2033	3.400	(96)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,857	31.03.2030	17.000	250	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,951	31.03.2030	41.600	874	0,02
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,988	30.11.2027	62.800	964	0,03
Erhalt ⁽¹⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,000	20.03.2054	15.200	(302)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,050	10.10.2028	12.100	230	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,159	31.03.2025	34.000	516	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,193	30.11.2027	42.200	845	0,02
Erhalt ⁽¹⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,228	30.08.2025	40.500	(172)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	20.12.2025	394.553	(3.222)	(0,09)
Zahlung ⁽¹⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	20.03.2034	36.300	312	0,01
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,000	16.06.2026	CAD 20.500	242	0,01
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,250	16.06.2031	19.300	210	0,01
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2025	600	7	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2030	27.900	338	0,01
Erhalt	3-Month CAD-Bank Bill	3,250	15.03.2028	15.410	263	0,01
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,250	20.12.2028	24.600	327	0,01
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,250	21.06.2033	37.500	1.207	0,03
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,250	21.06.2053	2.600	243	0,01
Zahlung ⁽¹⁾	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,500	10.05.2025	385.200	(609)	(0,02)
Erhalt ⁽¹⁾	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,500	01.06.2032	49.100	(680)	(0,02)
Erhalt	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,750	20.12.2033	36.200	(1.383)	(0,04)
Zahlung ⁽¹⁾	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	4,600	30.08.2025	50.500	361	0,01
Zahlung	3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,283	14.02.2027	CHF 4.200	(77)	0,00
Zahlung	3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,294	10.02.2027	15.500	(286)	(0,01)
Zahlung	3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,343	16.05.2027	6.300	(97)	0,00
Zahlung ⁽¹⁾	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,250	20.03.2029	CNY 60.070	48	0,00
Zahlung ⁽¹⁾	3-Month KRW-KORIBOR	3,250	20.03.2029	KRW11.383.400	44	0,00
Zahlung ⁽¹⁾	3-Month KRW-KORIBOR	3,500	20.03.2034	4.433.800	31	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	0,528	17.03.2024	NZD 950	24	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	3,750	15.06.2027	35.300	(579)	(0,02)
Zahlung	3-Month NZD-BBR	4,000	14.06.2024	93.500	(519)	(0,02)
Zahlung ⁽¹⁾	3-Month NZD-BBR	5,000	20.03.2025	54.500	36	0,00
Zahlung	3-Month SEK-STIBOR	1,000	19.06.2029	SEK 11.700	19	0,00
Erhalt	6-Month AUD-BBR-BBSW	1,250	17.06.2030	AUD 4.800	(49)	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	1,750	16.03.2027	3.000	10	0,00
Erhalt	6-Month AUD-BBR-BBSW	1,750	16.06.2031	6.450	(18)	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,000	21.06.2033	141.900	1.360	0,04
Zahlung ⁽¹⁾	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,250	15.09.2032	5.700	(1)	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,250	15.03.2033	40.300	(396)	(0,01)
Zahlung ⁽¹⁾	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	15.09.2032	233.470	1.535	0,04
Zahlung ⁽¹⁾	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,750	20.12.2033	195.100	2.691	0,08
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	1,913	30.01.2029	CZK 7.400	15	0,00
Erhalt ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,054	27.05.2050	€ 600	73	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,064	17.11.2052	1.300	192	0,01

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		0,250 %	15.09.2036	€ 1.400	\$ (103)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		0,650	12.04.2027	6.000	(193)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		0,650	11.05.2027	4.300	(127)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		0,700	11.04.2027	3.300	(108)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		1,000	30.03.2024	130.139	(906)	(0,03)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		1,000	13.05.2027	7.200	(229)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		1,000	18.05.2027	3.500	(109)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		2,100	11.04.2024	18.200	47	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		2,100	13.04.2024	41.200	119	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		2,100	17.05.2024	9.300	28	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		2,250	26.04.2024	5.800	32	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		2,250	28.04.2024	6.800	31	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		2,250	03.05.2024	6.400	29	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		2,250	21.09.2037	11.890	(246)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		2,250	21.09.2042	6.060	(778)	(0,02)
Erhalt ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR		2,750	20.03.2054	83.900	(8.687)	(0,24)
Erhalt ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR		2,760	03.01.2029	7.700	(115)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		2,880	19.12.2028	8.300	(168)	(0,01)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		2,890	22.12.2033	2.300	(78)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		2,910	29.12.2033	1.700	(62)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		2,920	13.12.2028	4.100	(90)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		2,990	08.12.2033	200	(9)	0,00
Zahlung ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR		3,000	19.03.2027	136.070	1.696	0,05
Erhalt ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR		3,000	15.03.2033	58.910	(777)	(0,02)
Zahlung ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR		3,000	20.03.2034	231.490	12.230	0,34
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		3,063	06.12.2033	1.600	(80)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		3,148	20.11.2033	2.800	(160)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		3,179	29.11.2028	100	(3)	0,00
Zahlung ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR		3,250	20.03.2029	329.300	12.169	0,34
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		3,255	22.11.2028	100	(4)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		3,280	22.11.2033	2.500	(175)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		3,300	03.10.2033	10.900	852	0,02
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		3,305	27.11.2033	3.200	(232)	(0,01)
Zahlung ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR		3,500	20.03.2026	358.400	5.106	0,14
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		3,535	18.09.2025	133.100	(1.404)	(0,04)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		3,536	18.09.2025	34.600	(365)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		4,870	07.07.2025	MXN 20.400	8	0,00
						\$ 41.617	1,17
						\$ 41.617	1,17

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

⁽¹⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

OPTIONSKAUF**ZINSSWAPOPTIONEN**

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BOA	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,750 %	15.07.2024	384.700	\$ 769	\$ 273	0,01
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,180	11.01.2024	8.600	246	920	0,02
BRC	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500	26.03.2024	66.300	89	2	0,00
FAR	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500	26.03.2024	89.300	134	2	0,00
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500	26.03.2024	89.100	138	2	0,00
JPM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500	26.03.2024	104.200	133	3	0,00
MYC	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500	26.03.2024	107.200	148	3	0,00
							\$ 1.657	\$ 1.205	0,03

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BPS	Put - OTC France Government International Bond 0,750 % fällig am 25.05.2052	€ 97,000	23.05.2025	2.200	\$ 166	\$ 904	0,03

VERKAUFSOPTIONEN**DEVIENOPTIONEN**

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens
GLM	Put - OTC USD versus TWD	TWD 31,000	04.03.2024	4.378	\$ (61)	\$ (127)	0,00
JPM	Put - OTC USD versus TWD	31,000	01.03.2024	11.402	(154)	(328)	(0,01)
					\$ (215)	\$ (455)	(0,01)

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond ESG Fund (Forts.)

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BOA	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,310 %	11.01.2024	76.400\$	(246)	\$ (1.771)	(0,05)
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	5,250	15.07.2024	384.700	(385)	(92)	0,00
BPS	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,545	16.01.2024	2.200	(10)	(28)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,995	16.01.2024	2.200	(10)	(1)	0,00
	Put - OTC 25-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,451	23.05.2025	2.200	(166)	(835)	(0,03)
CBK	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,310	18.01.2024	4.400	(17)	(13)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,590	05.01.2024	400	(1)	(4)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,700	18.01.2024	4.400	(17)	(13)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,960	05.01.2024	400	(1)	0	0,00
FAR	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,489	08.01.2024	2.600	(12)	(19)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,550	16.01.2024	1.300	(6)	(17)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,989	08.01.2024	2.600	(12)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,000	16.01.2024	1.300	(6)	0	0,00
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,697	02.04.2024	9.300	(73)	(3)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,697	02.04.2024	9.300	(73)	(148)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,721	08.04.2024	2.800	(21)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,721	08.04.2024	2.800	(21)	(43)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,215	22.01.2024	2.000	(8)	(6)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300	16.01.2024	500	(2)	(2)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,560	05.01.2024	2.500	(13)	(26)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,594	05.01.2024	2.500	(12)	(32)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,648	04.01.2024	2.100	(10)	(34)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,665	22.01.2024	2.000	(8)	(6)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	16.01.2024	500	(2)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,010	05.01.2024	2.500	(13)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,044	05.01.2024	2.500	(13)	0	0,00
JPM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	0,820	16.12.2024	20.100	(142)	(24)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,205	22.01.2024	1.700	(7)	(5)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,600	12.01.2024	2.100	(10)	(33)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,655	22.01.2024	1.700	(7)	(6)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,050	12.01.2024	2.100	(10)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,650	04.01.2024	400	(1)	(6)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,030	04.01.2024	400	(1)	0	0,00
MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,455	08.01.2024	2.200	(11)	(12)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,475	08.01.2024	700	(3)	(5)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,600	12.01.2024	200	(1)	(3)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,670	04.01.2024	2.900	(14)	(52)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,955	08.01.2024	2.200	(11)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,975	08.01.2024	700	(3)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,050	12.01.2024	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,120	04.01.2024	2.900	(14)	0	0,00
							\$ (1.394)	\$ (3.241)	(0,09)

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Netto- vermögens
GST	South Korea Government International Bond	(1,000) %	20.12.2028	\$ 7.600	\$ (222)	\$ (33)	\$ (255)	(0,01)
MYC	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.12.2028	7.800	(222)	(40)	(262)	(0,01)
					\$ (444)	\$ (73)	\$ (517)	(0,02)

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BRC	Italy Government International Bond	1,000 %	20.06.2025	\$ 1.700	\$ (41)	\$ 60	\$ 19	0,00
CBK	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	1.100	(27)	40	13	0,00
					\$ (68)	\$ 100	\$ 32	0,00

⁽¹⁾ Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den 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 Verbindlichkeiten, 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, wie in den Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps 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 Verbindlichkeiten, 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	Nenn- betrag erhaltener Währung	Nenn- betrag gelieferter Währung	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Netto- vermögens
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	\$ (29)	\$ 43	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)	16	15	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	(10)	16	6	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	(13)	31	0,00
						\$ 105	\$ (10)	\$ 95	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 Netto- vermögens
BOA	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500 %	20.09.2028	MYR 12.560	\$ 67	\$ (59)	\$ 8	0,00
GST	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	20.09.2028	301.220	1.078	(878)	200	0,01
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,600	20.09.2028	95.800	(10)	(19)	(29)	0,00
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	20.09.2033	59.060	374	(278)	96	0,00
						\$ 1.509	\$ (1.234)	\$ 275	0,01

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
AZD	01.2024	AUD 14.568	\$ 9.650	\$ 0	\$ (292)	\$ (292)	(0,01)
	03.2024	CNH 19.752	2.740	0	(49)	(49)	0,00
BOA	01.2024	CAD 1.900	1.402	0	(39)	(39)	0,00
	01.2024	£ 8.426	10.680	0	(62)	(62)	0,00
	01.2024	HUF 64.766	185	0	(2)	(2)	0,00
	01.2024	¥ 1.574.979	10.673	0	(506)	(506)	(0,01)
	01.2024	NZD 2.085	1.270	0	(50)	(50)	0,00
	01.2024	\$ 150	MXN 2.547	0	0	0	0,00
	01.2024	1.310	NOK 13.926	62	0	62	0,00
	02.2024	CNY 3.063	\$ 433	0	0	0	0,00
	03.2024	CNH 32.916	4.545	0	(105)	(105)	0,00
	03.2024	IDR 13.343.733	849	0	(17)	(17)	0,00
	03.2024	\$ 5.980	INR 500.360	12	0	12	0,00
	06.2024	KRW 712.809	\$ 548	0	(7)	(7)	0,00
BPS	01.2024	DKK 204.416	30.225	20	(91)	(71)	0,00
	01.2024	£ 13.386	16.980	0	(86)	(86)	0,00
	01.2024	HUF 720.998	2.051	0	(32)	(32)	0,00
	01.2024	¥ 14.578.840	99.358	0	(4.117)	(4.117)	(0,12)
	01.2024	KRW 1.177.821	900	0	(10)	(10)	0,00
	01.2024	\$ 6.179	AUD 9.321	182	0	182	0,01
	01.2024	3.078	BRL 15.202	52	0	52	0,00
	01.2024	5.398	CAD 7.340	169	0	169	0,00
	01.2024	28.612	€ 26.128	267	(10)	257	0,01
	01.2024	2.817	£ 2.218	16	(6)	10	0,00
	01.2024	4	HUF 1.353	0	0	0	0,00
	01.2024	700	IDR 10.827.425	3	0	3	0,00
	01.2024	1.155	¥ 164.400	12	0	12	0,00
	01.2024	7	KRW 9.649	0	0	0	0,00
	01.2024	13.191	ZAR 244.535	163	0	163	0,00
	02.2024	CNY 5.462	\$ 769	0	(3)	(3)	0,00
	02.2024	TWD 188.295	5.924	0	(299)	(299)	(0,01)
	03.2024	CNH 225.115	31.293	0	(503)	(503)	(0,01)

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond ESG Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermogens
	03.2024	IDR 48.864.725	\$ 3.189	\$ 20	\$ 0	\$ 20	0,00
	03.2024	INR 710.282	8.514	8	0	8	0,00
	03.2024	¥ 6.873.647	46.691	0	(2.516)	(2.516)	(0,07)
	03.2024	TWD 679.979	21.633	0	(898)	(898)	(0,03)
	03.2024	\$ 1.393	CNH 10.112	36	0	36	0,00
	03.2024	6.402	IDR 100.473.007	114	0	114	0,00
	03.2024	20.778	INR 1.737.979	35	0	35	0,00
	03.2024	122	THB 4.248	3	0	3	0,00
	04.2024	DKK 86.673	\$ 12.926	23	0	23	0,00
	06.2024	KRW 35.023.990	26.814	0	(449)	(449)	(0,01)
BRC	01.2024	€ 519.675	571.528	0	(2.663)	(2.663)	(0,08)
	01.2024	¥ 3.680.000	25.162	0	(986)	(986)	(0,03)
	01.2024	\$ 1.961	€ 1.794	21	0	21	0,00
	01.2024	596	ZAR 11.092	10	0	10	0,00
	02.2024	¥ 38.800.000	\$ 261.538	0	(15.888)	(15.888)	(0,45)
	03.2024	7.996.353	54.300	0	(2.945)	(2.945)	(0,08)
	03.2024	THB 102	3	0	0	0	0,00
	03.2024	\$ 301	IDR 4.675.923	2	0	2	0,00
	04.2024	DKK 204.732	\$ 30.585	107	0	107	0,00
	04.2024	¥ 1.690.042	13.839	1.687	0	1.687	0,05
	05.2024	1.370.000	11.081	1.187	0	1.187	0,03
	06.2024	KRW 39.110.028	30.004	0	(440)	(440)	(0,01)
CBK	01.2024	BRL 14.465	2.971	0	(7)	(7)	0,00
	01.2024	CHF 14.237	16.407	0	(518)	(518)	(0,01)
	01.2024	DKK 13.365	1.955	0	(26)	(26)	0,00
	01.2024	HUF 321.834	919	0	(11)	(11)	0,00
	01.2024	IDR 9.257.123	601	1	0	1	0,00
	01.2024	¥ 3.342.300	23.672	0	(51)	(51)	0,00
	01.2024	KRW 840.262	650	1	0	1	0,00
	01.2024	\$ 3.299	AUD 4.906	49	0	49	0,00
	01.2024	1.017	CHF 887	37	0	37	0,00
	01.2024	2.263	DKK 15.510	36	0	36	0,00
	01.2024	5.471	£ 4.322	39	0	39	0,00
	01.2024	700	IDR 10.765.650	0	(2)	(2)	0,00
	01.2024	10.178	MXN 178.636	323	0	323	0,01
	01.2024	160	NOK 1.716	9	0	9	0,00
	01.2024	1.549	PLN 6.221	33	0	33	0,00
	01.2024	1.578	ZAR 29.171	15	0	15	0,00
	01.2024	ZAR 8.326	\$ 442	0	(13)	(13)	0,00
	03.2024	CNH 158.320	22.317	0	(45)	(45)	0,00
	03.2024	ILS 5.579	1.532	0	(21)	(21)	0,00
	03.2024	PEN 11.581	3.076	0	(44)	(44)	0,00
	03.2024	TWD 355	11	0	0	0	0,00
	03.2024	\$ 4.844	BRL 23.993	65	0	65	0,00
	03.2024	1.921	CNH 13.900	42	0	42	0,00
	03.2024	2.287	IDR 35.632.973	25	(1)	24	0,00
	04.2024	2.971	BRL 14.611	12	0	12	0,00
	06.2024	KRW 7.493.446	\$ 5.813	0	(20)	(20)	0,00
	06.2024	\$ 9	KRW 12.103	0	0	0	0,00
GLM	01.2024	CAD 87.091	\$ 64.087	0	(1.969)	(1.969)	(0,06)
	01.2024	CHF 621	708	0	(30)	(30)	0,00
	01.2024	DKK 165.984	24.485	0	(119)	(119)	0,00
	01.2024	¥ 12.692.000	90.158	0	(108)	(108)	0,00
	01.2024	\$ 1.148	£ 901	1	0	1	0,00
	01.2024	20.324	MXN 356.500	633	0	633	0,02
	01.2024	9.038	PLN 36.188	163	0	163	0,00
	02.2024	21.832	BRL 111.508	1.086	0	1.086	0,03
	03.2024	CNH 134.717	\$ 18.668	0	(360)	(360)	(0,01)
	03.2024	SGD 1.614	1.220	0	(8)	(8)	0,00
	03.2024	\$ 2.045	IDR 31.448.395	0	(5)	(5)	0,00
	03.2024	2.341	TWD 72.515	58	0	58	0,00
	06.2024	KRW 2.674.367	\$ 2.062	0	(20)	(20)	0,00
JPM	01.2024	HUF 1.262.781	3.601	0	(48)	(48)	0,00
	01.2024	\$ 551	KRW 712.886	0	0	0	0,00
	02.2024	3.102	BRL 15.214	25	0	25	0,00
	03.2024	CNH 15.679	\$ 2.174	0	(40)	(40)	0,00
	03.2024	CZK 2.716	121	0	0	0	0,00
	03.2024	IDR 40.671.010	2.623	0	(14)	(14)	0,00
	03.2024	SGD 7.280	5.490	0	(48)	(48)	0,00
	03.2024	TWD 279.806	9.000	0	(272)	(272)	(0,01)
	03.2024	\$ 1.543	IDR 23.821.605	2	0	2	0,00
	03.2024	6.231	INR 520.920	7	0	7	0,00
	03.2024	8.096	TWD 250.676	199	0	199	0,01
	06.2024	KRW 35.014.695	\$ 27.003	1	(254)	(253)	(0,01)
	10.2024	¥ 4.060.000	32.677	2.728	0	2.728	0,08
MBC	01.2024	AUD 12.832	8.505	0	(252)	(252)	(0,01)
	01.2024	CAD 6.668	4.927	0	(130)	(130)	0,00
	01.2024	DKK 11.825	1.736	0	(17)	(17)	0,00
	01.2024	€ 25.664	28.062	0	(294)	(294)	(0,01)
	01.2024	¥ 10.888.400	76.400	0	(882)	(882)	(0,03)
	01.2024	\$ 6.919	€ 6.337	83	0	83	0,00
	01.2024	2.741	£ 2.165	19	0	19	0,00

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
	01.2024	\$ 689	HUF 253.318	\$ 41	\$ 0	\$ 41	0,00
	03.2024	CNH 366	\$ 50	0	(1)	(1)	0,00
	03.2024	¥ 4.110.103	33.566	4.155	0	4.155	0,12
	03.2024	\$ 1.882	IDR 29.015.105	0	(1)	(1)	0,00
	10.2024	¥ 2.760.000	\$ 22.134	1.776	0	1.776	0,05
MYI	01.2024	CAD 3.687	2.796	0	0	0	0,00
	01.2024	€ 900	995	1	0	1	0,00
	01.2024	£ 192	245	1	0	1	0,00
	01.2024	HUF 675.200	1.919	0	(32)	(32)	0,00
	01.2024	¥ 598.280	4.058	0	(188)	(188)	(0,01)
	01.2024	MYR 10.355	2.219	0	(41)	(41)	0,00
	01.2024	\$ 740	€ 666	0	(4)	(4)	0,00
	01.2024	689	£ 540	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	202	ZAR 3.719	1	0	1	0,00
	02.2024	CNY 3.198	\$ 452	0	(1)	(1)	0,00
	03.2024	CNH 18.849	2.614	0	(49)	(49)	0,00
	03.2024	¥ 4.650.000	31.962	0	(1.364)	(1.364)	(0,04)
	03.2024	\$ 8.632	IDR 133.390.589	29	(11)	18	0,00
	04.2024	DKK 86.200	\$ 12.983	150	0	150	0,00
RBC	06.2024	KRW 16.477.857	12.669	0	(158)	(158)	0,00
	04.2024	\$ 29	MXN 515	1	0	1	0,00
RYL	01.2024	AUD 6.261	\$ 4.209	0	(64)	(64)	0,00
	04.2024	DKK 55.000	8.260	72	0	72	0,00
SCX	01.2024	MYR 101.239	21.674	0	(418)	(418)	(0,01)
	01.2024	\$ 50	£ 40	0	0	0	0,00
	02.2024	CNY 11.925	\$ 1.654	0	(32)	(32)	0,00
	03.2024	CNH 21.910	3.026	0	(68)	(68)	0,00
	03.2024	IDR 7.040.723	449	0	(8)	(8)	0,00
	03.2024	THB 234.875	6.795	0	(132)	(132)	0,00
	03.2024	TWD 606.584	19.418	0	(681)	(681)	(0,02)
	03.2024	\$ 1.068	IDR 16.590.288	12	(4)	8	0,00
	03.2024	13.136	INR 1.098.530	20	0	20	0,00
	03.2024	7.241	TWD 225.235	222	0	222	0,01
SSB	06.2024	KRW 18.320.811	\$ 14.114	0	(148)	(148)	0,00
	03.2024	IDR 296.373	19	0	0	0	0,00
	03.2024	TWD 53.261	1.719	0	(46)	(46)	0,00
TOR	03.2024	CNH 10.596	1.468	0	(29)	(29)	0,00
	03.2024	IDR 6.253.296	396	0	(9)	(9)	0,00
UAG	01.2024	AUD 4.797	3.182	0	(91)	(91)	0,00
	01.2024	CAD 35.194	25.946	0	(748)	(748)	(0,02)
	01.2024	£ 73.350	92.826	0	(684)	(684)	(0,02)
	01.2024	MXN 12.407	701	0	(29)	(29)	0,00
	01.2024	\$ 751	CAD 1.020	23	0	23	0,00
	01.2024	7.417	NOK 79.117	375	0	375	0,01
	01.2024	2.765	ZAR 52.784	117	0	117	0,00
	03.2024	4.737	IDR 74.875.658	118	0	118	0,00
				\$ 17.017	\$ (43.742)	\$ (26.725)	(0,75)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2023 standen fur die Anteilsklasse Class Z AUD (Hedged) ausschuttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
AZD	01.2024	\$ 154.212	AUD 232.571	\$ 4.513	\$ 0	\$ 4.513	0,13
BOA	01.2024	12.732	19.251	406	0	406	0,01
BPS	01.2024	AUD 1.834	\$ 1.236	0	(16)	(16)	0,00
	01.2024	\$ 336	AUD 499	5	0	5	0,00
BRC	01.2024	289	440	12	0	12	0,00
CBK	01.2024	AUD 1.584	\$ 1.083	2	0	2	0,00
	01.2024	\$ 666	AUD 988	9	0	9	0,00
GLM	01.2024	1.047	1.558	17	0	17	0,00
MBC	01.2024	58.910	88.839	1.721	0	1.721	0,05
RYL	01.2024	16.282	24.650	541	0	541	0,01
UAG	01.2024	74.332	112.036	2.130	0	2.130	0,06
				\$ 9.356	\$ (16)	\$ 9.340	0,26

Zum 31. Dezember 2023 standen fur die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BPS	01.2024	CHF 78	\$ 91	\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	0,00
	01.2024	\$ 242	CHF 207	4	0	4	0,00
BRC	01.2024	CHF 184	\$ 213	0	(6)	(6)	0,00
	01.2024	\$ 25.282	CHF 22.052	932	0	932	0,03
CBK	01.2024	CHF 642	\$ 741	0	(22)	(22)	0,00
	01.2024	\$ 645	CHF 561	22	0	22	0,00
GLM	01.2024	CHF 69	\$ 79	0	(3)	(3)	0,00
	01.2024	\$ 220.127	CHF 192.903	9.188	0	9.188	0,26
MYI	01.2024	CHF 44	\$ 50	0	(2)	(2)	0,00
	01.2024	\$ 220.835	CHF 192.773	8.326	0	8.326	0,23
SCX	01.2024	CHF 482	\$ 576	3	0	3	0,00
	01.2024	\$ 359	CHF 312	12	0	12	0,00
UAG	01.2024	202.947	177.088	7.568	0	7.568	0,21
				\$ 26.055	\$ (35)	\$ 26.020	0,73

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond ESG Fund (Forts.)

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilklassen Institutional GBP (Currency Exposure) ausschüttend und Institutional EUR (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 Netto- vermögens
AZD	01.2024	\$ 6	AUD 9	0	0	0	0,00
BOA	01.2024	COP 3.700	\$ 1	0	0	0	0,00
	01.2024	PEN 2	0	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 6	AUD 9	0	0	0	0,00
	01.2024	1	CNY 5	0	0	0	0,00
	01.2024	2	£ 1	0	0	0	0,00
	01.2024	46	¥ 6.798	2	0	2	0,00
	01.2024	0	KRW 182	0	0	0	0,00
	01.2024	1	NZD 2	0	0	0	0,00
	01.2024	0	PEN 2	0	0	0	0,00
	01.2024	2	SGD 2	0	0	0	0,00
	02.2024	1	COP 3.700	0	0	0	0,00
	02.2024	0	PEN 2	0	0	0	0,00
BRC	01.2024	THB 128	\$ 4	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 0	CHF 0	0	0	0	0,00
	01.2024	1	CNY 10	0	0	0	0,00
	01.2024	1	COP 3.700	0	0	0	0,00
	01.2024	7	€ 6	0	0	0	0,00
	01.2024	1	£ 1	0	0	0	0,00
	01.2024	4	IDR 57.162	0	0	0	0,00
	01.2024	0	KRW 72	0	0	0	0,00
CBK	01.2024	DKK 0	\$ 0	0	0	0	0,00
	01.2024	MXN 49	3	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 1	CNY 8	0	0	0	0,00
	01.2024	10	KRW 12.964	0	0	0	0,00
	01.2024	0	NOK 1	0	0	0	0,00
	01.2024	1	RON 3	0	0	0	0,00
	02.2024	3	MXN 49	0	0	0	0,00
GLM	01.2024	CLP 548	\$ 1	0	0	0	0,00
	01.2024	MYR 13	3	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 22	CAD 30	1	0	1	0,00
	01.2024	4	CHF 4	0	0	0	0,00
	01.2024	76	CNY 536	0	0	0	0,00
	01.2024	1	CZK 32	0	0	0	0,00
	01.2024	1	HUF 322	0	0	0	0,00
	01.2024	1	ILS 4	0	0	0	0,00
	01.2024	0	¥ 7	0	0	0	0,00
	01.2024	3	MYR 13	0	0	0	0,00
	01.2024	1	PLN 5	0	0	0	0,00
	02.2024	1	CLP 548	0	0	0	0,00
	02.2024	3	MYR 13	0	0	0	0,00
MBC	01.2024	1	CLP 548	0	0	0	0,00
	01.2024	181	€ 165	1	0	1	0,00
	01.2024	0	¥ 53	0	0	0	0,00
	01.2024	3	MXN 49	0	0	0	0,00
MYI	01.2024	1	CAD 1	0	0	0	0,00
SSB	01.2024	KRW 11	\$ 0	0	0	0	0,00
UAG	01.2024	\$ 1	DKK 10	0	0	0	0,00
	01.2024	31	£ 24	0	0	0	0,00
	01.2024	44	¥ 6.456	2	0	2	0,00
	01.2024	1	NOK 5	0	0	0	0,00
	01.2024	0	PLN 1	0	0	0	0,00
	01.2024	3	SEK 32	0	0	0	0,00
				\$ 6	\$ 0	\$ 6	0,00

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
BPS	01.2024	€ 16.139	\$ 17.675	1	(158)	(157)	0,00
	01.2024	\$ 336.174	€ 305.707	1.603	(1)	1.602	0,05
BRC	01.2024	343.423	€ 312.265	1.600	0	1.600	0,04
CBK	01.2024	€ 2.260	\$ 2.468	1	(30)	(29)	0,00
	01.2024	\$ 3.010	€ 2.787	69	0	69	0,00
MBC	01.2024	€ 2.305	\$ 2.531	0	(16)	(16)	0,00
	01.2024	\$ 83.613	€ 76.897	1.351	0	1.351	0,04
UAG	01.2024	343.480	€ 312.265	1.543	0	1.543	0,04
				\$ 6.168	\$ (205)	\$ 5.963	0,17

Zum 31. Dezember 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 Netto- vermögens
BOA	01.2024	£ 174	\$ 220	\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	0,00
	01.2024	\$ 12.930	£ 10.203	78	0	78	0,00
BPS	01.2024	14.365	11.324	73	(1)	72	0,00
BRC	01.2024	244	193	2	0	2	0,00
CBK	01.2024	£ 4.635	\$ 5.886	0	(22)	(22)	0,00
	01.2024	\$ 715	£ 565	5	0	5	0,00
GLM	01.2024	41	32	0	0	0	0,00
MBC	01.2024	£ 1.293	\$ 1.639	0	(10)	(10)	0,00
MYI	01.2024	12.704	15.988	0	(208)	(208)	(0,01)
	01.2024	\$ 155	£ 123	2	0	2	0,00
SCX	01.2024	81.901	64.750	645	0	645	0,02
SSB	01.2024	52.949	41.961	545	0	545	0,02
UAG	01.2024	£ 99	\$ 123	0	(2)	(2)	0,00
	01.2024	\$ 81.882	£ 64.700	600	0	600	0,02
				\$ 1.950	\$ (245)	\$ 1.705	0,05

Zum 31. Dezember 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 Netto- vermögens
BOA	01.2024	\$ 153.483	NOK 1.631.931	\$ 7.232	\$ 0	\$ 7.232	0,20
BPS	01.2024	13.623	140.221	186	0	186	0,01
CBK	01.2024	98.339	1.052.939	5.356	0	5.356	0,15
GLM	01.2024	NOK 144.778	\$ 13.896	0	(363)	(363)	(0,01)
	01.2024	\$ 70.956	NOK 762.924	4.178	0	4.178	0,12
MYI	01.2024	2.137	22.937	122	0	122	0,00
RYL	01.2024	NOK 33.828	\$ 3.108	0	(223)	(223)	(0,01)
	01.2024	\$ 7.630	NOK 79.218	172	0	172	0,01
SCX	01.2024	1.219	13.114	73	0	73	0,00
UAG	01.2024	248.490	2.647.814	12.273	0	12.273	0,35
				\$ 29.592	\$ (586)	\$ 29.006	0,82

Zum 31. Dezember 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 Netto- vermögens
BOA	01.2024	\$ 13.742	NZD 22.553	\$ 538	\$ 0	\$ 538	0,02
BRC	01.2024	13.808	22.445	403	0	403	0,01
UAG	01.2024	14.328	23.215	371	0	371	0,01
				\$ 1.312	\$ 0	\$ 1.312	0,04

Zum 31. Dezember 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 Netto- vermögens
BOA	01.2024	\$ 12.774	SEK 133.234	\$ 450	\$ 0	\$ 450	0,01
BRC	01.2024	163	1.675	3	0	3	0,00
CBK	01.2024	SEK 4.647	\$ 444	0	(17)	(17)	0,00
	01.2024	\$ 2.031	SEK 21.114	66	(1)	65	0,00
GLM	01.2024	SEK 2.122	\$ 208	0	(2)	(2)	0,00
	01.2024	\$ 55	SEK 561	0	0	0	0,00
MBC	01.2024	SEK 2.418	\$ 231	0	(9)	(9)	0,00
	01.2024	\$ 69	SEK 685	0	(1)	(1)	0,00
SCX	01.2024	13.615	141.403	420	0	420	0,01
UAG	01.2024	14.020	144.651	337	0	337	0,01
				\$ 1.276	\$ (30)	\$ 1.246	0,03
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 46.171	1,30

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond ESG Fund (Forts.)

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Ginnie Mae, TBA			
4,500 % fällig am 01.02.2054	\$ 200	\$ (195)	(0,01)
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,000 % fällig am 01.01.2039	29.000	(26.005)	(0,73)
2,000 % fällig am 01.01.2054	15.550	(12.712)	(0,36)
2,000 % fällig am 01.02.2054	99.000	(81.025)	(2,27)
3,000 % fällig am 01.02.2054	19.500	(17.270)	(0,48)
4,000 % fällig am 01.01.2054	100	(95)	0,00
4,000 % fällig am 01.02.2054	27.000	(25.563)	(0,72)
4,500 % fällig am 01.02.2054	35.610	(34.543)	(0,97)
5,500 % fällig am 01.01.2054 (d)	80.000	(80.350)	(2,26)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (277.758)	(7,80)
Summe Anlagen		\$ 3.958.440	111,16
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (397.260)	(11,16)
Nettovermögen		\$ 3.561.180	100,00

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

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

- (a) Nullkuponwertpapier.
 (b) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
 (c) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
 (d) Das zum 31. Dezember 2023 leerverkaufte Wertpapier ist durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.

Barmittel in Höhe von USD 84.363 (31. Dezember 2022: USD 78.217) waren zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 23.400 (31. Dezember 2022: USD 44.770) waren zum 31. Dezember 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 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	\$ 3.995.856	\$ 79	\$ 3.995.935
Pensionsgeschäfte	0	165.958	0	165.958
Finanzderivate ⁽³⁾	(10.719)	85.024	0	74.305
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(277.758)	0	(277.758)
Summen	\$ (10.719)	\$ 3.969.080	\$ 79	\$ 3.958.440

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 2.913.880	\$ 0	\$ 2.913.880
Investmentfonds	5.649	0	0	5.649
Pensionsgeschäfte	0	1.157.847	0	1.157.847
Finanzderivate ⁽³⁾	10.275	(67.767)	0	(57.492)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(119.122)	0	(119.122)
Summen	\$ 15.924	\$ 3.884.838	\$ 0	\$ 3.900.762

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

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

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

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement ⁽¹⁾
AZD	\$ 4.215	\$ (4.700)	\$ (485)	\$ 569	\$ (270)	\$ 299
BOA	7.328	(7.150)	178	(19.412)	16.030	(3.382)
BOM	k. A.	k. A.	k. A.	68	0	68
BPS	(6.163)	5.020	(1.143)	(119)	70	(49)
BRC	(16.941)	17.930	989	511	(350)	161
CBK	5.364	(5.430)	(66)	21.756	(21.180)	576
FAR	(34)	0	(34)	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	11.917	(11.610)	307	(1.813)	1.600	(213)
GSC	k. A.	k. A.	k. A.	(6)	0	(6)
GST	12	140	152	(69)	70	1
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	(2)	0	(2)
JPM	1.887	(1.950)	(63)	634	(560)	74
MBC	7.534	(7.750)	(216)	(11.665)	10.830	(835)
MYC	(300)	310	10	(127)	50	(77)
MYI	6.573	(7.840)	(1.267)	(1.837)	1.310	(527)
RBC	1	0	1	128	0	128
RYL	498	(270)	228	(29)	0	(29)
SCX	(84)	(230)	(314)	9.488	(8.580)	908
SSB	499	(430)	69	488	(420)	68
TOR	(38)	0	(38)	(8.559)	7.570	(989)
UAG	23.903	(24.320)	(417)	(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. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	69,21	34,52
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	43,00	58,42
Sonstige übertragbare Wertpapiere	k. A.	0,85
Investmentfonds	k. A.	0,18
Pensionsgeschäfte	4,66	37,28
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,38)	0,30
Zentral abgerechnete Finanzderivate	1,17	(1,56)
Freiverkehrsfinanzderivate	1,30	(0,59)
Leerverkaufte Wertpapiere	(7,80)	(3,83)

* Gemäß der Liste der Märkte, die die Kriterien für einen geregelten OGAW-Markt erfüllen, in Anlage 1 zum Verkaufsprospekt.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	19,62	15,77
Kommunalanleihen und Wechsel	0,10	0,00
US-Regierungsbehörden	35,91	16,84
US-Schatzobligationen	6,43	3,33
Non-Agency-MBS	3,21	3,93
Forderungsbesicherte Wertpapiere	7,96	8,18
Staatsemissionen	18,36	10,32
Vorzugswertpapiere	k. A.	0,00
Kurzfristige Instrumente	20,62	35,42
Investmentfonds	k. A.	0,18
Pensionsgeschäfte	4,66	37,28
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,38)	0,30
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	k. A.	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	k. A.	0,00
Zinsswaps — Basisswaps	k. A.	0,00
Zinsswaps	1,17	(1,56)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,03	0,03
Optionen auf Wertpapiere	0,03	0,03
Verkaufsoptionen		
Devisenoptionen	(0,01)	k. A.
Zinsswapoptionen	(0,09)	(0,15)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzkauf	(0,02)	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Cross-Currency Swaps	0,00	0,00
Zinsswaps	0,01	(0,01)
Devisenterminkontrakte	(0,75)	(1,97)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	2,10	1,48
Leerverkaufte Wertpapiere	(7,80)	(3,83)
Sonstige Aktiva und Passiva	(11,16)	(25,57)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
AerCap Ireland Capital DAC			
1,650 % fällig am 29.10.2024	\$ 500	\$ 483	0,06
1,750 % fällig am 29.10.2024	500	483	0,06
AIB Group PLC			
5,250 % fällig am 23.10.2031	€ 2.000	2.390	0,30
		3.356	0,42
Summe Irland		45.709	5,71
ISRAEL STAATSEMISSIONEN			
Israel Government International Bond			
2,000 % fällig am 31.03.2027	ILS 7.600	2.006	0,25
4,500 % fällig am 17.01.2033	\$ 500	476	0,06
5,000 % fällig am 30.10.2026	€ 7.200	8.140	1,02
Summe Israel		10.622	1,33
ITALIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
AMCO - Asset Management Co. SpA			
4,625 % fällig am 06.02.2027	1.100	1.250	0,16
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA			
0,875 % fällig am 08.10.2027	200	206	0,03
2,000 % fällig am 29.01.2024	2.200	2.427	0,30
2,625 % fällig am 28.04.2025	100	108	0,01
6,750 % fällig am 05.09.2027	700	810	0,10
Intesa Sanpaolo SpA			
5,125 % fällig am 29.08.2031	1.000	1.180	0,15
		5.981	0,75
STAATSEMISSIONEN			
Cassa Depositi e Prestiti SpA			
5,750 % fällig am 05.05.2026	\$ 1.100	1.099	0,14
Italy Government International Bond			
6,000 % fällig am 04.08.2028	€ 100	134	0,01
		1.233	0,15
Summe Italien		7.214	0,90
JAPAN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Sumitomo Mitsui Banking Corp.			
0,400 % fällig am 07.11.2029	€ 1.800	1.699	0,21
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.			
0,010 % fällig am 15.10.2027	2.000	1.968	0,25
		3.667	0,46
STAATSEMISSIONEN			
Japan Government International Bond			
0,005 % fällig am 01.03.2024	¥620.000	4.399	0,55
0,005 % fällig am 01.04.2024	690.000	4.896	0,61
0,005 % fällig am 01.05.2024	310.000	2.200	0,28
0,005 % fällig am 01.10.2024	1.320.000	9.368	1,17
	00		
0,100 % fällig am 10.03.2028 (d)	1.039.900	7.753	0,97
	52		
0,500 % fällig am 20.03.2049	976.000	5.372	0,67
0,700 % fällig am 20.12.2048	1.188.000		
	00	6.913	0,87
0,700 % fällig am 20.09.2051	660.000	3.712	0,46
1,500 % fällig am 20.09.2043	710.000	5.130	0,64
Tokyo Metropolitan Government			
0,750 % fällig am 16.07.2025	\$ 800	751	0,09
		50.494	6,31
Summe Japan		54.161	6,77
LUXEMBURG UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Aroundtown S.A.			
0,000 % fällig am 16.07.2026 (b)	€ 700	651	0,08
0,375 % fällig am 15.04.2027	100	89	0,01
CPI Property Group S.A.			
2,750 % fällig am 12.05.2026	2.100	1.942	0,24
Cromwell Ereit Lux Finco SARL			
2,125 % fällig am 19.11.2025	500	522	0,07
Logicor Financing SARL			
0,625 % fällig am 17.11.2025	1.400	1.444	0,18
		4.648	0,58

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
NON-AGENCY-MBS			
Miravet SARL			
4,806 % fällig am 26.05.2065	€ 839	\$ 919	0,12
Summe Luxemburg		5.567	0,70
MALAYSIA UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Petronas Capital Ltd.			
2,480 % fällig am 28.01.2032	\$ 400	342	0,04
3,500 % fällig am 21.04.2030	400	376	0,05
4,550 % fällig am 21.04.2050	300	276	0,03
4,800 % fällig am 21.04.2060	300	285	0,04
		1.279	0,16
STAATSEMISSIONEN			
Malaysia Government International Bond			
3,519 % fällig am 20.04.2028	MYR 44.429	9.652	1,21
Summe Malaysia		10.931	1,37
MEXIKO STAATSEMISSIONEN			
Mexico Government International Bond			
4,000 % fällig am 15.03.2115	€ 400	343	0,04
MULTINATIONAL UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Preferred Term Securities Ltd.			
6,039 % fällig am 23.06.2035	\$ 764	733	0,09
NIEDERLANDE UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Cooperatieve Rabobank UA			
3,758 % fällig am 06.04.2033	600	539	0,07
CTP NV			
0,625 % fällig am 27.09.2026	€ 600	597	0,07
0,875 % fällig am 20.01.2026	900	922	0,12
1,500 % fällig am 27.09.2031	600	518	0,07
ING Groep NV			
2,125 % fällig am 23.05.2026	400	432	0,05
		3.008	0,38
NON-AGENCY-MBS			
Jubilee Place BV			
4,985 % fällig am 17.10.2057	826	915	0,11
Summe Niederlande		3.923	0,49
NEUSEELAND STAATSEMISSIONEN			
New Zealand Government International Bond			
1,500 % fällig am 15.05.2031	NZD 1.300	681	0,08
NORWEGEN STAATSEMISSIONEN			
Kommunalbanken A/S			
1,900 % fällig am 19.01.2027	AUD 1.600	1.018	0,13
Norway Government International Bond			
1,750 % fällig am 13.03.2025	NOK 6.300	606	0,07
Summe Norwegen		1.624	0,20
PERU UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Banco de Credito del Peru S.A.			
4,650 % fällig am 17.09.2024	PEN 2.400	630	0,08
STAATSEMISSIONEN			
Peru Government International Bond			
6,150 % fällig am 12.08.2032	100	26	0,00
Summe Peru		656	0,08
POLEN STAATSEMISSIONEN			
Poland Government International Bond			
3,875 % fällig am 14.02.2033	€ 900	1.037	0,13

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
4,250 % fällig am 14.02.2043	€ 200	\$ 233	0,03
4,875 % fällig am 04.10.2033	\$ 500	508	0,06
5,500 % fällig am 16.11.2027	200	208	0,03
5,500 % fällig am 04.04.2053	400	418	0,05
Summe Polen		2.404	0,30
PORTUGAL UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Banco Espirito Santo S.A.			
4,000 % fällig am 21.01.2019 ^	€ 400	121	0,01
4,750 % fällig am 15.01.2018 ^	700	213	0,03
Summe Portugal		334	0,04
KATAR UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
QatarEnergy			
2,250 % fällig am 12.07.2031	\$ 400	341	0,04
RUMÄNIEN STAATSEMISSIONEN			
Romania Government International Bond			
1,375 % fällig am 02.12.2029	€ 630	575	0,07
1,750 % fällig am 13.07.2030	1.000	896	0,11
2,000 % fällig am 28.01.2032	600	514	0,06
2,000 % fällig am 14.04.2033	700	581	0,07
2,124 % fällig am 16.07.2031	400	353	0,04
2,625 % fällig am 02.12.2040	600	447	0,06
2,875 % fällig am 13.04.2042	800	600	0,08
3,750 % fällig am 07.02.2034	800	763	0,10
5,000 % fällig am 27.09.2026	1.700	1.931	0,24
Summe Rumänien		6.660	0,83
SAUDI-ARABIEN STAATSEMISSIONEN			
Saudi Arabia Government International Bond			
3,250 % fällig am 22.10.2030	\$ 400	371	0,05
4,750 % fällig am 18.01.2028	1.900	1.922	0,24
4,875 % fällig am 18.07.2033	2.200	2.250	0,28
Summe Saudi-Arabien		4.543	0,57
SERBIEN STAATSEMISSIONEN			
Serbia Government International Bond			
1,000 % fällig am 23.09.2028	€ 600	561	0,07
2,050 % fällig am 23.09.2036	900	694	0,09
Summe Serbien		1.255	0,16
SINGAPUR STAATSEMISSIONEN			
Singapore Government International Bond			
2,250 % fällig am 01.08.2036	SGD 2.300	1.657	0,21
3,375 % fällig am 01.09.2033	320	257	0,03
Summe Singapur		1.914	0,24
SLOWENIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Nova Kreditna Banka Maribor d.d.			
1,875 % fällig am 27.01.2025	€ 700	770	0,10
Nova Ljubljanska Banka d.d.			
3,400 % fällig am 05.02.2030	1.000	959	0,12
Summe Slowenien		1.729	0,22
SÜDKOREA STAATSEMISSIONEN			
South Korea Government International Bond			
1,375 % fällig am 10.12.2029	KRW 1.834.280	1.290	0,16
1,500 % fällig am 10.12.2030	1.622.130	1.129	0,14
2,000 % fällig am 10.06.2031	1.769.360	1.267	0,16
2,125 % fällig am 10.06.2027	2.095.000	1.571	0,20
2,375 % fällig am 10.12.2027	2.480.000	1.870	0,23
2,375 % fällig am 10.12.2028	13.776.070	10.322	1,29
2,625 % fällig am 10.06.2028	7.891.650	5.998	0,75
3,250 % fällig am 10.03.2028	1.472.700	1.158	0,15

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	
UNGARISCHE SCHWATZWECHSEL								INVESTMENTFONDS ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN				
10.900 % fällig am 04.01.2024 (b)(c)	HUF 1.356.000	\$ 3.917	0,49	(0,207) % fällig am 05.02.2024 (b)(c)	¥3.164.000	\$ 22.446	2,81					
JAPANISCHE SCHWATZWECHSEL												
(0,280) % fällig am 09.01.2024 (b)(c)	¥4.173.000	29.600	3,70	(0,202) % fällig am 13.02.2024 (b)(c)	4.100.000	29.087	3,63					
(0,269) % fällig am 09.01.2024 (b)(c)	33.000	234	0,03	(0,197) % fällig am 22.01.2024 (b)(c)	203.000	1.440	0,18					
(0,260) % fällig am 09.01.2024 (b)(c)	34.000	241	0,03	(0,193) % fällig am 29.01.2024 (b)(c)	382.000	2.710	0,34					
(0,238) % fällig am 15.01.2024 (b)(c)	1.001.000	7.101	0,89	(0,189) % fällig am 05.02.2024 (b)(c)	646.000	4.583	0,57					
(0,218) % fällig am 15.01.2024 (b)(c)	289.000	2.050	0,26	(0,188) % fällig am 11.03.2024 (b)(c)	3.949.000	28.020	3,50					
(0,216) % fällig am 22.01.2024 (b)(c)	2.087.000	14.805	1,85	(0,156) % fällig am 11.03.2024 (b)(c)	1.261.000	8.948	1,12					
(0,211) % fällig am 29.01.2024 (b)(c)	2.078.000	14.742	1,84				166.007	20,75				
				Summe kurzfristige Instrumente				172.639	21,58			
				Summe übertragbare Wertpapiere				\$ 962.952	120,34			
								Summe Investmentfonds		\$ 10.172	1,27	

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft ⁽¹⁾	% des Netto- vermögens
FICC	2,600 %	29.12.2023	02.01.2024	\$ 1.005	U.S. Treasury Notes 4,875 % fällig am 30.11.2025	\$ (1.025)	\$ 1.005	\$ 1.005	0,13
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (1.025)	\$ 1.005	\$ 1.005	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 Netto- vermögens
3-Month Euribor March Futures	Long	03.2024	295	\$ 51	0,01
3-Month Euribor March Futures	Long	03.2025	295	265	0,03
3-Month Euribor September Futures	Short	09.2024	590	(389)	(0,05)
3-Month SOFR December Futures	Long	03.2024	13	(60)	(0,01)
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2025	600	(786)	(0,10)
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2024	41	(6)	0,00
3-Month SOFR June Futures	Long	09.2025	151	226	0,03
3-Month SOFR March Futures	Long	06.2024	495	203	0,03
3-Month SOFR September Futures	Short	12.2024	153	(98)	(0,01)
3-Month SOFR September Futures	Long	12.2025	150	223	0,03
Australia Government 3-Year Note March Futures	Short	03.2024	56	(41)	(0,01)
Australia Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2024	226	(510)	(0,06)
Canada Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2024	82	243	0,03
Euro-BTP Italy Government Bond March Futures	Long	03.2024	249	1.236	0,15
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Long	03.2024	25	48	0,01
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Long	03.2024	15	190	0,02
Euro-OAT France Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2024	143	(640)	(0,08)
Euro-Schatz March Futures	Short	03.2024	5	(4)	0,00
Japan Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2024	18	174	0,02
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Short	03.2024	47	(97)	(0,01)
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Short	03.2024	582	(1.573)	(0,20)
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Short	03.2024	306	(1.086)	(0,14)
U.S. Treasury 10-Year Ultra March Futures	Short	03.2024	77	(438)	(0,05)
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Long	03.2024	3	28	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2024	9	(105)	(0,01)
United Kingdom Long Gilt March Futures	Short	03.2024	261	(2.344)	(0,29)
				\$ (5.290)	(0,66)
Summe der an einem regelten Markt gehandelten Finanzderivate					
				\$ (5.290)	(0,66)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

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

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000 %	20.12.2024	\$ 100	\$ (2)	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	\$ 6.600	\$ (118)	(0,01)
CDX.IG-41 10-Year Index	(1,000)	20.12.2033	82.000	(928)	(0,12)
iTraxx Europe Main 40 10-Year Index	(1,000)	20.12.2033	€ 5.400	(77)	(0,01)
				\$ (1.123)	(0,14)

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	\$ 1.000	\$ 6	0,00
CDX.IG-41 5-Year Index	1,000	20.12.2028	117.400	843	0,11
				\$ 849	0,11

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,000 %	17.06.2027	£ 21.900	\$ 52	0,01
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,000	17.06.2035	4.700	(10)	0,00
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,250	20.03.2054	2.800	448	0,06
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,500	20.03.2034	40.900	4.305	0,54
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	5,000	20.03.2029	41.600	1.415	0,18
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	5,500	20.03.2026	12.000	310	0,04
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,250	20.03.2029	INR 501.570	7	0,00
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,500	20.03.2029	162.160	6	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,500	20.03.2034	103.220	(7)	0,00
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.12.2026	¥ 970.000	1	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	(161)	(0,02)
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,050	15.12.2031	851.000	(101)	(0,01)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	19.06.2039	540.000	484	0,06
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	15.12.2051	80.000	(123)	(0,02)
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,450	15.12.2051	170.000	(56)	(0,01)
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,800	15.06.2052	640.000	(340)	(0,04)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,850	20.09.2033	120.000	(9)	0,00
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	1,200	20.09.2053	290.000	79	0,01
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	2,750	20.03.2029	SGD 21.489	(160)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,400	15.01.2028	\$ 24.600	(2.139)	(0,27)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,750	16.06.2031	15.710	1.868	0,23
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,000	15.06.2027	16.900	1.236	0,15
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,000	15.06.2029	26.260	(1.864)	(0,23)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,249	31.08.2024	11.650	570	0,07
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,250	15.12.2026	63.400	5.811	0,73
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,298	25.08.2024	10.200	511	0,06
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,500	15.12.2028	19.300	(2.314)	(0,29)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,518	20.01.2029	1.500	(161)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,630	20.01.2029	4.400	(447)	(0,06)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.06.2024	9.600	113	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.06.2027	21.830	22	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,841	31.10.2024	800	(12)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,910	14.11.2024	1.700	(23)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,920	17.10.2024	1.900	(29)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,965	30.06.2024	15.900	(374)	(0,05)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,965	30.11.2026	27.900	680	0,08
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,968	30.06.2024	15.900	(373)	(0,05)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,973	27.10.2024	1.100	(15)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,993	13.10.2024	700	(10)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,018	24.10.2024	800	(11)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,050	08.09.2029	500	(12)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,088	07.11.2024	500	(6)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,100	09.09.2029	2.100	(45)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,140	25.10.2024	900	(10)	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,150	13.05.2025	56.600	397	0,05
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,190	25.10.2024	800	(9)	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,200	13.05.2025	4.600	43	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,225	25.10.2024	900	(10)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,225	30.09.2029	2.800	(56)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,250	21.06.2028	4.800	49	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,250	20.12.2053	20.590	(2.474)	(0,31)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,454	30.06.2029	5.400	(68)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,470	22.02.2030	1.100	(14)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	22.06.2030	1.800	(10)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2030	200	1	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2033	60.942	2.685	0,33
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,525	02.03.2030	700	(7)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,650	22.11.2024	1.500	(14)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
Zahlung		1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,650 %	05.12.2024	\$ 1.900	\$ (17)	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾		1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,684	03.01.2034	500	(7)	0,00
Zahlung		1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	21.11.2024	3.000	(24)	0,00
Zahlung		1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	11.12.2024	1.400	(11)	0,00
Erhalt		1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	21.06.2025	14.800	208	0,03
Erhalt		1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.12.2028	33.097	(871)	(0,11)
Zahlung ⁽⁴⁾		1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2034	5.390	1	0,00
Zahlung		1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,800	22.08.2030	500	8	0,00
Erhalt		1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,842	26.12.2033	1.100	(30)	0,00
Zahlung		1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,849	31.03.2030	700	11	0,00
Erhalt		1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,854	29.12.2033	1.600	(45)	(0,01)
Zahlung		1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,857	31.03.2030	3.600	53	0,01
Zahlung		1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,898	30.06.2029	5.000	58	0,01
Zahlung		1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,951	31.03.2030	8.500	179	0,02
Zahlung		1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,981	30.11.2027	13.300	159	0,02
Zahlung		1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,988	30.11.2027	10.600	274	0,03
Erhalt ⁽⁴⁾		1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,000	20.03.2054	3.200	(58)	(0,01)
Erhalt		1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,159	31.03.2025	35.100	513	0,06
Zahlung		1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,193	30.11.2027	9.100	182	0,02
Erhalt ⁽⁴⁾		1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,228	30.08.2025	11.700	(50)	(0,01)
Erhalt		1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	20.12.2025	119.651	(547)	(0,07)
Erhalt ⁽⁴⁾		1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,500	04.10.2025	2.900	(27)	0,00
Zahlung		3-Month CAD-Bank Bill	1,220	03.03.2025	CAD 6.900	(297)	(0,04)
Zahlung		3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2025	9.600	(331)	(0,04)
Zahlung		3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2030	9.200	(580)	(0,07)
Zahlung		3-Month CAD-Bank Bill	1,500	16.06.2051	250	(27)	0,00
Zahlung		3-Month CAD-Bank Bill	1,713	02.10.2029	2.100	(140)	(0,02)
Zahlung		3-Month CAD-Bank Bill	1,900	18.12.2029	24.500	(1.612)	(0,20)
Erhalt		3-Month CAD-Bank Bill	3,250	15.03.2028	9.640	165	0,02
Erhalt		3-Month CAD-Bank Bill	3,250	15.03.2033	4.900	66	0,01
Zahlung		3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,250	21.06.2033	4.600	126	0,02
Zahlung		3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,250	21.06.2053	2.300	215	0,03
Zahlung ⁽⁴⁾		3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,500	10.05.2025	78.600	(125)	(0,02)
Erhalt ⁽⁴⁾		3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,500	01.06.2032	5.700	(104)	(0,01)
Erhalt		3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,750	20.12.2033	9.000	(344)	(0,04)
Zahlung ⁽⁴⁾		3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	4,600	30.08.2025	14.600	104	0,01
Zahlung ⁽⁴⁾		3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	5,000	04.10.2025	4.000	43	0,01
Zahlung		3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,283	14.02.2027	CHF 900	(39)	(0,01)
Zahlung		3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,294	10.02.2027	8.500	(344)	(0,04)
Zahlung		3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,343	16.05.2027	1.900	(75)	(0,01)
Zahlung ⁽⁴⁾		3-Month CNY-CNREPOFIX	2,250	20.03.2029	CNY 286.920	229	0,03
Zahlung ⁽⁴⁾		3-Month KRW-KORIBOR	3,250	20.03.2029	KRW 2.155.640	8	0,00
Zahlung ⁽⁴⁾		3-Month KRW-KORIBOR	3,500	20.03.2034	1.749.240	12	0,00
Zahlung		3-Month NZD-BBR	0,528	17.03.2024	NZD 650	(2)	0,00
Zahlung		3-Month NZD-BBR	3,750	15.06.2027	9.400	7	0,00
Zahlung		3-Month NZD-BBR	4,000	14.06.2024	32.500	(95)	(0,01)
Zahlung ⁽⁴⁾		3-Month NZD-BBR	4,750	20.03.2025	22.600	(28)	0,00
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	(155)	(0,02)
Erhalt		6-Month AUD-BBR-BBSW	1,250	17.06.2030	AUD 5.100	417	0,05
Zahlung		6-Month AUD-BBR-BBSW	1,750	16.03.2027	6.600	(311)	(0,04)
Zahlung		6-Month AUD-BBR-BBSW	4,000	21.06.2033	27.900	270	0,03
Zahlung ⁽⁴⁾		6-Month AUD-BBR-BBSW	4,250	15.09.2032	1.900	0	0,00
Zahlung		6-Month AUD-BBR-BBSW	4,250	15.03.2033	14.500	(204)	(0,03)
Zahlung ⁽⁴⁾		6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	15.09.2032	43.700	303	0,04
Zahlung ⁽⁴⁾		6-Month AUD-BBR-BBSW	4,750	20.12.2033	65.300	985	0,12
Zahlung		6-Month CZK-PRIBOR	1,913	30.01.2029	CZK 24.300	(100)	(0,01)
Erhalt ⁽⁴⁾		6-Month EUR-EURIBOR	0,054	27.05.2050	€ 450	117	0,01
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	0,064	17.11.2052	1.000	336	0,04
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	0,550	10.08.2024	900	(30)	0,00
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	0,650	12.04.2027	2.400	(155)	(0,02)
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	0,650	11.05.2027	1.800	(108)	(0,01)
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	0,700	11.04.2027	1.400	(88)	(0,01)
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027	2.200	(109)	(0,01)
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	1,000	18.05.2027	1.300	(64)	(0,01)
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	2,100	11.04.2024	6.500	17	0,00
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	2,100	13.04.2024	14.700	43	0,01
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	2,100	17.05.2024	4.000	12	0,00
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	2,250	26.04.2024	1.600	9	0,00
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	2,250	28.04.2024	2.200	10	0,00
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	2,250	03.05.2024	2.100	10	0,00
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	2,250	21.09.2037	8.950	(535)	(0,07)
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	2,250	21.09.2042	1.260	(162)	(0,02)
Erhalt ⁽⁴⁾		6-Month EUR-EURIBOR	2,750	20.03.2054	26.700	(3.073)	(0,38)
Erhalt ⁽⁴⁾		6-Month EUR-EURIBOR	2,760	03.01.2029	800	(12)	0,00
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	2,880	19.12.2028	2.100	(43)	(0,01)
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	2,890	22.12.2033	700	(24)	0,00
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	2,910	29.12.2033	1.000	(37)	(0,01)
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	2,920	13.12.2028	700	(15)	0,00
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	2,950	29.12.2028	1.700	(42)	(0,01)
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	2,990	08.12.2033	300	(13)	0,00
Zahlung ⁽⁴⁾		6-Month EUR-EURIBOR	3,000	19.03.2027	30.530	388	0,05

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,000 %	15.03.2033	€ 13.480	\$ (181)	(0,02)
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.03.2034	87.520	5.230	0,65
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,063	06.12.2033	200	(10)	0,00
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,250	20.03.2029	112.620	4.379	0,55
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,255	22.11.2028	1.800	(68)	(0,01)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,280	22.11.2033	500	(35)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	3,300	03.10.2033	900	70	0,01
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,305	27.11.2033	800	(58)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	3,370	09.10.2028	2.900	133	0,02
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,500	20.03.2026	109.700	1.585	0,20
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,536	18.09.2025	9.900	(104)	(0,01)
Zahlung	6-Month HUF-BBR	1,500	20.03.2024	HUF 342.600	(35)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	4,870	07.07.2025	MXN 86.100	(173)	(0,02)
					\$ 14.808	1,85
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ 14.532	1,82

- (1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps 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 Verbindlichkeiten, 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, wie in den 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 Verbindlichkeiten, 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. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BOA	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,750 %	15.07.2024	14.100	\$ 28	\$ 10	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,180	11.01.2024	3.600	103	385	0,05
BRC	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500	26.03.2024	23.000	31	1	0,00
DUB	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,750	10.07.2024	66.800	182	47	0,01
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500	26.03.2024	43.400	67	1	0,00
JPM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500	26.03.2024	25.800	33	1	0,00
MYC	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500	26.03.2024	24.100	33	1	0,00
							\$ 477	\$ 446	0,06

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BPS	Put - OTC France Government International Bond 0,750 % fällig am 25.05.2052	€ 97,000	23.05.2025	1.600	\$ 121	\$ 657	0,08

VERKAUFSoPTIONEN

DEVISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens
GLM	Put - OTC USD versus TWD	TWD 31,000	04.03.2024	1.055	\$ (14)	\$ (31)	(0,01)
JPM	Put - OTC USD versus TWD	31,000	01.03.2024	2.801	(38)	(80)	(0,01)
					\$ (52)	\$ (111)	(0,02)

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BOA	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,310 %	11.01.2024	31.500	\$ (102)	\$ (730)	(0,09)
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	5,250	15.07.2024	14.100	(14)	(4)	0,00
BPS	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,494	08.01.2024	100	0	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,545	16.01.2024	800	(4)	(10)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,994	08.01.2024	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,995	16.01.2024	800	(4)	0	0,00
	Put - OTC 25-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,451	23.05.2025	1.600	(121)	(607)	(0,08)

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens
CBK	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,310 %	18.01.2024	600	\$ (2)	\$ (2)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,700	18.01.2024	600	(2)	(2)	0,00
DUB	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,790	08.04.2024	2.800	(22)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,790	08.04.2024	2.800	(22)	(42)	(0,01)
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	5,250	10.07.2024	66.800	(100)	(16)	0,00
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,697	02.04.2024	3.400	(27)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,697	02.04.2024	3.400	(27)	(54)	(0,01)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,721	08.04.2024	900	(7)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,721	08.04.2024	900	(7)	(14)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,215	22.01.2024	400	(2)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300	16.01.2024	100	0	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,560	05.01.2024	600	(3)	(6)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,594	05.01.2024	600	(3)	(8)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,648	04.01.2024	600	(3)	(10)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,665	22.01.2024	400	(2)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	16.01.2024	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,010	05.01.2024	600	(3)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,044	05.01.2024	600	(3)	0	0,00
JPM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	0,820	16.12.2024	8.700	(62)	(10)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,650	04.01.2024	100	0	(2)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,030	04.01.2024	100	0	0	0,00
MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,455	08.01.2024	550	(3)	(3)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,475	08.01.2024	650	(3)	(4)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,600	12.01.2024	500	(2)	(8)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,670	04.01.2024	700	(3)	(13)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,955	08.01.2024	550	(3)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,975	08.01.2024	650	(3)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,050	12.01.2024	500	(2)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,120	04.01.2024	700	(3)	0	0,00
							\$ (564)	\$ (1.550)	(0,19)

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Netto- vermögens
GST	South Korea Government International Bond	(1,000) %	20.12.2028	\$ 2.000	\$ (59)	\$ (8)	\$ (67)	(0,01)
MYC	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.12.2028	1.900	(54)	(10)	(64)	(0,01)
					\$ (113)	\$ (18)	\$ (131)	(0,02)

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BRC	Italy Government International Bond	1,000 %	20.06.2025	\$ 1.500	\$ (37)	\$ 54	\$ 17	0,00
CBK	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	1.000	(24)	36	12	0,00
					\$ (61)	\$ 90	\$ 29	0,00

⁽¹⁾ Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den 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 Verbindlichkeiten, 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, wie in den Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps 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 Verbindlichkeiten, 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 Netto- vermögens
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	\$ (12)	\$ 17	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)	23	21	0,01

Kontrahent	Erhalt	Zahlung	Fälligkeits- datum	Nennbetrag erhaltener Währung	Nennbetrag gelieferter Währung	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Netto- vermögens
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	AUD 7.000	\$ 4.830	\$ (14)	\$ 23	\$ 9	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	(3)	6	0,00
						\$ 22	\$ 31	\$ 53	0,01

ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BOA	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500 %	20.09.2028	MYR 11.550	\$ 61	\$ (53)	\$ 8	0,00
GST	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	20.09.2028	57.380	227	(189)	38	0,01
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,600	20.09.2028	40.670	(4)	(8)	(12)	0,00
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	20.09.2033	11.320	72	(54)	18	0,00
						\$ 356	\$ (304)	\$ 52	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 Netto- vermögens
BPS	Erhalt	iBoxx USD Liquid Investment Grade Index	k. A.	1,113 %	\$ 18.800	20.03.2024	\$ 227	\$ (1.387)	\$ (1.160)	(0,14)
JPM	Erhalt	iBoxx USD Liquid Investment Grade Index	k. A.	1,113	5.300	20.03.2024	66	(434)	(368)	(0,05)
MYC	Erhalt	iBoxx USD Liquid Investment Grade Index	k. A.	1,113	1.700	20.03.2024	20	(105)	(85)	(0,01)
							\$ 313	\$ (1.926)	\$ (1.613)	(0,20)

DEWISENTERMIKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu zahlende	Zu erhaltende Währung	Zu erhaltende	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
AZD	01.2024	AUD	13.850		9.174	\$ 0	\$ (278)	\$ (278)	(0,03)
	03.2024	CNH	43.275		6.004	0	(108)	(108)	(0,01)
BOA	01.2024	£	2.237		2.836	0	(15)	(15)	0,00
	01.2024	¥	4.319.979		29.274	0	(1.388)	(1.388)	(0,17)
	01.2024	NZD	2.389		1.456	0	(57)	(57)	(0,01)
	01.2024	\$	242	NOK	2.569	11	0	11	0,00
	03.2024	CNH	67.820	\$	9.366	0	(213)	(213)	(0,03)
	03.2024	IDR	3.531.433		225	0	(4)	(4)	0,00
	06.2024	KRW	194.402		149	0	(2)	(2)	0,00
BPS	01.2024	DKK	48.773		7.194	0	(35)	(35)	0,00
	01.2024	€	10.064		10.981	0	(139)	(139)	(0,02)
	01.2024	£	4.741		6.014	0	(30)	(30)	0,00
	01.2024	HUF	201.260		574	0	(8)	(8)	0,00
	01.2024	¥	2.651.496		18.091	0	(729)	(729)	(0,09)
	01.2024	KRW	197.067		150	0	(2)	(2)	0,00
	01.2024	\$	100	BRL	491	1	0	1	0,00
	01.2024		2.383	CAD	3.225	63	0	63	0,01
	01.2024		10.883	€	9.956	118	(1)	117	0,01
	01.2024		3	HUF	901	0	0	0	0,00
	01.2024		150	IDR	2.319.926	1	0	1	0,00
	01.2024		13.442	¥	1.978.700	602	0	602	0,08
	01.2024		3.661	ZAR	67.871	45	0	45	0,01
	02.2024	TWD	74.676	\$	2.349	0	(119)	(119)	(0,02)
	03.2024	CNH	91.502		12.710	0	(214)	(214)	(0,03)
	03.2024	IDR	8.037.182		524	3	0	3	0,00
	03.2024	INR	175.655		2.105	2	0	2	0,00
	03.2024	TWD	115.492		3.676	0	(151)	(151)	(0,02)
	03.2024	\$	490	CNH	3.539	10	0	10	0,00
	03.2024		2.674	IDR	42.034.861	52	0	52	0,01
	03.2024		61	THB	2.122	2	0	2	0,00
	06.2024	KRW	10.662.748	\$	8.167	0	(133)	(133)	(0,02)
BRC	01.2024	¥	1.290.000		8.820	0	(346)	(346)	(0,04)
	01.2024	KRW	193.845		150	0	0	0	0,00
	01.2024	\$	917	€	839	10	0	10	0,00
	01.2024		100	MXN	1.705	0	0	0	0,00
	01.2024		149	ZAR	2.773	3	0	3	0,00
	03.2024	THB	51	\$	1	0	0	0	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
	03.2024	\$ 50	IDR 776.911	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	04.2024	¥ 690.018	\$ 5.644	683	0	683	0,09
	05.2024	310.000	2.507	269	0	269	0,03
CBK	06.2024	KRW 11.037.302	8.464	0	(127)	(127)	(0,02)
	01.2024	BRL 28.305	5.813	0	(14)	(14)	0,00
	01.2024	CHF 3.426	3.949	0	(124)	(124)	(0,02)
	01.2024	DKK 3.775	552	0	(7)	(7)	0,00
	01.2024	HUF 8.405	24	0	0	0	0,00
	01.2024	IDR 2.314.281	150	0	0	0	0,00
	01.2024	¥ 709.600	5.026	0	(11)	(11)	0,00
	01.2024	\$ 1.056	AUD 1.570	16	0	16	0,00
	01.2024	1.192	DKK 8.235	29	0	29	0,00
	01.2024	2.090	£ 1.660	26	0	26	0,00
	01.2024	2.887	MXN 51.056	115	0	115	0,01
	01.2024	387	PLN 1.553	8	0	8	0,00
	03.2024	CNH 35.246	\$ 4.968	0	(10)	(10)	0,00
	03.2024	ILS 7.739	2.126	0	(28)	(28)	0,00
	03.2024	PEN 3.539	940	0	(14)	(14)	0,00
	03.2024	\$ 1.197	BRL 5.928	16	0	16	0,00
	03.2024	870	CNH 6.295	19	0	19	0,00
	03.2024	150	IDR 2.314.875	0	0	0	0,00
	04.2024	5.813	BRL 28.592	24	0	24	0,00
DUB	06.2024	KRW 1.875.289	\$ 1.455	0	(5)	(5)	0,00
	01.2024	129.970	100	0	0	0	0,00
	03.2024	CNH 31.511	4.373	0	(78)	(78)	(0,01)
	03.2024	SGD 2.686	2.029	0	(14)	(14)	0,00
GLM	06.2024	KRW 11.157.417	8.572	0	(113)	(113)	(0,01)
	01.2024	CAD 23.335	17.172	0	(528)	(528)	(0,07)
	01.2024	DKK 64.615	9.531	0	(46)	(46)	(0,01)
	01.2024	¥ 2.245.500	15.952	0	(18)	(18)	0,00
	01.2024	MXN 12	1	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 5.573	BRL 28.073	207	0	207	0,03
	01.2024	924	£ 725	1	0	1	0,00
	01.2024	5.366	MXN 94.131	167	0	167	0,02
	01.2024	2.250	PLN 9.011	41	0	41	0,01
	03.2024	CNH 47.275	\$ 6.545	0	(133)	(133)	(0,02)
	03.2024	IDR 39.278	3	0	0	0	0,00
	03.2024	SGD 343	259	0	(2)	(2)	0,00
	03.2024	\$ 175	IDR 2.692.063	0	(1)	(1)	0,00
	03.2024	564	TWD 17.475	14	0	14	0,00
JPM	01.2024	HUF 459.463	\$ 1.308	0	(20)	(20)	0,00
	01.2024	\$ 150	IDR 2.308.050	0	0	0	0,00
	01.2024	150	KRW 194.424	0	0	0	0,00
	02.2024	834	BRL 4.091	7	0	7	0,00
	02.2024	11.119	INR 928.889	18	0	18	0,00
	03.2024	IDR 10.774.363	\$ 695	0	(4)	(4)	0,00
	03.2024	TWD 119.653	3.848	0	(116)	(116)	(0,01)
	03.2024	\$ 2.186	TWD 67.683	53	0	53	0,01
	06.2024	KRW 11.404.015	\$ 8.787	1	(91)	(90)	(0,01)
MBC	10.2024	¥ 330.000	2.646	212	0	212	0,03
	01.2024	AUD 7.382	4.894	0	(144)	(144)	(0,02)
	01.2024	CAD 2.025	1.496	0	(40)	(40)	(0,01)
	01.2024	¥ 2.317.100	16.258	0	(188)	(188)	(0,02)
	01.2024	MXN 513	28	0	(3)	(3)	0,00
	01.2024	\$ 2.056	AUD 3.035	16	0	16	0,00
	01.2024	4.668	€ 4.279	59	0	59	0,01
	01.2024	121	HUF 44.333	7	0	7	0,00
	02.2024	¥ 4.100.000	\$ 27.716	0	(1.544)	(1.544)	(0,19)
	03.2024	CNH 3.514	485	0	(12)	(12)	0,00
	03.2024	¥ 620.016	5.070	634	0	634	0,08
	03.2024	\$ 632	CNH 4.487	1	0	1	0,00
MYI	10.2024	¥ 730.000	\$ 5.853	468	0	468	0,06
	01.2024	CAD 1.896	1.438	0	0	0	0,00
	01.2024	DKK 2.710	401	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	HUF 29.555	84	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	¥ 1.641.010	11.131	0	(517)	(517)	(0,06)
	01.2024	MYR 1.783	382	0	(7)	(7)	0,00
	01.2024	\$ 12	€ 11	0	0	0	0,00
	03.2024	CNH 41.296	\$ 5.726	0	(106)	(106)	(0,01)
	03.2024	¥ 5.210.000	35.811	0	(1.528)	(1.528)	(0,19)
	03.2024	THB 13.620	398	0	(4)	(4)	0,00
	03.2024	\$ 483	CNH 3.436	2	0	2	0,00
	03.2024	2.912	IDR 44.962.124	7	(4)	3	0,00
	06.2024	KRW 6.424.754	\$ 4.940	0	(62)	(62)	(0,01)
	10.2024	¥ 260.000	2.126	208	0	208	0,03
RBC	04.2024	\$ 8	MXN 137	0	0	0	0,00
RYL	01.2024	AUD 987	\$ 664	0	(10)	(10)	0,00
	04.2024	DKK 7.300	1.096	10	0	10	0,00
SCX	01.2024	MYR 44.252	9.474	0	(183)	(183)	(0,02)
	03.2024	CNH 40.542	5.600	0	(126)	(126)	(0,02)
	03.2024	IDR 1.577.776	100	0	(2)	(2)	0,00
	03.2024	THB 117.860	3.410	0	(66)	(66)	(0,01)
	03.2024	TWD 124.229	3.986	0	(130)	(130)	(0,02)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
	03.2024	\$ 212	IDR 3.310.448	\$ 3	\$ (1)	\$ 2	0,00
	03.2024	2.092	TWD 65.082	64	0	64	0,01
	06.2024	KRW 5.322.282	\$ 4.100	0	(43)	(43)	(0,01)
SOG	03.2024	CNH 2.785	384	0	(9)	(9)	0,00
	03.2024	\$ 396	CNH 2.873	10	0	10	0,00
SSB	03.2024	479	IDR 7.547.172	10	0	10	0,00
TOR	02.2024	¥ 3.810.000	\$ 25.747	0	(1.409)	(1.409)	(0,18)
	03.2024	CNH 21.314	2.952	0	(58)	(58)	(0,01)
	03.2024	IDR 780.507	49	0	(1)	(1)	0,00
UAG	01.2024	AUD 4.560	3.026	0	(87)	(87)	(0,01)
	01.2024	CAD 8.681	6.400	0	(184)	(184)	(0,02)
	01.2024	€ 123.307	135.633	0	(609)	(609)	(0,08)
	01.2024	£ 25.759	32.599	0	(240)	(240)	(0,03)
	01.2024	¥ 172.886	1.180	0	(47)	(47)	(0,01)
	01.2024	MXN 3.545	200	0	(8)	(8)	0,00
	01.2024	\$ 1.340	NOK 14.290	68	0	68	0,01
	01.2024	653	ZAR 12.472	28	0	28	0,00
				\$ 4.444	\$ (12.850)	\$ (8.406)	(1,05)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 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 Netto- vermögens
BPS	01.2024	€ 193	\$ 214	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
	01.2024	\$ 999	€ 915	12	0	12	0,00
CBK	01.2024	€ 6	\$ 7	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 6	€ 5	0	0	0	0,00
MBC	01.2024	€ 21	\$ 23	0	(1)	(1)	(0,01)
	01.2024	\$ 8.039	€ 7.312	40	0	40	0,01
MYI	01.2024	8.064	7.337	42	0	42	0,01
UAG	01.2024	7.557	6.870	34	0	34	0,00
				\$ 129	\$ (1)	\$ 128	0,01

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilsklasse Class E USD (Currency Exposure) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
AZD	01.2024	\$ 652	AUD 984	\$ 20	\$ 0	\$ 20	0,00
BOA	01.2024	PEN 278	\$ 75	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 345	AUD 522	11	0	11	0,00
	01.2024	235	£ 186	1	0	1	0,00
	01.2024	4.982	¥ 735.162	237	0	237	0,03
	01.2024	190	NZD 312	7	0	7	0,00
	01.2024	75	PEN 278	0	0	0	0,00
	02.2024	75	278	0	0	0	0,00
BPS	01.2024	€ 58	\$ 63	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	\$ 96	DKK 653	1	0	1	0,00
	01.2024	528	€ 484	7	0	7	0,00
	01.2024	562	£ 443	3	0	3	0,00
	01.2024	217	¥ 31.974	10	0	10	0,00
BRC	01.2024	CHF 0	\$ 0	0	0	0	0,00
	01.2024	¥ 8.462	59	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	\$ 422	IDR 6.573.507	4	0	4	0,00
	01.2024	367	THB 12.894	11	0	11	0,00
CBK	01.2024	DKK 1	\$ 0	0	0	0	0,00
	01.2024	€ 159	175	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	HUF 1	0	0	0	0	0,00
	01.2024	MXN 5.926	350	0	0	0	0,00
	01.2024	NOK 0	0	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 204	CNY 1.446	0	0	0	0,00
	01.2024	1.162	KRW 1.497.492	0	(9)	(9)	0,00
	01.2024	20	NOK 209	1	0	1	0,00
	01.2024	1	SEK 10	0	0	0	0,00
	02.2024	348	MXN 5.926	0	0	0	0,00
DUB	01.2024	14	SGD 19	0	0	0	0,00
GLM	01.2024	CLP 38.146	\$ 43	0	0	0	0,00
	01.2024	MYR 1.559	335	0	(4)	(4)	0,00
	01.2024	\$ 2.482	CAD 3.372	76	0	76	0,01
	01.2024	538	CHF 472	23	0	23	0,00
	01.2024	8.635	CNY 60.986	0	(22)	(22)	0,00
	01.2024	161	CZK 3.570	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	66	HUF 23.188	1	0	1	0,00
	01.2024	107	ILS 400	4	0	4	0,00
	01.2024	335	MYR 1.559	5	0	5	0,00
	01.2024	198	PLN 792	3	0	3	0,00
	02.2024	43	CLP 38.146	1	0	1	0,00
	02.2024	336	MYR 1.559	4	0	4	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
MBC	01.2024	CNY 314	\$ 44	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2024	€ 51	55	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	¥ 7.522	53	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	\$ 306	AUD 462	9	0	9	0,00
	01.2024	76	CAD 102	2	0	2	0,00
	01.2024	43	CLP 38.146	0	0	0	0,00
	01.2024	16.485	€ 14.993	81	0	81	0,01
	01.2024	344	MXN 5.926	5	0	5	0,00
MYI	01.2024	61	CAD 80	0	0	0	0,00
	01.2024	4.357	€ 3.964	23	0	23	0,01
	01.2024	1.894	¥ 279.262	88	0	88	0,01
	01.2024	197	SGD 262	2	0	2	0,00
SCX	01.2024	CNY 1.065	\$ 150	0	0	0	0,00
	01.2024	TWD 470	15	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 240	CNY 1.706	1	0	1	0,00
	01.2024	349	SEK 3.628	11	0	11	0,00
SSB	01.2024	KRW 1.221	\$ 1	0	0	0	0,00
TOR	01.2024	\$ 3.131	¥ 459.250	130	0	130	0,02
UAG	01.2024	0	CZK 1	0	0	0	0,00
	01.2024	127	DKK 866	1	0	1	0,00
	01.2024	3.047	£ 2.408	23	0	23	0,01
	01.2024	88	NOK 934	4	0	4	0,00
	01.2024	10	PLN 38	0	0	0	0,00
				\$ 810	\$ (41)	\$ 769	0,10
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ (9.677)	(1,21)

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000\$)	MARKT-WERT (000\$)	% DES NETTO-VERMOGENS
US-REGIERUNGSBEHORDEN			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,000 % fallig am 01.01.2039	\$ 13.300	(11.926)	(1,49)
2,000 % fallig am 01.02.2054	75.650	(61.915)	(7,73)
2,500 % fallig am 01.02.2054	3.300	(2.812)	(0,35)
3,000 % fallig am 01.02.2054	7.400	(6.554)	(0,82)
5,500 % fallig am 01.01.2054	14.700	(14.764)	(1,85)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (97.971)	(12,24)
Summe Anlagen		\$ 875.723	109,45
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (75.597)	(9,45)
Nettovermogen		\$ 800.126	100,00

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

- * Auf null lautende Saldi konnen fur faktisch vorhandene Betrage stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt
- ^ Das Wertpapier ist in Verzug.
- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
- (b) Nullkuponwertpapier.
- (c) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfalligkeit dar.
- (d) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (e) Mit dem Fonds verbunden.
- (f) Eingeschrankte Wertpapiere: 31. Dezember 2022: 0,76 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Falligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermogens
Citigroup, Inc.	3,290 %	17.03.2026	10.03.2022	\$ 2.200	\$ 2.143	0,27
Deutsche Bank AG	3,729	14.01.2032	22.01.2021	301	251	0,03
				\$ 2.501	\$ 2.394	0,30

Barmittel in Hoh€ von USD 28.089 (31. Dezember 2022: USD 25.647) waren zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten fur borsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfand€t.

Barmittel in Hoh€ von USD 10.080 (31. Dezember 2022: USD 12.800) waren zum 31. Dezember 2023 gema den Rahmenvertragen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheiten fur Finanzderivate verpfand€t.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 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	\$ 962.859	\$ 93	\$ 962.952
Investmentfonds	10.172	0	0	10.172
Pensionsgeschäfte	0	1.005	0	1.005
Finanzderivate ⁽³⁾	(1.720)	1.285	0	(435)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(97.971)	0	(97.971)
Summen	\$ 8.452	\$ 867.178	\$ 93	\$ 875.723

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 737.412	\$ 0	\$ 737.412
Investmentfonds	46.863	459	0	47.322
Pensionsgeschäfte	0	1.625	0	1.625
Finanzderivate ⁽³⁾	1.705	(29.777)	0	(28.072)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(76.200)	0	(76.200)
Summen	\$ 48.568	\$ 633.519	\$ 0	\$ 682.087

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

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

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

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
AZD	\$ (349)	\$ 300	\$ (49)	\$ 27	\$ 0	\$ 27
BOA	(1.743)	1.570	(173)	(4.371)	3.760	(611)
BOM	k. A.	k. A.	k. A.	(9)	0	(9)
BPS	(1.750)	1.990	240	633	(530)	103
BRC	524	(450)	74	488	(400)	88
CBK	60	0	60	979	(680)	299
CLY	k. A.	k. A.	k. A.	(11)	0	(11)
DUB	(217)	0	(217)	(252)	280	28
GLM	(324)	0	(324)	(593)	420	(173)
GST	(23)	0	(23)	(35)	0	(35)
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	(5)	0	(5)
IND	k. A.	k. A.	k. A.	193	(330)	(137)
JPM	(399)	260	(139)	165	0	165
MBC	(612)	620	8	(4.349)	3.720	(629)
MYC	(170)	10	(160)	15	10	25
MYI	(1.858)	1.890	32	(894)	490	(404)
RBC	k. A.	k. A.	k. A.	(1)	0	(1)
RYL	k. A.	k. A.	k. A.	(3)	0	(3)
SCX	(472)	340	(132)	(688)	600	(88)
SOG	1	0	1	k. A.	k. A.	k. A.
SSB	10	0	10	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	(1.338)	1.280	(58)	(3.747)	3.130	(617)
UAG	(1.017)	1.820	803	(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. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	74,23	51,35
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	46,09	51,26
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,02	0,37
Investmentfonds	1,27	6,61
Pensionsgeschäfte	0,13	0,23
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,66)	0,23
Zentral abgerechnete Finanzderivate	1,82	(2,33)
Freiverkehrsfinanzderivate	(1,21)	(1,82)
Leerverkaufte Wertpapiere	(12,24)	(10,64)

* Gemäß der Liste der Märkte, die die Kriterien für einen geregelten OGAW-Markt erfüllen, in Anlage 1 zum Verkaufsprospekt.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Australien	1,88	1,91
Belgien	0,10	k. A.
Brasilien	k. A.	0,21
Kanada	1,84	1,68
Cayman-Inseln	2,75	2,86
China	3,95	2,16
Dänemark	2,21	2,57
Frankreich	2,73	3,25
Deutschland	1,84	2,47
Hongkong	k. A.	0,08
Ungarn	0,27	0,03
Irland	5,71	6,51
Israel	1,33	1,22
Italien	0,90	1,29
Japan	6,77	4,87
Luxemburg	0,70	0,71
Malaysia	1,37	0,92
Mexiko	0,04	0,04
Multinational	0,09	0,11
Niederlande	0,49	0,77
Neuseeland	0,08	0,09
Norwegen	0,20	0,22
Peru	0,08	1,21
Polen	0,30	0,03
Portugal	0,04	0,14
Katar	0,04	0,05
Rumänien	0,83	0,55
Saudi-Arabien	0,57	k. A.
Serbien	0,16	0,26
Singapur	0,24	k. A.
Slowenien	0,22	0,22
Südkorea	4,86	2,27
Spanien	1,05	1,50
Supranational	0,11	0,51
Schweden	0,09	0,09
Schweiz	1,13	0,95
Thailand	0,47	0,51
Vereinigte Arabische Emirate	0,07	0,07
Großbritannien	6,80	9,28
USA	46,45	30,13
Kurzfristige Instrumente	21,58	21,24
Investmentfonds	1,27	6,61
Pensionsgeschäfte	0,13	0,23
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,66)	0,24
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	k. A.	(0,01)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,00	(0,02)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	(0,14)	(0,13)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,11	k. A.
Zinsswaps — Basisswaps	k. A.	0,01
Zinsswaps	1,85	(2,19)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,06	0,05
Optionen auf Wertpapiere	0,08	0,09
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Devisenoptionen	(0,02)	k. A.
Zinsswapoptionen	(0,19)	(0,28)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzkauf	(0,02)	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Cross-Currency Swaps	0,01	0,00
Zinsswaps	0,01	(0,02)
Total Return Swaps auf Indizes	(0,20)	0,07
Devisenterminkontrakte	(1,05)	(2,07)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,11	0,35
Leerverkaufte Wertpapiere	(12,24)	(10,64)
Sonstige Aktiva und Passiva	(9,45)	4,74
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				CAYMAN-INSELN				ZF Finance GmbH			
ÖSTERREICH				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				3,750 % fällig am 21.09.2028 € 4.000 \$ 4.275 0,14			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Diamond Foreign Asset Co. 8,500 % fällig am 01.10.2030 \$ 1.125 \$ 1.151 0,04				Summe Deutschland 102,641 3,44			
ams-OSRAM AG 10,500 % fällig am 30.03.2029 € 1.300 \$ 1.562 0,05				Spirit Loyalty Cayman Ltd. 8,000 % fällig am 20.09.2025 6.300 4.538 0,15				GIBRALTAR			
12,250 % fällig am 30.03.2029 \$ 4.800 5,344 0,18				Transocean, Inc. 8,750 % fällig am 15.02.2030 2.138 2.235 0,07				KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG			
Summe Österreich 6,906 0,23				UPCB Finance Ltd. 3,625 % fällig am 15.06.2029 € 3.000 3.177 0,11				GVC Holdings (Gibraltar) Ltd. 8,948 % fällig am 31.10.2029 \$ 591 593 0,02			
BELGIEN				Wynn Macau Ltd. 5,500 % fällig am 01.10.2027 \$ 800 756 0,03				ITALIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				11,857 0,40				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Ontex Group NV 3,500 % fällig am 15.07.2026 € 7.500 8,014 0,27				KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 6,750 % fällig am 05.09.2027 € 15.300 17.698 0,59			
BERMUDA				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				7,708 % fällig am 18.01.2028 2.000 2.215 0,07			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				American Airlines, Inc. 10,427 % fällig am 20.04.2028 765 787 0,02				8,000 % fällig am 22.01.2030 2.000 2.229 0,07			
NCL Corp. Ltd. 5,875 % fällig am 15.02.2027 \$ 1.875 1.860 0,06				Summe Cayman-Inseln 12,644 0,42				10,500 % fällig am 23.07.2029 3.000 3.648 0,12			
8,375 % fällig am 01.02.2028 3.000 3.179 0,11				TSCHECHISCHE REPUBLIK				Cerved Group SpA 6,000 % fällig am 15.02.2029 6.098 6.167 0,21			
SEADRILL FINANCE LTD.				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				FIS Fabbrica Italiana Sintetici SpA 5,625 % fällig am 01.08.2027 2.000 2.066 0,07			
Seadrill Finance Ltd. 8,375 % fällig am 01.08.2030 4.100 4.281 0,14				EP Infrastructure A/S 1,816 % fällig am 02.03.2031 € 19.500 16.723 0,56				IMA Industria Macchine Automatiche SpA 3,750 % fällig am 15.01.2028 12.000 12.399 0,42			
Valaris Ltd. 8,375 % fällig am 30.04.2030 8.375 8.588 0,29				FRANKREICH				Inter Media and Communication SpA 6,750 % fällig am 09.02.2027 3.000 3.203 0,11			
Viking Cruises Ltd. 5,875 % fällig am 15.09.2027 4.000 3.863 0,13				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Intesa Sanpaolo SpA 4,198 % fällig am 01.06.2032 \$ 8.700 7.183 0,24			
VOC Escrow Ltd. 5,000 % fällig am 15.02.2028 4.000 3.834 0,13				Accor S.A. 7,250 % fällig am 11.01.2029 (c) 700 843 0,03				4,950 % fällig am 01.06.2042 2.000 1.426 0,05			
Summe Bermuda 25,605 0,86				Altice France S.A. 2,500 % fällig am 15.01.2025 3.900 4.165 0,14				5,710 % fällig am 15.01.2026 3.600 3.585 0,12			
KANADA				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				7,700 % fällig am 17.09.2025 (c)(e) 3.500 3.448 0,12			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Air Canada 3,875 % fällig am 15.08.2026 3.250 3.107 0,10				7,750 % fällig am 11.01.2027 (c)(e) € 2.000 2.270 0,08			
Air Canada 4,625 % fällig am 15.08.2029 CAD 3.000 2.109 0,07				4,125 % fällig am 15.01.2029 3.000 2.659 0,09				Italmatch Chemicals SpA 9,393 % fällig am 06.02.2028 4.787 5.282 0,18			
Air Canada Pass-Through Trust 3,600 % fällig am 15.09.2028 \$ 374 352 0,01				4,250 % fällig am 15.10.2029 1.700 1.500 0,05				10,000 % fällig am 06.02.2028 500 572 0,02			
B.C. Unlimited Liability Co. 3,500 % fällig am 15.02.2029 11.400 10.523 0,35				5,125 % fällig am 15.07.2029 \$ 3.700 2.884 0,10				Mundys SpA 1,875 % fällig am 12.02.2028 12.500 12.719 0,43			
4,000 % fällig am 15.10.2030 17.600 15.807 0,53				5,500 % fällig am 15.01.2028 20.100 16.570 0,55				Nexi SpA 1,625 % fällig am 30.04.2026 8.000 8.403 0,28			
4,375 % fällig am 15.01.2028 2.500 2.390 0,08				5,875 % fällig am 01.02.2027 € 600 593 0,02				2,125 % fällig am 30.04.2029 (g) 21.200 20.732 0,69			
Bausch & Lomb Escrow Corp. 8,375 % fällig am 01.10.2028 9.000 9.506 0,32				11,500 % fällig am 01.02.2027 (a)(f) 2.730 3.038 0,10				Shiba BidCo SpA 4,500 % fällig am 31.10.2028 5.000 5.207 0,17			
Bombardier, Inc. 7,125 % fällig am 15.06.2026 4.655 4.637 0,16				CAB SELAS 3,375 % fällig am 01.02.2028 11.000 10.861 0,36				Telecom Italia SpA 1,625 % fällig am 18.01.2029 5.000 4.789 0,16			
7,500 % fällig am 01.02.2029 4.000 4.070 0,14				Cerba Healthcare SACA 3,500 % fällig am 31.05.2028 15.300 14.198 0,48				5,303 % fällig am 30.05.2024 \$ 2.000 1.992 0,07			
7,875 % fällig am 15.04.2027 2.610 2.613 0,09				Chrome Holdco S.A.S. 5,000 % fällig am 31.05.2029 3.850 2.973 0,10				7,875 % fällig am 31.07.2028 € 25.725 31.648 1,06			
8,750 % fällig am 15.11.2030 5.300 5.650 0,19				Electricite de France S.A. 9,125 % fällig am 15.03.2033 (c) \$ 26.800 29.987 1,01				UniCredit SpA 5,459 % fällig am 30.06.2035 \$ 24.400 22.977 0,77			
Garda World Security Corp. 7,750 % fällig am 15.02.2028 1.200 1.243 0,04				Eramet S.A. 7,000 % fällig am 22.05.2028 € 4.300 4.861 0,16				7,296 % fällig am 02.04.2034 800 823 0,03			
GFL Environmental, Inc. 3,500 % fällig am 01.09.2028 5.000 4.625 0,15				Summe Frankreich 101,290 3,40				Summe Italien 182,681 6,13			
4,000 % fällig am 01.08.2028 3.000 2.775 0,09				DEUTSCHLAND				JERSEY, KANALINSELN			
6,750 % fällig am 15.01.2031 1.050 1.083 0,04				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
goeasy Ltd. 9,250 % fällig am 01.12.2028 10.300 11.009 0,37				Bayer AG 7,000 % fällig am 25.09.2083 5.600 6.402 0,21				Adient Global Holdings Ltd. 3,500 % fällig am 15.08.2024 € 747 819 0,03			
Intelligent Packaging Ltd. Finco, Inc. 6,000 % fällig am 15.09.2028 4.800 4.483 0,15				Cheplapharm Arzneimittel GmbH 3,500 % fällig am 11.02.2027 4.350 4.661 0,16				G City Europe Ltd. 4,250 % fällig am 11.09.2025 2.000 2.035 0,07			
Strathcona Resources Ltd. 6,875 % fällig am 01.08.2026 875 836 0,03				4,375 % fällig am 15.01.2028 13.550 14.633 0,49				Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd. 3,250 % fällig am 12.11.2025 (g) 7.700 7.731 0,26			
86,818 2,91				5,500 % fällig am 15.01.2028 \$ 200 189 0,01				Summe Jersey, Kanalinseln 10,585 0,36			
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				7,500 % fällig am 15.05.2030 € 3.850 4.542 0,15				LIBERIA			
Air Canada 9,139 % fällig am 11.08.2028 1.331 1.337 0,05				CT Investment GmbH 5,500 % fällig am 15.04.2026 8.700 9.572 0,32				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
B.C. Unlimited Liability Co. 7,606 % fällig am 20.09.2030 1.614 1.617 0,05				IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK) 3,750 % fällig am 15.09.2026 (b) 4.000 4.369 0,15				Royal Caribbean Cruises Ltd. 4,250 % fällig am 01.07.2026 \$ 5.000 4.833 0,16			
NorthRiver Midstream Finance LP 8,395 % fällig am 16.08.2030 499 500 0,02				IHO Verwaltungs GmbH (3,875 % bar oder 4,625 % PIK) 3,875 % fällig am 15.05.2027 (b) 2.000 2.170 0,07				5,375 % fällig am 15.07.2027 5.400 5.349 0,18			
3,454 0,12				IHO Verwaltungs GmbH (4,750 % bar oder 5,500 % PIK) 4,750 % fällig am 15.09.2026 (b) \$ 5.000 4.795 0,16				5,500 % fällig am 31.08.2026 10.000 9.908 0,33			
Summe Kanada 90,272 3,03				Nidda Healthcare Holding GmbH 7,500 % fällig am 21.08.2026 € 22.250 25.377 0,85				5,500 % fällig am 01.04.2028 7.800 7.705 0,26			
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				TK Elevator Midco GmbH 4,375 % fällig am 15.07.2027 14.400 15.433 0,52				7,250 % fällig am 15.01.2030 3.000 3.135 0,11			
Air Canada 9,139 % fällig am 11.08.2028 1.331 1.337 0,05				WEPA Hygieneprodukte GmbH 2,875 % fällig am 15.12.2027 6.000 6.223 0,21				Summe Liberia 30,930 1,04			
B.C. Unlimited Liability Co. 7,606 % fällig am 20.09.2030 1.614 1.617 0,05				LUXEMBURG				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
NorthRiver Midstream Finance LP 8,395 % fällig am 16.08.2030 499 500 0,02				Albion Financing SARL 6,125 % fällig am 15.10.2026 6.125 6.074 0,20							
3,454 0,12											
Summe Kanada 90,272 3,03											

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

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Altice Financing S.A. 3,000 % fällig am 15.01.2028	€ 7.600	\$ 7.522	0,25	LeasePlan Corp. NV 7,375 % fällig am 29.05.2024 (c)(e)	€ 7.000	\$ 7.780	0,26	Verisure Midholding AB 5,250 % fällig am 15.02.2029	€ 2.650	\$ 2.803	0,10
5,750 % fällig am 15.08.2029	\$ 5.000	4.444	0,15	OI European Group BV 6,250 % fällig am 15.05.2028	800	928	0,03	Summe Schweden		33.247	1,12
Altice France Holding S.A. 4,000 % fällig am 15.02.2028	€ 3.000	1.481	0,05	Q-Park Holding BV 2,000 % fällig am 01.03.2027	7.000	7.168	0,24	SCHWEIZ			
Birkenstock Financing SARL 5,250 % fällig am 30.04.2029	5.000	5.510	0,19	Sensata Technologies BV 5,000 % fällig am 01.10.2025	\$ 1.000	1.002	0,03	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Camelot Finance S.A. 4,500 % fällig am 01.11.2026	\$ 4.750	4.641	0,16	Trivium Packaging Finance BV 3,750 % fällig am 15.08.2026	€ 5.000	5.366	0,18	UBS Group AG 9,250 % fällig am 13.11.2028 (c)(e)	\$ 300	324	0,01
Cidron Aida Finco SARL 5,000 % fällig am 01.04.2028	€ 17.500	18.669	0,63	United Group BV 3,125 % fällig am 15.02.2026	5.000	5.309	0,18	GROSSBRITANNIEN			
Cirsa Finance International SARL 4,500 % fällig am 15.03.2027	14.000	14.929	0,50	3,625 % fällig am 15.02.2028	18.830	19.339	0,65	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
8,448 % fällig am 31.07.2028	100	112	0,00	4,000 % fällig am 15.11.2027	1.500	1.573	0,05	BCP Modular Services Finance PLC 4,750 % fällig am 30.11.2028	€ 10.000	10.291	0,35
InPost S.A. 2,250 % fällig am 15.07.2027	2.925	3.011	0,10	UPC Holding BV 3,875 % fällig am 15.06.2029	3.000	3.083	0,10	Bellis Acquisition Co. PLC 3,250 % fällig am 16.02.2026	£ 5.000	5.931	0,20
LHMC Finco 2 SARL (7,250 % bar oder 8,000 % PIK) 7,250 % fällig am 02.10.2025 (b)	3.796	4.178	0,14	Wintershall Dea Finance BV 2,499 % fällig am 20.04.2026 (c)	3.000	3.017	0,10	Carnival PLC 1,000 % fällig am 28.10.2029	€ 8.000	6.431	0,22
Loarra Investments SARL 6,500 % fällig am 15.05.2029	15.500	16.915	0,57	ZF Europe Finance BV 2,000 % fällig am 23.02.2026	3.000	3.171	0,11	Deuce Finco PLC 5,500 % fällig am 15.06.2027	£ 7.000	8.345	0,28
Summer BC Holdco SARL 5,750 % fällig am 31.10.2026	2.300	2.442	0,08	3,000 % fällig am 23.10.2029	3.000	3.059	0,10	Harbour Energy PLC 5,500 % fällig am 15.10.2026	\$ 17.300	16.927	0,57
Telecom Italia Capital S.A. 6,375 % fällig am 15.11.2033	\$ 7.000	6.856	0,23	6,125 % fällig am 13.03.2029	10.000	11.770	0,40	Heathrow Finance PLC 4,125 % fällig am 01.09.2029	£ 3.333	3.686	0,12
7,200 % fällig am 18.07.2036	3.000	3.015	0,10	Ziggo BV 2,875 % fällig am 15.01.2030	5.000	4.934	0,17	INEOS Finance PLC 2,875 % fällig am 01.05.2026	€ 5.000	5.366	0,18
				4,875 % fällig am 15.01.2030	\$ 1.300	1.161	0,04	INEOS Quattro Finance PLC 8,500 % fällig am 15.03.2029	800	935	0,03
		99.799	3,35			137.226	4,61	9,625 % fällig am 15.03.2029	\$ 5.500	5.861	0,20
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG			
Albion Financing SARL 10,924 % fällig am 17.08.2026	287	289	0,01	Stars Group Holdings BV 8,863 % fällig am 22.07.2028	62	62	0,00	Market Bidco Finco PLC 5,500 % fällig am 04.11.2027	£ 10.300	11.604	0,39
ICON Luxembourg SARL 7,860 % fällig am 03.07.2028	725	729	0,02	Summe Niederlande		137.288	4,61	Pinnacle Bidco PLC 8,250 % fällig am 11.10.2028	€ 7.300	8.407	0,28
Jazz Financing Lux SARL 8,970 % fällig am 05.05.2028	661	665	0,02	NORWEGEN				10,000 % fällig am 11.10.2028	£ 5.400	7.174	0,24
PRA Health Sciences, Inc. 7,860 % fällig am 03.07.2028	195	195	0,01	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Rolls-Royce PLC 5,750 % fällig am 15.10.2027	4.000	5.131	0,17
Samsonite International S.A. 8,106 % fällig am 21.06.2030	398	399	0,01	PANAMA				Thames Water Kemble Finance PLC 4,625 % fällig am 19.05.2026	2.843	1.852	0,06
		2.277	0,07	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Virgin Media Secured Finance PLC 4,250 % fällig am 15.01.2030	20.000	22.360	0,75
Summe Luxemburg		102.076	3,42	Carnival Corp.				Vmed O2 UK Financing PLC 3,250 % fällig am 31.01.2031	€ 10.750	10.955	0,37
				4,000 % fällig am 01.08.2028				4,750 % fällig am 15.07.2031	€ 6.250	5.587	0,19
MULTINATIONAL				5,750 % fällig am 01.03.2027				Zenith Finco PLC			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				6,000 % fällig am 01.05.2029				6,500 % fällig am 30.06.2027			
American Airlines, Inc. 5,500 % fällig am 20.04.2026	13.583	13.495	0,45	7,000 % fällig am 15.08.2029				139.965 4,70			
5,750 % fällig am 20.04.2029	10.800	10.540	0,35	7,625 % fällig am 01.03.2026 (g)				KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG			
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 3,250 % fällig am 01.09.2028	3.000	2.628	0,09	Summe Panama				Delta SARL			
Clarios Global LP 4,375 % fällig am 15.05.2026	€ 10.000	10.991	0,37	24.162 0,81				7,598 % fällig am 15.01.2030			
Connect Finco SARL 6,750 % fällig am 01.10.2026	\$ 5.000	4.974	0,17	SPANIEN				Froneri International Ltd.			
Summe multinational		42.628	1,43	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				7,706 % fällig am 29.01.2027			
NIEDERLANDE				Cellnex Finance Co. S.A.				352 353 0,01			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				5,750 % fällig am 01.03.2027				955 0,03			
Ashland Services BV 2,000 % fällig am 30.01.2028	€ 9.625	9.908	0,33	3,875 % fällig am 07.07.2041				Summe Großbritannien			
Axalta Coating Systems Dutch Holding BV 7,250 % fällig am 15.02.2031	\$ 9.400	9.870	0,33	€ 2.400 1.861 0,06				140.920 4,73			
Boels Topholding BV 6,250 % fällig am 15.02.2029	€ 1.100	1.273	0,04	Cellnex Telecom S.A.				USA			
Clear Channel International BV 6,625 % fällig am 01.08.2025	\$ 3.000	3.017	0,10	1,000 % fällig am 20.04.2027				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Dufry One BV 2,000 % fällig am 15.02.2027 (g)	€ 14.250	14.765	0,50	€ 4.100 4.189 0,14				Academy Ltd.			
3,375 % fällig am 15.04.2028	10.000	10.565	0,35	Grifols S.A.				6,000 % fällig am 15.11.2027			
Energizer Gamma Acquisition BV 3,500 % fällig am 30.06.2029	6.082	5.814	0,20	3,875 % fällig am 15.10.2028				1.075 1.057 0,04			
GTCR W-2 Merger Sub LLC 8,500 % fällig am 15.01.2031	£ 1.400	1.935	0,07	Grupo Antolin-Irausa S.A.				Acadia Healthcare Co., Inc.			
IPD BV 8,000 % fällig am 15.06.2028	€ 1.200	1.419	0,05	3,500 % fällig am 30.04.2028				5,000 % fällig am 15.04.2029			
				4,000 % fällig am 18.09.2027				Acushnet Co.			
				Summe Spanien				7,375 % fällig am 15.10.2028			
				46.029 1,54				AdaptHealth LLC			
SCHWEDEN				Castellum AB				5,125 % fällig am 01.03.2030			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				3,125 % fällig am 02.12.2026 (c)				6,125 % fällig am 01.08.2028			
				7.700 6.489 0,22				ADT Security Corp.			
				Dometic Group AB				4,875 % fällig am 15.07.2032			
				2,000 % fällig am 29.09.2028 (g)				Advantage Sales & Marketing, Inc.			
				Intrum AB				6,500 % fällig am 15.11.2028			
				3,000 % fällig am 15.09.2027				Allegiant Travel Co.			
				3,500 % fällig am 15.07.2026				7,250 % fällig am 15.08.2027			
				9,250 % fällig am 15.03.2028 (g)				Alliant Holdings Intermediate LLC			
				Verisure Holding AB				7,000 % fällig am 15.01.2031			
				3,250 % fällig am 15.02.2027							

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Allison Transmission, Inc. 3,750 % fällig am 30.01.2031	\$ 2.000	\$ 1.769	0,06	4,250 % fällig am 15.01.2034	\$ 7.000	\$ 5.698	0,19	Diamond Sports Group LLC 5,375 % fällig am 15.08.2026 ^	\$ 6.000	\$ 308	0,01
4,750 % fällig am 01.10.2027	2.000	1.934	0,07	4,500 % fällig am 15.08.2030	10.000	9.028	0,30	Directv Financing LLC 5,875 % fällig am 15.08.2027	12.500	11.755	0,39
AMC Networks, Inc. 4,250 % fällig am 15.02.2029	7.000	5.348	0,18	4,500 % fällig am 01.05.2032	10.000	8.578	0,29	DISH DBS Corp. 5,250 % fällig am 01.12.2026	6.750	5.796	0,19
4,750 % fällig am 01.08.2025	8.300	8.088	0,27	4,500 % fällig am 01.06.2033	5.000	4.237	0,14	5,750 % fällig am 01.12.2028	5.000	3.997	0,13
American Airlines Pass-Through Trust 3,375 % fällig am 01.11.2028	288	264	0,01	4,750 % fällig am 01.03.2030	7.000	6.406	0,22	5,875 % fällig am 15.11.2024	2.000	1.877	0,06
American Builders & Contractors Supply Co., Inc. 3,875 % fällig am 15.11.2029	2.000	1.785	0,06	5,125 % fällig am 01.05.2027	9.000	8.701	0,29	7,750 % fällig am 01.07.2026	2.000	1.395	0,05
Amsted Industries, Inc. 4,625 % fällig am 15.05.2030	5.000	4.583	0,15	5,375 % fällig am 01.06.2029	3.500	3.304	0,11	DISH Network Corp. 11,750 % fällig am 15.11.2027	5.000	5.223	0,18
AmWINS Group, Inc. 4,875 % fällig am 30.06.2029	5.000	4.573	0,15	CD&R Smokey Buyer, Inc. 6,750 % fällig am 15.07.2025	2.275	2.253	0,08	DT Midstream, Inc. 4,125 % fällig am 15.06.2029	5.000	4.606	0,15
Antero Midstream Partners LP 5,375 % fällig am 15.06.2029	5.000	4.813	0,16	Central Garden & Pet Co. 4,125 % fällig am 30.04.2031	4.000	3.539	0,12	4,375 % fällig am 15.06.2031	4.000	3.613	0,12
5,750 % fällig am 01.03.2027	200	199	0,01	Central Parent LLC 8,000 % fällig am 15.06.2029	4.700	4.909	0,17	Edgewell Personal Care Co. 4,125 % fällig am 01.04.2028	1.500	1.367	0,05
API Group DE, Inc. 4,750 % fällig am 15.10.2029	3.000	2.821	0,09	Charles River Laboratories International, Inc. 3,750 % fällig am 15.03.2029	2.000	1.834	0,06	5,500 % fällig am 01.06.2028	2.500	2.456	0,08
Aramark Services, Inc. 5,000 % fällig am 01.02.2028	3.000	2.912	0,10	4,000 % fällig am 15.03.2031	1.000	905	0,03	Element Solutions, Inc. 3,875 % fällig am 01.09.2028	3.200	2.949	0,10
Ascent Resources Utica Holdings LLC 5,875 % fällig am 30.06.2029	3.000	2.794	0,09	Chesapeake Energy Corp. 5,500 % fällig am 01.02.2026	2.000	1.984	0,07	Embeckta Corp. 5,000 % fällig am 15.02.2030 (g)	6.700	5.692	0,19
AT&T, Inc. 2,875 % fällig am 02.03.2025 (c)	€ 7.500	7.982	0,27	5,875 % fällig am 01.02.2029	1.500	1.472	0,05	Emerald Debt Merger Sub LLC 6,625 % fällig am 15.12.2030	6.425	6.570	0,22
Avantor Funding, Inc. 3,875 % fällig am 15.07.2028	4.750	5.151	0,17	6,750 % fällig am 15.04.2029	12.000	12.124	0,41	Endeavor Energy Resources LP 5,750 % fällig am 30.01.2028	10.000	10.016	0,34
4,625 % fällig am 15.07.2028	\$ 2.500	2.418	0,08	Churchill Downs, Inc. 5,250 % fällig am 15.07.2028	3.750	3.661	0,12	EnLink Midstream LLC 5,375 % fällig am 01.06.2029	7.500	7.347	0,25
B&G Foods, Inc. 8,000 % fällig am 15.09.2028	4.000	4.205	0,14	5,875 % fällig am 15.03.2026	775	759	0,03	5,625 % fällig am 15.01.2028	1.000	990	0,03
Ball Corp. 2,875 % fällig am 15.08.2030	2.500	2.148	0,07	Cinemark USA, Inc. 5,250 % fällig am 15.07.2028	1.800	1.653	0,06	6,500 % fällig am 01.09.2030	1.750	1.789	0,06
3,125 % fällig am 15.09.2031	1.500	1.295	0,04	5,875 % fällig am 15.03.2026	775	759	0,03	EQM Midstream Partners LP 4,000 % fällig am 01.08.2024	1.871	1.855	0,06
Bath & Body Works, Inc. 6,875 % fällig am 01.11.2035	7.000	7.098	0,24	CITGO Petroleum Corp. 8,375 % fällig am 15.01.2029	4.150	4.271	0,14	4,500 % fällig am 15.01.2029	11.750	11.111	0,37
BCPE Empire Holdings, Inc. 7,625 % fällig am 01.05.2027	12.600	12.163	0,41	Clarivate Science Holdings Corp. 3,875 % fällig am 01.07.2028	3.750	3.539	0,12	4,750 % fällig am 15.01.2031	5.050	4.707	0,16
Beacon Roofing Supply, Inc. 6,500 % fällig am 01.08.2030	1.550	1.586	0,05	4,875 % fällig am 01.07.2029	4.000	3.758	0,13	6,000 % fällig am 01.07.2025	735	735	0,02
Blue Racer Midstream LLC 7,625 % fällig am 15.12.2025	4.475	4.538	0,15	Clearway Energy Operating LLC 3,750 % fällig am 15.01.2032	2.150	1.876	0,06	6,500 % fällig am 01.07.2027	5.800	5.909	0,20
Boxer Parent Co., Inc. 6,500 % fällig am 02.10.2025	€ 3.000	3.318	0,11	4,750 % fällig am 15.03.2028	2.000	1.928	0,06	6,500 % fällig am 15.07.2048	4.000	4.105	0,14
Boyd Gaming Corp. 4,750 % fällig am 01.12.2027	\$ 2.000	1.928	0,06	Cloud Software Group, Inc. 6,500 % fällig am 31.03.2029	8.000	7.626	0,26	7,500 % fällig am 01.06.2027	1.000	1.031	0,03
4,750 % fällig am 15.06.2031	4.000	3.676	0,12	CommScope, Inc. 6,000 % fällig am 01.03.2026	2.000	1.784	0,06	7,500 % fällig am 01.06.2030	2.000	2.152	0,07
Boyer USA, Inc. 4,750 % fällig am 15.05.2029	5.000	4.707	0,16	Community Health Systems, Inc. 4,750 % fällig am 15.02.2031	5.000	3.938	0,13	Fertitta Entertainment LLC 4,625 % fällig am 15.01.2029	2.000	1.817	0,06
Brandywine Operating Partnership LP 3,950 % fällig am 15.11.2027	100	89	0,00	5,250 % fällig am 15.05.2030	5.000	4.189	0,14	First Student Bidco, Inc. 4,000 % fällig am 31.07.2029	5.000	4.341	0,15
4,550 % fällig am 01.10.2029	300	263	0,01	5,625 % fällig am 15.03.2027	8.700	8.095	0,27	Ford Motor Co. 6,100 % fällig am 19.08.2032	4.250	4.286	0,14
7,800 % fällig am 15.03.2028	200	202	0,01	6,000 % fällig am 15.01.2029	1.625	1.465	0,05	Ford Motor Credit Co. LLC 2,700 % fällig am 10.08.2026	4.000	3.707	0,12
Buckeye Partners LP 4,125 % fällig am 01.03.2025	3.000	2.912	0,10	8,000 % fällig am 15.03.2026	692	690	0,02	3,375 % fällig am 13.11.2025	2.500	2.393	0,08
4,500 % fällig am 01.03.2028	1.000	943	0,03	Comstock Resources, Inc. 5,875 % fällig am 15.01.2030	2.000	1.737	0,06	4,000 % fällig am 13.11.2030	12.000	10.776	0,36
Builders FirstSource, Inc. 4,250 % fällig am 01.02.2032	3.000	2.710	0,09	6,750 % fällig am 01.03.2029	4.000	3.663	0,12	4,125 % fällig am 17.08.2027	2.500	2.369	0,08
5,000 % fällig am 01.03.2030	5.000	4.834	0,16	CoreLogic, Inc. 4,500 % fällig am 01.05.2028	4.197	3.681	0,12	4,134 % fällig am 04.08.2025	6.000	5.835	0,20
Burford Capital Global Finance LLC 9,250 % fällig am 01.07.2031	7.650	8.140	0,27	Coty, Inc. 5,000 % fällig am 15.04.2026	523	515	0,02	Fortrea Holdings, Inc. 7,500 % fällig am 01.07.2030	2.000	2.056	0,07
Calpine Corp. 3,750 % fällig am 01.03.2031	7.000	6.148	0,21	5,750 % fällig am 15.09.2028	€ 700	816	0,03	Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC 5,500 % fällig am 01.05.2028	2.950	2.839	0,10
4,500 % fällig am 15.02.2028	4.000	3.807	0,13	6,625 % fällig am 15.07.2030	\$ 2.750	2.827	0,10	6,500 % fällig am 01.10.2025	1.287	1.284	0,04
4,625 % fällig am 01.02.2029	1.500	1.395	0,05	Covanta Holding Corp. 4,875 % fällig am 01.12.2029	3.000	2.625	0,09	Freedom Mortgage Corp. 12,000 % fällig am 01.10.2028	10.900	11.913	0,40
5,125 % fällig am 15.03.2028	4.000	3.838	0,13	5,000 % fällig am 01.09.2030	3.000	2.560	0,09	12,250 % fällig am 01.10.2030	7.650	8.404	0,28
5,250 % fällig am 01.06.2026	663	655	0,02	Credit Acceptance Corp. 9,250 % fällig am 15.12.2028	1.700	1.814	0,06	Frontier Communications Holdings LLC 5,000 % fällig am 01.05.2028	2.500	2.313	0,08
Cantor Fitzgerald LP 7,200 % fällig am 12.12.2028	1.550	1.590	0,05	Credit Suisse AG AT1 Claim 4,125 % fällig am 15.08.2031	4.900	588	0,02	5,875 % fällig am 15.10.2027	3.000	2.901	0,10
Capstone Borrower, Inc. 8,000 % fällig am 15.06.2030	3.100	3.229	0,11	Crocs, Inc. 4,125 % fällig am 15.08.2031	4.000	3.390	0,11	Gap, Inc. 3,625 % fällig am 01.10.2029	10.600	9.076	0,30
Cargo Aircraft Management, Inc. 4,750 % fällig am 01.02.2028	9.900	9.072	0,30	Crown Americas LLC 4,250 % fällig am 30.09.2026	5.000	4.855	0,16	3,875 % fällig am 01.10.2031	4.900	4.042	0,14
Catalent Pharma Solutions, Inc. 2,375 % fällig am 01.03.2028	€ 13.300	12.828	0,43	4,750 % fällig am 01.02.2026	2.000	1.982	0,07	Gartner, Inc. 3,625 % fällig am 15.06.2029	4.000	3.615	0,12
CCO Holdings LLC 4,250 % fällig am 01.02.2031	\$ 5.000	4.376	0,15	CrownRock LP 5,625 % fällig am 15.10.2025	2.500	2.498	0,08	3,750 % fällig am 01.10.2030	2.000	1.770	0,06
				CSC Holdings LLC 3,375 % fällig am 15.02.2031	5.000	3.653	0,12	4,500 % fällig am 01.07.2028	2.000	1.898	0,06
				4,125 % fällig am 01.12.2030	3.500	2.667	0,09	Genesis Energy LP 6,250 % fällig am 15.05.2026	2.000	2.000	0,07
				5,500 % fällig am 15.04.2027	2.000	1.850	0,06	8,250 % fällig am 15.01.2029	2.875	2.961	0,10
				Curo Group Holdings Corp. 7,500 % fällig am 01.08.2028	200	68	0,00	8,875 % fällig am 15.04.2030	700	725	0,02
				Cushman & Wakefield U.S. Borrower LLC 8,875 % fällig am 01.09.2031	1.800	1.909	0,06	GN Bondco LLC 9,500 % fällig am 15.10.2031	7.000	6.843	0,23
				DaVita, Inc. 4,625 % fällig am 01.06.2030	12.000	10.487	0,35	Go Daddy Operating Co. LLC 3,500 % fällig am 01.03.2029	5.000	4.534	0,15
				Diamond Offshore Drilling, Inc. 13,000 % fällig am 21.12.2026	44	43	0,00	GoTo Group, Inc. 5,500 % fällig am 01.09.2027	2.000	969	0,03

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

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Graphic Packaging International LLC				LFS Topco LLC				OneMain Finance Corp.			
2,625 % fällig am 01.02.2029	€ 1.000	\$ 1.026	0,03	5,875 % fällig am 15.10.2026	\$ 2.500	\$ 2.303	0,08	3,500 % fällig am 15.01.2027	\$ 5.000	\$ 4.631	0,16
3,500 % fällig am 01.03.2029	\$ 2.500	2.260	0,08	LifePoint Health, Inc.				5,375 % fällig am 15.11.2029	5.000	4.689	0,16
Gray Television, Inc.				11,000 % fällig am 15.10.2030	8.200	8.646	0,29	6,625 % fällig am 15.01.2028	2.000	2.021	0,07
5,875 % fällig am 15.07.2026	500	487	0,02	Light & Wonder International, Inc.				6,875 % fällig am 15.03.2025	5.000	5.065	0,17
Greystar Real Estate Partners LLC				7,500 % fällig am 01.09.2031	2.825	2.949	0,10	7,125 % fällig am 15.03.2026	2.000	2.039	0,07
7,750 % fällig am 01.09.2030	1.225	1.285	0,04	Lindblad Expeditions Holdings, Inc.				9,000 % fällig am 15.01.2029	3.325	3.518	0,12
GTCR W-2 Merger Sub LLC				9,000 % fällig am 15.05.2028	5.000	5.192	0,17	Organon & Co.			
7,500 % fällig am 15.01.2031	5.400	5.710	0,19	Lindblad Expeditions LLC				2,875 % fällig am 30.04.2028	€ 7.500	7.631	0,26
HAT Holdings LLC				6,750 % fällig am 15.02.2027	2.800	2.788	0,09	4,125 % fällig am 30.04.2028	\$ 3.000	2.764	0,09
3,375 % fällig am 15.06.2026	5.400	5.079	0,17	Live Nation Entertainment, Inc.				5,125 % fällig am 30.04.2031	14.600	12.504	0,42
3,750 % fällig am 15.09.2030	4.300	3.627	0,12	6,500 % fällig am 15.05.2027	4.000	4.073	0,14	Outfront Media Capital LLC			
8,000 % fällig am 15.06.2027	14.150	14.753	0,50	Madison IAQ LLC				4,250 % fällig am 15.01.2029	2.500	2.258	0,08
HealthEquity, Inc.				4,125 % fällig am 30.06.2028	1.225	1.115	0,04	4,625 % fällig am 15.03.2030	2.000	1.785	0,06
4,500 % fällig am 01.10.2029	2.000	1.860	0,06	Marriott Ownership Resorts, Inc.				5,000 % fällig am 15.08.2027	3.000	2.902	0,10
Hilton Domestic Operating Co., Inc.				4,500 % fällig am 15.06.2029	2.000	1.765	0,06	Owens & Minor, Inc.			
3,625 % fällig am 15.02.2032	2.000	1.748	0,06	Mauser Packaging Solutions Holding Co.				6,625 % fällig am 01.04.2030 (g)	1.950	1.864	0,06
3,750 % fällig am 01.05.2029	3.500	3.249	0,11	7,875 % fällig am 15.08.2026	6.000	6.111	0,21	Owens-Brockway Glass Container, Inc.			
4,000 % fällig am 01.05.2031	3.000	2.751	0,09	Medline Borrower LP				7,250 % fällig am 15.05.2031	2.400	2.436	0,08
Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC				3,875 % fällig am 01.04.2029	18.250	16.523	0,55	Oxford Finance LLC			
4,875 % fällig am 01.07.2031	5.000	4.432	0,15	5,250 % fällig am 01.10.2029	10.000	9.439	0,32	6,375 % fällig am 01.02.2027	5.300	5.015	0,17
5,000 % fällig am 01.06.2029	4.000	3.695	0,12	MGM Resorts International				Pactiv Evergreen Group Issuer LLC			
Hilton Worldwide Finance LLC				4,625 % fällig am 01.09.2026	5.000	4.883	0,16	4,375 % fällig am 15.10.2028	3.000	2.808	0,09
4,875 % fällig am 01.04.2027	2.500	2.464	0,08	5,750 % fällig am 15.06.2025	1.000	997	0,03	Pactiv Evergreen Group Issuer, Inc.			
Hologic, Inc.				Midcap Financial Issuer Trust				4,000 % fällig am 15.10.2027	10.000	9.356	0,31
3,250 % fällig am 15.02.2029	4.000	3.631	0,12	6,500 % fällig am 01.05.2028	2.700	2.529	0,09	Park Intermediate Holdings LLC			
4,625 % fällig am 01.02.2028	5.000	4.805	0,16	Midwest Gaming Borrower LLC				4,875 % fällig am 15.05.2029	3.000	2.780	0,09
Howard Hughes Corp.				4,875 % fällig am 01.05.2029		5.58		7,500 % fällig am 01.06.2025	1.000	1.006	0,03
4,125 % fällig am 01.02.2029	4.000	3.571	0,12	MPH Acquisition Holdings LLC				PBF Holding Co. LLC			
4,375 % fällig am 01.02.2031	3.000	2.607	0,09	5,500 % fällig am 01.09.2028	11.045	9.902	0,33	7,875 % fällig am 15.09.2030	750	765	0,03
5,375 % fällig am 01.08.2028	1.000	963	0,03	Murphy Oil USA, Inc.				PDC Energy, Inc.			
Howard Midstream Energy Partners LLC				3,750 % fällig am 15.02.2031	600	523	0,02	5,750 % fällig am 15.05.2026	2.000	1.997	0,07
6,750 % fällig am 15.01.2027	450	445	0,02	Nabors Industries, Inc.				PennyMac Financial Services, Inc.			
8,875 % fällig am 15.07.2028	5.775	6.068	0,20	7,375 % fällig am 15.05.2027	2.750	2.697	0,09	4,250 % fällig am 15.02.2029	7.500	6.760	0,23
Howmet Aerospace, Inc.				Nationstar Mortgage Holdings, Inc.				5,750 % fällig am 15.09.2031	2.000	1.854	0,06
5,950 % fällig am 01.02.2037	3.000	3.135	0,11	5,500 % fällig am 15.08.2028	5.000	4.813	0,16	Performance Food Group, Inc.			
Icahn Enterprises LP				NCR Atleos Corp.				4,250 % fällig am 01.08.2029	3.000	2.755	0,09
5,250 % fällig am 15.05.2027	700	629	0,02	9,500 % fällig am 01.04.2029	12.475	13.266	0,45	5,500 % fällig am 15.10.2027	5.000	4.932	0,17
6,250 % fällig am 15.05.2026	300	286	0,01	NCR Voyix Corp.				Permian Resources Operating LLC			
iHeartCommunications, Inc.				5,250 % fällig am 01.10.2030	2.500	2.299	0,08	5,375 % fällig am 15.01.2026	2.000	1.975	0,07
4,750 % fällig am 15.01.2028	1.500	1.155	0,04	Newell Brands, Inc.				5,875 % fällig am 01.07.2029	3.000	2.929	0,10
5,250 % fällig am 15.08.2027	300	239	0,01	6,375 % fällig am 15.09.2027 (g)	1.250	1.245	0,04	6,875 % fällig am 01.04.2027	4.000	4.002	0,13
Imola Merger Corp.				6,375 % fällig am 01.04.2036	1.525	1.397	0,05	7,000 % fällig am 15.01.2032	200	206	0,01
4,750 % fällig am 15.05.2029	7.500	7.135	0,24	Newfold Digital Holdings Group, Inc.				PetSmart, Inc.			
IQVIA, Inc.				11,750 % fällig am 15.10.2028	9.100	9.797	0,33	4,750 % fällig am 15.02.2028	3.775	3.562	0,12
2,250 % fällig am 15.01.2028	€ 5.000	5.206	0,18	Nexstar Media, Inc.				7,750 % fällig am 15.02.2029	1.000	974	0,03
2,250 % fällig am 15.03.2029	3.000	3.045	0,10	4,750 % fällig am 01.11.2028	4.000	3.689	0,12	Post Holdings, Inc.			
2,875 % fällig am 15.06.2028	3.500	3.696	0,12	5,625 % fällig am 15.07.2027	4.000	3.871	0,13	4,500 % fällig am 15.09.2031	1.864	1.673	0,06
5,000 % fällig am 15.05.2027	\$ 1.000	982	0,03	NextEra Energy Operating Partners LP				4,625 % fällig am 15.04.2030	5.000	4.604	0,15
Jeld-Wen, Inc.				3,875 % fällig am 15.10.2026	200	191	0,01	5,500 % fällig am 15.12.2029	5.000	4.823	0,16
4,625 % fällig am 15.12.2025	500	484	0,02	4,250 % fällig am 15.07.2024	2.000	1.979	0,07	5,625 % fällig am 15.01.2028	5.000	4.958	0,17
4,875 % fällig am 15.12.2027	2.000	1.892	0,06	4,250 % fällig am 15.09.2024	262	254	0,01	PRA Group, Inc.			
Kaiser Aluminum Corp.				4,500 % fällig am 15.09.2027	5.975	5.756	0,19	7,375 % fällig am 01.09.2025	4.400	4.378	0,15
4,500 % fällig am 01.06.2031	2.000	1.727	0,06	7,250 % fällig am 15.01.2029	3.000	3.143	0,11	Prime Security Services Borrower LLC			
4,625 % fällig am 01.03.2028	4.000	3.704	0,12	NGL Energy Operating LLC				3,375 % fällig am 31.08.2027	5.000	4.639	0,16
KFC Holding Co.				7,500 % fällig am 01.02.2026	3.900	3.942	0,13	5,250 % fällig am 15.04.2024	267	266	0,01
4,750 % fällig am 01.06.2027	3.500	3.450	0,12	Noble Finance LLC				5,750 % fällig am 15.04.2026	4.000	4.024	0,14
Kinetik Holdings LP				8,000 % fällig am 15.04.2030	8.700	9.060	0,30	6,250 % fällig am 15.01.2028	5.000	4.975	0,17
5,875 % fällig am 15.06.2030	3.000	2.947	0,10	Novelis Corp.				PTC, Inc.			
6,625 % fällig am 15.12.2028	1.200	1.223	0,04	3,250 % fällig am 15.11.2026	3.000	2.826	0,10	4,000 % fällig am 15.02.2028	1.250	1.186	0,04
Kronos International, Inc.				3,875 % fällig am 15.08.2031	8.000	7.061	0,24	Raising Cane's Restaurants LLC			
3,750 % fällig am 15.09.2025	€ 8.200	8.711	0,29	4,750 % fällig am 30.01.2030	7.000	6.594	0,22	9,375 % fällig am 01.05.2029	900	962	0,03
LABL, Inc.				NRG Energy, Inc.				Range Resources Corp.			
5,875 % fällig am 01.11.2028	\$ 6.675	6.060	0,20	3,375 % fällig am 15.02.2029	4.250	3.758	0,13	4,750 % fällig am 15.02.2030	2.000	1.851	0,06
6,750 % fällig am 15.07.2026	5.000	4.868	0,16	NSG Holdings LLC				Resorts World Las Vegas LLC			
Lamb Weston Holdings, Inc.				7,750 % fällig am 15.12.2025	141	140	0,00	4,625 % fällig am 16.04.2029	250	218	0,01
4,125 % fällig am 31.01.2030	2.000	1.846	0,06	NuStar Logistics LP				8,450 % fällig am 27.07.2030	2.000	2.065	0,07
4,875 % fällig am 15.05.2028	2.000	1.958	0,07	5,750 % fällig am 01.10.2025	2.500	2.486	0,08	RHP Hotel Properties LP			
Las Vegas Sands Corp.				6,375 % fällig am 01.10.2030	2.000	2.006	0,07	4,500 % fällig am 15.02.2029	2.500	2.327	0,08
3,900 % fällig am 08.08.2029	20.500	18.914	0,63	Olympus Water U.S. Holding Corp.				4,750 % fällig am 15.10.2027	1.500	1.450	0,05
Legacy LifePoint Health LLC				3,875 % fällig am 01.10.2028	€ 10.000	10.156	0,34	Ritchie Bros Holdings, Inc.			
4,375 % fällig am 15.02.2027	4.425	4.090	0,14	4,250 % fällig am 01.10.2028	\$ 2.700	2.433	0,08	6,750 % fällig am 15.03.2028	1.400	1.443	0,05
Lehman Brothers Holdings, Inc.				5,375 % fällig am 01.10.2029 (g)	€ 10.000	9.482	0,32	7,750 % fällig am 15.03.2031	2.500	2.668	0,09
0,000 % fällig am 25.05.2010 ^	14.200	25	0,00	7,125 % fällig am 01.10.2027	\$ 325	326	0,01	RLJ Lodging Trust LP			
Level 3 Financing, Inc.				ON Semiconductor Corp.				4,000 % fällig am 15.09.2029	5.000	4.498	0,15
3,625 % fällig am 15.01.2029	2.000	1.050	0,04	3,875 % fällig am 01.09.2028	3.500	3.249	0,11	Rockcliff Energy LLC			
3,750 % fällig am 15.07.2029	3.000	1.560	0,05					5,500 % fällig am 15.10.2029	5.000	4.732	0,16
4,250 % fällig am 01.07.2028	5.000	2.975	0,10								

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

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Oryx Midstream Services Permian Basin LLC				Station Casinos LLC				US-SCHATZ OBLIGATIONEN			
8,710 % fällig am 05.10.2028	\$ 314	\$ 315	0,01	7,706 % fällig am 08.02.2027	\$ 1.174	\$ 1.177	0,04	U.S. Treasury Notes			
Pacific Gas & Electric Co.				Tempo Acquisition LLC				3,500 % fällig am 15.09.2025	\$ 30.000	\$ 29.562	0,99
7,856 % fällig am 23.06.2025	550	552	0,02	8,106 % fällig am 31.08.2028	932	937	0,03	4,250 % fällig am 15.10.2025 (g)	58.000	57.899	1,94
PetSmart, Inc.				TransDigm, Inc.				5,000 % fällig am 31.10.2025	59.100	59.782	2,01
9,206 % fällig am 11.02.2028	1.470	1.456	0,05	8,598 % fällig am 22.02.2027	384	386	0,01			147.243	4,94
Polaris Newco LLC				Trident TPI Holdings, Inc.				Summe USA		1.745.681	58,57
9,470 % fällig am 02.06.2028	432	427	0,01	9,610 % fällig am 15.09.2028	685	684	0,02	Summe Übertragbare Wertpapiere		\$ 2.863.479	96,08
Prime Security Services Borrower LLC				U.S. Foods, Inc.							
7,841 % fällig am 14.10.2030	550	552	0,02	7,970 % fällig am 22.11.2028	811	816	0,03				
Rand Parent LLC				U.S. Renal Care, Inc.							
9,598 % fällig am 17.03.2030	299	299	0,01	10,470 % fällig am 20.06.2028	0	0	0,00				
Red Ventures LLC				United Airlines, Inc.							
8,356 % fällig am 03.03.2030	349	349	0,01	9,220 % fällig am 21.04.2028	2.140	2.151	0,07	AKTIEN			
Reynolds Consumer Products LLC				USI, Inc.				INVESTMENTFONDS			
7,206 % fällig am 04.02.2027	350	351	0,01	8,348 % fällig am 22.11.2029	355	356	0,01	ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
Scientific Games Holdings LP				Vertiv Group Corp.				PIMCO Funds: Global			
8,598 % - 8,914 % fällig am 04.04.2029	249	250	0,01	7,974 % fällig am 02.03.2027	933	937	0,03	Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (d)	1.219.084	11.264	0,38
Scientific Games International, Inc.				WMG Acquisition Corp.				PIMCO Funds: Global			
8,465 % fällig am 14.04.2029	399	401	0,01	7,481 % fällig am 20.01.2028	1.000	1.002	0,03	Investors Series plc - PIMCO European High Yield Bond Fund (d)	4.496.448	56.176	1,88
Sotera Health Holdings LLC				Worldpay LLC				PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (d)	891.085	8.880	0,30
8,395 % fällig am 11.12.2026	650	650	0,02	TBD % fällig am 31.01.2031	1.500	1.508	0,05			76.320	2,56
Spirit Aerosystems, Inc.						43.213	1,45	Summe Investmentfonds		\$ 76.320	2,56
9,633 % fällig am 15.01.2027	590	592	0,02								
SS&C Technologies, Inc.				NON-AGENCY-MBS							
7,706 % fällig am 22.03.2029	959	962	0,03	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust							
				5,852 % fällig am 25.05.2047	28	4	0,00				

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablaufmonat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl March Futures	Short	03.2024	1.146	\$ (2.496)	(0,08)
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2024	146	(669)	(0,02)
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2024	131	307	0,01
U.S. Treasury 10-Year Ultra March Futures	Short	03.2024	129	(735)	(0,03)
United Kingdom Long Gilt March Futures	Long	03.2024	12	107	0,00
				\$ (3.486)	(0,12)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (3.486)	(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-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Cellnex Telecom S.A.	5,000 %	20.12.2030	€ 17.900	\$ 684	0,02
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5,000	20.06.2028	15.700	530	0,02
Newell Brands, Inc.	1,000	20.06.2028	\$ 2.400	60	0,00
				\$ 1.274	0,04

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-41 5-Year Index	5,000 %	20.12.2028	\$ 21.087	\$ 586	0,02
iTraxx Crossover 40 5-Year Index	5,000	20.12.2028	€ 23.400	952	0,03
				\$ 1.538	0,05

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,250 %	20.03.2029	€ 69.600	\$ 2.290	0,08
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ 5.102	0,17

- (1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann (i) zahlt der Fonds entweder dem Sicherungsnehmer einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps 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 Verbindlichkeiten, 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. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Netto- vermögens
JLN	Cellnex Telecom S.A.	5,000 %	20.06.2028	€ 200	\$ 30	\$ 7	\$ 37	0,00

- (1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps 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 Verbindlichkeiten, 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 Netto- vermögens
BOA	01.2024	£ 5.485	\$ 6.951	\$ 0	\$ (41)	\$ (41)	0,00
BPS	01.2024	€ 715.978	\$ 788.034	3	(3.056)	(3.053)	(0,10)
	01.2024	£ 7.727	9.801	0	(50)	(50)	0,00
	01.2024	\$ 3.418	€ 3.129	40	0	40	0,00
CBK	01.2024	€ 496	\$ 543	0	(5)	(5)	0,00
MBC	01.2024	CAD 2.138	1.580	0	(42)	(42)	0,00
	01.2024	€ 1.344	1.465	0	(20)	(20)	0,00
	01.2024	\$ 5.758	€ 5.338	140	0	140	0,00
MYI	01.2024	€ 1.744	\$ 1.934	8	0	8	0,00
	01.2024	£ 427	546	1	0	1	0,00
	01.2024	SGD 160	121	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 3.777	£ 2.958	0	(6)	(6)	0,00
UAG	01.2024	£ 41.900	\$ 53.026	0	(390)	(390)	(0,01)
				\$ 192	\$ (3.610)	\$ (3.418)	(0,11)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 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 Netto- vermögens
BRC	01.2024	\$ 1.467	CHF 1.280	\$ 55	\$ 0	\$ 55	0,00
CBK	01.2024	CHF 10	\$ 12	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 9.258	CHF 8.066	330	0	330	0,01
GLM	01.2024	10.228	8.963	427	0	427	0,02
MYI	01.2024	10.277	8.971	387	0	387	0,01
				\$ 1.199	\$ 0	\$ 1.199	0,04

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

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
BPS	01.2024	€ 1.998	\$ 2.158	\$ 0	\$ (50)	\$ (50)	0,00
	01.2024	\$ 455.726	€ 414.549	2.315	(3)	2.312	0,08
BRC	01.2024	385.584	350.601	1.796	0	1.796	0,06
	01.2024	€ 18.029	\$ 19.715	0	(207)	(207)	(0,01)
MBC	01.2024	\$ 385	€ 356	8	0	8	0,00
	01.2024	€ 258	\$ 283	0	(2)	(2)	0,00
	01.2024	\$ 343.336	€ 314.000	3.605	0	3.605	0,12
				\$ 7.724	\$ (262)	\$ 7.462	0,25

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend und 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 Netto- vermögens
BOA	01.2024	£ 809	\$ 1.023	\$ 0	\$ (8)	\$ (8)	0,00
	01.2024	\$ 19.141	£ 15.106	117	0	117	0,00
BPS	01.2024	19.713	15.539	98	(1)	97	0,00
	01.2024	327	258	3	0	3	0,00
CBK	01.2024	£ 2.008	\$ 2.542	0	(18)	(18)	0,00
	01.2024	203	258	0	0	0	0,00
MBC	01.2024	3.395	4.319	0	(9)	(9)	0,00
	01.2024	\$ 89	£ 71	1	0	1	0,00
MYI	01.2024	£ 648	\$ 815	0	(11)	(11)	0,00
	01.2024	\$ 214	£ 168	0	(1)	(1)	0,00
SCX	01.2024	111.228	87.936	876	0	876	0,03
	01.2024	£ 202	\$ 254	0	(3)	(3)	0,00
SSB	01.2024	\$ 70.735	£ 56.056	728	0	728	0,03
	01.2024	£ 314	\$ 393	0	(7)	(7)	0,00
UAG	01.2024	\$ 111.207	£ 87.871	814	0	814	0,03
				\$ 2.637	\$ (58)	\$ 2.579	0,09

Zum 31. Dezember 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 Netto- vermögens
DUB	01.2024	\$ 1.848	SGD 2.456	\$ 15	\$ 0	\$ 15	0,00
	01.2024	SGD 20	\$ 15	0	0	0	0,00
GLM	01.2024	\$ 288	SGD 385	4	0	4	0,00
	01.2024	148	198	2	0	2	0,00
MBC	02.2024	224	295	0	0	0	0,00
	01.2024	1.723	2.299	20	0	20	0,00
MYI	02.2024	SGD 38	\$ 29	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 1.786	SGD 2.383	21	0	21	0,00
TOR	02.2024	SGD 12	\$ 9	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 7	SGD 10	0	0	0	0,00
				\$ 62	\$ 0	\$ 62	0,00

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 7.921 0,27

Summe Anlagen

\$ 2.949.336 98,96

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ 30.914 1,04

Nettovermögen

\$ 2.980.250 100,00

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

- * Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt
- ^ Das Wertpapier ist in Verzug.
- (a) Wertpapier per Emissionstermin.
- (b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.
- (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: 0,00 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Altice France S.A.	11,500 %	01.02.2027	20.12.2023	\$ 2.906	\$ 3.038	0,10

(g) Wertpapiere mit einem aggregierten beizulegenden Zeitwert von USD 21.426 (31. Dezember 2022: USD 10.952) waren zum 31. Dezember 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 566 (31. Dezember 2022: USD 205) waren zum 31. Dezember 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheiten erhalten worden.

Barmittel in Höhe von USD 31.571 (31. Dezember 2022: USD 20.021) waren zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 2.520 (31. Dezember 2022: USD 8.590) waren zum 31. Dezember 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 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	\$ 2.863.432	\$ 47	\$ 2.863.479
Investmentfonds	76.320	0	0	76.320
Finanzderivate ⁽³⁾	(3.058)	12.595	0	9.537
Summen	\$ 73.262	\$ 2.876.027	\$ 47	\$ 2.949.336

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 2.850.743	\$ 43	\$ 2.850.786
Investmentfonds	201.583	0	0	201.583
Pensionsgeschäfte	0	11.412	0	11.412
Finanzderivate ⁽³⁾	933	15.128	0	16.061
Summen	\$ 202.516	\$ 2.877.283	\$ 43	\$ 3.079.842

⁽¹⁾ Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.⁽²⁾ Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.⁽³⁾ Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
BPS	0,000 %	13.10.2023	TBD ⁽¹⁾	€ (1.688)	\$ (1.871)	(0,06)
	4,500	22.11.2023	TBD ⁽¹⁾	\$ (1.400)	(1.407)	(0,05)
	5,000	22.11.2023	TBD ⁽¹⁾	(409)	(412)	(0,01)
BRC	2,900	20.09.2023	TBD ⁽¹⁾	€ (1.784)	(1.985)	(0,07)
BSN	5,510	14.12.2023	04.01.2024	\$ (6.092)	(6.109)	(0,21)
JML	2,250	14.11.2023	TBD ⁽¹⁾	€ (268)	(297)	(0,01)
	3,000	08.06.2023	TBD ⁽¹⁾	(2.124)	(2.380)	(0,08)
	3,000	12.06.2023	TBD ⁽¹⁾	(1.273)	(1.426)	(0,05)
	3,000	19.10.2023	TBD ⁽¹⁾	(2.528)	(2.809)	(0,09)
MYI	2,500	17.05.2023	TBD ⁽¹⁾	(1.266)	(1.421)	(0,05)
TDM	2,000	27.10.2023	TBD ⁽¹⁾	\$ (434)	(436)	(0,01)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (20.553)	(0,69)

⁽¹⁾ Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement ⁽¹⁾
BOA	\$ 68	\$ 0	\$ 68	\$ 1.580	\$ (1.340)	\$ 240
BPS	(704)	2.520	1.816	33	0	33
BRC	1.854	(3.880)	(2.026)	9	0	9

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement ⁽¹⁾
CBK	\$ 108	\$ 0	\$ 108	\$ 11.688	\$ (11.530)	\$ 158
DUB	15	0	15	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	431	(420)	11	3	(10)	(7)
JLN	37	0	37	k. A.	k. A.	k. A.
JPM	0	(40)	(40)	(416)	50	(366)
MBC	3.675	(5.510)	(1.835)	8.000	(7.460)	540
MYI	398	(400)	(2)	(51)	0	(51)
SCX	876	(1.240)	(364)	(9.114)	8.540	(574)
SSB	725	(630)	95	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	21	0	21	100	(180)	(80)
UAG	417	(370)	47	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. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	47,81	49,58
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	47,88	42,29
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,39	0,01
Investmentfonds	2,56	6,50
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,37
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,12)	0,03
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,17	0,10
Freiverkehrsfinanzderivate	0,27	0,38
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,69)	(0,34)

* Gemäß der Liste der Märkte, die die Kriterien für einen geregelten OGAW-Markt erfüllen, in Anlage 1 zum Verkaufsprospekt.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Österreich	0,23	k. A.
Belgien	0,27	0,22
Bermuda	0,86	0,40
Kanada	3,03	1,55
Cayman-Inseln	0,42	0,78
Dänemark	k. A.	0,09
Tschechische Republik	0,56	k. A.
Frankreich	3,40	1,95
Deutschland	3,44	2,67
Gibraltar	0,02	k. A.
Irland	k. A.	0,22
Italien	6,13	3,75
Jersey, Kanalinseln	0,36	0,20
Liberia	1,04	0,67
Luxemburg	3,42	2,47
Multinational	1,43	1,67
Niederlande	4,61	5,00
Norwegen	0,08	0,34
Panama	0,81	0,53
Spanien	1,54	1,70
Schweden	1,12	0,91
Schweiz	0,01	0,11
Großbritannien	4,73	3,84
USA	58,57	59,77
Kurzfristige Instrumente	k. A.	3,04
Investmentfonds	2,56	6,50
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,37
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,12)	0,03
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,04	k. A.
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,05	0,10
Zinsswaps	0,08	k. A.
Freiverkehrsfinanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,00	k. A.
Devisenterminkontrakte	(0,11)	(0,64)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,38	1,02
Sonstige Aktiva und Passiva	1,04	0,74
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE											
AUSTRALIEN											
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL											
Aurizon Network Pty. Ltd. 3,125 % fällig am 01.06.2026	€ 5.700	\$ 6.242	0,06	Bacardi Ltd. 2,750 % fällig am 15.07.2026	\$ 1.543	\$ 1.455	0,01	Betony CLO Ltd. 6,732 % fällig am 30.04.2031	\$ 3.753	\$ 3.755	0,03
Australia & New Zealand Banking Group Ltd. 3,437 % fällig am 04.04.2025	800	885	0,01	4,450 % fällig am 15.05.2025	10.410	10.273	0,10	Blackbird Capital Aircraft Lease Securitization Ltd. 4,213 % fällig am 16.12.2041	4.155	3.920	0,04
Boral Finance Pty. Ltd. 3,750 % fällig am 01.05.2028	\$ 415	383	0,00	4,700 % fällig am 15.05.2028	26.330	25.822	0,24	Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd. 6,691 % fällig am 15.05.2031	7.614	7.607	0,07
CIMIC Finance Ltd. 1,500 % fällig am 28.05.2029	€ 4.300	4.137	0,04	Seadrill Finance Ltd. 8,375 % fällig am 01.08.2030	300	313	0,00	6,795 % fällig am 15.07.2031	5.390	5.384	0,05
GAIF Bond Issuer Pty. Ltd. 1,900 % fällig am 14.12.2028	AUD 23.500	13.681	0,13	VOC Escrow Ltd. 5,000 % fällig am 15.02.2028	1.200	1.150	0,01	CIFC Funding Ltd. 6,640 % fällig am 24.04.2031	3.953	3.954	0,04
GTA Finance Co. Pty. Ltd. 2,200 % fällig am 26.08.2027	7.200	4.399	0,04			49.699	0,46	6,864 % fällig am 17.10.2031	4.800	4.803	0,04
Lendlease Finance Ltd. 3,400 % fällig am 27.10.2027	9.900	6.148	0,06	Summe Bermuda		55.895	0,52	Elevation CLO Ltd. 6,775 % fällig am 15.07.2031	995	995	0,01
Macquarie University 3,500 % fällig am 07.09.2028	250	160	0,00	BRASILIEN				KDAC Aviation Finance Ltd. 4,212 % fällig am 15.12.2042	3.494	2.944	0,03
Network Finance Co. Pty. Ltd. 6,061 % fällig am 19.06.2030	700	495	0,00	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Madison Park Funding Ltd. 6,405 % fällig am 15.04.2029	2.840	2.829	0,03
Optus Finance Pty. Ltd. 1,000 % fällig am 20.06.2029	€ 6.700	6.497	0,06	Banco BTG Pactual S.A. 4,500 % fällig am 10.01.2025	14.000	13.765	0,13	Northwoods Capital Ltd. 6,758 % fällig am 19.04.2031	9.717	9.728	0,09
Pacific National Finance Pty. Ltd. 4,750 % fällig am 22.03.2028	\$ 15.700	14.723	0,14	CSN Resources S.A. 5,875 % fällig am 08.04.2032	8.100	7.052	0,06	7,246 % fällig am 15.06.2031	976	978	0,01
Qantas Airways Ltd. 3,150 % fällig am 27.09.2028	AUD 500	309	0,00	Summe Brasilien		20.817	0,19	Palmer Square CLO Ltd. 6,687 % fällig am 18.04.2031	1.970	1.969	0,02
Santos Finance Ltd. 4,125 % fällig am 14.09.2027	\$ 7.800	7.428	0,07	KANADA				Romark WM-R Ltd. 6,707 % fällig am 20.04.2031	2.813	2.813	0,02
5,250 % fällig am 13.03.2029	21.303	20.867	0,20	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Sapphire Aviation Finance Ltd. 4,250 % fällig am 15.03.2040	4.395	3.919	0,04
6,875 % fällig am 19.09.2033	4.800	5.095	0,05	Air Canada Pass-Through Trust 3,300 % fällig am 15.07.2031	2.332	2.098	0,02	Sound Point CLO Ltd. 6,655 % fällig am 15.04.2031	5.123	5.114	0,05
Woodside Finance Ltd. 3,700 % fällig am 15.03.2028	600	564	0,01	3,600 % fällig am 15.09.2028	5.245	4.939	0,05	6,797 % fällig am 21.01.2031	3.780	3.776	0,03
4,500 % fällig am 04.03.2029	26.115	25.115	0,23	3,750 % fällig am 15.06.2029	2.553	2.352	0,02	6,821 % fällig am 26.10.2031	6.500	6.504	0,06
		117.128	1,10	4,125 % fällig am 15.11.2026	3.134	3.018	0,03	Steele Creek CLO Ltd. 6,744 % fällig am 21.04.2031	971	972	0,01
				5,250 % fällig am 01.10.2030	3.114	3.057	0,03	Thunderbolt Aircraft Lease Ltd. 4,212 % fällig am 17.05.2032	2.049	1.900	0,02
				Bank of Montreal 4,689 % fällig am 28.07.2029	5.000	5.035	0,05	Trinitas CLO Ltd. 6,777 % fällig am 20.07.2031	5.868	5.871	0,05
				Bank of Nova Scotia 4,900 % fällig am 04.06.2025 (g)(i)	17.869	17.112	0,16	Wind River CLO Ltd. 6,707 % fällig am 18.07.2031	905	905	0,01
				Brookfield Finance, Inc. 3,500 % fällig am 30.03.2051	19.100	13.992	0,13		98.138	9,91	
				3,900 % fällig am 25.01.2028	3.000	2.892	0,03	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
				4,700 % fällig am 20.09.2047	1.801	1.570	0,01	Alibaba Group Holding Ltd. 2,125 % fällig am 09.02.2031	2.000	1.659	0,02
				4,850 % fällig am 29.03.2029	8.834	8.789	0,08	4,400 % fällig am 06.12.2057	8.000	6.524	0,06
				Canadian Pacific Railway Co. 3,100 % fällig am 02.12.2051	8.000	5.787	0,05	Avolon Holdings Funding Ltd. 2,528 % fällig am 18.11.2027	14.256	12.643	0,12
				CI Financial Corp. 4,100 % fällig am 15.06.2051	11.237	6.608	0,06	2,875 % fällig am 15.02.2025	8.300	8.012	0,08
				Enbridge, Inc. 4,250 % fällig am 01.12.2026	10.504	10.368	0,10	4,250 % fällig am 15.04.2026	3.013	2.912	0,03
				5,700 % fällig am 08.03.2033	2.068	2.150	0,02	4,375 % fällig am 01.05.2026	2.310	2.237	0,02
				6,000 % fällig am 15.11.2028	11.800	12.398	0,12	5,500 % fällig am 15.01.2026	18.600	18.492	0,17
				Fairfax Financial Holdings Ltd. 2,750 % fällig am 29.03.2028	€ 29.201	30.837	0,29	China Modern Dairy Holdings Ltd. 2,125 % fällig am 14.07.2026	9.200	8.171	0,08
				4,850 % fällig am 17.04.2028	\$ 100	99	0,00	Gaci First Investment Co. 4,750 % fällig am 14.02.2030	2.600	2.603	0,02
				Honda Canada Finance, Inc. 1,646 % fällig am 25.02.2028	CAD 7.082	4.828	0,05	4,875 % fällig am 14.02.2035	1.700	1.664	0,02
				Royal Bank of Canada 3,500 % fällig am 25.07.2028	€ 1.000	1.134	0,01	5,125 % fällig am 14.02.2053	13.000	11.805	0,11
				4,851 % fällig am 14.12.2026	\$ 8.900	8.971	0,08	GGAM Finance Ltd. 8,000 % fällig am 15.02.2027	2.700	2.771	0,03
				Toronto-Dominion Bank 4,680 % fällig am 08.01.2029	CAD 14.396	11.045	0,10	Goodman HK Finance 4,375 % fällig am 19.06.2024	3.500	3.474	0,03
						159.079	1,49	Melco Resorts Finance Ltd. 4,875 % fällig am 06.06.2025	16.760	16.271	0,15
				STAATSEMISSIONEN				5,250 % fällig am 26.04.2026	3.650	3.522	0,03
				Canada Government International Bond 2,750 % fällig am 01.12.2048	500	360	0,00	5,375 % fällig am 04.12.2029	3.027	2.678	0,03
				Province of Ontario 2,050 % fällig am 02.06.2030	9.927	6.878	0,06	5,625 % fällig am 17.07.2027	8.241	7.731	0,07
				2,600 % fällig am 02.06.2025	151.500	112.285	1,05	5,750 % fällig am 21.07.2028	2.100	1.947	0,02
				Province of Quebec 1,900 % fällig am 01.09.2030	4.500	3.079	0,03	MGM China Holdings Ltd. 4,750 % fällig am 01.02.2027	9.900	9.426	0,09
						122.602	1,14	5,250 % fällig am 18.06.2025	8.100	7.961	0,07
				Summe Kanada		281.681	2,63	5,375 % fällig am 15.05.2024	1.255	1.250	0,01
				CAYMAN INSELN				5,875 % fällig am 15.05.2026	6.746	6.609	0,06
				FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				Sands China Ltd. 2,550 % fällig am 08.03.2027 (k)	1.000	910	0,01
				Ares CLO Ltd. 6,825 % fällig am 15.10.2030	\$ 8.970	8.979	0,08	3,100 % fällig am 08.03.2029	1.500	1.309	0,01
				Atlas Senior Loan Fund Ltd. 6,745 % fällig am 15.01.2031	7.574	7.585	0,07	4,300 % fällig am 08.01.2026	10.000	9.609	0,09
				6,805 % fällig am 16.01.2030	935	934	0,01	5,650 % fällig am 08.08.2028	24.248	24.061	0,22
								Suci Second Investment Co. 6,000 % fällig am 25.10.2028	800	847	0,01

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Sunny Optical Technology Group Co. Ltd. 5,950 % fällig am 17.07.2026	\$ 10.500	\$ 10.605	0,10	OP Mortgage Bank 3,375 % fällig am 15.02.2027	€ 6.000	\$ 6.744	0,06	DEUTSCHLAND UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Tencent Holdings Ltd. 2,390 % fällig am 03.06.2030	8.266	7.048	0,07	SATO Oyj 1,375 % fällig am 24.02.2028	6.571	6.061	0,06	Bayer AG 0,625 % fällig am 12.07.2031	€ 1.000	\$ 876	0,01
3,240 % fällig am 03.06.2050	5.200	3.472	0,03	Teollisuuden Voima Oyj 4,750 % fällig am 01.06.2030	1.200	1.391	0,01	Commerzbank AG 3,375 % fällig am 12.12.2025	900	1.004	0,01
3,290 % fällig am 03.06.2060	700	444	0,00	Summe Finnland		28.647	0,27	Deutsche Bank AG 1,750 % fällig am 19.11.2030	40.300	38.758	0,36
Tencent Music Entertainment Group 2,000 % fällig am 03.09.2030	2.800	2.275	0,02	FRANKREICH UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				2,625 % fällig am 16.12.2024	£ 15.000	18.541	0,17
Tingyi Cayman Islands Holding Corp. 1,625 % fällig am 24.09.2025	11.300	10.655	0,10	Altarea S.C.A. 1,750 % fällig am 16.01.2030	11.200	9.578	0,09	Deutsche Börse AG 3,875 % fällig am 28.09.2033	€ 8.800	10.361	0,10
Wynn Macau Ltd. 4,875 % fällig am 01.10.2024	2.135	2.110	0,02	1,875 % fällig am 17.01.2028	5.700	5.305	0,05	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 1,625 % fällig am 09.07.2024	9.200	10.032	0,09
5,500 % fällig am 15.01.2026	8.554	8.356	0,08	Altice France S.A. 5,125 % fällig am 15.07.2029	\$ 1.200	935	0,01	1,875 % fällig am 31.03.2028	8.353	8.738	0,08
5,500 % fällig am 01.10.2027	2.000	1.891	0,02	BNP Paribas S.A. 2,219 % fällig am 09.06.2026	21.000	20.058	0,19	2,125 % fällig am 09.07.2027	14.700	15.812	0,15
Xiaomi Best Time International Ltd. 2,875 % fällig am 14.07.2031	1.900	1.582	0,01	2,871 % fällig am 19.04.2032	3.700	3.132	0,03	Hamburg Commercial Bank AG 0,500 % fällig am 22.09.2026	100	102	0,00
Zhongsheng Group Holdings Ltd. 3,000 % fällig am 13.01.2026	7.100	6.622	0,06	3,500 % fällig am 16.11.2027	20.000	18.886	0,18	IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK) 3,750 % fällig am 15.09.2026 (b)	19.590	21.397	0,20
		232.158	2,17	5,198 % fällig am 10.01.2030	15.000	15.030	0,14	Robert Bosch GmbH 3,625 % fällig am 02.06.2030	2.000	2.272	0,02
Summe Cayman-Inseln		330.296	3,08	8,500 % fällig am 14.08.2028 (g/i)	6.000	6.298	0,06	4,000 % fällig am 02.06.2035	2.200	2.581	0,02
				BPCE S.A. 6,612 % fällig am 19.10.2027	4.500	4.635	0,04	4,375 % fällig am 02.06.2043	300	356	0,00
CHILE UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				6,714 % fällig am 19.10.2029	30.000	31.621	0,29	Sixt SE 1,750 % fällig am 09.12.2024	10.958	11.894	0,11
Celeo Redes Operacion Chile S.A. 5,200 % fällig am 22.06.2047	1.505	1.344	0,01	Bureau Veritas S.A. 1,875 % fällig am 06.01.2025	€ 15.200	16.435	0,15	Volkswagen Bank GmbH 4,375 % fällig am 03.05.2028	400	456	0,01
Empresa Electrica Cochrane SpA 5,500 % fällig am 14.05.2027	839	796	0,01	Credit Agricole S.A. 6,316 % fällig am 03.10.2029	\$ 6.100	6.395	0,06	4,625 % fällig am 03.05.2031	5.300	6.152	0,06
Summe Chile		2.140	0,02	Electricite de France S.A. 4,625 % fällig am 25.01.2043	€ 1.700	1.981	0,02	Volkswagen Leasing GmbH 1,500 % fällig am 19.06.2026	7.500	7.936	0,08
				4,875 % fällig am 21.09.2038	\$ 12.600	11.673	0,11	Vonovia SE 0,250 % fällig am 01.09.2028	8.900	8.371	0,08
CHINA UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				5,500 % fällig am 25.01.2035	£ 5.000	6.450	0,06	Summe Deutschland		165.639	1,55
State Grid Overseas Investment BVI Ltd. 0,797 % fällig am 05.08.2026	€ 12.223	12.609	0,12	5,625 % fällig am 25.01.2053	5.300	6.638	0,06	GUERNSEY, KANALINSELN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
2,125 % fällig am 02.05.2030	5.217	5.140	0,05	6,900 % fällig am 23.05.2053	\$ 4.100	4.645	0,04	Amdocs Ltd. 2,538 % fällig am 15.06.2030	\$ 5.875	5.071	0,05
Summe China		17.749	0,17	9,125 % fällig am 15.03.2033 (g)	3.400	3.804	0,04	Globalworth Real Estate Investments Ltd. 2,950 % fällig am 29.07.2026	€ 16.713	15.237	0,14
				Holding d'Infrastructures de Transport SASU 1,475 % fällig am 18.01.2031	€ 9.200	8.735	0,08	3,000 % fällig am 29.03.2025	421	426	0,00
KOLUMBIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				1,625 % fällig am 18.09.2029	3.600	3.583	0,03	Sirius Real Estate Ltd. 1,125 % fällig am 22.06.2026	8.300	8.292	0,08
Ecopetrol S.A. 8,875 % fällig am 13.01.2033	\$ 7.900	8.593	0,08	Holding d'Infrastructures des Metiers de l'Environnement 0,625 % fällig am 16.09.2028	3.200	3.081	0,03	1,750 % fällig am 24.11.2028	10.100	9.292	0,09
				Indigo Group S.A.S. 1,625 % fällig am 19.04.2028	9.700	9.980	0,09	Summe Guernsey, Kanalinseln		38.318	0,36
TSCHECHISCHE REPUBLIK UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Kering S.A. 5,125 % fällig am 23.11.2026	£ 2.000	2.602	0,02	HONGKONG UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
EP Infrastructure A/S 1,659 % fällig am 26.04.2024	€ 5.400	5.888	0,06	New Immo Holding S.A. 2,750 % fällig am 26.11.2026	€ 2.800	2.845	0,03	AIA Group Ltd. 4,950 % fällig am 04.04.2033	\$ 300	302	0,00
1,816 % fällig am 02.03.2031	8.000	6.861	0,06	Peugeot Invest 1,875 % fällig am 30.10.2026	18.300	19.332	0,18	Lenovo Group Ltd. 3,421 % fällig am 02.11.2030 (k)	6.400	5.656	0,05
2,045 % fällig am 09.10.2028	3.300	3.055	0,03	SEB S.A. 1,375 % fällig am 16.06.2025	6.800	7.233	0,07	Summe Hongkong		13.275	0,12
Summe Tschechische Republik		15.804	0,15	Societe Generale S.A. 2,889 % fällig am 09.06.2032	\$ 24.213	20.000	0,19	INDIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
				6,691 % fällig am 10.01.2034	26.900	28.436	0,27	Adani Transmission Step-One Ltd. 4,250 % fällig am 21.05.2036	16.249	13.115	0,12
DÄNEMARK UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Societe Generale SFH S.A. 3,625 % fällig am 31.07.2026	€ 9.000	10.148	0,09	Bharti Airtel Ltd. 4,375 % fällig am 10.06.2025	5.000	4.932	0,05
GN Store Nord A/S 0,875 % fällig am 25.11.2024	13.661	14.465	0,14	TDF Infrastructure SASU 1,750 % fällig am 01.12.2029	9.100	8.795	0,08	ReNew Power Pvt Ltd. 5,875 % fällig am 05.03.2027	4.778	4.574	0,04
Jyske Realkredit A/S 1,500 % fällig am 01.10.2053	DKK 8.634	1.042	0,01	2,500 % fällig am 07.04.2026	7.100	7.656	0,07	Summe Indien		22.621	0,21
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % fällig am 01.10.2050	4.010	469	0,00	Teleperformance SE 5,250 % fällig am 22.11.2028	1.400	1.619	0,02				
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	94.058	10.912	0,10	Thales S.A. 4,000 % fällig am 18.10.2025	2.600	2.912	0,03				
1,000 % fällig am 01.10.2053	9.219	1.044	0,01	Ubisoft Entertainment S.A. 0,878 % fällig am 24.11.2027	18.400	17.349	0,16				
1,500 % fällig am 01.10.2053	6.805	820	0,01	Worldline S.A. 4,125 % fällig am 12.09.2028	8.000	8.774	0,08				
4,625 % fällig am 19.01.2029	€ 6.600	7.543	0,07			336.579	3,14				
Realkredit Danmark A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 29.867	3.465	0,03	KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG							
1,000 % fällig am 01.10.2053	3.664	395	0,00	Altice France S.A. 9,465 % fällig am 15.08.2028	4.195	4.175	0,04				
1,500 % fällig am 01.10.2053	6.816	822	0,01	STAATSEMISSIONEN							
Summe Dänemark		40.977	0,38	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 3,000 % fällig am 25.11.2031	4.300	4.878	0,05				
				Summe Frankreich		345.632	3,23				
FINNLAND UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL											
Balder Finland Oyj 1,000 % fällig am 20.01.2029	€ 13.904	11.738	0,11								
Nokia Oyj 4,375 % fällig am 12.06.2027	\$ 2.800	2.713	0,03								

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
INDONESIEN				JAPAN				CPI Property Group S.A.			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				1,500 % fällig am 27.01.2031			
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia				Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.				€ 10.269	\$ 6.001		0,06
2,800 % fällig am 23.06.2030	\$ 6.600	\$ 5.965	0,05	0,953 % fällig am 19.07.2025	\$ 14.400	\$ 14.033	0,13	1,750 % fällig am 14.01.2030	10.150	6.408	0,06
4,450 % fällig am 20.02.2029	600	599	0,01	1,538 % fällig am 20.07.2027	9.500	8.685	0,08	Cromwell Ereit Lux Finco SARL			
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara				2,048 % fällig am 17.07.2030	15.400	12.966	0,12	2,125 % fällig am 19.11.2025	19.376	20.208	0,19
4,000 % fällig am 30.06.2050	7.800	6.050	0,06	3,195 % fällig am 18.07.2029	5.600	5.150	0,05	Helvetia Europe S.A.			
4,125 % fällig am 15.05.2027	1.400	1.363	0,01	3,273 % fällig am 19.09.2025	€ 3.100	3.404	0,03	2,750 % fällig am 30.09.2041	4.600	4.415	0,04
4,875 % fällig am 17.07.2049	700	621	0,01	5,422 % fällig am 22.02.2029	\$ 2.700	2.751	0,03	Logicor Financing SARL			
6,150 % fällig am 21.05.2048	2.300	2.362	0,02	5,475 % fällig am 22.02.2031	3.837	3.935	0,04	1,625 % fällig am 15.07.2027	23.701	24.102	0,22
Summe Indonesien		16.960	0,16	Mizuho Financial Group, Inc.				Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.			
IRLAND				1,979 % fällig am 08.09.2031	7.100	5.794	0,05	5,125 % fällig am 29.10.2022 ^ \$ 61.150		3.669	0,03
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				2,201 % fällig am 10.07.2033	9.100	7.581	0,07	5,250 % fällig am 23.05.2023 ^ (i) 12.200		732	0,01
Cumulus Static CLO DAC				4,416 % fällig am 20.05.2033	€ 5.000	5.826	0,05	TMS Issuer SARL			
5,499 % fällig am 25.04.2033	€ 5.000	5.520	0,05	5,739 % fällig am 27.05.2031	\$ 568	585	0,01	5,780 % fällig am 23.08.2032	7.000	7.319	0,07
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Nippon Life Insurance Co.				Summe Luxemburg		96.879	0,90
AerCap Ireland Capital DAC				6,250 % fällig am 13.09.2053	4.300	4.516	0,04	MAURITIUS			
1,650 % fällig am 29.10.2024	\$ 2.900	2.801	0,03	Nissan Motor Co. Ltd.				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
2,450 % fällig am 29.10.2026	3.200	2.964	0,03	4,345 % fällig am 17.09.2027	13.557	12.980	0,12	India Green Energy Holdings			
2,875 % fällig am 14.08.2024	3.300	3.238	0,03	4,810 % fällig am 17.09.2030	3.100	2.900	0,03	5,375 % fällig am 29.04.2024	9.900	9.802	0,09
3,150 % fällig am 15.02.2024	6.200	6.176	0,06	Nomura Holdings, Inc.				AKTIEN			
4,450 % fällig am 01.10.2025	400	393	0,00	1,851 % fällig am 16.07.2025	15.950	15.110	0,14	MEXIKO			
4,450 % fällig am 03.04.2026	5.475	5.380	0,05	2,172 % fällig am 14.07.2028	5.000	4.396	0,04	STAMMAKTIEN			
AIB Group PLC				2,679 % fällig am 16.07.2030	1.800	1.535	0,01	Desarolladora Homex S.A.B. de C.V. (c)			
4,263 % fällig am 10.04.2025	11.100	11.043	0,10	2,710 % fällig am 22.01.2029	9.800	8.686	0,08	427.064	0	0,00	
Perrigo Finance Unlimited Co.				3,103 % fällig am 16.01.2030	3.873	3.425	0,03	PARI (000S)			
4,900 % fällig am 15.12.2044	4.800	3.791	0,04	5,842 % fällig am 18.01.2028	9.500	9.709	0,09	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
SMBC Aviation Capital Finance DAC				6,181 % fällig am 18.01.2033 (k) 8.000	8.578	8.057	0,08	Banco Mercantil del Norte S.A.			
3,550 % fällig am 15.04.2024	3.800	3.775	0,03	Sumitomo Mitsui Banking Corp.				6,625 % fällig am 24.01.2032 (g)(i) \$ 9.400	8.009	0,08	
STERIS Irish FinCo UnLtd Co.				2,440 % fällig am 18.06.2024	11.500	11.333	0,11	Petroleos Mexicanos			
2,700 % fällig am 15.03.2031	2.900	2.496	0,02	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.				2,750 % fällig am 21.04.2027	€ 200	186	0,00
Zurich Finance Ireland Designated Activity Co.				2,130 % fällig am 08.07.2030	3.500	2.950	0,03	3,750 % fällig am 21.02.2024	100	110	0,00
5,125 % fällig am 23.11.2052	€ 3.600	4.430	0,04	2,696 % fällig am 16.07.2024	4.700	4.632	0,04	4,875 % fällig am 21.02.2028	500	483	0,00
		46.487	0,43	2,750 % fällig am 15.01.2030	2.018	1.786	0,02	10,000 % fällig am 07.02.2033	\$ 8.000	8.042	0,08
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				5,464 % fällig am 13.01.2026	6.000	6.060	0,06	Trust Fibra Uno			
Delos Aircraft DAC				5,520 % fällig am 13.01.2028	5.000	5.121	0,05	4,869 % fällig am 15.01.2030	1.900	1.722	0,02
7,348 % fällig am 31.10.2027	\$ 10.425	10.479	0,10	5,710 % fällig am 13.01.2030	10.000	10.392	0,10			18.552	0,18
Summe Irland		62.486	0,58	5,716 % fällig am 14.09.2028	5.400	5.595	0,05	STAATSEMISSIONEN			
ISRAEL				5,766 % fällig am 13.01.2033	4.500	4.758	0,04	Mexico Government International Bond			
STAATSEMISSIONEN				6,796 % fällig am 13.01.2026	1.400	1.411	0,01	2,750 % fällig am 27.11.2031 (f) MXN 414.165		21.596	0,20
Israel Government International Bond				Suntory Holdings Ltd.				3,000 % fällig am 03.12.2026 (f) 161.468		8.858	0,08
5,000 % fällig am 30.10.2026	€ 8.500	9.610	0,09	2,250 % fällig am 16.10.2024	900	876	0,01	4,000 % fällig am 30.11.2028 (f) 273.729		15.807	0,15
ITALIEN				Summe Japan		197.459	1,84			46.261	0,43
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				JERSEY, KANALINSELN				Summe Mexiko			
Aeroporti di Roma SpA				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				64.813 0,61			
1,750 % fällig am 30.07.2031	1.700	1.624	0,02	AA Bond Co. Ltd.				MULTINATIONAL			
AMCO - Asset Management Co. SpA				5,500 % fällig am 31.07.2050	€ 7.682	9.306	0,09	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
4,625 % fällig am 06.02.2027	4.609	5.239	0,05	G City Europe Ltd.				Delta Air Lines, Inc.			
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA				4,250 % fällig am 11.09.2025	€ 24.641	25.072	0,23	4,750 % fällig am 20.10.2028	\$ 3.125	3.076	0,03
1,875 % fällig am 09.01.2026	26.749	28.106	0,26	Gatwick Funding Ltd.				NIEDERLANDE			
2,625 % fällig am 28.04.2025	16.100	17.362	0,16	2,500 % fällig am 15.04.2032	€ 300	337	0,00	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
6,750 % fällig am 05.09.2027	13.300	15.384	0,14	2,625 % fällig am 07.10.2048	1.200	986	0,01	ABN AMRO Bank NV			
Intesa Sanpaolo SpA				3,125 % fällig am 28.09.2041	1.600	1.566	0,02	6,575 % fällig am 13.10.2026	10.000	10.170	0,10
4,000 % fällig am 23.09.2029	\$ 10.600	9.658	0,09	Heathrow Funding Ltd.				Achmea Bank NV			
5,017 % fällig am 26.06.2024	5.900	5.841	0,06	1,875 % fällig am 12.07.2032	€ 3.800	3.686	0,04	3,750 % fällig am 19.10.2026	€ 5.500	6.219	0,06
5,710 % fällig am 15.01.2026	14.506	14.444	0,14	2,750 % fällig am 13.10.2031	€ 1.200	1.388	0,01	Arcadis NV			
9,125 % fällig am 07.09.2029 (g)(i) € 9.400	11.451	11.451	0,11	HSBC Bank Capital Funding Sterling LP				4,875 % fällig am 28.02.2028	6.900	7.905	0,07
Mundys SpA				5,844 % fällig am 05.11.2031 (g) 8.867	11.812	11.812	0,11	ASR Nederland NV			
1,625 % fällig am 03.02.2025	4.100	4.407	0,04	Summe Jersey, Kanalinseln		54.153	0,51	3,375 % fällig am 02.05.2049	4.300	4.423	0,04
1,875 % fällig am 13.07.2027	15.770	16.329	0,15	LIBERIA				7,000 % fällig am 07.12.2043	2.600	3.249	0,03
1,875 % fällig am 12.02.2028	1.323	1.346	0,01	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				BMW Finance NV			
Nexi SpA				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				4,125 % fällig am 04.10.2033	3.900	4.650	0,04
2,125 % fällig am 30.04.2029	6.450	6.308	0,06	Altice Financing S.A.				BP Capital Markets BV			
Societa per Azioni Esercizi Aeroportuali SEA SpA				4,250 % fällig am 15.08.2029	€ 1.300	1.279	0,01	4,323 % fällig am 12.05.2035	2.500	2.935	0,03
3,500 % fällig am 09.10.2025 (k) 2.800	3.038			Aroundtown S.A.				Cooperative Rabobank UA			
Telecom Italia SpA				3,000 % fällig am 16.10.2029	€ 1.300	1.200	0,01	4,375 % fällig am 29.06.2027 (g)(i) 19.000	19.705	19.705	0,18
7,875 % fällig am 31.07.2028	18.600	22.883	0,21	5,375 % fällig am 21.03.2029	\$ 16.200	13.354	0,12	CTP NV			
Summe Italien		163.420	1,53	Becton Dickinson Euro Finance SARL				0,500 % fällig am 21.06.2025	9.199	9.583	0,09
				0,334 % fällig am 13.08.2028	€ 4.347	4.235	0,04	1,250 % fällig am 21.06.2029	12.800	11.739	0,11
				1,336 % fällig am 13.08.2041	5.180	3.957	0,04				

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
BESCHREIBUNG				STAATSEMISSIONEN				SLOWAKEI			
Danfoss Finance BV				BNG Bank NV				STAATSEMISSIONEN			
0,125 % fällig am 28.04.2026	€ 2.000	\$ 2.054	0,02	2,375 % fällig am 16.03.2026	\$ 9.200	\$ 8.815	0,08	Slovakia Government International Bond			
Digital Dutch Finco BV				Summe Niederlande		315.431	2,94	1,875 % fällig am 09.03.2037	€ 500	\$ 458	0,00
1,000 % fällig am 15.01.2032	2.600	2.294	0,02	NORWEGEN				SLOWENIEN			
1,250 % fällig am 01.02.2031	12.188	11.291	0,11	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
EnBW International Finance BV				Sparebanken Vest Boligkreditt A/S				Nova Kreditna Banka Maribor d.d.			
3,500 % fällig am 24.07.2028	5.000	5.618	0,05	3,375 % fällig am 15.11.2028	€ 2.000	2.270	0,02	1,875 % fällig am 27.01.2025	10.600	11.657	0,11
2,200 % fällig am 24.01.2035	7.175	8.201	0,08	Var Energi ASA				SÜDAFRIKA			
Enel Finance International NV				8,000 % fällig am 15.11.2032	\$ 9.800	11.018	0,10	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
1,875 % fällig am 12.07.2028	\$ 600	524	0,01	Yara International ASA				AngloGold Ashanti Holdings PLC			
5,500 % fällig am 15.06.2052	5.000	4.732	0,04	4,750 % fällig am 01.06.2028	15.147	14.795	0,14	3,375 % fällig am 01.11.2028	\$ 5.300	4.775	0,05
IMCD NV				Summe Norwegen		28.083	0,26	3,750 % fällig am 01.10.2030	7.800	6.787	0,06
4,875 % fällig am 18.09.2028	€ 4.600	5.330	0,05	PERU				Summe Südafrika		11.562	0,11
Imperial Brands Finance Netherlands BV				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				STAATSEMISSIONEN			
5,250 % fällig am 15.02.2031	7.000	8.015	0,07	Banco de Credito del Peru S.A.				South Africa Government International Bond			
ING Groep NV				4,650 % fällig am 17.09.2024	PEN 9.800	2.571	0,02	10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR 1.231.200	70.481	0,66
6,250 % fällig am 20.05.2033	£ 4.900	6.298	0,06	POLEN				Summe Südafrika		82.043	0,77
JAB Holdings BV				STAATSEMISSIONEN				SÜDKOREA			
1,000 % fällig am 20.12.2027	€ 5.000	5.079	0,05	Poland Government International Bond				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
2,200 % fällig am 23.11.2030	\$ 6.735	5.423	0,05	3,875 % fällig am 14.02.2033	€ 7.300	8.409	0,08	Kookmin Bank			
2,250 % fällig am 19.12.2039	€ 4.800	4.144	0,04	4,250 % fällig am 14.02.2043	2.300	2.680	0,02	4,000 % fällig am 13.04.2027	€ 3.600	4.089	0,04
5,000 % fällig am 12.06.2033	3.300	3.937	0,04	Summe Polen		11.089	0,10	Shinhan Bank Co. Ltd.			
JDE Peet's NV				PORTUGAL				1,183 % fällig am 29.09.2025	AUD 7.200	4.614	0,04
4,125 % fällig am 23.01.2030	8.500	9.669	0,09	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Shinhan Financial Group Co. Ltd.			
4,500 % fällig am 23.01.2034	21.200	24.652	0,23	Banco Santander Totta S.A.				3,340 % fällig am 05.02.2030 (i)	\$ 3.000	2.924	0,03
LeasePlan Corp. NV				3,750 % fällig am 11.09.2026	13.200	14.845	0,14	Summe Südkorea		11.627	0,11
2,875 % fällig am 24.10.2024	\$ 1.020	997	0,01	KATAR				STAATSEMISSIONEN			
7,375 % fällig am 29.05.2024 (g)(i)	€ 1.000	1.111	0,01	STAATSEMISSIONEN				Korea Housing Finance Corp.			
Lseg Netherlands BV				Qatar Government International Bond				4,082 % fällig am 25.09.2027	€ 8.200	9.362	0,09
4,231 % fällig am 29.09.2030	7.000	8.174	0,08	4,400 % fällig am 16.04.2050	\$ 11.100	10.254	0,10	Summe Südkorea		20.989	0,20
Nationale-Niederlanden Bank NV				RUMÄNIEN				SPANIEN			
3,625 % fällig am 16.10.2026	3.400	3.835	0,04	STAATSEMISSIONEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
NE Property BV				Romania Government International Bond				Banco Santander S.A.			
1,875 % fällig am 09.10.2026	3.500	3.540	0,03	1,375 % fällig am 02.12.2029	€ 2.984	2.723	0,02	4,875 % fällig am 18.10.2031	3.200	3.770	0,03
2,000 % fällig am 20.01.2030	7.000	6.224	0,06	1,750 % fällig am 13.07.2030	7.650	6.854	0,06	6,527 % fällig am 07.11.2027	\$ 11.600	12.003	0,11
3,375 % fällig am 14.07.2027	9.111	9.528	0,09	2,125 % fällig am 07.03.2028	7.200	7.234	0,07	CaixaBank S.A.			
NN Group NV				2,625 % fällig am 02.12.2040	22.600	16.854	0,16	3,625 % fällig am 14.09.2028 (g)(i)	€ 5.400	4.620	0,04
4,625 % fällig am 13.01.2048	2.000	2.223	0,02	2,875 % fällig am 13.04.2042	8.200	6.152	0,06	Deutsche Bank S.A. Espanola			
Prosus NV				Summe Rumänien		39.817	0,37	3,625 % fällig am 23.11.2026	2.400	2.700	0,03
1,539 % fällig am 03.08.2028	3.700	3.537	0,03	RUSSLAND				Werfen S.A.			
2,031 % fällig am 03.08.2032	25.387	21.512	0,20	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				4,625 % fällig am 06.06.2028	11.000	12.405	0,12
4,027 % fällig am 03.08.2050	\$ 3.800	2.497	0,02	MMK International Capital DAC				Summe Spanien		35.498	0,33
4,193 % fällig am 19.01.2032	3.800	3.281	0,03	4,375 % fällig am 13.06.2024 ^	\$ 4.900	294	0,00	ÜBERNATIONAL			
Sagax Euro MTN NL BV				SAUDI-ARABIEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
0,750 % fällig am 26.01.2028 (k)	€ 5.817	5.500	0,05	STAATSEMISSIONEN				Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung			
1,000 % fällig am 17.05.2029	1.400	1.267	0,01	Saudi Arabia Government International Bond				1,500 % fällig am 13.02.2025	\$ 5.200	5.017	0,05
1,625 % fällig am 24.02.2026	5.900	6.185	0,06	2,250 % fällig am 02.02.2033	18.705	15.529	0,15	1,625 % fällig am 27.09.2024	400	390	0,00
Sandoz Finance BV				4,750 % fällig am 18.01.2028	52.000	52.599	0,49	Europäische Investitionsbank			
3,970 % fällig am 17.04.2027	7.400	8.344	0,08	4,875 % fällig am 18.07.2033	25.000	25.567	0,24	0,750 % fällig am 15.11.2024	£ 15.196	18.705	0,18
4,220 % fällig am 17.04.2030	600	689	0,01	5,000 % fällig am 18.01.2053	6.000	5.665	0,05	Summe Supranational		24.112	0,23
4,500 % fällig am 17.11.2033	700	822	0,01	Summe Saudi-Arabien		99.360	0,93	SCHWEDEN			
Siemens Energy Finance BV				SINGAPUR				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
4,250 % fällig am 05.04.2029	3.300	3.566	0,03	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd.			
Syngenta Finance NV				1,832 % fällig am 10.09.2030 (i)	13.300	12.516	0,12	1,832 % fällig am 10.09.2030 (i)	13.300	12.516	0,12
4,892 % fällig am 24.04.2025	\$ 5.284	5.216	0,05	SINGAPUR				Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd.			
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				4,750 % fällig am 19.05.2033	4.687	4.699	0,04
3,150 % fällig am 01.10.2026	6.000	5.560	0,05	Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd.				5,110 % fällig am 19.05.2043	18.100	18.047	0,17
Volkswagen Financial Services NV				1,832 % fällig am 10.09.2030 (i)	13.300	12.516	0,12	SP PowerAssets Ltd.			
0,875 % fällig am 20.02.2025	£ 6.400	7.750	0,07	3,000 % fällig am 26.09.2027	2.400	2.282	0,02	3,000 % fällig am 26.09.2027	2.400	2.282	0,02
1,875 % fällig am 03.12.2024	1.800	2.218	0,02	United Overseas Bank Ltd.				1,750 % fällig am 16.03.2031 (i)	3.500	3.231	0,03
Volkswagen International Finance NV				1,750 % fällig am 16.03.2031 (i)	3.500	3.231	0,03	Summe Singapur		40.775	0,38
7,875 % fällig am 06.09.2032 (g)	€ 2.900	3.614	0,03	Summe Singapur		40.775	0,38	SCHWEIZ			
Vonovia Finance BV				STAATSEMISSIONEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
0,500 % fällig am 14.09.2029	400	365	0,00	UBS AG				5,650 % fällig am 11.09.2028	\$ 12.500	12.972	0,12
1,125 % fällig am 14.09.2034	1.000	827	0,01	Summe Südkorea		11.627	0,11				
		306.221	2,86								
NON-AGENCY-MBS											
EMF-NL Prime BV											
4,785 % fällig am 17.04.2041	343	364	0,00								
Eurosail BV											
5,485 % fällig am 17.10.2040	28	31	0,00								
		395	0,00								

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Cleveland Electric Illuminating Co. 3,500 % fällig am 01.04.2028 \$	2.965	\$ 2.779	0,03	Duke Energy Indiana LLC 5,400 % fällig am 01.04.2053 \$	1.218	\$ 1.243	0,01	Glencore Funding LLC 5,400 % fällig am 08.05.2028 \$	500	\$ 510	0,00
CNA Financial Corp. 5,500 % fällig am 15.06.2033	1.000	1.032	0,01	Duke Energy Ohio, Inc. 5,650 % fällig am 01.04.2053	1.868	1.961	0,02	Global Payments, Inc. 4,875 % fällig am 17.03.2031 €	8.600	9.998	0,09
Columbia Pipelines Holding Co. LLC 6,042 % fällig am 15.08.2028	3.400	3.512	0,03	Duke Energy Progress LLC 5,250 % fällig am 15.03.2033	5.283	5.449	0,05	5,950 % fällig am 15.08.2052 \$	2.031	2.074	0,02
Columbia Pipelines Operating Co. LLC 5,927 % fällig am 15.08.2030	2.300	2.380	0,02	Edison International 8,125 % fällig am 15.06.2053	1.230	1.259	0,01	GLP Capital LP 4,000 % fällig am 15.01.2030	1.500	1.370	0,01
6,036 % fällig am 15.11.2033	13.500	14.145	0,13	Enel Finance America LLC 7,100 % fällig am 14.10.2027	2.600	2.776	0,03	4,000 % fällig am 15.01.2031	4.000	3.607	0,03
Comcast Corp. 5,350 % fällig am 15.05.2053	12.889	13.344	0,12	Energy Transfer LP 4,400 % fällig am 15.03.2027	6.745	6.599	0,06	5,300 % fällig am 15.01.2029	15.224	15.145	0,14
ConocoPhillips Co. 5,050 % fällig am 15.09.2033	12.000	12.335	0,12	5,150 % fällig am 01.02.2043	2.294	2.046	0,02	5,375 % fällig am 15.04.2026	5.600	5.569	0,05
Constellation Energy Generation LLC 5,600 % fällig am 01.03.2028	1.500	1.546	0,01	5,150 % fällig am 15.03.2045	7.503	6.896	0,06	5,750 % fällig am 01.06.2028	13.929	14.065	0,13
5,750 % fällig am 01.10.2041	2.500	2.500	0,02	5,300 % fällig am 01.04.2044	4.130	3.809	0,04	Goldman Sachs Group, Inc. 2,383 % fällig am 21.07.2032	4.100	3.370	0,03
6,125 % fällig am 15.01.2034	2.500	2.677	0,03	5,350 % fällig am 15.05.2045	7.181	6.685	0,06	2,600 % fällig am 07.02.2030	4.187	3.681	0,03
Consumers Securitization Funding LLC 5,550 % fällig am 01.03.2028	1.000	1.005	0,01	6,050 % fällig am 01.12.2026	4.200	4.321	0,04	3,272 % fällig am 29.09.2025	15.500	15.240	0,14
Continental Resources, Inc. 2,875 % fällig am 01.04.2032	15.595	12.664	0,12	7,500 % fällig am 01.07.2038	5.257	6.094	0,06	4,223 % fällig am 01.05.2029	19.400	18.779	0,18
5,750 % fällig am 15.01.2031	170	169	0,00	Entergy Louisiana LLC 3,780 % fällig am 01.04.2025	25.100	24.662	0,23	4,482 % fällig am 23.08.2028	17.300	17.002	0,16
Corporate Office Properties LP 2,250 % fällig am 15.03.2026	5.100	4.759	0,04	Entergy Mississippi LLC 5,000 % fällig am 01.09.2033	1.000	1.008	0,01	6,484 % fällig am 15.01.2029	31.500	33.446	0,31
CoStar Group, Inc. 2,800 % fällig am 15.07.2030	5.100	4.340	0,04	Enterprise Products Operating LLC 5,250 % fällig am 16.08.2077	4.739	4.542	0,04	6,811 % fällig am 15.05.2026	14.800	14.899	0,14
Cox Communications, Inc. 5,450 % fällig am 15.09.2028	3.385	3.457	0,03	5,375 % fällig am 15.02.2078	5.614	5.046	0,05	7,250 % fällig am 10.04.2028 £	3.817	5.330	0,05
Credit Acceptance Corp. 9,250 % fällig am 15.12.2028	2.300	2.455	0,02	8,638 % fällig am 16.08.2077	5.838	5.812	0,05	Golub Capital BDC, Inc. 7,050 % fällig am 05.12.2028 \$	3.000	3.148	0,03
Credit Suisse AG AT1 Claim	22.000	2.640	0,02	EPR Properties 4,500 % fällig am 01.04.2025	4.420	4.339	0,04	Goodman U.S. Finance Four LLC 4,500 % fällig am 15.10.2037	7.182	6.144	0,06
Crown Castle Towers LLC 4,241 % fällig am 15.07.2048	5.800	5.508	0,05	4,500 % fällig am 01.06.2027	6.264	5.915	0,06	Goodman U.S. Finance Three LLC 3,700 % fällig am 15.03.2028	15.779	14.702	0,14
Crown Castle, Inc. 2,250 % fällig am 15.01.2031	12.500	10.359	0,10	4,750 % fällig am 15.12.2026	4.425	4.237	0,04	Guardian Life Global Funding 1,100 % fällig am 23.06.2025	3.000	2.833	0,03
3,100 % fällig am 15.11.2029	10.305	9.230	0,09	4,950 % fällig am 15.04.2028	1.986	1.886	0,02	Gulfstream Natural Gas System LLC 4,600 % fällig am 15.09.2025	4.560	4.478	0,04
3,800 % fällig am 15.02.2028	3.765	3.579	0,03	Equipifax, Inc. 5,100 % fällig am 01.06.2028	7.800	7.870	0,07	Haleon U.S. Capital LLC 3,625 % fällig am 24.03.2032	500	461	0,00
3,800 % fällig am 15.02.2029	3.597	3.466	0,03	Equitable Financial Life Global Funding 1,300 % fällig am 12.07.2026	1.000	902	0,01	Hanover Insurance Group, Inc. 4,500 % fällig am 15.04.2026	740	727	0,01
CVS Health Corp. 5,000 % fällig am 30.01.2029	7.000	7.132	0,07	Evergy Missouri West, Inc. 5,150 % fällig am 15.12.2027	2.000	2.014	0,02	HAT Holdings LLC 8,000 % fällig am 15.06.2027	3.950	4.118	0,04
5,250 % fällig am 30.01.2031	18.900	19.396	0,18	Eversource Energy 5,125 % fällig am 15.05.2033	8.300	8.349	0,08	HCA, Inc. 3,500 % fällig am 01.09.2030	7.475	6.778	0,06
5,875 % fällig am 01.06.2053	6.500	6.845	0,06	5,950 % fällig am 01.02.2029	2.000	2.096	0,02	3,500 % fällig am 15.07.2051	3.800	2.681	0,03
CVS Pass-Through Trust 4,704 % fällig am 10.01.2036	202	187	0,00	Exelon Corp. 4,050 % fällig am 15.04.2030	3.417	3.262	0,03	4,125 % fällig am 15.06.2029	3.100	2.966	0,03
5,926 % fällig am 10.01.2034	1.860	1.886	0,02	Expedia Group, Inc. 3,250 % fällig am 15.02.2030	6.708	6.153	0,06	4,500 % fällig am 15.02.2027	3.800	3.757	0,04
6,036 % fällig am 10.12.2028	1.008	1.019	0,01	3,800 % fällig am 15.02.2028	10.805	10.426	0,10	5,500 % fällig am 01.06.2033	22.127	22.484	0,21
7,507 % fällig am 10.01.2032	1.032	1.086	0,01	6,250 % fällig am 01.05.2025	983	993	0,01	HEICO Corp. 5,350 % fällig am 01.08.2033	1.000	1.024	0,01
8,353 % fällig am 10.07.2031	219	237	0,00	Extra Space Storage LP 5,900 % fällig am 15.01.2031	2.800	2.924	0,03	Highwoods Realty LP 2,600 % fällig am 01.02.2031	6.700	5.216	0,05
DAE Funding LLC 1,550 % fällig am 01.08.2024	6.333	6.171	0,06	Fells Point Funding Trust 3,046 % fällig am 31.01.2027	6.150	5.799	0,05	4,200 % fällig am 15.04.2029	2.500	2.265	0,02
1,625 % fällig am 15.02.2024	3.100	3.084	0,03	FirstEnergy Transmission LLC 4,550 % fällig am 01.04.2049	2.083	1.807	0,02	Host Hotels & Resorts LP 2,900 % fällig am 15.12.2031	2.173	1.825	0,02
3,375 % fällig am 20.03.2028	24.600	22.706	0,21	Fiserv, Inc. 3,000 % fällig am 01.07.2031 £	800	916	0,01	3,375 % fällig am 15.12.2029	4.700	4.224	0,04
Daimler Truck Finance North America LLC 1,625 % fällig am 13.12.2024	2.900	2.796	0,03	Flex Intermediate Holdco LLC 3,363 % fällig am 30.06.2031 \$	33.661	27.577	0,26	3,500 % fällig am 15.09.2030	2.600	2.322	0,02
2,000 % fällig am 14.12.2026	7.360	6.774	0,06	Ford Foundation 2,815 % fällig am 01.06.2070	1.600	1.022	0,01	3,875 % fällig am 01.04.2024	8.200	8.157	0,08
Dell International LLC 4,900 % fällig am 01.10.2026	11.010	11.032	0,10	Ford Motor Credit Co. LLC 2,330 % fällig am 25.11.2025 €	5.450	5.852	0,05	4,000 % fällig am 15.06.2025	1.625	1.588	0,01
6,020 % fällig am 15.06.2026	12.036	12.324	0,12	3,021 % fällig am 06.03.2024	13.290	14.639	0,14	Howard Midstream Energy Partners LLC 8,875 % fällig am 15.07.2028	1.000	1.051	0,01
Delta Air Lines, Inc. 2,900 % fällig am 28.11.2024	14.442	14.068	0,13	3,250 % fällig am 15.09.2025	1.400	1.528	0,01	Hudson Pacific Properties LP 3,250 % fällig am 15.01.2030	2.325	1.710	0,02
3,750 % fällig am 28.10.2029	18.900	17.319	0,16	4,535 % fällig am 06.03.2025 £	2.607	3.278	0,03	3,950 % fällig am 01.11.2027	3.500	2.934	0,03
Discovery Communications LLC 2,500 % fällig am 20.09.2024 £	2.400	2.992	0,03	4,675 % fällig am 01.12.2024 €	3.187	3.529	0,03	4,650 % fällig am 01.04.2029	2.700	2.194	0,02
DISH DBS Corp. 5,250 % fällig am 01.12.2026 \$	3.000	2.576	0,02	7,350 % fällig am 06.03.2030 \$	4.600	4.945	0,05	5,950 % fällig am 15.02.2028	2.200	1.947	0,02
5,750 % fällig am 01.12.2028	3.100	2.478	0,02	Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC 7,875 % fällig am 01.12.2030	7.500	7.820	0,07	Humana, Inc. 4,875 % fällig am 01.04.2030	1.000	1.014	0,01
Doctors Co. An Interinsurance Exchange 4,500 % fällig am 18.01.2032	900	718	0,01	Freedom Mortgage Corp. 12,000 % fällig am 01.10.2028	5.800	6.339	0,06	5,875 % fällig am 01.03.2033	5.895	6.283	0,06
DTE Electric Co. 1,900 % fällig am 01.04.2028	4.600	4.142	0,04	FS KKR Capital Corp. 1,650 % fällig am 12.10.2024	9.700	9.362	0,09	Hyundai Capital America 0,875 % fällig am 14.06.2024	12.010	11.739	0,11
5,200 % fällig am 01.04.2033	3.500	3.639	0,03	2,625 % fällig am 15.01.2027	5.211	4.683	0,04	1,500 % fällig am 15.06.2026	9.947	9.088	0,08
Duke Energy Carolinas LLC 4,000 % fällig am 30.09.2042	122	105	0,00	7,875 % fällig am 15.01.2029	600	636	0,01	6,000 % fällig am 11.07.2025	1.200	1.210	0,01
Duke Energy Corp. 3,850 % fällig am 15.06.2034 €	16.000	17.535	0,16	Georgia Power Co. 3,250 % fällig am 15.03.2051	200	145	0,00	6,532 % fällig am 04.08.2025	10.000	9.998	0,09
4,300 % fällig am 15.03.2028 \$	3.613	3.565	0,03	4,950 % fällig am 17.05.2033	5.000	5.044	0,05	Illumina, Inc. 5,750 % fällig am 13.12.2027	2.000	2.054	0,02
								Infor, Inc. 1,750 % fällig am 15.07.2025	4.575	4.316	0,04
								Integrus Baptist Medical Center, Inc. 3,875 % fällig am 15.08.2050	8.200	6.302	0,06
								Intercontinental Exchange, Inc. 3,000 % fällig am 15.09.2060	9.350	6.333	0,06
								Invitation Homes Operating Partnership LP 4,150 % fällig am 15.04.2032	1.500	1.380	0,01

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
5,450 % fällig am 15.08.2030	\$ 3.400	\$ 3.430	0,03	MetLife, Inc.	\$ 7.079	\$ 6.956	0,06	OneMain Finance Corp.	\$ 2.800	\$ 2.837	0,03
5,500 % fällig am 15.08.2033	1.500	1.504	0,01	5,875 % fällig am 15.03.2028 (g)				6,875 % fällig am 15.03.2025	4.900	5.048	0,05
Ipalco Enterprises, Inc.				Metropolitan Edison Co.	6.300	6.152	0,06	ONEOK, Inc.	21.030	20.455	0,19
3,700 % fällig am 01.09.2024	2.858	2.814	0,03	4,000 % fällig am 15.04.2025				4,350 % fällig am 15.03.2029	12.300	13.038	0,12
4,250 % fällig am 01.05.2030	200	185	0,00	Mid-America Apartments LP	2.600	2.360	0,02	6,050 % fällig am 01.09.2033	17.000	19.047	0,18
Jackson National Life Global Funding	600	589	0,01	1,100 % fällig am 15.09.2026	1.811	1.752	0,02	6,625 % fällig am 01.09.2053			
Jefferies Financial Group, Inc.				3,600 % fällig am 01.06.2027	1.857	1.806	0,02	Oracle Corp.	9.300	7.424	0,07
5,875 % fällig am 21.07.2028	3.325	3.411	0,03	Mid-Atlantic Interstate Transmission LLC	4.100	6.901	0,06	3,600 % fällig am 01.04.2040	500	371	0,00
Jersey Central Power & Light Co.				4,100 % fällig am 15.05.2028	7.140	6.901	0,06	3,600 % fällig am 01.04.2050	1.345	977	0,01
4,300 % fällig am 15.01.2026	880	862	0,01	MidAmerican Energy Co.	4.903	4.115	0,04	3,850 % fällig am 01.04.2060	6.600	5.040	0,05
4,700 % fällig am 01.04.2024	3.800	3.787	0,04	3,950 % fällig am 01.08.2047	2.200	2.355	0,02	4,100 % fällig am 25.03.2061 (j)	10.000	10.765	0,10
JetBlue Pass-Through Trust				5,750 % fällig am 01.11.2035				6,150 % fällig am 09.11.2029 (j)	24.500	26.663	0,25
4,000 % fällig am 15.05.2034	884	812	0,01	Midwest Connector Capital Co. LLC	29.977	29.811	0,28	6,250 % fällig am 09.11.2032 (j)			
JPMorgan Chase & Co.				3,900 % fällig am 01.04.2024	5.530	5.550	0,05	Organon & Co.	€ 2.300	2.340	0,02
2,069 % fällig am 01.06.2029	6.600	5.855	0,05	Mileage Plus Holdings LLC				2,875 % fällig am 30.04.2028			
2,301 % fällig am 15.10.2025	33.500	32.650	0,30	6,500 % fällig am 20.06.2027	100	97	0,00	Ovintiv, Inc.	\$ 2.888	2.988	0,03
2,545 % fällig am 08.11.2032	10.000	8.347	0,08	Mississippi Power Co.	2.600	2.222	0,02	6,250 % fällig am 15.07.2033			
2,580 % fällig am 22.04.2032	16.700	14.133	0,13	3,950 % fällig am 30.03.2028	100	97	0,00	Pacific Gas & Electric Co.	500	413	0,00
2,739 % fällig am 15.10.2030	35.800	31.856	0,30	4,250 % fällig am 15.03.2042	2.600	2.222	0,02	2,500 % fällig am 01.02.2031	6.700	6.350	0,06
3,540 % fällig am 01.05.2028	3.100	2.960	0,03	Monongahela Power Co.	150	147	0,00	2,950 % fällig am 01.03.2026	16.330	14.895	0,14
3,702 % fällig am 06.05.2030	9.300	8.758	0,08	5,400 % fällig am 15.12.2043				3,000 % fällig am 15.06.2028	8.009	7.685	0,07
3,782 % fällig am 01.02.2028	3.569	3.449	0,03	Morgan Stanley	46.900	28.508	0,27	3,150 % fällig am 01.01.2026	11.935	11.168	0,10
4,005 % fällig am 23.04.2029	6.100	5.874	0,05	0,000 % fällig am 02.04.2032 (j)	1.100	1.106	0,01	3,300 % fällig am 15.03.2027	15.869	14.825	0,14
4,457 % fällig am 13.11.2031	€ 2.000	2.331	0,02	5,123 % fällig am 01.02.2029	2.315	2.316	0,02	3,400 % fällig am 01.12.2027	9.676	9.518	0,09
4,565 % fällig am 14.06.2030	\$ 8.536	8.359	0,08	5,250 % fällig am 21.04.2034	11.300	11.474	0,11	3,400 % fällig am 15.08.2024	5.877	5.691	0,05
5,350 % fällig am 01.06.2034	14.700	14.918	0,14	5,424 % fällig am 21.07.2034	4.900	4.996	0,05	3,450 % fällig am 01.07.2025	13.400	12.992	0,12
6,070 % fällig am 22.10.2027	16.950	17.443	0,16	5,449 % fällig am 20.07.2029	14.000	14.847	0,14	3,500 % fällig am 15.06.2025	3.300	2.445	0,02
6,087 % fällig am 23.10.2029	10.000	10.519	0,10	6,407 % fällig am 01.11.2029	21.000	21.602	0,20	3,750 % fällig am 15.08.2042	100	73	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.				Morgan Stanley Bank N.A.				4,000 % fällig am 01.12.2046	2.173	1.743	0,02
5,110 % fällig am 08.12.2026	14.650	14.787	0,14	5,882 % fällig am 30.10.2026	700	586	0,01	4,200 % fällig am 01.06.2041	500	393	0,00
Kenvue, Inc.				MSCI, Inc.	2.400	2.174	0,02	4,300 % fällig am 15.03.2045	8.543	6.914	0,06
4,900 % fällig am 22.03.2033	1.100	1.134	0,01	3,250 % fällig am 15.08.2033	100	91	0,00	4,450 % fällig am 15.04.2042	3.400	2.671	0,02
5,000 % fällig am 22.03.2030	400	413	0,00	3,625 % fällig am 01.09.2030	5.350	5.035	0,05	4,500 % fällig am 15.12.2041	1.889	1.581	0,01
5,100 % fällig am 22.03.2043	6.700	6.957	0,06	3,875 % fällig am 15.02.2031	400	412	0,00	4,750 % fällig am 15.02.2044	7.000	7.615	0,07
Kilroy Realty LP				4,000 % fällig am 15.11.2029				6,700 % fällig am 01.04.2053	5.200	5.719	0,05
2,500 % fällig am 15.11.2032	1.100	834	0,01	Nasdaq, Inc.	5.350	5.350	0,05	6,950 % fällig am 15.03.2034			
4,250 % fällig am 15.08.2029	1.000	918	0,01	5,350 % fällig am 28.06.2028				Pacific Life Global Funding	8.000	7.590	0,07
Kinder Morgan, Inc.				National Fuel Gas Co.	3.700	3.103	0,03	1,200 % fällig am 24.06.2025			
7,420 % fällig am 15.02.2037	3.388	3.676	0,03	2,950 % fällig am 01.03.2031	1.800	1.441	0,01	PacificCorp	16.855	16.238	0,15
8,050 % fällig am 15.10.2030	36	42	0,00	National Health Investors, Inc.	8.700	6.911	0,06	5,350 % fällig am 01.12.2053	5.000	4.917	0,05
Kinetik Holdings LP				3,000 % fällig am 01.02.2031	200	265	0,00	5,500 % fällig am 15.05.2054	3.600	3.848	0,04
6,625 % fällig am 15.12.2028	700	714	0,01	Nationwide Financial Services, Inc.				6,250 % fällig am 15.10.2037			
KKR Financial Holdings LLC				3,900 % fällig am 30.11.2049				Pactiv Evergreen Group Issuer LLC	1.700	1.591	0,01
5,400 % fällig am 23.05.2033	10.400	10.053	0,09	Nationwide Mutual Insurance Co.				4,375 % fällig am 15.10.2028			
KKR Group Finance Co. LLC				9,375 % fällig am 15.08.2039				PECO Energy Co.	200	143	0,00
3,625 % fällig am 25.02.2050	1.146	824	0,01	Netflix, Inc.	€ 29.473	33.201	0,31	3,000 % fällig am 15.09.2049			
Kraft Heinz Foods Co.				3,625 % fällig am 15.06.2030	17.481	20.009	0,19	Pennsylvania Electric Co.	6.770	6.287	0,06
4,125 % fällig am 01.07.2027	£ 6.150	7.759	0,07	3,875 % fällig am 15.11.2029				3,600 % fällig am 01.06.2029	2.205	2.163	0,02
4,375 % fällig am 01.06.2046	\$ 24.570	21.470	0,20	Neuberger Berman Group LLC	\$ 12.077	11.586	0,11	4,150 % fällig am 15.04.2025	4.415	4.596	0,04
Las Vegas Sands Corp.				4,500 % fällig am 15.03.2027				6,150 % fällig am 01.10.2038			
3,200 % fällig am 08.08.2024	51.200	50.238	0,47	Newfold Digital Holdings Group, Inc.	1.500	1.615	0,02	PennyMac Financial Services, Inc.	100	103	0,00
3,500 % fällig am 18.08.2026	5.556	5.300	0,05	11,750 % fällig am 15.10.2028				7,875 % fällig am 15.12.2029			
3,900 % fällig am 08.08.2029	3.300	3.045	0,03	NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	2.500	2.220	0,02	Penske Truck Leasing Co. LP	16.854	15.106	0,14
Lazard Group LLC				1,900 % fällig am 15.06.2028	140	121	0,00	3,350 % fällig am 01.11.2029			
4,375 % fällig am 11.03.2029	4.868	4.716	0,04	4,800 % fällig am 01.12.2077	4.229	4.162	0,04	Philip Morris International, Inc.	6.700	7.030	0,07
Lehman Brothers Holdings, Inc.				5,250 % fällig am 28.02.2053	500	472	0,00	5,625 % fällig am 17.11.2029			
0,000 % fällig am 23.12.2010 ^	900	2	0,00	5,650 % fällig am 01.05.2079				Physicians Realty LP	11.672	11.131	0,10
5,259 % fällig am 12.06.2013 ^	€ 2.807	16	0,00	NGPL PipeCo LLC	8.755	8.604	0,08	3,950 % fällig am 15.01.2028	7.400	7.205	0,07
6,875 % fällig am 02.05.2018 ^	\$ 3.000	6	0,00	4,875 % fällig am 15.08.2027				4,300 % fällig am 15.03.2027			
Leidos, Inc.				Nissan Motor Acceptance Co. LLC	15.000	13.496	0,13	Piedmont Natural Gas Co., Inc.	5.000	5.145	0,05
2,300 % fällig am 15.02.2031	1.885	1.579	0,01	1,850 % fällig am 16.09.2026	1.000	1.000	0,01	5,400 % fällig am 15.06.2033	2.394	2.574	0,02
Liberty Mutual Group, Inc.				6,282 % fällig am 08.03.2024				Pioneer Natural Resources Co.			
3,625 % fällig am 23.05.2059	€ 2.800	3.028	0,03	NVR, Inc.	3.000	2.622	0,02	7,200 % fällig am 15.01.2028			
4,569 % fällig am 01.02.2029	\$ 800	783	0,01	3,000 % fällig am 15.05.2030	19.275	19.275	0,18	Plains All American Pipeline LP	1.000	988	0,01
Marriott International, Inc.				Oaktree Specialty Lending Corp.	2.000	1.940	0,02	4,500 % fällig am 15.12.2026	300	316	0,00
3,500 % fällig am 15.10.2032	10.981	9.796	0,09	3,500 % fällig am 25.02.2025				6,700 % fällig am 15.05.2036			
5,550 % fällig am 15.10.2028	2.000	2.064	0,02	Occidental Petroleum Corp.	3.622	3.744	0,04	Principal Life Global Funding	5.600	5.337	0,05
Marvell Technology, Inc.				6,200 % fällig am 15.03.2040	2.000	2.168	0,02	3,000 % fällig am 18.04.2026			
2,450 % fällig am 15.04.2028	14.850	13.410	0,13	6,600 % fällig am 15.03.2046	1.000	1.065	0,01	Progress Energy, Inc.	397	458	0,00
MassMutual Global Funding				6,625 % fällig am 01.09.2030	12.950	15.169	0,14	7,750 % fällig am 01.03.2031			
3,400 % fällig am 08.03.2026	3.700	3.606	0,03	8,875 % fällig am 15.07.2030				3,400 % fällig am 31.01.2030	€ 2.100	2.366	0,02
Merck & Co., Inc.				Oklahoma Gas & Electric Co.	5.400	3.269	0,03	4,250 % fällig am 31.01.2043	5.000	5.584	0,05
5,150 % fällig am 17.05.2063	2.100	2.192	0,02	5,400 % fällig am 15.01.2033				Protective Life Corp.	\$ 21.076	18.665	0,17
Meta Platforms, Inc.				Omega Healthcare Investors, Inc.	4.100	4.079	0,04	3,400 % fällig am 15.01.2030			
5,600 % fällig am 15.05.2053	12.671	13.743	0,13	5,250 % fällig am 15.01.2026				Protective Life Global Funding	1.800	1.851	0,02
MetLife Capital Trust								5,467 % fällig am 08.12.2028			
7,875 % fällig am 15.12.2067	2.995	3.224	0,03								

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Provident Funding Associates LP				Southern Power Co.				3,450 % fällig am 07.01.2030			
6,375 % fällig am 15.06.2025	\$ 4.100	\$ 3.783	0,04	5,250 % fällig am 15.07.2043	\$ 2.800	\$ 2.654	0,02	3,500 % fällig am 01.09.2031	\$ 1.636	\$ 1.462	0,01
Realty Income Corp.				Southwest Airlines Co.				3,700 % fällig am 01.09.2031	4.975	4.360	0,04
2,200 % fällig am 15.06.2028	5.000	4.484	0,04	5,125 % fällig am 15.06.2027	7.412	7.450	0,07	4,000 % fällig am 11.10.2027	1.680	1.606	0,02
4,875 % fällig am 01.06.2026	3.471	3.476	0,03	Spirit AeroSystems, Inc.				4,150 % fällig am 11.10.2025	1.595	1.587	0,01
4,875 % fällig am 06.07.2030	€ 500	586	0,01	3,850 % fällig am 15.06.2026	1.200	1.155	0,01	4,150 % fällig am 25.02.2033	9.530	8.807	0,08
Regency Centers LP				9,375 % fällig am 30.11.2029	4.000	4.382	0,04	4,300 % fällig am 15.02.2027	1.604	1.556	0,01
2,950 % fällig am 15.09.2029	\$ 1.200	1.077	0,01	9,750 % fällig am 15.11.2030	12.990	13.980	0,13	4,550 % fällig am 25.02.2033	946	841	0,01
Reliance Standard Life Global Funding				Spirit Airlines Pass-Through Trust				5,800 % fällig am 15.07.2037	6.500	6.617	0,06
2,750 % fällig am 21.01.2027	6.000	5.520	0,05	4,100 % fällig am 01.10.2029	2.326	2.139	0,02	5,875 % fällig am 15.04.2029	5.488	5.563	0,05
Retail Opportunity Investments Partnership LP				Spirit Realty LP				UnitedHealth Group, Inc.			
6,750 % fällig am 15.10.2028	4.800	5.048	0,05	3,200 % fällig am 15.01.2027	4.800	4.545	0,04	3,875 % fällig am 15.08.2059	200	163	0,00
RGA Global Funding				3,200 % fällig am 15.02.2031	2.245	1.983	0,02	5,875 % fällig am 15.02.2053	22.500	25.504	0,24
6,000 % fällig am 21.11.2028	9.000	9.344	0,09	4,000 % fällig am 15.07.2029	853	810	0,01	6,050 % fällig am 15.02.2063	9.579	11.063	0,10
Rio Oil Finance Trust				4,450 % fällig am 15.09.2026	6.100	5.986	0,06	Venture Global Calcasieu Pass LLC			
8,200 % fällig am 06.04.2028	3.413	3.497	0,03	Sprint Spectrum Co. LLC				3,875 % fällig am 01.11.2033	7.800	6.619	0,06
9,750 % fällig am 06.01.2027	139	144	0,00	4,738 % fällig am 20.09.2029	906	899	0,01	4,125 % fällig am 15.08.2031	400	353	0,00
Rockies Express Pipeline LLC				5,152 % fällig am 20.09.2029	3.400	3.386	0,03	6,250 % fällig am 15.01.2030	39.200	39.040	0,36
4,800 % fällig am 15.05.2030	6.500	5.956	0,06	Standard Industries, Inc.				Venture Global LNG, Inc.			
RTX Corp.				2,250 % fällig am 21.11.2026	€ 14.299	14.985	0,14	8,125 % fällig am 01.06.2028	14.700	14.859	0,14
6,100 % fällig am 15.03.2034	2.700	2.931	0,03	STORE Capital Corp.				8,375 % fällig am 01.06.2031	14.600	14.614	0,14
6,400 % fällig am 15.03.2054	2.400	2.780	0,03	2,750 % fällig am 18.11.2030	\$ 2.000	1.565	0,01	Verizon Communications, Inc.			
S&P Global, Inc.				4,500 % fällig am 15.03.2028	800	736	0,01	2,100 % fällig am 22.03.2028	1.000	905	0,01
4,250 % fällig am 01.05.2029	13.394	13.350	0,12	Stryker Corp.				2,355 % fällig am 15.03.2032	736	612	0,01
4,750 % fällig am 01.08.2028	2.600	2.646	0,02	1,950 % fällig am 15.06.2030	9.550	8.170	0,08	6,218 % fällig am 20.03.2026	782	783	0,01
Sabine Pass Liquefaction LLC				Sun Communities Operating LP				VICI Properties LP			
4,200 % fällig am 15.03.2028	5.700	5.586	0,05	4,200 % fällig am 15.04.2032	3.400	3.105	0,03	3,875 % fällig am 15.02.2029	9.075	8.344	0,08
5,000 % fällig am 15.03.2027	7.300	7.335	0,07	Synchrony Bank				4,250 % fällig am 01.12.2026	5.200	5.008	0,05
5,750 % fällig am 15.05.2024	423	423	0,00	5,625 % fällig am 23.08.2027	7.550	7.427	0,07	4,500 % fällig am 15.01.2028	6.483	6.189	0,06
Sabra Health Care LP				Synchrony Financial				4,625 % fällig am 01.12.2029	2.825	2.665	0,02
3,200 % fällig am 01.12.2031	4.050	3.317	0,03	3,950 % fällig am 01.12.2027	5.066	4.743	0,04	5,750 % fällig am 01.02.2027	2.000	2.007	0,02
Sammons Financial Group, Inc.				System Energy Resources, Inc.				Virginia Electric and Power Co.			
4,450 % fällig am 12.05.2027	700	659	0,01	2,140 % fällig am 09.12.2025	16.809	15.656	0,15	5,000 % fällig am 01.04.2033	4.830	4.889	0,05
San Diego Gas & Electric Co.				T-Mobile USA, Inc.				Vistra Operations Co. LLC			
3,750 % fällig am 01.06.2047	100	80	0,00	2,050 % fällig am 15.02.2028	13.940	12.585	0,12	3,550 % fällig am 15.07.2024	9.500	9.369	0,09
4,100 % fällig am 15.06.2049	3.400	2.809	0,03	2,250 % fällig am 15.11.2031	16.100	13.413	0,13	3,700 % fällig am 30.01.2027	7.817	7.410	0,07
5,350 % fällig am 01.04.2053	2.683	2.720	0,03	2,550 % fällig am 15.02.2031	6.963	6.001	0,06	VMware LLC			
Santander Holdings USA, Inc.				3,300 % fällig am 15.02.2051	2.200	1.591	0,01	1,000 % fällig am 15.08.2024	5.000	4.858	0,05
2,490 % fällig am 06.01.2028	3.895	3.569	0,03	3,875 % fällig am 15.04.2030	13.200	12.521	0,12	3,900 % fällig am 21.08.2027	7.900	7.669	0,07
3,244 % fällig am 05.10.2026	2.500	2.357	0,02	4,800 % fällig am 15.07.2028	8.400	8.475	0,08	4,700 % fällig am 15.05.2030	19.078	18.830	0,18
3,500 % fällig am 07.06.2024	9.500	9.402	0,09	Tapestry, Inc.				Volkswagen Group of America Finance LLC			
4,500 % fällig am 17.07.2025	4.000	3.956	0,04	5,350 % fällig am 27.11.2025	€ 7.000	7.895	0,07	6,366 % fällig am 07.06.2024	1.500	1.502	0,01
SBA Tower Trust				7,350 % fällig am 27.11.2028	\$ 2.000	2.099	0,02	Vornado Realty LP			
1,884 % fällig am 15.07.2050	25.172	23.370	0,22	7,700 % fällig am 27.11.2030	1.700	1.791	0,02	2,150 % fällig am 01.06.2026	700	632	0,01
2,836 % fällig am 15.01.2050	7.009	6.771	0,06	Targa Resources Corp.				Walgreens Boots Alliance, Inc.			
SCE Recovery Funding LLC				6,125 % fällig am 15.03.2033	3.361	3.541	0,03	3,450 % fällig am 01.06.2026	2.000	1.902	0,02
5,112 % fällig am 14.12.2049	3.100	3.073	0,03	6,150 % fällig am 01.03.2029	4.700	4.917	0,05	Warnermidia Holdings, Inc.			
Sempra				TD SYNEXX Corp.				3,755 % fällig am 15.03.2027	1.500	1.438	0,01
4,125 % fällig am 01.04.2052	4.100	3.539	0,03	1,750 % fällig am 09.08.2026	5.950	5.398	0,05	4,279 % fällig am 15.03.2032	5.732	5.248	0,05
5,500 % fällig am 01.08.2033	6.200	6.431	0,06	2,375 % fällig am 09.08.2028	9.836	8.498	0,08	5,141 % fällig am 15.03.2052	9.090	7.808	0,07
SLM Corp.				Teachers Insurance & Annuity Association of America				WEA Finance LLC			
3,125 % fällig am 02.11.2026	900	840	0,01	4,375 % fällig am 15.09.2054	18.016	17.600	0,16	3,750 % fällig am 17.09.2024	7.800	7.662	0,07
4,200 % fällig am 29.10.2025	2.200	2.136	0,02	Time Warner Cable Enterprises LLC				WEC Energy Group, Inc.			
Southern California Edison Co.				8,375 % fällig am 15.07.2033	400	464	0,00	4,750 % fällig am 09.01.2026	7.200	7.175	0,07
2,250 % fällig am 01.06.2030	1.110	953	0,01	Times Square Hotel Trust				Wells Fargo & Co.			
2,500 % fällig am 01.06.2031	4.631	3.971	0,04	8,528 % fällig am 01.08.2026	3.579	3.572	0,03	2,393 % fällig am 02.06.2028	11.500	10.538	0,10
2,750 % fällig am 01.02.2032	1.900	1.636	0,02	Trans-Allegheny Interstate Line Co.				2,406 % fällig am 30.10.2025	5.700	5.546	0,05
2,950 % fällig am 01.02.2051	6.400	4.351	0,04	3,850 % fällig am 01.06.2025	1.157	1.134	0,01	3,196 % fällig am 17.06.2027	5.800	5.547	0,05
3,450 % fällig am 01.02.2052	5.800	4.239	0,04	Transcontinental Gas Pipe Line Co. LLC				3,584 % fällig am 22.05.2028	7.000	6.672	0,06
3,650 % fällig am 01.06.2051	3.598	2.716	0,03	3,250 % fällig am 15.05.2030	5.800	5.260	0,05	4,897 % fällig am 25.07.2033	14.599	14.230	0,13
3,900 % fällig am 01.12.2041	450	367	0,00	TransDigm, Inc.				5,389 % fällig am 24.04.2034	1.600	1.608	0,02
4,000 % fällig am 01.04.2047	11.644	9.517	0,09	6,250 % fällig am 15.03.2026	1.000	999	0,01	5,557 % fällig am 25.07.2034	80.400	81.898	0,76
4,125 % fällig am 01.03.2048	3.755	3.161	0,03	Truist Financial Corp.				5,574 % fällig am 25.07.2029	3.300	3.371	0,03
5,625 % fällig am 01.02.2036	2.053	2.096	0,02	4,873 % fällig am 26.01.2029	4.900	4.831	0,05	6,303 % fällig am 23.10.2029	13.000	13.709	0,13
5,650 % fällig am 01.10.2028	3.100	3.234	0,03	5,122 % fällig am 26.01.2034	1.700	1.647	0,02	West Virginia United Health System Obligated Group			
5,950 % fällig am 01.02.2038	1.490	1.565	0,01	U.S. Airways Pass-Through Trust				3,129 % fällig am 01.06.2050	1.500	994	0,01
6,650 % fällig am 01.04.2029	10.800	11.523	0,11	5,900 % fällig am 01.04.2026	913	913	0,01	Western Midstream Operating LP			
Southern California Gas Co.				U.S. Bancorp				6,350 % fällig am 15.01.2029	6.400	6.688	0,06
5,200 % fällig am 01.06.2033	10.000	10.291	0,10	4,653 % fällig am 01.02.2029	3.500	3.447	0,03	Westinghouse Air Brake Technologies Corp.			
Southern Co.				6,787 % fällig am 26.10.2027	10.200	10.654	0,10	4,150 % fällig am 15.03.2024	8.860	8.824	0,08
1,875 % fällig am 15.09.2081	€ 2.800	2.660	0,02	UDR, Inc.				4,700 % fällig am 15.09.2028	5.471	5.414	0,05
5,200 % fällig am 15.06.2033	\$ 1.000	1.021	0,01	3,000 % fällig am 15.08.2031	7.000	6.189	0,06	Weyerhaeuser Co.			
Southern Co. Gas Capital Corp.				United Airlines Pass-Through Trust				4,000 % fällig am 15.11.2029	1.820	1.741	0,02
1,750 % fällig am 15.01.2031	11.390	9.324	0,09	2,700 % fällig am 01.11.2033	6.406	5.433	0,05	4,750 % fällig am 15.05.2026	12.100	12.049	0,11
3,250 % fällig am 15.06.2026	1.100	1.059	0,01	2,875 % fällig am 07.04.2030	481	431	0,00	6,875 % fällig am 15.12.2033	649	715	0,01
4,400 % fällig am 30.05.2047	600	511	0,00	3,450 % fällig am 01.06.2029	637	593	0,01	7,350 % fällig am 01.07.2026	12.350	12.836	0,12
5,875 % fällig am 15.03.2041	1.567	1.600	0,01					7,375 % fällig am 15.03.2032	2.889	3.356	0,03
								Xcel Energy, Inc.			
								4,600 % fällig am 01.06.2032	17.820	17.387	0,16
								5,450 % fällig am 15.08.2033	6.000	6.191	0,06

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Yellowstone Energy LP				5,500 % fällig am 25.10.2034	\$ 338	\$ 334	0,00	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Pass-Through			
5,750 % fällig am 31.12.2026	\$ 3.883	\$ 3.871	0,04	5,500 % fällig am 25.07.2035	33	14	0,00	Certificates			
Zimmer Biomet Holdings, Inc.				5,500 % fällig am 25.12.2035	194	141	0,00	7,074 % fällig am 25.07.2033	\$ 153	\$ 141	0,00
1,164 % fällig am 15.11.2027	€ 4.220	4.329	0,04	5,930 % fällig am 25.05.2035	4	3	0,00	7,323 % fällig am 25.06.2033	1	1	0,00
2,425 % fällig am 13.12.2026	4.500	4.882	0,05	6,000 % fällig am 25.11.2037	25	10	0,00	Thornburg Mortgage Securities Trust			
Zoetis, Inc.				7,884 % fällig am 20.02.2036	16	14	0,00	3,826 % fällig am 25.09.2037	131	128	0,00
2,000 % fällig am 15.05.2030	\$ 800	689	0,01	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.				Towd Point Mortgage Trust			
				4,631 % fällig am 25.06.2033	4	3	0,00	2,750 % fällig am 25.06.2057	3.640	3.502	0,03
		4.063.793	37,93	Credit Suisse First Boston Mortgage-Backed Pass-Through				3,250 % fällig am 25.07.2056	1.000	972	0,01
				Certificates				WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				4,858 % fällig am 25.07.2033	2	2	0,00	2,909 % fällig am 25.11.2041	158	141	0,00
Avolon TLB Borrower (U.S.) LLC				6,500 % fällig am 25.12.2033	13	12	0,00	4,077 % fällig am 25.03.2035	48	45	0,00
7,708 % fällig am 22.06.2028	10.870	10.894	0,10	Credit Suisse Mortgage Capital Certificates				5,840 % fällig am 25.05.2034	1.484	1.327	0,01
Carnival Corp.				3,834 % fällig am 26.06.2037	4.338	3.970	0,04	6,010 % fällig am 25.12.2045	4	4	0,00
8,357 % fällig am 08.08.2027	6.368	6.392	0,06	Credit Suisse Mortgage Capital Trust				6,012 % fällig am 25.08.2046	6	5	0,00
Catalent Pharma Solutions, Inc.				3,599 % fällig am 27.05.2037	3.572	2.433	0,02	6,090 % fällig am 25.01.2045	12	12	0,00
8,356 % fällig am 22.02.2028	1.200	1.203	0,01	Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust				Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
Charter Communications Operating LLC				5,610 % fällig am 25.07.2047	416	383	0,01	5,850 % fällig am 25.06.2037	3.002	2.779	0,03
7,133 % fällig am 01.02.2027	4.611	4.616	0,04	GSC Capital Corp. Mortgage Trust				5,852 % fällig am 25.11.2046	1.947	1.570	0,02
7,360 % fällig am 07.12.2030	12.000	11.979	0,11	5,830 % fällig am 25.05.2036	367	343	0,00	Washington Mutual MSC Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
Forward Air Corp.				GSMPS Mortgage Loan Trust				4,661 % fällig am 25.06.2033	69	65	0,00
9,856 % fällig am 19.12.2030	8.000	7.607	0,07	5,820 % fällig am 25.01.2036	1.799	1.451	0,01	Wells Fargo Alternative Loan Trust			
SkyMiles IP Ltd.				GSR Mortgage Loan Trust				5,332 % fällig am 25.07.2037	128	115	0,00
9,166 % fällig am 20.10.2027	9.760	10.009	0,10	5,778 % fällig am 25.09.2035	0	0	0,00	6,000 % fällig am 25.03.2037	1.109	871	0,01
		52.700	0,49	6,970 % fällig am 25.04.2032	98	79	0,00	Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust			
				HarborView Mortgage Loan Trust				5,742 % fällig am 25.08.2036	257	242	0,00
KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL				5,573 % fällig am 19.04.2034	5	5	0,00			62.472	0,58
Illinois State General Obligation Bonds, (BABs), Series 2010				5,660 % fällig am 19.08.2037	4.210	3.613	0,04	US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
6,725 % fällig am 01.04.2035	92	97	0,00	5,880 % fällig am 19.12.2036	3.058	2.443	0,02	Fannie Mae			
7,350 % fällig am 01.07.2035	429	466	0,01	6,152 % fällig am 20.06.2035	1.434	1.299	0,01	3,916 % fällig am 01.01.2037	0	0	0,00
Municipal Electric Authority of Georgia Revenue Bonds, (BABs), Series 2010				HomeBanc Mortgage Trust				4,003 % fällig am 01.02.2037	1	1	0,00
6,637 % fällig am 01.04.2057	191	219	0,00	5,970 % fällig am 25.03.2035	248	201	0,00	4,073 % fällig am 01.03.2037	23	23	0,00
New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue Bonds, Series 2010				Impac CMB Trust				4,375 % fällig am 01.03.2037	0	0	0,00
5,267 % fällig am 01.05.2027	2.200	2.242	0,02	6,170 % fällig am 25.03.2035	98	91	0,00	4,520 % fällig am 01.04.2037	0	0	0,00
State Board of Administration Finance Corp., Florida Revenue Notes, Series 2020				IndyMac Mortgage Loan Trust				5,500 % fällig am 25.05.2036	242	246	0,00
1,258 % fällig am 01.07.2025	24.984	23.713	0,22	3,551 % fällig am 25.03.2036	693	503	0,01	5,585 % fällig am 01.12.2034	10	10	0,00
1,705 % fällig am 01.07.2027	6.785	6.147	0,06	JPMorgan Alternative Loan Trust				5,692 % fällig am 25.07.2037	2	2	0,00
		32.884	0,31	5,843 % fällig am 26.05.2037	204	153	0,00	5,802 % fällig am 25.05.2042	22	22	0,00
				JPMorgan Mortgage Trust				5,883 % fällig am 01.10.2036	0	0	0,00
NON-AGENCY-MBS				5,442 % fällig am 25.07.2035	17	15	0,00	6,128 % fällig am 01.06.2043	7	7	0,00
American Home Mortgage Assets Trust				Lehman Mortgage Trust				6,129 % fällig am 01.10.2044	4	4	0,00
5,952 % fällig am 25.10.2046	6.215	4.235	0,04	5,750 % fällig am 25.02.2037	1.421	936	0,01	6,153 % fällig am 01.09.2037	1	1	0,00
Banc of America Funding Trust				MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust				6,352 % fällig am 25.04.2032	0	0	0,00
6,496 % fällig am 20.09.2034	0	0	0,00	5,386 % fällig am 21.11.2034	5	5	0,00	6,451 % fällig am 01.09.2037	2	2	0,00
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust				MASTR Alternative Loan Trust				6,625 % fällig am 15.11.2030	16.854	19.410	0,18
4,782 % fällig am 25.01.2035	305	291	0,00	5,500 % fällig am 25.02.2034	14	13	0,00	Freddie Mac			
5,030 % fällig am 25.08.2035	28	26	0,00	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				1,020 % fällig am 25.08.2029	2.897	125	0,00
5,453 % fällig am 25.02.2034	4	4	0,00	4,340 % fällig am 25.02.2035	16	15	0,00	(a)			
6,035 % fällig am 25.11.2034	106	94	0,00	4,347 % fällig am 25.05.2036	253	227	0,00	3,943 % fällig am 01.01.2037	0	0	0,00
Bear Stearns ALT-A Trust				4,970 % fällig am 25.05.2033	2	2	0,00	4,311 % fällig am 01.03.2037	2	2	0,00
4,196 % fällig am 25.11.2036	387	173	0,00	6,000 % fällig am 25.04.2036	32	14	0,00	4,315 % fällig am 01.03.2036	1	1	0,00
5,790 % fällig am 25.06.2046	2.040	1.801	0,02	6,130 % fällig am 25.06.2028	0	0	0,00	4,410 % fällig am 01.04.2037	0	0	0,00
BWAY Mortgage Trust				6,485 % fällig am 25.01.2029	66	62	0,00	4,500 % fällig am 01.01.2040	26	26	0,00
2,809 % fällig am 10.03.2033	161	157	0,00	MortgageIT Trust				4,660 % fällig am 01.03.2036	0	0	0,00
Chase Mortgage Finance Trust				6,210 % fällig am 25.12.2034	81	78	0,00	5,992 % fällig am 25.11.2055	5.861	3.679	0,03
5,459 % fällig am 25.02.2037	7	7	0,00	NAAC Reperforming Loan REMIC Trust Certificates				6,008 % fällig am 01.10.2038	0	0	0,00
Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates				5,920 % fällig am 25.02.2035	214	172	0,00	6,212 % fällig am 25.02.2045	16	15	0,00
5,700 % fällig am 25.10.2035	57	53	0,00	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust				Ginnie Mae, TBA			
5,750 % fällig am 25.01.2035	58	55	0,00	3,790 % fällig am 15.11.2032	4.300	3.650	0,04	4,000 % fällig am 01.02.2054	3.000	2.867	0,03
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				Residential Accredit Loans, Inc. Trust				Small Business Administration			
5,972 % fällig am 25.09.2035	10	10	0,00	5,890 % fällig am 25.04.2046	5.463	1.545	0,02	4,720 % fällig am 01.02.2024	3	3	0,00
Commercial Mortgage Trust				6,000 % fällig am 25.02.2037	2.466	1.878	0,02	Uniform Mortgage-Backed Security			
3,178 % fällig am 10.02.2035	10.100	9.601	0,09	6,512 % fällig am 25.08.2035	165	135	0,00	3,000 % fällig am 01.06.2042			
Countrywide Alternative Loan Trust				Residential Asset Securitization Trust				- 01.10.2046	33.389	30.702	0,29
5,682 % fällig am 20.07.2046	3.894	3.123	0,03	6,500 % fällig am 25.04.2037	2.122	575	0,01	3,500 % fällig am 01.10.2045	3.183	2.972	0,03
5,750 % fällig am 25.04.2047	562	313	0,00	Sequoia Mortgage Trust				4,000 % fällig am 01.05.2030			
6,030 % fällig am 25.02.2037	35	29	0,00	5,872 % fällig am 20.05.2035	109	98	0,00	- 01.01.2041	164	159	0,00
6,090 % fällig am 25.08.2035	439	388	0,01	6,437 % fällig am 20.05.2034	393	372	0,00	4,500 % fällig am 01.07.2052			
6,170 % fällig am 25.12.2035	1.195	1.010	0,01	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				- 01.01.2053	82.435	79.965	0,75
6,362 % fällig am 25.08.2035	1.597	1.281	0,01	5,121 % fällig am 25.04.2035	181	164	0,00	5,000 % fällig am 01.02.2053	31.321	30.998	0,29
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				Structured Asset Mortgage Investments Trust				Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
4,008 % fällig am 25.01.2036	142	130	0,00	5,850 % fällig am 25.07.2046	164	115	0,00	3,500 % fällig am 01.02.2054	51.600	47.391	0,44
4,765 % fällig am 25.11.2034	16	15	0,00	5,890 % fällig am 25.04.2036	88	78	0,00	4,000 % fällig am 01.01.2054	502.000	475.129	4,43
				5,890 % fällig am 25.05.2036	9	6	0,00	5,000 % fällig am 01.01.2054	108.530	107.390	1,00
				5,970 % fällig am 19.07.2035	1	1	0,00	5,500 % fällig am 01.02.2054	100.000	100.453	0,94
				6,030 % fällig am 25.02.2036	15	12	0,00	6,000 % fällig am 01.02.2054	133.000	135.052	1,26
				6,472 % fällig am 25.03.2046	99	88	0,00	6,500 % fällig am 01.02.2054	15.800	16.191	0,15
										1.052.848	9,82

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	
US-SCHATZobligationen				JUNGFERNINSELN (BRITISCH) UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				INVESTMENTFONDS ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN				
U.S. Treasury Bonds				Champion Path Holdings Ltd.				PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (h)				
1,375 % fällig am 15.11.2040	\$ 29	\$ 19	0,00	4,500 % fällig am 27.01.2026	\$ 9.662	\$ 9.021	0,08		11.356.637	\$ 104.935	0,98	
1,875 % fällig am 15.02.2041	183.662	132.143	1,23	4,850 % fällig am 27.01.2028	13.700	11.777	0,11					
2,000 % fällig am 15.11.2041	14.806	10.715	0,10	CLP Power Hong Kong Financing Ltd.				PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Asia Strategic Interest Bond Fund (h)				
2,250 % fällig am 15.05.2041	67.320	51.312	0,48	2,125 % fällig am 30.06.2030	16.700	14.170	0,13		3.787.451	35.034	0,33	
2,375 % fällig am 15.02.2042	38.663	29.681	0,28	Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd.				PIMCO Funds: Global Investors Series plc - European High Yield Bond Fund (h)				
2,750 % fällig am 15.11.2047	105.800	82.392	0,77	6,125 % fällig am 15.05.2029	3.800	3.905	0,04		3.637.652	45.447	0,42	
3,125 % fällig am 15.08.2044	43	36	0,00	JMH Co. Ltd.				PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (h)				
3,250 % fällig am 15.05.2042	139.903	122.809	1,15	2,500 % fällig am 09.04.2031	4.900	4.175	0,04		59.946.504	597.345	5,58	
3,375 % fällig am 15.08.2042	2.000	1.784	0,02	Summe Jungferneisen (Britisch)				PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (h)				
4,375 % fällig am 15.08.2043	25.400	25.936	0,24						329.257	4.477	0,04	
4,750 % fällig am 15.11.2043	64.200	68.885	0,64	Summe kurzfristige Instrumente				Summe übertragbare Wertpapiere				
U.S. Treasury Inflation Protected Securities (f)				Summe Jungferneisen (Britisch)				Summe übertragbare Wertpapiere				
0,125 % fällig am 15.07.2024	3.628	3.566	0,03			43.048	0,40	\$ 10.091.319		94,18		
0,125 % fällig am 15.10.2024	35.377	34.608	0,32	UNGARISCHE SCHATZWECHSEL				BÖRSENGEHANDELTE FONDS				
0,125 % fällig am 15.04.2025	6.551	6.318	0,06	10,900 % fällig am 04.01.2024 (d)(e)				PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (h)				
0,250 % fällig am 15.01.2025	99.894	96.970	0,91			22.820	0,21		2.587.040	257.980	2,41	
1,125 % fällig am 15.01.2033	13.221	12.517	0,12	Summe kurzfristige Instrumente				Summe Investmentfonds				
1,500 % fällig am 15.02.2053	96.979	88.019	0,82			59.902	0,56		\$ 1.045.218		9,76	
2,375 % fällig am 15.01.2025	16.486	16.358	0,15	Summe übertragbare Wertpapiere				Summe Investmentfonds				
U.S. Treasury STRIPS				Summe übertragbare Wertpapiere				Summe Investmentfonds				
0,000 % fällig am 15.11.2042 (d)	9.000	3.923	0,04									
0,000 % fällig am 15.05.2043 (d)	25	11	0,00									
		788.002	7,36									
AKTIEN												
OPTIONSSCHEINE												
Guaranteed Rate, Inc. - Exp. 31. Dezember 2060												
	7.228	0	0,00									
Summe USA												
		6.097.846	56,91									

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
CEW	4,980	11.12.2023	03.01.2024	CAD 200.000	Province of Ontario 3,650 % fällig am 02.06.2033	\$ (151.161)	\$ 151.676	\$ 152.304	1,41
DEU	5,150	29.12.2023	02.01.2024	\$ 22.200	Province of Quebec 3,250 % fällig am 01.09.2032	(8.415)	22.200	22.213	0,21
FICC	2,600	29.12.2023	02.01.2024	3.237	U.S. Treasury Notes 0,625 % fällig am 15.05.2030	(22.670)	3.237	3.238	0,03
					U.S. Treasury Notes 4,875 % fällig am 30.11.2025	(3.302)	3.237	3.238	0,03
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (185.548)	\$ 177.113	\$ 177.755	1,65

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Canada Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2024	434	\$ 1.788	0,02
Euro-BTP Italy Government Bond March Futures	Long	03.2024	453	2.249	0,02
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Long	03.2024	3.621	15.885	0,15
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Long	03.2024	15	190	0,00
Euro-Schatz March Futures	Long	03.2024	2.192	1.167	0,01
Japan Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2024	71	(600)	(0,01)
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2024	583	1.575	0,02
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Short	03.2024	325	(1.153)	(0,01)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2024	54	(612)	(0,01)
United Kingdom Long Gilt March Futures	Long	03.2024	695	6.036	0,06
				\$ 26.525	0,25
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 26.525	0,25

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

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

Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Toll Brothers Finance Corp.	(1,000) %	20.06.2024	\$ 23.500	\$ (101)	0,00

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

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AES Corp.	5,000 %	20.12.2025	\$ 7.900	\$ (884)	(0,01)
AES Corp.	5,000	20.06.2026	2.400	(244)	0,00
Airbus SE	1,000	20.12.2028	€ 10.300	202	0,00
American International Group, Inc.	1,000	20.12.2027	\$ 8.000	198	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2024	3.400	11	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2024	7.600	(89)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2025	2.000	(9)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2026	54.000	(364)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2026	1.300	(7)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2028	29.600	459	0,00
Atlantia SpA	1,000	20.12.2025	€ 1.800	93	0,00
Boeing Co.	1,000	20.06.2025	\$ 7.000	168	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2025	900	26	0,00
Boeing Co.	1,000	20.06.2026	1.000	20	0,00
BP Capital Markets PLC	1,000	20.12.2025	€ 6.800	(15)	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.06.2028	23.600	379	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2028	1.600	34	0,00
Cellnex Telecom S.A.	5,000	20.12.2030	7.400	164	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.12.2024	\$ 5.000	(360)	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2024	32.050	200	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2024	27.900	545	0,01
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	18.750	87	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2026	2.000	16	0,00
General Motors Co.	5,000	20.12.2026	2.050	(171)	0,00
General Motors Co.	5,000	20.06.2028	2.435	68	0,00
Glencore Finance Europe Ltd.	5,000	20.06.2028	€ 2.700	44	0,00
Hess Corp.	1,000	20.06.2026	\$ 7.000	158	0,00
Lennar Corp.	5,000	20.12.2026	3.200	(254)	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20.06.2028	600	19	0,00
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	1,000	20.06.2026	11.300	(116)	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2024	€ 25.300	(125)	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2024	9.000	30	0,00
Southwest Airlines Co.	1,000	20.12.2026	\$ 3.100	44	0,00
T-Mobile USA, Inc.	5,000	20.06.2028	7.800	69	0,00
Telefonica Emisiones S.A.	1,000	20.06.2028	€ 24.800	293	0,00
Tesco PLC	1,000	20.12.2024	63.700	667	0,01
Tesco PLC	1,000	20.12.2027	1.750	40	0,00
Tesco PLC	1,000	20.06.2028	2.800	32	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2024	\$ 14.400	35	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2026	1.900	(23)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2027	500	16	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2028	9.400	144	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2028	2.300	33	0,00
Vodafone Group PLC	1,000	20.06.2024	€ 12.700	(110)	0,00
Volkswagen International Finance NV	1,000	20.12.2026	4.100	(52)	0,00
Volkswagen International Finance NV	1,000	20.06.2028	1000	14	0,00
Volkswagen International Finance NV	1,000	20.06.2028	11.100	(37)	0,00
				\$ 1.448	0,01

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽²⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-39 5-Year Index	1,000 %	20.12.2027	\$ 1.200	\$ 17	0,00
CDX.IG-40 5-Year Index	1,000	20.06.2028	10.000	60	0,00
CDX.IG-41 5-Year Index	1,000	20.12.2028	1.090.200	7.812	0,07
iTraxx Crossover 40 5-Year Index	5,000	20.12.2028	€ 11.300	576	0,01
				\$ 8.465	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	\$ (3.824)	(0,03)
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,320	20.10.2033	3.000	335	0,00
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	5,000	20.03.2029	71.000	5.173	0,05
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.09.2024	¥ 1.829.900	15	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,300	20.03.2028	1.192.900	60	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	1,000	20.09.2043	4.000.000	865	0,01
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,684	03.01.2034	\$ 4.400	(61)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.12.2028	200	9	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	02.01.2034	4.600	(90)	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,810	02.01.2034	4.600	(114)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,842	26.12.2033	4.900	(132)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,854	29.12.2033	9.000	(253)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,950	19.12.2033	9.200	(329)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2030	CAD 244.800	(11.510)	(0,11)
Erhalt	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	0,000	21.06.2025	17.500	(25)	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,500	01.06.2032	55.400	(1.820)	(0,02)
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,750	20.09.2025	111.000	1.328	0,01
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,750	20.12.2025	381.100	4.356	0,04
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	4,000	21.06.2025	17.500	85	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	20.09.2033	AUD 30.700	1.025	0,01
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	20.03.2034	9.800	442	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	17.03.2053	€ 88.530	40.024	0,37
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,175	17.03.2033	214.110	(47.747)	(0,45)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	10.08.2024	31.200	(1.034)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	12.04.2027	88.900	(5.746)	(0,05)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,700	11.04.2027	5.400	(342)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027	62.700	(3.113)	(0,03)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	18.05.2027	28.000	(1.374)	(0,01)
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	2,760	03.01.2029	7.200	(107)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,950	29.12.2028	6.700	(165)	0,00
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.03.2034	101.600	6.671	0,06
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,250	20.03.2029	58.900	2.382	0,02
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	3,300	03.10.2033	7.400	578	0,01
					\$ (14.438)	(0,13)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ (4.626)	(0,04)

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

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

(3) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

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

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

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

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
FAR	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,600 %	13.12.2024	70.300	\$ 798	\$ 488	0,01
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,975	29.05.2024	119.800	132	46	0,00
							\$ 930	\$ 534	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	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,288 %	19.01.2024	2.800	\$ (12)	\$ (11)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,738	19.01.2024	2.800	(12)	(6)	0,00
BPS	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,494	08.01.2024	4.600	(21)	(34)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,545	16.01.2024	9.300	(42)	(117)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,994	08.01.2024	4.600	(21)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,995	16.01.2024	9.300	(42)	(2)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
CBK	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,235 %	22.01.2024	9,300	\$ (38)	\$ (29)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,685	22.01.2024	9,300	(38)	(27)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,310	18.01.2024	4,200	(16)	(13)	0,00
FAR	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,590	05.01.2024	6,400	(23)	(72)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,700	18.01.2024	4,200	(16)	(12)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,960	05.01.2024	6,400	(23)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,273	16.01.2024	5,000	(21)	(14)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,489	08.01.2024	5,000	(23)	(36)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,550	16.01.2024	5,000	(22)	(64)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,723	16.01.2024	5,000	(21)	(8)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,989	08.01.2024	5,000	(23)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,000	16.01.2024	5,000	(22)	(1)	0,00
GLM	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,195	29.05.2024	59,900	(132)	(222)	(0,01)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,215	22.01.2024	8,800	(36)	(25)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,285	19.01.2024	4,500	(19)	(18)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300	16.01.2024	9,000	(38)	(30)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,560	05.01.2024	9,000	(46)	(95)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,594	05.01.2024	9,000	(45)	(115)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,648	04.01.2024	8,700	(39)	(141)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,665	22.01.2024	8,800	(36)	(28)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,735	19.01.2024	4,500	(19)	(9)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	16.01.2024	9,000	(38)	(13)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,010	05.01.2024	9,000	(46)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,044	05.01.2024	9,000	(45)	0	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,440	08.01.2024	10,300	(23)	(36)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,860	08.01.2024	10,300	(24)	0	0,00
	JPM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,170	29.01.2024	4,800	(21)	(15)
Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap		3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,205	22.01.2024	4,800	(20)	(13)	0,00
Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap		3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	18.01.2024	5,000	(25)	(26)	0,00
Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap		3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,600	12.01.2024	5,000	(23)	(79)	0,00
Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap		3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,620	29.01.2024	4,800	(21)	(25)	0,00
Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap		3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,655	22.01.2024	4,800	(20)	(16)	0,00
Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap		3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	18.01.2024	5,000	(25)	(9)	0,00
Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap		3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,050	12.01.2024	5,000	(23)	(1)	0,00
Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap		6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,490	12.01.2024	6,500	(26)	(50)	0,00
Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap		6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,650	04.01.2024	8,500	(31)	(134)	0,00
Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap		6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,890	12.01.2024	6,500	(26)	(4)	0,00
Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap		6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,030	04.01.2024	8,500	(31)	0	0,00
Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap		3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,455	08.01.2024	9,300	(45)	(53)	0,00
Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap		3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,475	08.01.2024	4,600	(22)	(30)	0,00
Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap		3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,600	12.01.2024	4,900	(22)	(77)	0,00
Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,670	04.01.2024	9,300	(44)	(167)	(0,01)	
Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,955	08.01.2024	9,300	(45)	0	0,00	
Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,975	08.01.2024	4,600	(22)	0	0,00	
Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,050	12.01.2024	4,900	(22)	(1)	0,00	
Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,120	04.01.2024	9,300	(44)	0	0,00	
Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,330	15.01.2024	6,400	(27)	(17)	0,00	
Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,740	15.01.2024	6,400	(27)	(12)	0,00	
UAG	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,344	18.01.2024	4,900	(24)	(25)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,744	18.01.2024	4,900	(24)	(9)	0,00
							\$ (1.682)	\$ (1.941)	(0,02)

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.01.2054	\$ 97,891	09.01.2024	10,300	\$ (40)	\$ (117)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 6,000 % fällig am 01.02.2054	101,094	06.02.2024	8,200	(33)	(66)	0,00
JPM	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 6,000 % fällig am 01.02.2054	99,227	06.02.2024	5,200	(28)	(3)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 6,000 % fällig am 01.02.2054	101,227	06.02.2024	5,200	(19)	(38)	0,00
SAL	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.02.2054	95,813	06.02.2024	10,300	(57)	(46)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.02.2054	97,813	06.02.2024	10,300	(54)	(56)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.01.2054	99,906	09.01.2024	5,100	(13)	(4)	0,00
					\$ (244)	\$ (330)	0,00

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Brazil Government International Bond	1,000 %	20.06.2026	\$ 1.100	\$ (38)	\$ 49	\$ 11	0,00
BRC	NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	1,000	20.12.2025	7.800	170	(80)	90	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2024	31.400	(1.185)	1.372	187	0,00
CBK	Intrum AB	5,000	20.12.2024	€ 3.000	286	(311)	(25)	0,00
DUB	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2025	\$ 5.700	(5)	69	64	0,00
	Equinix, Inc.	5,000	20.06.2027	4.500	629	(98)	531	0,01
GST	Intrum AB	5,000	20.12.2024	€ 15.100	1.696	(1.825)	(129)	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2025	\$ 5.700	(7)	71	64	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.12.2026	1.400	33	(7)	26	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2024	5.700	(229)	263	34	0,00

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
JLN	Intrum AB	5,000 %	20.12.2024	€ 5.000	\$ 560	\$ (602)	\$ (42)	0,00
JPM	Banco do Brasil S.A.	1,000	20.12.2024	\$ 4.400	(99)	97	(2)	0,00
	NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	1,000	20.06.2024	16.300	223	(154)	69	0,00
	NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	1,000	20.12.2024	8.100	112	(54)	58	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2025	7.600	(1)	87	86	0,00
MYC	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2027	15.800	(978)	1.066	88	0,00
	Brookfield Asset Management, Inc.	1,000	20.06.2025	7.900	0	76	76	0,00
	Consolidated Edison Co. of New York, Inc.	1,000	20.12.2024	16.500	323	(175)	148	0,00
	Pioneer Natural Resources Co.	1,000	20.06.2025	8.400	(408)	513	105	0,00
MYI	Intrum AB	5,000	20.12.2024	€ 2.700	311	(334)	(23)	0,00
					\$ 1.393	\$ 23	\$ 1.416	0,01

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BRC	iTraxx Japan 40 5-Year Index	1,000 %	20.12.2028	¥ 2.637.000	\$ 284	\$ 104	\$ 388	0,00
DBL	iTraxx Japan 40 5-Year Index	1,000	20.12.2028	1.332.000	127	69	196	0,00
JPM	iTraxx Japan 40 5-Year Index	1,000	20.12.2028	11.370.000	1.145	528	1.673	0,02
					\$ 1.556	\$ 701	\$ 2.257	0,02

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

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens	
AZD	01.2024	AUD	50.097	\$ 33.186	\$ 0	\$ (1.005)	(0,01)	
BOA	01.2024	COP	135.913.333	\$ 33.790	0	(1.252)	(0,01)	
	01.2024	£	15.319	19.433	0	(96)	0,00	
	01.2024	\$	35.533	COP 135.913.333	0	(490)	0,00	
	01.2024		23.954	¥ 3.534.930	1.135	0	1.135	0,01
	01.2024		3.426	NOK 36.426	161	0	161	0,00
	03.2024	CNH	100	\$ 14	0	0	0,00	
	03.2024	COP	135.913.333	35.020	471	0	471	0,00
	03.2024	PEN	4.550	1.198	0	(28)	(28)	0,00
	03.2024	\$	4.047	INR 338.665	8	0	8	0,00
BPS	01.2024	AUD	34.549	\$ 22.832	0	(747)	(747)	(0,01)
	01.2024	CAD	200.628	148.051	0	(4.104)	(4.104)	(0,04)
	01.2024	DKK	62.549	9.226	0	(45)	(45)	0,00
	01.2024	€	1.401.843	1.542.672	0	(6.229)	(6.229)	(0,06)
	01.2024	£	38.163	48.407	0	(245)	(245)	0,00
	01.2024	HUF	1.247.443	3.546	0	(59)	(59)	0,00
	01.2024	¥	294.300	2.006	0	(83)	(83)	0,00
	01.2024	MXN	62.364	3.401	0	(265)	(265)	0,00
	01.2024	\$	4.895	CAD 6.554	76	0	76	0,00
	01.2024		41.439	€ 37.868	451	(49)	402	0,00
	01.2024		1.859	£ 1.453	0	(7)	(7)	0,00
	01.2024		4	HUF 1.429	0	0	0	0,00
	01.2024	ZAR	602.435	\$ 32.497	0	(402)	(402)	0,00
	03.2024	\$	1.917	IDR 29.550.353	0	(1)	(1)	0,00
	03.2024		14.064	INR 1.176.339	23	0	23	0,00
BRC	01.2024	PLN	1.426	\$ 326	0	(36)	(36)	0,00
	01.2024	\$	2.093	CAD 2.793	25	0	25	0,00
	02.2024		1.205	TRY 36.759	0	(8)	(8)	0,00
	03.2024	SGD	224	\$ 169	0	(2)	(2)	0,00
	03.2024	\$	9	THB 306	0	0	0	0,00
	03.2024		6.122	TRY 192.235	0	(75)	(75)	0,00
	04.2024		6.551	211.086	0	(94)	(94)	0,00
CBK	01.2024	CHF	115	\$ 132	0	(5)	(5)	0,00
	01.2024	COP	131.077.730	33.311	0	(524)	(524)	(0,01)
	01.2024	£	7.248	9.112	0	(128)	(128)	0,00
	01.2024	HUF	606.318	1.731	0	(21)	(21)	0,00
	01.2024	MXN	548.922	30.871	0	(1.399)	(1.399)	(0,01)
	01.2024	\$	4.636	CAD 6.286	132	0	132	0,00
	01.2024		67.606	COP 262.691.763	533	(460)	73	0,00
	01.2024		1.787	€ 1.620	3	0	3	0,00
	01.2024		5.727	£ 4.522	38	0	38	0,00
	01.2024		420	NOK 4.487	22	0	22	0,00
	01.2024	ZAR	264.545	\$ 13.906	0	(543)	(543)	(0,01)
	02.2024	\$	19.892	BRL 99.477	554	0	554	0,01

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
DUB	01.2024	COP	130.876.200	\$ 34.242	\$ 459	\$ 459	0,00	
	01.2024	\$	32.900	COP 130.876.200	883	883	0,01	
	01.2024	ZAR	142	\$ 8	0	0	0,00	
GLM	01.2024	AUD	73.392	48.272	0	(1.817)	(0,02)	
	01.2024	CAD	279.793	205.889	0	(6.325)	(0,06)	
	01.2024	DKK	82.866	12.224	0	(59)	0,00	
	01.2024	MXN	180.377	10.283	0	(321)	0,00	
	01.2024	\$	577	HUF 210.850	31	0	31	0,00
	01.2024		675	MXN 11.766	17	0	17	0,00
JPM	03.2024		3.799	IDR 58.400.847	0	(12)	0,00	
	03.2024		1.336	TRY 41.953	0	(15)	0,00	
	01.2024	HUF	5.276.379	\$ 15.043	0	(204)	0,00	
	03.2024	\$	1.863	IDR 28.761.962	2	0	2	0,00
	03.2024		4.217	INR 352.581	5	0	5	0,00
	03.2024		289	SGD 384	3	0	3	0,00
MBC	06.2024	KRW	326.333	\$ 250	0	(4)	0,00	
	01.2024	AUD	20.405	13.530	0	(396)	0,00	
	01.2024	€	38.644	41.977	0	(721)	(0,01)	
	01.2024	HUF	8.280.310	22.595	0	(1.268)	(0,01)	
	01.2024	¥	290.500	2.038	0	(24)	0,00	
	01.2024	\$	1.794	AUD 2.649	14	0	14	0,00
	01.2024		495	COP 2.000.000	19	0	19	0,00
	01.2024		4.846	£ 3.836	45	0	45	0,00
	01.2024	ZAR	147.042	\$ 7.694	0	(337)	0,00	
	03.2024	\$	2.273	IDR 35.032.549	0	(1)	(1)	0,00
MYI	01.2024	CAD	28.617	\$ 21.700	0	(3)	0,00	
	01.2024	€	1.289	1.429	5	0	5	0,00
	01.2024	£	1.118	1.426	1	0	1	0,00
	01.2024	HUF	527.775	1.500	0	(25)	0,00	
	01.2024	SEK	617	62	1	0	1	0,00
	01.2024	SGD	297	225	0	0	0	0,00
	01.2024	\$	434	CHF 367	2	0	2	0,00
	01.2024		924	€ 832	0	(5)	(5)	0,00
	01.2024		7.196	£ 5.635	0	(13)	(13)	0,00
	01.2024		9.108	¥ 1.342.798	423	0	423	0,00
	01.2024		49	SEK 496	0	0	0	0,00
	01.2024		81	SGD 107	0	0	0	0,00
	01.2024		3.530	ZAR 64.841	12	0	12	0,00
	03.2024		19.756	IDR 303.988.143	0	(43)	(43)	0,00
	06.2024	KRW	44.749	\$ 34	0	0	0	0,00
	RBC	04.2024	MXN	263	15	0	0	0,00
SCX	01.2024	CAD	7.794	5.814	0	(98)	0,00	
	03.2024	\$	1.688	IDR 25.860.271	0	(11)	(11)	0,00
	03.2024		9.179	INR 767.612	14	0	14	0,00
	03.2024		20.396	THB 704.992	396	0	396	0,00
TOR	01.2024		15.054	¥ 2.208.244	619	0	619	0,01
	01.2024	AUD	16.495	\$ 10.944	0	(314)	(314)	0,00
UAG	01.2024	£	207.356	262.414	0	(1.933)	(0,02)	
	01.2024	\$	19.400	NOK 206.943	980	0	980	0,01
	01.2024	ZAR	334.210	\$ 17.508	0	(743)	(0,01)	
				\$ 7.563	\$ (33.094)	\$ (25.531)	(0,24)	

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 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	01.2024	\$	4.900	AUD 7.390	\$ 143	\$ 143	0,00
BOA	01.2024		314	475	10	10	0,00
BPS	01.2024	AUD	120	\$ 82	0	0	0,00
BRC	01.2024		15	10	0	(1)	0,00
CBK	01.2024		7	5	0	0	0,00
GLM	01.2024		7	5	0	0	0,00
MBC	01.2024	\$	1.937	AUD 2.922	57	57	0,00
RYL	01.2024	AUD	3	\$ 2	0	0	0,00
UAG	01.2024	\$	2.361	AUD 3.558	68	68	0,00
				\$ 278	\$ (1)	\$ 277	0,00

Zum 31. Dezember 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
BPS	01.2024	CHF	1.086	\$ 1.265	\$ 0	\$ (26)	0,00
	01.2024	\$	9.324	CHF 7.952	129	0	129

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BRC	01.2024	CHF 889	\$ 1.022	\$ 0	\$ (34)	\$ (34)	0,00
	01.2024	\$ 36.566	CHF 31.858	1.305	0	1.305	0,01
CBK	01.2024	CHF 2.125	\$ 2.455	0	(72)	(72)	0,00
	01.2024	\$ 205.294	CHF 178.856	7.323	0	7.323	0,07
GLM	01.2024	CHF 477	\$ 545	0	(21)	(21)	0,00
	01.2024	\$ 229.994	CHF 201.538	9.587	0	9.587	0,10
MYI	01.2024	229.241	200.109	8.641	0	8.641	0,08
SCX	01.2024	CHF 453	\$ 541	3	0	3	0,00
	01.2024	\$ 6.369	CHF 5.539	216	0	216	0,00
				\$ 27.204	\$ (153)	\$ 27.051	0,26

Zum 31. Dezember 2023 standen fur die Anteilsklasse Institutional CZK (Hedged) ausschuttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
GLM	01.2024	\$ 2.863	CZK 63.389	\$ 0	\$ (27)	\$ (27)	0,00
MYI	01.2024	2.941	65.740	0	0	0	0,00
SCX	01.2024	CZK 1.720	\$ 77	0	0	0	0,00
UAG	01.2024	\$ 2.773	CZK 61.872	0	(6)	(6)	0,00
				\$ 0	\$ (33)	\$ (33)	0,00

Zum 31. Dezember 2023 standen fur die Anteilsklassen Institutional EUR (Currency Exposure) thesaurierend, Institutional USD (Currency Exposure) thesaurierend, Institutional USD (Currency Exposure) ausschuttend, Class E Class EUR (Currency Exposure) ausschuttend und H Institutional USD (Currency Exposure) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
AZD	01.2024	\$ 938	AUD 1.417	\$ 29	\$ 0	\$ 29	0,00
BOA	01.2024	497	752	16	0	16	0,00
	01.2024	814	£ 642	5	0	5	0,00
	01.2024	557	¥ 82.267	26	0	26	0,00
	01.2024	101	NZD 165	4	0	4	0,00
	01.2024	63	SEK 658	2	0	2	0,00
BPS	01.2024	€ 597	\$ 652	0	(8)	(8)	0,00
	01.2024	\$ 7.350	€ 6.744	102	0	102	0,00
	01.2024	1.543	£ 1.216	8	0	8	0,00
	01.2024	905	¥ 133.148	41	0	41	0,00
BRC	01.2024	CHF 0	\$ 0	0	0	0	0,00
CBK	01.2024	€ 136	150	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	SEK 1	0	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 336	CAD 453	7	0	7	0,00
	01.2024	832	€ 771	20	0	20	0,00
	01.2024	347	£ 274	3	0	3	0,00
GLM	01.2024	5.925	CAD 8.052	182	0	182	0,00
	01.2024	845	CHF 741	35	0	35	0,00
MBC	01.2024	€ 114	\$ 124	0	(2)	(2)	0,00
	01.2024	\$ 689	AUD 1.040	20	0	20	0,00
	01.2024	547	CAD 740	15	0	15	0,00
	01.2024	62.577	€ 56.920	314	0	314	0,01
MYI	01.2024	346	CAD 456	0	0	0	0,00
	01.2024	305	£ 239	0	(1)	(1)	0,00
SSB	01.2024	263	209	3	0	3	0,00
UAG	01.2024	8.362	6.607	62	0	62	0,00
				\$ 894	\$ (12)	\$ 882	0,01

Zum 31. Dezember 2023 standen fur die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschuttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Investor EUR (Hedged) ausschuttend, Administrative EUR (Hedged) thesaurierend, Administrative EUR (Hedged) ausschuttend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) ausschuttend, Class R EUR (Hedged) ausschuttend, Class T EUR (Hedged) thesaurierend, Class W EUR (Hedged) thesaurierend und Class W EUR (Hedged) ausschuttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BPS	01.2024	€ 11.546	\$ 12.674	\$ 1	\$ (84)	\$ (83)	0,00
	01.2024	\$ 822.087	€ 747.897	4.269	(2)	4.267	0,04
BRC	01.2024	705.134	641.159	3.285	0	3.285	0,03
CBK	01.2024	€ 712	\$ 769	0	(17)	(17)	0,00
	01.2024	\$ 3.461	€ 3.170	42	0	42	0,00
MBC	01.2024	€ 4.633	\$ 5.072	0	(46)	(46)	0,00
	01.2024	\$ 615.266	€ 562.732	6.499	0	6.499	0,06
				\$ 14.096	\$ (149)	\$ 13.947	0,13

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend, Investor GBP (Hedged) ausschüttend, Administrative GBP (Hedged) ausschüttend, Class E GBP (Hedged) ausschüttend, Class R GBP (Hedged) ausschüttend, Class W GBP (Hedged) thesaurierend und Class W GBP ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2024	£ 14.563	\$ 18.431	\$ 0	\$ (134)	\$ (134)	0,00
	01.2024	\$ 21.326	£ 16.791	79	0	79	0,00
BPS	01.2024	£ 243	\$ 307	0	(3)	(3)	0,00
	01.2024	\$ 354.502	£ 280.582	3.196	0	3.196	0,03
BRC	01.2024	1.327	1.049	11	0	11	0,00
CBK	01.2024	£ 6.815	\$ 8.648	0	(40)	(40)	0,00
	01.2024	\$ 2.330	£ 1.840	16	0	16	0,00
DUB	01.2024	£ 50.541	\$ 63.659	0	(774)	(774)	(0,01)
GLM	01.2024	22	28	0	0	0	0,00
MBC	01.2024	6.141	7.818	0	(11)	(11)	0,00
	01.2024	\$ 1.433	£ 1.126	2	0	2	0,00
MYI	01.2024	4.645	3.680	49	(2)	47	0,00
SCX	01.2024	365.122	288.662	2.876	0	2.876	0,03
SSB	01.2024	£ 13.863	\$ 17.445	0	(228)	(228)	0,00
UAG	01.2024	1.161	1.453	0	(27)	(27)	0,00
	01.2024	\$ 365.046	£ 288.446	2.677	0	2.677	0,02
				\$ 8.906	\$ (1.219)	\$ 7.687	0,07

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilklasse 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	01.2024	\$ 7.002	NOK 74.447	\$ 330	\$ 0	\$ 330	0,00
CBK	01.2024	7.842	83.922	423	0	423	0,00
RYL	01.2024	NOK 20	\$ 2	0	0	0	0,00
UAG	01.2024	\$ 11.334	NOK 120.770	559	0	559	0,01
				\$ 1.312	\$ 0	\$ 1.312	0,01

Zum 31. Dezember 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	01.2024	\$ 79.893	SEK 833.307	\$ 2.814	\$ 0	\$ 2.814	0,03
BRC	01.2024	221	\$ 22	0	0	0	0,00
CBK	01.2024	1.228	118	0	(4)	(4)	0,00
	01.2024	\$ 11.874	SEK 123.909	424	0	424	0,00
GLM	01.2024	SEK 560	\$ 54	0	(2)	(2)	0,00
	01.2024	\$ 30	SEK 315	1	0	1	0,00
MBC	01.2024	46	468	1	0	1	0,00
SCX	01.2024	SEK 314	\$ 30	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	\$ 88.201	SEK 916.038	2.717	0	2.717	0,03
UAG	01.2024	SEK 111	\$ 11	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 89.144	SEK 920.034	2.170	0	2.170	0,02
				\$ 8.127	\$ (7)	\$ 8.120	0,08

Zum 31. Dezember 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
DUB	01.2024	\$ 45.202	SGD 60.087	\$ 363	\$ 0	\$ 363	0,00
GLM	01.2024	SGD 370	\$ 277	0	(4)	(4)	0,00
	01.2024	\$ 1.035	SGD 1.385	16	0	16	0,00
JPM	01.2024	11.095	14.800	128	0	128	0,00
MBC	01.2024	SGD 554	\$ 416	0	(4)	(4)	0,00
	01.2024	\$ 324	SGD 433	4	0	4	0,00
	02.2024	SGD 113	\$ 85	0	(1)	(1)	0,00
	02.2024	\$ 193	SGD 253	0	0	0	0,00
MYI	01.2024	42.159	56.237	486	0	486	0,01
	02.2024	SGD 1.448	\$ 1.098	0	(1)	(1)	0,00
TOR	01.2024	\$ 38.997	SGD 52.032	459	0	459	0,00
	02.2024	SGD 292	\$ 221	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 1.456	\$ (11)	\$ 1.445	0,01

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 37.093 0,35

Summe Anlagen

\$ 11.372.642 106,15

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (658.920) (6,15)

Nettovermögen

\$ 10.713.722 100,00

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
 (b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.
 (c) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.
 (d) Nullkuponwertpapier.
 (e) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
 (f) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
 (g) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
 (h) Mit dem Teilfonds verbunden.
 (i) Bedingt wandelbares Wertpapier.
 (j) 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	\$ 24.742	\$ 20.889	0,20
Morgan Stanley	0,000	02.04.2032	11.02.2020	41.265	28.508	0,27
Oracle Corp.	4,100	25.03.2061	24.03.2021 - 26.03.2021	6.834	5.040	0,05
Oracle Corp.	6,150	09.11.2029	13.07.2023	10.486	10.765	0,10
Oracle Corp.	6,250	09.11.2032	07.11.2022 - 12.07.2023	25.064	26.663	0,25
				\$ 108.391	\$ 91.865	0,87

(k) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 8.265 (31. Dezember 2022: USD 4.048) und Barmittel in Höhe von USD 3.891 (31. Dezember 2022: USD null) waren zum 31. Dezember 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 260 (31. Dezember 2022: USD null) waren zum 31. Dezember 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheiten erhalten worden.

Barmittel in Höhe von USD 177.696 (31. Dezember 2022: USD 213.307) waren zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 8.110 (31. Dezember 2022: USD 55.028) waren zum 31. Dezember 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 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	\$ 10.078.308	\$ 13.011	\$ 10.091.319
Investmentfonds	787.238	257.980	0	1.045.218
Pensionsgeschäfte	0	177.113	0	177.113
Finanzderivate ⁽³⁾	26.715	32.277	0	58.992
Summen	\$ 813.953	\$ 10.545.678	\$ 13.011	\$ 11.372.642

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 1	\$ 9.770.167	\$ 8.376	\$ 9.778.544
Investmentfonds	782.040	256.286	0	1.038.326
Pensionsgeschäfte	0	75.423	0	75.423
Finanzderivate ⁽³⁾	(44.604)	(36.888)	0	(81.492)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(136.255)	0	(136.255)
Summen	\$ 737.437	\$ 9.928.733	\$ 8.376	\$ 10.674.546

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

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

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

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten	
					Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BPS	3,200 %	28.09.2023	TBD ⁽¹⁾	€ (2.248)	\$ (2.504)	(0,03)
	4,050	28.09.2023	TBD ⁽¹⁾	\$ (1.399)	(1.414)	(0,01)
	4,300	22.11.2023	TBD ⁽¹⁾	(335)	(337)	0,00
	4,500	28.09.2023	TBD ⁽¹⁾	(199)	(202)	0,00
BRC	2,500	04.12.2023	TBD ⁽¹⁾	(2.080)	(2.084)	(0,02)
JML	2,000	14.11.2023	TBD ⁽¹⁾	€ (1.162)	(1.287)	(0,01)
Summe umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (7.828)	(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 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
AZD	\$ (833)	\$ 940	\$ 107	\$ 32	\$ 0	\$ 32
BOA	2.872	(3.410)	(538)	5.200	(5.790)	(590)
BOM	k. A.	k. A.	k. A.	360	(470)	(110)
BPS	(4.216)	6.880	2.664	(21.024)	20.550	(474)
BRC	5.041	(8.780)	(3.739)	977	0	977
BSH	k. A.	k. A.	k. A.	(11)	0	(11)
CBK	6.148	(8.080)	(1.932)	36.530	(37.360)	(830)
CLY	k. A.	k. A.	k. A.	24	0	24
DBL	196	0	196	k. A.	k. A.	k. A.
DUB	995	(770)	225	(3.383)	3.210	(173)
FAR	365	(390)	(25)	k. A.	k. A.	k. A.
FBF	k. A.	k. A.	k. A.	189	(250)	(61)
GLM	616	(190)	426	(8.272)	8.408	136
GST	490	(470)	20	1.037	(1.030)	7
JLN	(42)	0	(42)	(237)	0	(237)
JPM	1.401	(1.300)	101	(9.156)	8.080	(1.076)
MBC	4.179	(7.500)	(3.321)	20.345	(19.090)	1.255
MYC	60	0	60	(594)	630	36
MYI	9.504	(11.110)	(1.606)	(342)	280	(62)
RBC	k. A.	k. A.	k. A.	236	(350)	(114)
RYL	k. A.	k. A.	k. A.	14	0	14
SAL	(106)	0	(106)	(90)	0	(90)
SCX	6.112	(7.970)	(1.858)	(14.373)	13.840	(533)
SOG	k. A.	k. A.	k. A.	(88)	30	(58)
SSB	(225)	290	65	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	1.077	(1.020)	57	365	(2.890)	(2.525)
UAG	3.459	(4.341)	(882)	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. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	64,03	63,86
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	30,03	28,59
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,12	0,33
Investmentfonds	9,76	9,85
Pensionsgeschäfte	1,65	0,72
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,25	(0,41)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,04)	(0,44)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,35	0,08
Leerverkaufte Wertpapiere	k. A.	(1,29)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,07)	(0,04)

* Gemäß der Liste der Märkte, die in Anhang 1 zum Prospekt aufgeführt sind und die Kriterien für gemäß OGAW-Vorschriften geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Australien	2,35	1,72
Österreich	0,05	0,21
Belgien	0,14	0,12
Bermuda	0,52	0,66
Brasilien	0,19	0,32
Kanada	2,63	2,14
Cayman-Inseln	3,08	3,29
Chile	0,02	0,06
China	0,17	0,27
Kolumbien	0,08	k. A.
Zypern	k. A.	0,09
Tschechische Republik	0,15	k. A.
Dänemark	0,38	0,30
Finnland	0,27	0,20
Frankreich	3,23	2,51
Deutschland	1,55	1,98
Guernsey, Kanalinseln	0,36	0,33
Hongkong	0,12	0,27
Indien	0,21	0,25
Indonesien	0,16	0,17
Irland	0,58	0,78
Israel	0,09	k. A.
Italien	1,53	2,62
Japan	1,84	1,59
Jersey, Kanalinseln	0,51	0,53
Liberia	0,03	k. A.
Luxemburg	0,90	2,33
Mauritius	0,09	0,37
Mexiko	0,61	0,18
Multinational	0,03	0,03
Niederlande	2,94	2,56
Norwegen	0,26	0,13
Panama	k. A.	0,18
Peru	0,02	1,25
Polen	0,10	k. A.
Portugal	0,14	k. A.
Katar	0,10	0,10
Rumänien	0,37	0,31
Russland	0,00	0,02
Saudi-Arabien	0,93	0,16
Singapur	0,38	0,17
Slowakei	0,00	0,00
Slowenien	0,11	0,10
Südafrika	0,77	0,95
Südkorea	0,20	0,07
Spanien	0,33	0,25
Supranational	0,23	0,22
Schweden	0,16	0,32
Schweiz	1,23	2,23
Thailand	0,07	0,07
Türkei	0,03	0,04
Ukraine	k. A.	0,02
Vereinigte Arabische Emirate	0,07	0,08
Großbritannien	6,00	5,72
USA	56,91	51,20
Jungferninseln (Britisch)	0,40	0,40
Kurzfristige Instrumente	0,56	2,91
Investmentfonds	9,76	9,85
Pensionsgeschäfte	1,65	0,72
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,25	(0,41)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,01	(0,07)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,08	0,01
Zinsswaps	(0,13)	(0,38)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,01	0,45
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	(0,02)	(0,81)
Optionen auf Wertpapiere	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,01	0,03
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,02	0,05
Devisenterminkontrakte	(0,24)	(0,50)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,57	0,86
Leerverkaufte Wertpapiere	k. A.	(1,29)
Sonstige Aktiva und Passiva	(6,15)	(1,29)
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit ESG Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					REGION WALLONNE BELGIUM					TSCHECHISCHE REPUBLIK				
AUSTRALIEN					3,500 % fällig am 15.03.2043					UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL										UniCredit Bank Czech Republic & Slovakia A/S				
APPF Commercial Finance Pty. Ltd.										3,750 % fällig am 20.06.2028				
3,600 % fällig am 11.11.2031					AUD 800 \$ 440 0,02					€ 4.100 \$ 4.633 0,21				
Boral Finance Pty. Ltd.										DÄNEMARK				
3,750 % fällig am 01.05.2028					\$ 52 48 0,00					UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
GAIF Bond Issuer Pty. Ltd.										AP Moller - Maersk A/S				
3,400 % fällig am 30.09.2026					850 805 0,03					5,875 % fällig am 14.09.2033				
Goodman Australia Finance Pty. Ltd.										Danske Bank A/S				
1,375 % fällig am 27.09.2025					€ 400 428 0,02					4,500 % fällig am 09.11.2028				
GPT Wholesale Office Fund										6,259 % fällig am 22.09.2026				
3,222 % fällig am 05.11.2031					AUD 1.740 945 0,04					€ 1.200 1.369 0,06				
Lendlease Finance Ltd.										GN Store Nord A/S				
3,400 % fällig am 27.10.2027					1.370 851 0,04					0,875 % fällig am 25.11.2024				
Macquarie University										5,056 % fällig am 31.05.2028				
2,250 % fällig am 22.05.2030					750 435 0,02					5,618 % fällig am 06.02.2030				
3,500 % fällig am 07.09.2028					250 160 0,01					6,500 % fällig am 01.06.2031				
Sydney Airport Finance Co. Pty. Ltd.										Summe Dänemark				
3,375 % fällig am 30.04.2025					\$ 150 146 0,01					€ 4.200 4.831 0,22				
Transurban Finance Co. Pty. Ltd.										5,618 % fällig am 06.02.2030				
2,450 % fällig am 16.03.2031					2.100 1.749 0,08					6,500 % fällig am 01.06.2031				
4,125 % fällig am 02.02.2026					600 587 0,03					Summe 28.062 1,29				
Vicinity Centres Trust										FINNLAND				
4,927 % fällig am 02.06.2028					AUD 2.500 1.686 0,08					UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Worley Financial Services Pty. Ltd.										Balder Finland Oyj				
5,950 % fällig am 13.10.2028					1.700 1.184 0,05					1,000 % fällig am 20.01.2029				
					9.464 0,43					400 338 0,01				
STAATSEMISSIONEN										Kemira Oyj				
Australia Government International Bond										1,000 % fällig am 30.03.2028				
4,250 % fällig am 21.04.2026					525 363 0,02					1.000 995 0,05				
Summe Australien					9.827 0,45					Nokia Oyj				
ÖSTERREICH										4,375 % fällig am 21.08.2031				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL										2.800 3.117 0,14				
Erste Group Bank AG										Nordea Bank Abp				
0,125 % fällig am 17.05.2028					€ 1.400 1.359 0,06					3,750 % fällig am 01.03.2029				
4,000 % fällig am 16.01.2031					1.000 1.144 0,05					(e)(f)				
4,250 % fällig am 15.10.2027					2.400 2.277 0,11					4,125 % fällig am 05.05.2028				
(e)(f)										€ 2.500 2.855 0,13				
UniCredit Bank Austria AG										6,000 % fällig am 02.06.2026				
3,125 % fällig am 21.09.2029					2.800 3.146 0,15					€ 300 387 0,02				
Summe Österreich					7.926 0,37					Tornator Oyj				
BELGIEN										1,250 % fällig am 14.10.2026				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL										€ 200 207 0,01				
ING Belgium S.A.										Summe Finnland				
3,375 % fällig am 31.05.2027					5.000 5.634 0,26					13.003 0,60				
KBC Bank NV										FRANKREICH				
3,750 % fällig am 28.09.2026					300 340 0,02					UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
KBC Group NV										Altarea S.C.A.				
1,500 % fällig am 29.03.2026					500 537 0,02					1,875 % fällig am 17.01.2028				
4,375 % fällig am 06.12.2031					4.000 4.664 0,22					1.200 1.164 0,05				
5,796 % fällig am 19.01.2029					\$ 400 407 0,02					Arkea Home Loans SFH S.A.				
8,000 % fällig am 05.09.2028					€ 600 706 0,03					3,250 % fällig am 01.08.2033				
(e)(f)										AXA S.A.				
Proximus SADP										1,375 % fällig am 07.10.2041				
4,125 % fällig am 17.11.2033					3.000 3.543 0,16					5,500 % fällig am 11.07.2043				
Silfin NV										2.500 2.965 0,14				
2,875 % fällig am 11.04.2027					2.400 2.488 0,11					Banque Federative du Credit Mutuel S.A.				
Sofina S.A.										0,250 % fällig am 29.06.2028				
1,000 % fällig am 23.09.2028					1.300 1.213 0,06					1,750 % fällig am 19.12.2024				
					19.532 0,90					€ 100 123 0,01				
STAATSEMISSIONEN										4,000 % fällig am 21.11.2029				
Belgium Government International Bond										4,125 % fällig am 18.09.2030				
2,750 % fällig am 22.04.2039					700 755 0,03					4,375 % fällig am 02.05.2030				
Communaute Francaise de Belgique										1.100 1.265 0,06				
0,625 % fällig am 11.06.2035					2.000 1.676 0,08					BNP Paribas Home Loan SFH S.A.				
Ministeries van de Vlaamse Gemeenschap										3,000 % fällig am 31.01.2030				
1,500 % fällig am 11.04.2044					300 244 0,01					BNP Paribas S.A.				
3,250 % fällig am 12.01.2043					2.100 2.302 0,11					1,675 % fällig am 30.06.2027				
4,000 % fällig am 26.09.2042					500 606 0,03					\$ 6.650 6.094 0,28				
										2,219 % fällig am 09.06.2026				
										2,819 % fällig am 19.11.2025				
										1.300 1.267 0,06				
										3,132 % fällig am 20.01.2033				
										1.400 1.191 0,05				
										4,400 % fällig am 14.08.2028				
										2.833 2.763 0,13				
										4,625 % fällig am 25.02.2031				
										(e)(f)				
										2.100 1.697 0,08				
										BPCE S.A.				
										2,045 % fällig am 19.10.2027				
										3,116 % fällig am 19.10.2032				
										3.000 3.090 0,14				
										6,612 % fällig am 19.10.2027				

BESCHREIBUNG	% DES			BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES			BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES			
	MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS				MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS				MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS		
Cie de Financement Foncier S.A. 3,125 % fällig am 17.05.2029	€	4.200	\$ 4.715	0,22	0,250 % fällig am 16.07.2035	€	1.000	\$ 834	0,04					
CNP Assurances SACA 1,250 % fällig am 27.01.2029 4,875 % fällig am 07.10.2030 (e)(f)	\$	800	630	0,03	Summe Frankreich			53.481	2,46					
Credit Agricole Assurances S.A. 1,500 % fällig am 06.10.2031	€	3.400	3.076	0,14	DEUTSCHLAND			143.520	6,61					
Credit Agricole S.A. 0,125 % fällig am 09.12.2027 0,375 % fällig am 21.10.2025 4,375 % fällig am 27.11.2033 5,301 % fällig am 12.07.2028		700	687	0,03	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL									
Electricite de France S.A. 4,625 % fällig am 25.01.2043 5,500 % fällig am 25.01.2035	€	1.500	1.748	0,08	Amprion GmbH 3,875 % fällig am 07.09.2028	€	2.600	2.965	0,14	Hong Kong Government International Bond 2,375 % fällig am 02.02.2051	\$	300	\$ 204	0,01
Engie S.A. 3,625 % fällig am 11.01.2030 4,000 % fällig am 11.01.2035 4,250 % fällig am 11.01.2043	€	1.000	1.136	0,05	Commerzbank AG 3,125 % fällig am 13.06.2033 5,250 % fällig am 25.03.2029		2.400	2.724	0,13	3,750 % fällig am 07.06.2032	€	3.500	4.046	0,18
Holding d'Infrastructures des Metiers de l'Environnement 0,125 % fällig am 16.09.2025		2.000	2.302	0,11	Deutsche Bahn Finance GmbH 4,000 % fällig am 23.11.2043		300	362	0,02	5,250 % fällig am 11.01.2053	\$	3.200	3.612	0,17
Kering S.A. 5,125 % fällig am 23.11.2026	£	900	1.171	0,05	Deutsche Bank AG 1,447 % fällig am 01.04.2025 (g) 1,875 % fällig am 23.02.2028 2,125 % fällig am 24.11.2026 (g)	\$	2.000	1.976	0,09	Summe Hongkong			7.862	0,36
New Immo Holding S.A. 2,750 % fällig am 26.11.2026	€	900	914	0,04	3,211 % fällig am 16.11.2027 2,552 % fällig am 07.01.2028 3,125 % fällig am 19.05.2033 3,547 % fällig am 18.09.2031 3,742 % fällig am 07.01.2033	€	2.500	2.598	0,12	INDIEN				
SEB S.A. 1,500 % fällig am 31.05.2024		200	218	0,01	Deutsche Börse AG 3,875 % fällig am 28.09.2026 3,875 % fällig am 28.09.2033	€	1.500	1.694	0,08	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Societe Generale S.A. 0,500 % fällig am 12.06.2029 2,625 % fällig am 22.01.2025 3,625 % fällig am 01.03.2041 4,000 % fällig am 12.01.2027 6,691 % fällig am 10.01.2034 7,367 % fällig am 10.01.2053 10,000 % fällig am 14.11.2028 (e)(f)	\$	400	384	0,02	E.ON SE 3,875 % fällig am 12.01.2035		1.000	1.152	0,05	IRLAND				
Societe Generale SFH S.A. 3,625 % fällig am 31.07.2026	€	2.800	3.157	0,14	Eurogrid GmbH 3,279 % fällig am 05.09.2031		1.000	1.101	0,05	FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
Suez SACA 5,000 % fällig am 03.11.2032		1.200	1.469	0,07	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 2,125 % fällig am 09.07.2027		400	430	0,02	Cumulus Static CLO DAC 5,499 % fällig am 25.04.2033	€	1.400	1.546	0,07
Vilmorin & Cie S.A. 1,375 % fällig am 26.03.2028		1.200	1.123	0,05	IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK) 3,750 % fällig am 15.09.2026 (b)		300	328	0,01	OCP Euro CLO DAC 5,873 % fällig am 20.01.2033		2.000	2.209	0,10
			90.039	4,15	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,000 % fällig am 15.09.2028 (c)		7.450	7.363	0,34	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
STAATSEMISSIONEN					0,750 % fällig am 30.09.2030 1,375 % fällig am 07.06.2032 2,750 % fällig am 14.02.2033 4,875 % fällig am 03.02.2031	\$	1.100	894	0,04	AIB Group PLC 2,250 % fällig am 04.04.2028 4,625 % fällig am 23.07.2029 5,250 % fällig am 23.10.2031 5,750 % fällig am 16.02.2029		2.800	2.969	0,14
Action Logement Services 1,375 % fällig am 13.04.2032 3,125 % fällig am 28.09.2037 3,625 % fällig am 25.05.2043		2.500	2.461	0,11	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen 1,000 % fällig am 26.05.2042	€	1.700	1.486	0,07	Bank of Ireland Group PLC 4,875 % fällig am 16.07.2028 6,253 % fällig am 16.09.2026 7,594 % fällig am 06.12.2032	\$	250	253	0,01
Agence Francaise de Developpement 1,625 % fällig am 25.05.2032 3,750 % fällig am 20.09.2038		2.000	2.016	0,09	Robert Bosch GmbH 4,375 % fällig am 02.06.2043		1.000	1.188	0,05	CCEP Finance Ireland DAC 0,500 % fällig am 06.09.2029	€	1.900	1.821	0,08
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 1,375 % fällig am 20.01.2031 2,750 % fällig am 25.11.2032 3,000 % fällig am 25.05.2028	\$	6.800	5.641	0,26	Vonovia SE 0,000 % fällig am 01.12.2025 (c)		200	206	0,01	Smurfit Kappa Acquisitions ULC 2,875 % fällig am 15.01.2026		300	327	0,02
Caisse Francaise de Financement Local 3,500 % fällig am 20.03.2029 3,625 % fällig am 17.01.2029	€	1.000	1.113	0,05	2,125 % fällig am 01.09.2028 1,625 % fällig am 01.09.2051		1.900	1.787	0,08	Summe Irland			18.826	0,87
France Government International Bond 0,500 % fällig am 25.06.2044 2,000 % fällig am 25.11.2032		1.200	1.353	0,06	ZF Finance GmbH 2,250 % fällig am 03.05.2028		1.800	1.830	0,08	ITALIEN				
Region of Ile de France 0,675 % fällig am 24.11.2036 3,050 % fällig am 03.02.2033 3,700 % fällig am 14.06.2038		1.900	1.562	0,07	STAATSEMISSIONEN			50.944	2,35	FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
SNCF Réseau 0,750 % fällig am 25.05.2036		500	420	0,02	Land Berlin 2,750 % fällig am 14.02.2033		2.600	2.915	0,14	Koromo Italy SRL 4,676 % fällig am 26.02.2035		1.764	1.954	0,09
Societe Du Grand Paris EPIC 3,500 % fällig am 25.05.2043 3,700 % fällig am 25.05.2053		2.200	2.475	0,11	Land Hessen 2,875 % fällig am 04.07.2033		1.200	1.361	0,06	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Societe Nationale SNCF S.A. 3,125 % fällig am 02.11.2027 3,375 % fällig am 25.05.2033		4.600	5.154	0,24	Land Nordrhein-Westfalen 0,500 % fällig am 25.11.2039 2,900 % fällig am 07.06.2033		200	154	0,01	Intesa Sanpaolo SpA 2,625 % fällig am 11.03.2036 3,625 % fällig am 30.06.2028 3,875 % fällig am 12.01.2028 4,000 % fällig am 23.09.2029 4,198 % fällig am 01.06.2032 4,950 % fällig am 01.06.2042 5,017 % fällig am 26.06.2024 6,625 % fällig am 31.05.2033 6,625 % fällig am 20.06.2033 7,778 % fällig am 20.06.2054 9,125 % fällig am 07.09.2029 (e)(f)	€	1.500	1.827	0,08
UNEDIC ASSEO 0,000 % fällig am 19.11.2030 (c)		300	280	0,01	Summe Deutschland			6.668	0,31	Mundys SpA 1,875 % fällig am 12.02.2028		2.900	2.951	0,14
					GUERNSEY, KANALINSELN			57.612	2,66	ITALIEN				
					UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
					Globalworth Real Estate Investments Ltd. 2,950 % fällig am 29.07.2026		1.850	1.687	0,08	Nexi SpA 2,125 % fällig am 30.04.2029		1.800	1.760	0,08
					Sirius Real Estate Ltd. 1,125 % fällig am 22.06.2026 1,750 % fällig am 24.11.2028		1.100	1.099	0,05	Telecom Italia SpA 7,875 % fällig am 31.07.2028		1.650	2.030	0,09
					Summe Guernsey, Kanalinseln			4.902	0,23					

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit ESG Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS				
UniCredit SpA				CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-				3,649 % fällig am 06.04.2028	\$	3.400	\$	3.243	0,15		
1,982 % fällig am 03.06.2027	\$	1.900	\$	1,739	0,08	SIF Pan European Core Fund		4,875 % fällig am 29.06.2029							
3,500 % fällig am 31.07.2030	€	2.500	2,827	0,13	0,500 % fällig am 27.01.2028	€	600	\$	587	0,03	(e)(f)	€	2.800	2,801	0,13
4,625 % fällig am 12.04.2027	\$	1.000	978	0,05	0,900 % fällig am 12.10.2029	3.700	3.405	0,16	5,250 % fällig am 14.09.2027	€	1.200	1.549	0,07		
5,459 % fällig am 30.06.2035	1.500	1.413	0,07	CPI Property Group S.A.				CTP NV							
7,296 % fällig am 02.04.2034	3.400	3.500	0,16	1,625 % fällig am 23.04.2027	700	570	0,03	0,500 % fällig am 21.06.2025	€	3.800	3.958	0,18			
				1,750 % fällig am 14.01.2030	1.550	979	0,04	0,875 % fällig am 20.01.2026	2.900	2.973	0,14				
				2,750 % fällig am 12.05.2026	1.062	982	0,05	1,250 % fällig am 21.06.2029	500	459	0,02				
				2,750 % fällig am 22.01.2028	€	500	449	0,02	1,500 % fällig am 27.09.2031	2.500	2.157	0,10			
Summe Italien		35.222	1,62	Logicor Financing SARL				Danfoss Finance BV							
				1,625 % fällig am 17.01.2030	€	500	474	0,02	0,125 % fällig am 28.04.2026	1.500	1.540	0,07			
				2,000 % fällig am 17.01.2034				Digital Dutch Finco BV							
				(h)	2.900	2.514	0,12	1,000 % fällig am 15.01.2032	350	309	0,01				
				Segro Capital SARL				1,250 % fällig am 01.02.2031	1.900	1.760	0,08				
				1,875 % fällig am 23.03.2030	950	966	0,04	Digital Intrepid Holding BV							
				SELP Finance SARL				0,625 % fällig am 15.07.2031	1.600	1.390	0,06				
				0,875 % fällig am 27.05.2029	1.950	1.837	0,08	1,375 % fällig am 18.07.2032	1.000	902	0,04				
								EDP Finance BV							
								6,300 % fällig am 11.10.2027	\$	4.100	4.304	0,20			
								EnBW International Finance BV							
								4,300 % fällig am 23.05.2034	€	1.700	1.989	0,09			
								Enel Finance International NV							
								0,375 % fällig am 28.05.2029	1.500	1.429	0,07				
								1,875 % fällig am 12.07.2028	\$	1.700	1.486	0,07			
								2,250 % fällig am 12.07.2031	4.600	3.741	0,17				
								2,650 % fällig am 10.09.2024	200	195	0,01				
								2,875 % fällig am 11.04.2029	€	3.100	3.628	0,17			
								7,750 % fällig am 14.10.2052	\$	2.000	2.465	0,11			
								Holcim Sterling Finance Netherlands BV							
								2,250 % fällig am 04.04.2034	€	1.800	1.777	0,08			
								Iberdrola International BV							
								6,750 % fällig am 15.09.2033	\$	1.200	1.280	0,06			
								ING Groep NV							
								1,250 % fällig am 16.02.2027	€	1.200	1.261	0,06			
								1,400 % fällig am 01.07.2026	\$	1.800	1.695	0,08			
								2,125 % fällig am 23.05.2026	€	2.700	2.919	0,14			
								3,875 % fällig am 16.05.2027							
								(e)(f)	\$	100	81	0,00			
								4,125 % fällig am 24.08.2033	€	2.100	2.332	0,11			
								4,250 % fällig am 16.05.2031							
								(e)(f)	\$	500	365	0,02			
								4,252 % fällig am 28.03.2033	2.200	2.064	0,10				
								6,500 % fällig am 16.04.2025							
								(e)(f)							
								JAB Holdings BV							
								4,500 % fällig am 08.04.2052	4.800	3.756	0,17				
								5,000 % fällig am 12.06.2033	€	200	239	0,01			
								JDE Peet's NV							
								1,125 % fällig am 16.06.2033	300	267	0,01				
								2,250 % fällig am 24.09.2031	\$	2.050	1.643	0,08			
								4,125 % fällig am 23.01.2030	€	800	910	0,04			
								LeasePlan Corp. NV							
								0,250 % fällig am 07.09.2026	3.500	3.556	0,16				
								Lseg Netherlands BV							
								4,125 % fällig am 29.09.2026	1.500	1.701	0,08				
								4,231 % fällig am 29.09.2030	2.300	2.686	0,12				
								Mondelez International Holdings Netherlands BV							
								0,250 % fällig am 09.09.2029	2.000	1.907	0,09				
								Nationale-Nederlanden Bank NV							
								0,500 % fällig am 21.09.2028	3.200	3.124	0,14				
								1,875 % fällig am 17.05.2032	500	514	0,02				
								3,250 % fällig am 28.05.2027	2.000	2.245	0,10				
								NE Property BV							
								2,000 % fällig am 20.01.2030	4.200	3.734	0,17				
								3,375 % fällig am 14.07.2027	600	627	0,03				
								NN Group NV							
								4,500 % fällig am 15.01.2026							
								(e)	200	221	0,01				
								4,625 % fällig am 13.01.2048	200	222	0,01				
								OCI NV							
								6,700 % fällig am 16.03.2033	\$	2.000	2.044	0,09			
								Prosus NV							
								2,085 % fällig am 19.01.2030	€	1.300	1.204	0,06			
								2,778 % fällig am 19.01.2034	200	173	0,01				
								3,257 % fällig am 19.01.2027	\$	2.200	2.033	0,09			
								Sandoz Finance BV							
								4,220 % fällig am 17.04.2030	€	2.900	3.329	0,15			
								Sartorius Finance BV							
								4,250 % fällig am 14.09.2026	600	678	0,03				
								4,375 % fällig am 14.09.2029	500	573	0,03				
								Siemens Energy Finance BV							
								4,000 % fällig am 05.04.2026	2.500	2.732	0,13				

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Sika Capital BV	€ 2.000	\$ 2.248	0,10	RUMÄNIEN				SPANIEN			
3,750 % fällig am 03.11.2026				STAATSEMISSIONEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Stedin Holding NV	100	95	0,01	Romania Government International Bond	€ 500	\$ 456	0,02	Acciona Energia Financiacion Filiales S.A.	€ 3.400	\$ 3.972	0,18
0,500 % fällig am 14.11.2029				1,375 % fällig am 02.12.2029				5,125 % fällig am 23.04.2031			
Telefonica Europe BV	1.500	1.708	0,08	1,750 % fällig am 13.07.2030	2.500	2.240	0,10	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.			
6,135 % fällig am 03.02.2030 (e)				2,625 % fällig am 02.12.2040	3.400	2.536	0,12	5,862 % fällig am 14.09.2026	\$ 1.200	1.206	0,05
TenneT Holding BV	1.000	1.201	0,06	3,750 % fällig am 07.02.2034	900	858	0,04	6,138 % fällig am 14.09.2028	1.000	1.028	0,05
4,250 % fällig am 28.04.2032				4,625 % fällig am 03.04.2049	100	93	0,01	Banco Santander S.A.			
Thermo Fisher Scientific Finance BV	700	586	0,03	5,000 % fällig am 27.09.2026	400	454	0,02	0,625 % fällig am 24.06.2029	€ 800	784	0,04
1,625 % fällig am 18.10.2041				Summe Rumänien		6.637	0,31	3,490 % fällig am 28.05.2030	\$ 200	180	0,01
Universal Music Group NV	600	694	0,03	SERBIEN				3,625 % fällig am 21.03.2029 (e)(f)	€ 600	497	0,02
4,000 % fällig am 13.06.2031				STAATSEMISSIONEN				4,125 % fällig am 12.11.2027 (e)(f)	€ 1.000	949	0,04
Van Lanschot Kempen NV	1.000	1.119	0,05	Serbia Government International Bond	1.500	1.402	0,06	4,175 % fällig am 24.03.2028	\$ 1.000	963	0,04
3,500 % fällig am 31.05.2026				1,000 % fällig am 23.09.2028	400	328	0,02	4,375 % fällig am 14.01.2026 (e)(f)	€ 400	408	0,02
Vesteda Finance BV	5.300	4.716	0,22	1,650 % fällig am 03.03.2033				4,875 % fällig am 18.10.2031	700	825	0,04
0,750 % fällig am 18.10.2031				Summe Serbien		1.730	0,08	6,921 % fällig am 08.08.2033	\$ 5.000	5.333	0,24
Vonovia Finance BV	100	91	0,00	SINGAPUR				Bankinter S.A.			
0,500 % fällig am 14.09.2029	200	166	0,01	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				0,625 % fällig am 06.10.2027	€ 1.000	1.007	0,05
1,125 % fällig am 14.09.2034				Clean Renewable Power Mauritius Pte. Ltd.	\$ 1.170	1.070	0,05	CaixaBank S.A.			
Wabtec Transportation Netherlands BV	4.200	4.283	0,20	4,250 % fällig am 25.03.2027				0,625 % fällig am 21.01.2028	3.000	3.060	0,14
1,250 % fällig am 03.12.2027				Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd.	1.250	1.263	0,06	0,750 % fällig am 10.07.2026	600	637	0,03
WPC Eurobond BV	300	304	0,01	5,340 % fällig am 19.05.2063				1,500 % fällig am 03.12.2026	£ 700	831	0,04
1,350 % fällig am 15.04.2028				SingTel Group Treasury Pte. Ltd.	900	878	0,04	4,625 % fällig am 16.05.2027	€ 1.000	1.128	0,05
		137.347	6,33	3,875 % fällig am 28.08.2028				5,375 % fällig am 14.11.2030	100	119	0,01
				United Overseas Bank Ltd.				5,875 % fällig am 09.10.2027 (e)(f)	800	858	0,04
				3,863 % fällig am 07.10.2032 (f)	4.000	3.827	0,17	Caja Rural de Navarra SCC			
NON-AGENCY-MBS				Summe Singapur		7.038	0,32	3,000 % fällig am 26.04.2027	1.700	1.882	0,09
Green Lion BV	4.900	5.429	0,25	SÜDKOREA				Cellnex Finance Co. S.A.			
4,440 % fällig am 23.07.2065				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				3,875 % fällig am 07.07.2041	\$ 1.000	776	0,04
Green Storm BV	200	223	0,01	Hana Bank	€ 7.500	8.385	0,39	Telefonica Emisiones S.A.			
4,712 % fällig am 22.02.2068				3,750 % fällig am 04.05.2026				4,183 % fällig am 21.11.2033	€ 3.100	3.603	0,17
		5.652	0,26	KB Kookmin Card Co. Ltd.	\$ 2.600	2.381	0,11	Werfen S.A.			
				1,500 % fällig am 13.05.2026				4,625 % fällig am 06.06.2028	2.200	2.481	0,11
STAATSEMISSIONEN				Kodit Global Co. Ltd.	3.700	3.693	0,17			32.527	1,50
BNG Bank NV	700	669	0,03	4,954 % fällig am 25.03.2026				STAATSEMISSIONEN			
0,050 % fällig am 20.11.2029	500	530	0,02	Kookmin Bank	900	750	0,03	Autonomous Community of Andalusia			
0,500 % fällig am 26.11.2025	5.000	5.647	0,26	2,500 % fällig am 04.11.2030 (f)	€ 2.000	2.272	0,11	3,950 % fällig am 30.04.2033	2.500	2.918	0,13
3,000 % fällig am 11.01.2033	14.000	16.171	0,75	4,000 % fällig am 13.04.2027				Junta de Castilla y Leon			
3,250 % fällig am 29.08.2033	\$ 1.600	1.562	0,07	LG Energy Solution Ltd.	\$ 2.100	2.166	0,10	3,500 % fällig am 30.04.2033	1.400	1.577	0,07
3,500 % fällig am 19.05.2028				5,750 % fällig am 25.09.2028				Spain Government International Bond			
Nederlandse Waterschapsbank NV	€ 2.000	1.622	0,08	Shinhan Bank Co. Ltd.	AUD 1.100	705	0,03	1,000 % fällig am 30.07.2042	3.170	2.344	0,11
0,125 % fällig am 03.09.2035	500	559	0,03	1,183 % fällig am 29.09.2025	\$ 1.100	1.028	0,05	Xunta de Galicia			
2,750 % fällig am 17.12.2029	6.500	7.396	0,34	4,000 % fällig am 23.04.2029 (f)	2.200	2.040	0,09	0,084 % fällig am 30.07.2027	150	151	0,01
3,000 % fällig am 20.04.2033	5.600	6.278	0,29	4,375 % fällig am 13.04.2032 (f)	AUD 1.500	1.042	0,05			6.990	0,32
Netherlands Government International Bond	2.150	2.645	0,12	6,338 % fällig am 16.11.2025				Summe Spanien		39.517	1,82
2,500 % fällig am 15.07.2033				Shinhan Financial Group Co. Ltd.	\$ 300	279	0,01	SUPRANATIONAL			
3,250 % fällig am 15.01.2044				1,350 % fällig am 10.01.2026	900	900	0,04	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Summe Niederlande		188.733	8,70	5,000 % fällig am 24.07.2028				Asian Development Bank			
				SK Hynix, Inc.	600	599	0,03	1,500 % fällig am 04.05.2028	CAD 2.000	1.393	0,06
NEUSEELAND				1,000 % fällig am 19.01.2024	1.000	812	0,04	6,550 % fällig am 26.01.2025	ZAR 64.000	3.417	0,16
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				2,375 % fällig am 19.01.2031	3.400	3.511	0,16	Banque Ouest Africaine de Developpement			
ANZ New Zealand International Ltd.	500	566	0,03	6,375 % fällig am 17.01.2028				2,750 % fällig am 22.01.2033	€ 3.800	3.233	0,15
3,951 % fällig am 17.07.2026				STAATSEMISSIONEN				Eurofima Europäische Gesellschaft fuer die Finanzierung von Eisenbahnmaterial			
NORWEGEN				Export-Import Bank of Korea	2.000	1.680	0,08	0,000 % fällig am 28.07.2026 (c)	1.000	1.032	0,05
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Korea Expressway Corp.	1.000	917	0,04	3,125 % fällig am 09.11.2031	3.200	3.660	0,17
DNB Bank ASA	2.400	2.432	0,11	1,125 % fällig am 17.05.2026				Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung			
0,375 % fällig am 18.01.2028	2.700	3.138	0,14	Korea Housing Finance Corp.	€ 400	425	0,02	1,500 % fällig am 13.02.2025	\$ 880	849	0,04
4,625 % fällig am 01.11.2029				0,010 % fällig am 05.02.2025	\$ 2.200	2.197	0,10	1,625 % fällig am 27.09.2024	500	488	0,02
Statkraft A/S	500	557	0,03	4,625 % fällig am 24.02.2028				Europäische Investitionsbank			
3,125 % fällig am 13.12.2031				Korea Land & Housing Corp.	3.000	3.035	0,14	0,750 % fällig am 15.07.2027	AUD 2.100	1.275	0,06
Summe Norwegen		6.127	0,28	5,750 % fällig am 06.10.2025				1,500 % fällig am 15.06.2032	€ 3.000	3.056	0,14
PERU				Korea Water Resources Corp.	3.500	3.432	0,16	Europäische Union			
STAATSEMISSIONEN				3,500 % fällig am 27.04.2025				0,000 % fällig am 04.11.2025 (c)	1.400	1.478	0,07
Peru Government International Bond	2.000	1.673	0,08	Summe Südkorea		42.249	1,95	0,000 % fällig am 04.10.2030 (c)	3.700	3.473	0,16
1,950 % fällig am 17.11.2036								0,000 % fällig am 04.07.2035 (c)	1.700	1.372	0,06
POLEN								0,300 % fällig am 04.11.2050	1.900	1.078	0,05
STAATSEMISSIONEN								0,400 % fällig am 04.02.2037	2.150	1.759	0,08
Poland Government International Bond	\$ 1.500	1.524	0,07					1,250 % fällig am 04.02.2043	8.000	6.626	0,31
4,875 % fällig am 04.10.2033								2,625 % fällig am 04.02.2048	5.160	5.310	0,24
								2,750 % fällig am 04.02.2033	2.370	2.653	0,12
								2,750 % fällig am 04.12.2037	25.300	27.451	1,26

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit ESG Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	% DES			BESCHREIBUNG	% DES			BESCHREIBUNG	% DES			
	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS		PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS		PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	
Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung				British Telecommunications PLC				NatWest Group PLC				
0,125 % fällig am 03.01.2051	€ 1.600	\$ 844	0,04	3,250 % fällig am 08.11.2029	\$ 700	\$ 640	0,03	0,780 % fällig am 26.02.2030	€ 1.200	\$ 1.144	0,05	
2,900 % fällig am 19.01.2033	2.400	2.717	0,13	Brookfield Finance UK PLC				2,000 % fällig am 04.03.2025	300	330	0,02	
3,100 % fällig am 14.04.2038	2.900	3.295	0,15	2,340 % fällig am 30.01.2032	3.000	2.400	0,11	2,057 % fällig am 09.11.2028	£ 1.900	2.164	0,10	
		76.459	3,52	Burberry Group PLC				4,269 % fällig am 22.03.2025	\$ 2.500	2.492	0,11	
STAATSEMISSIONEN				1,125 % fällig am 21.09.2025	£ 500	597	0,03	4,600 % fällig am 28.06.2031		1.200	904	0,04
Europäische Union				Cadent Finance PLC				(e)(f)	€ 3.000	3.414	0,16	
4,000 % fällig am 04.04.2044	3.900	4.886	0,23	4,250 % fällig am 05.07.2029	€ 800	924	0,04	4,699 % fällig am 14.03.2028	€ 3.000	3.414	0,16	
Summe Supranational		81.345	3,75	5,750 % fällig am 14.03.2034	£ 1.500	1.996	0,09	4,771 % fällig am 16.02.2029	900	1.034	0,05	
				Chanel Ceres PLC				4,892 % fällig am 18.05.2029	\$ 1.200	1.180	0,05	
SCHWEDEN				0,500 % fällig am 31.07.2026	€ 800	824	0,04	5,125 % fällig am 12.05.2027		£ 400	459	0,02
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				1,000 % fällig am 31.07.2031	2.801	2.610	0,12	(e)(f)	\$ 3.800	3.936	0,18	
EQT AB				Clarion Funding PLC				NatWest Markets PLC				
0,875 % fällig am 14.05.2031	3.200	2.821	0,13	1,250 % fällig am 13.11.2032	£ 700	674	0,03	5,899 % fällig am 23.08.2028	AU 900	629	0,03	
2,375 % fällig am 06.04.2028	1.000	1.045	0,05	1,875 % fällig am 22.01.2035	200	190	0,01					
2,875 % fällig am 06.04.2032	3.000	2.964	0,14	CSL Finance PLC				Peabody Capital PLC				
Sagax AB				4,250 % fällig am 27.04.2032	\$ 1.100	1.073	0,05	2,750 % fällig am 02.03.2034	£ 500	529	0,02	
1,125 % fällig am 30.01.2027	800	796	0,04	Derwent London PLC				Pearson Funding PLC				
Skandinaviska Enskilda Banken AB				1,875 % fällig am 17.11.2031	£ 2.700	2.744	0,13	3,750 % fällig am 04.06.2030	500	595	0,03	
4,000 % fällig am 09.11.2026	1.500	1.687	0,08	Direct Line Insurance Group PLC				Pinnacle Bidco PLC				
Svenska Handelsbanken AB				4,000 % fällig am 05.06.2032	300	312	0,01	8,250 % fällig am 11.10.2028	€ 2.000	2.303	0,11	
0,125 % fällig am 03.11.2026	300	305	0,01	DS Smith PLC				Places for People Treasury PLC				
		9.618	0,45	4,375 % fällig am 27.07.2027	€ 1.300	1.479	0,07	2,500 % fällig am 26.01.2036	£ 2.200	2.119	0,10	
STAATSEMISSIONEN				ENW Finance PLC				6,250 % fällig am 06.12.2041	2.300	3.161	0,15	
Kommuninvest Sverige AB				4,893 % fällig am 24.11.2032	£ 1.700	2.229	0,10	Prudential Funding Asia PLC				
3,375 % fällig am 15.03.2027	700	796	0,04	Ferguson Finance PLC				2,950 % fällig am 03.11.2033	\$ 600	528	0,02	
Sweden Government International Bond				3,250 % fällig am 02.06.2030	\$ 900	806	0,04	Reckitt Benckiser Treasury Services PLC				
0,125 % fällig am 09.09.2030 SEK	9.000	793	0,03	4,650 % fällig am 20.04.2032	2.850	2.756	0,13	1,750 % fällig am 19.05.2032	£ 100	107	0,00	
		1.589	0,07	Grainger PLC				Santander UK Group Holdings PLC				
Summe Schweden		11.207	0,52	3,000 % fällig am 03.07.2030	£ 1.260	1.378	0,06	1,673 % fällig am 14.06.2027	\$ 800	728	0,03	
SCHWEIZ				HSBC Holdings PLC				3,823 % fällig am 03.11.2028	2.300	2.163	0,10	
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				1,750 % fällig am 24.07.2027	3.100	3.633	0,17	6,833 % fällig am 21.11.2026	1.500	1.529	0,07	
UBS AG				2,013 % fällig am 22.09.2028	\$ 1.500	1.336	0,06	Severn Trent Utilities Finance PLC				
1,375 % fällig am 13.01.2025	\$ 200	192	0,01	2,804 % fällig am 24.05.2032	1.200	1.002	0,05	2,000 % fällig am 02.06.2040	£ 300	255	0,01	
5,650 % fällig am 11.09.2028	3.300	3.425	0,16	2,848 % fällig am 04.06.2031	1.600	1.377	0,06	2,625 % fällig am 22.02.2033	1.900	2.039	0,09	
5,800 % fällig am 11.09.2025	4.000	4.048	0,19	2,871 % fällig am 22.11.2032	1.300	1.081	0,05	5,250 % fällig am 04.04.2036	1.900	2.508	0,12	
UBS Group AG				2,999 % fällig am 10.03.2026	1.450	1.407	0,06	SSE PLC				
2,593 % fällig am 11.09.2025	800	783	0,04	3,000 % fällig am 22.07.2028	£ 100	119	0,01	2,875 % fällig am 01.08.2029	€ 300	328	0,02	
4,125 % fällig am 24.09.2025	4.300	4.209	0,19	3,973 % fällig am 22.05.2030	\$ 4.300	4.020	0,19	4,000 % fällig am 05.09.2031	3.700	4.280	0,20	
4,125 % fällig am 15.04.2026	3.602	3.519	0,16	4,041 % fällig am 13.03.2028	2.790	2.690	0,12	Standard Chartered PLC				
4,194 % fällig am 01.04.2031	10.350	9.646	0,44	4,300 % fällig am 08.03.2026	5.987	5.889	0,27	0,800 % fällig am 17.11.2029	1.100	1.059	0,05	
4,282 % fällig am 09.01.2028	1.050	1.018	0,05	5,402 % fällig am 11.08.2033	600	603	0,03	1,214 % fällig am 23.03.2025	\$ 800	795	0,04	
4,375 % fällig am 10.02.2031				6,332 % fällig am 09.03.2044	250	270	0,01	1,456 % fällig am 14.01.2027	3.018	2.767	0,13	
(e)(f)	1.600	1.267	0,06	7,336 % fällig am 03.11.2026	600	623	0,03	2,678 % fällig am 29.06.2032	500	407	0,02	
5,959 % fällig am 12.01.2034	800	828	0,04	Informa PLC				4,874 % fällig am 10.05.2031	€ 2.500	2.897	0,13	
9,250 % fällig am 13.11.2028				2,125 % fällig am 06.10.2025	€ 3.000	3.224	0,15	6,301 % fällig am 09.01.2029	\$ 500	514	0,02	
(e)(f)	1.300	1.406	0,06	InterContinental Hotels Group PLC				7,767 % fällig am 16.11.2028	900	973	0,04	
9,250 % fällig am 13.11.2033				3,375 % fällig am 08.10.2028	£ 4.400	5.235	0,24	Tesco Corporate Treasury Services PLC				
(e)(f)	900	1.000	0,04	John Lewis PLC				1,875 % fällig am 02.11.2028	£ 2.600	2.926	0,13	
Summe Schweiz		31.341	1,44	4,250 % fällig am 18.12.2034	300	278	0,01	2,750 % fällig am 27.04.2030	500	564	0,03	
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE				6,125 % fällig am 21.01.2025	200	254	0,01	Tesco Property Finance PLC				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Land Securities Capital Markets PLC				5,744 % fällig am 13.04.2040	189	244	0,01	
Masdar Abu Dhabi Future Energy Co.				4,875 % fällig am 15.09.2034	5.000	6.555	0,30	Thames Water Utilities Finance PLC				
4,875 % fällig am 25.07.2033	4.300	4.268	0,20	Legal & General Group PLC				0,875 % fällig am 31.01.2028	€ 3.000	2.835	0,13	
GROSSBRITANNIEN				5,625 % fällig am 24.03.2031				1,250 % fällig am 31.01.2032	100	83	0,00	
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				(e)(f)	500	543	0,03	4,375 % fällig am 18.01.2031	100	105	0,00	
Anglian Water Services Financing PLC				Lloyds Banking Group PLC				8,250 % fällig am 25.04.2040	£ 2.400	3.442	0,16	
2,750 % fällig am 26.10.2029	£ 100	116	0,01	3,750 % fällig am 18.03.2028	\$ 1.600	1.532	0,07	TP ICAP Finance PLC				
Assura Financing PLC				4,582 % fällig am 10.12.2025	2.000	1.959	0,09	2,625 % fällig am 18.11.2028	300	320	0,01	
1,625 % fällig am 30.06.2033	1.200	1.148	0,05	5,985 % fällig am 07.08.2027	4.900	4.989	0,23	7,875 % fällig am 17.04.2030	1.200	1.632	0,08	
Barclays PLC				6,942 % fällig am 07.08.2027	1.400	1.402	0,06	Travis Perkins PLC				
2,667 % fällig am 10.03.2032	\$ 1.000	825	0,04	London & Quadrant Housing Trust				3,750 % fällig am 17.02.2026		1.000	1.203	0,06
2,894 % fällig am 24.11.2032	300	246	0,01	2,000 % fällig am 31.03.2032	£ 1.400	1.456	0,07	(h)				
4,918 % fällig am 08.08.2030	€ 1.150	1.325	0,06	LSEGA Financing PLC				Virgin Money UK PLC				
5,501 % fällig am 09.08.2028	\$ 300	302	0,01	2,500 % fällig am 06.04.2031	\$ 3.000	2.570	0,12	4,000 % fällig am 25.09.2026	200	245	0,01	
5,746 % fällig am 09.08.2033	3.350	3.392	0,16	3,200 % fällig am 06.04.2041	1.000	775	0,04	4,000 % fällig am 03.09.2027	3.000	3.631	0,17	
6,224 % fällig am 09.05.2034	4.400	4.566	0,21	Marks & Spencer PLC				4,625 % fällig am 29.10.2028	€ 500	552	0,03	
7,090 % fällig am 06.11.2029	£ 3.000	4.077	0,19	4,500 % fällig am 10.07.2027	£ 300	370	0,02	Vmed O2 UK Financing PLC				
7,325 % fällig am 02.11.2026	\$ 800	827	0,04	Motability Operations Group PLC				3,250 % fällig am 31.01.2031	700	713	0,03	
7,437 % fällig am 02.11.2033	2.300	2.577	0,12	1,500 % fällig am 20.01.2041	400	322	0,01	4,500 % fällig am 15.07.2031	£ 1.000	1.106	0,05	
Berkeley Group PLC				3,500 % fällig am 17.07.2031	€ 2.300	2.609	0,12	Vodafone Group PLC				
2,500 % fällig am 11.08.2031	£ 3.550	3.503	0,16	National Grid PLC				5,125 % fällig am 04.06.2081	\$ 2.659	2.012	0,09	
				3,875 % fällig am 16.01.2029	1.600	1.818	0,08	Weir Group PLC				
				Nationwide Building Society				2,200 % fällig am 13.05.2026	11.800	10.976	0,51	
				4,302 % fällig am 08.03.2029	\$ 900	863	0,04	Workspace Group PLC				
				4,500 % fällig am 01.11.2026	€ 3.900	4.446	0,21	2,250 % fällig am 11.03.2028	£ 1.600	1.752	0,08	
								Yorkshire Building Society				
								3,511 % fällig am 11.10.2030	2.400	2.742	0,13	
								6,375 % fällig am 15.11.2028	2.000	2.603	0,12	

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Zenith Finco PLC				Bank of America Corp.				Corebridge Financial, Inc.			
6,500 % fällig am 30.06.2027 (h)	£ 2.300	\$ 2.393	0,11	0,583 % fällig am 24.08.2028	€ 200	\$ 199	0,01	3,900 % fällig am 05.04.2032	\$ 6.150	\$ 5.564	0,26
		204.135	9,41	1,102 % fällig am 24.05.2032	300	277	0,01	Corporate Office Properties LP			
				1,734 % fällig am 22.07.2027	\$ 300	275	0,01	2,000 % fällig am 15.01.2029	700	584	0,03
NON-AGENCY-MBS				1,898 % fällig am 23.07.2031	2.700	2.210	0,10	2,250 % fällig am 15.03.2026	500	467	0,02
Gemgarto PLC				2,087 % fällig am 14.06.2029	2.400	2.116	0,10	2,750 % fällig am 15.04.2031	400	324	0,01
5,810 % fällig am 16.12.2067	286	364	0,02	2,299 % fällig am 21.07.2032	600	490	0,02	Crown Castle, Inc.			
				2,456 % fällig am 22.10.2025	2.000	1.948	0,09	2,500 % fällig am 15.07.2031	1.000	835	0,04
STAATSEMISSIONEN				2,687 % fällig am 22.04.2032	6.600	5.575	0,26	3,100 % fällig am 15.11.2029	2.500	2.239	0,10
United Kingdom Gilt				2,824 % fällig am 27.04.2033	€ 700	727	0,03	3,250 % fällig am 15.01.2051	800	560	0,03
1,250 % fällig am 22.07.2027	4.800	5.682	0,26	2,884 % fällig am 22.10.2030	\$ 1.100	977	0,05	5,000 % fällig am 11.01.2028	2.600	2.592	0,12
3,750 % fällig am 22.10.2053	3.900	4.645	0,21	2,972 % fällig am 04.02.2033	300	255	0,01	CVS Health Corp.			
		10.327	0,47	3,384 % fällig am 02.04.2026	7.800	7.591	0,35	4,300 % fällig am 25.03.2028	192	189	0,01
Summe Großbritannien		214.826	9,90	3,458 % fällig am 15.03.2025	1.100	1.095	0,05	5,125 % fällig am 21.02.2030	3.800	3.861	0,18
				3,559 % fällig am 23.04.2027	2.600	2.504	0,12	CVS Pass-Through Trust			
USA				3,824 % fällig am 20.01.2028	2.214	2.129	0,10	4,163 % fällig am 11.08.2036	109	97	0,00
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				4,962 % fällig am 24.08.2025	€ 1.400	1.554	0,07	Dell International LLC			
GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust				5,015 % fällig am 22.07.2033	\$ 4.900	4.849	0,22	3,375 % fällig am 15.12.2041	1.470	1.111	0,05
2,100 % fällig am 20.05.2048	\$ 2.654	2.052	0,09	6,204 % fällig am 10.11.2028	4.060	4.238	0,20	6,020 % fällig am 15.06.2026	626	641	0,03
4,000 % fällig am 20.04.2049	5.110	4.497	0,21	Bank of New York Mellon Corp.				8,350 % fällig am 15.07.2046	11	14	0,00
4,950 % fällig am 20.07.2049	6.035	5.554	0,25	4,543 % fällig am 01.02.2029	4.300	4.271	0,20	Digital Euro Finco LLC			
5,520 % fällig am 22.02.2055	3.240	3.169	0,15	4,706 % fällig am 01.02.2034	2.800	2.740	0,13	2,500 % fällig am 16.01.2026	€ 950	1.023	0,05
		15.272	0,70	5,802 % fällig am 25.10.2028	3.500	3.631	0,17	Digital Stout Holding LLC			
				Blackstone Holdings Finance Co. LLC				3,300 % fällig am 19.07.2029	£ 100	118	0,01
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				2,850 % fällig am 05.08.2051	600	381	0,02	3,750 % fällig am 17.10.2030	400	476	0,02
AES Corp.				6,200 % fällig am 22.04.2033	400	427	0,02	Discover Bank			
1,375 % fällig am 15.01.2026	4.319	3.998	0,18	BlueHub Loan Fund, Inc.				3,450 % fällig am 27.07.2026	\$ 3.860	3.651	0,17
2,450 % fällig am 15.01.2031	3.600	3.027	0,14	3,099 % fällig am 01.01.2030	650	540	0,02	Discovery Communications LLC			
5,450 % fällig am 01.06.2028	4.740	4.822	0,22	BMW U.S. Capital LLC				4,875 % fällig am 01.04.2043	1.900	1.592	0,07
				3,625 % fällig am 18.04.2029	3.591	3.446	0,16	5,200 % fällig am 20.09.2047	2.000	1.726	0,08
Alcon Finance Corp.				Booking Holdings, Inc.				Doris Duke Charitable Foundation			
3,000 % fällig am 23.09.2029	1.900	1.730	0,08	4,125 % fällig am 12.05.2033	€ 600	709	0,03	2,345 % fällig am 01.07.2050	400	243	0,01
Alexandria Real Estate Equities, Inc.				Boston Properties LP				DTE Electric Co.			
2,000 % fällig am 18.05.2032	3.350	2.690	0,12	2,550 % fällig am 01.04.2032	\$ 930	741	0,03	1,900 % fällig am 01.04.2028	1.500	1.351	0,06
4,750 % fällig am 15.04.2035	2.500	2.427	0,11	6,500 % fällig am 15.01.2034	2.800	2.957	0,14	3,250 % fällig am 01.04.2051	1.100	810	0,04
				Brandywine Operating Partnership LP				3,950 % fällig am 01.03.2049	700	590	0,03
Ally Financial, Inc.				3,950 % fällig am 15.11.2027	1.617	1.446	0,07	Duke Energy Florida LLC			
2,200 % fällig am 02.11.2028	800	681	0,03	Bush Foundation				2,500 % fällig am 01.12.2029	300	268	0,01
5,800 % fällig am 01.05.2025	3.000	3.005	0,14	2,754 % fällig am 01.10.2050	375	266	0,01	Duke Energy Progress LLC			
8,000 % fällig am 01.11.2031	300	329	0,02	Capital One Financial Corp.				3,450 % fällig am 15.03.2029	1.300	1.241	0,06
American Assets Trust LP				6,377 % fällig am 08.06.2034	2.200	2.266	0,10	Edison International			
3,375 % fällig am 01.02.2031	400	327	0,02	Carrier Global Corp.				7,875 % fällig am 15.06.2054	4.169	4.211	0,19
American Express Co.				4,125 % fällig am 29.05.2028	€ 1.500	1.708	0,08	Elevance Health, Inc.			
4,050 % fällig am 03.05.2029	2.900	2.872	0,13	CBRE Services, Inc.				2,875 % fällig am 15.09.2029	1.812	1.662	0,08
5,282 % fällig am 27.07.2029	800	817	0,04	2,500 % fällig am 01.04.2031	\$ 1.000	847	0,04	Eli Lilly & Co.			
5,625 % fällig am 28.07.2034	500	517	0,02	Centene Corp.				1,375 % fällig am 14.09.2061	€ 700	488	0,02
				2,625 % fällig am 01.08.2031	600	499	0,02	Enel Finance America LLC			
American Tower Corp.				3,000 % fällig am 15.10.2030	7.000	6.071	0,28	2,875 % fällig am 12.07.2041	\$ 2.500	1.705	0,08
0,875 % fällig am 21.05.2029	€ 500	482	0,02	Charles Schwab Corp.				7,100 % fällig am 14.10.2027	1.250	1.335	0,06
0,950 % fällig am 05.10.2030	650	604	0,03	2,000 % fällig am 20.03.2028	300	267	0,01	Entergy Louisiana LLC			
1,000 % fällig am 15.01.2032	3.100	2.810	0,13	4,000 % fällig am 01.12.2030 (e)	1.400	1.111	0,05	4,750 % fällig am 15.09.2052	1.700	1.566	0,07
1,450 % fällig am 15.09.2026	\$ 400	365	0,02	5,643 % fällig am 19.05.2029	600	616	0,03	Equifax, Inc.			
1,875 % fällig am 15.10.2030	5.600	4.595	0,21	5,853 % fällig am 19.05.2034	600	620	0,03	5,100 % fällig am 01.06.2028	1.200	1.211	0,06
1,950 % fällig am 22.05.2026	€ 200	213	0,01	Church & Dwight Co., Inc.				Equinix, Inc.			
2,100 % fällig am 15.06.2030	\$ 1.000	840	0,04	5,600 % fällig am 15.11.2032	1.200	1.287	0,06	2,500 % fällig am 15.05.2031	1.600	1.359	0,06
3,650 % fällig am 15.03.2027	€ 1.000	962	0,04	Citibank N.A.				Equitable Financial Life Global Funding			
3,950 % fällig am 15.03.2029	900	860	0,04	5,803 % fällig am 29.09.2028	2.500	2.612	0,12	0,600 % fällig am 16.06.2028	€ 1.300	1.280	0,06
Amgen, Inc.				Citigroup, Inc.				1,300 % fällig am 12.07.2026	\$ 4.450	4.014	0,19
5,150 % fällig am 02.03.2028	5.300	5.428	0,25	2,520 % fällig am 03.11.2032	1.400	1.155	0,05	5,500 % fällig am 02.12.2025	1.600	1.602	0,07
5,250 % fällig am 02.03.2030	4.400	4.525	0,21	2,572 % fällig am 03.06.2031 (g)	8.100	6.923	0,32	ERAC USA Finance LLC			
5,600 % fällig am 02.03.2043	1.600	1.654	0,08	6,075 % fällig am 25.01.2026 (g)	2.000	1.989	0,09	3,800 % fällig am 01.11.2025	5.000	4.882	0,23
5,650 % fällig am 02.03.2053	50	53	0,00	6,780 % fällig am 24.05.2025	1.400	1.404	0,06	Essential Properties LP			
5,750 % fällig am 02.03.2063	100	105	0,00	Citizens Bank N.A.				2,950 % fällig am 15.07.2031	200	157	0,01
Apple, Inc.				5,284 % fällig am 26.01.2026	3.650	3.533	0,16	Eversource Energy			
2,200 % fällig am 11.09.2029	1.961	1.775	0,08	Clearway Energy Operating LLC				1,650 % fällig am 15.08.2030	800	650	0,03
4,300 % fällig am 10.05.2033	250	254	0,01	3,750 % fällig am 15.01.2032	700	611	0,03	F&G Global Funding			
Assured Guaranty U.S. Holdings, Inc.				Comcast Corp.				2,300 % fällig am 11.04.2027	700	630	0,03
3,600 % fällig am 15.09.2051	550	395	0,02	4,650 % fällig am 15.02.2033	3.810	3.834	0,18	FactSet Research Systems, Inc.			
Astrazeneca Finance LLC				5,500 % fällig am 15.05.2064	2.000	2.107	0,10	3,450 % fällig am 01.03.2032	2.600	2.331	0,11
1,750 % fällig am 28.05.2028	100	90	0,00	CommonSpirit Health				Farmers Exchange Capital			
4,900 % fällig am 03.03.2030	1.300	1.339	0,06	2,782 % fällig am 01.10.2030	600	521	0,02	5,454 % fällig am 15.10.2054	400	336	0,02
AT&T, Inc.				Commonwealth Edison Co.				Fifth Third Bancorp			
3,550 % fällig am 15.09.2055	246	177	0,01	2,200 % fällig am 01.03.2030	1.000	865	0,04	6,361 % fällig am 27.10.2028	2.200	2.284	0,11
3,800 % fällig am 01.12.2057	600	447	0,02	Community Preservation Corp.				First American Financial Corp.			
3,850 % fällig am 01.06.2060	2.200	1.643	0,08	2,867 % fällig am 01.02.2030	1.225	1.074	0,05	2,400 % fällig am 15.08.2031	3.600	2.851	0,13
4,300 % fällig am 15.02.2030	1.300	1.274	0,06	Continental Wind LLC				4,000 % fällig am 15.05.2030	700	630	0,03
4,850 % fällig am 25.05.2047 (g)	CAD 1.500	1.058	0,05	6,000 % fällig am 28.02.2033	2.329	2.377	0,11				
Autodesk, Inc.											
2,400 % fällig am 15.12.2031	\$ 1.900	1.626	0,07								

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit ESG Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Fiserv, Inc. 3,000 % fällig am 01.07.2031	£ 100	\$ 115	0,01	6,070 % fällig am 22.10.2027 6,087 % fällig am 23.10.2029	\$ 2.100	\$ 2.161	0,10	Pacific Gas & Electric Co. 6,700 % fällig am 01.04.2053	\$ 3.200	\$ 3.481	0,16
Ford Motor Credit Co. LLC 1,744 % fällig am 19.07.2024 3,021 % fällig am 06.03.2024	€ 900 300	980 330	0,05 0,02	JPMorgan Chase Bank N.A. 6,402 % fällig am 08.12.2026	3.000	3.012	0,14	Pacific Life Global Funding 1,375 % fällig am 14.04.2026	605	559	0,03
4,535 % fällig am 06.03.2025 4,675 % fällig am 01.12.2024 6,798 % fällig am 07.11.2028	£ 400 € 200 \$ 1.750	503 221 1.832	0,02 0,01 0,08	Kaiser Foundation Hospitals 2,810 % fällig am 01.06.2041	2.850	2.137	0,10	1,600 % fällig am 21.09.2028 2,450 % fällig am 11.01.2032 6,216 % fällig am 06.12.2024	1.000 2.000 2.000	858 1.660 1.992	0,04 0,08 0,09
FS KKR Capital Corp. 3,125 % fällig am 12.10.2028	\$ 1.300	1.134	0,05	Kilroy Realty LP 2,650 % fällig am 15.11.2033 3,050 % fällig am 15.02.2030	6.400	4.860	0,22	Pacific LifeCorp. 3,350 % fällig am 15.09.2050	200	145	0,01
Gap, Inc. 3,625 % fällig am 01.10.2029	550	471	0,02	Lazard Group LLC 4,375 % fällig am 11.03.2029	200	194	0,01	PacifiCorp 5,350 % fällig am 01.12.2053 5,500 % fällig am 15.05.2054	1.200 4.700	1.156 4.622	0,05 0,21
Goldman Sachs Group, Inc. 1,000 % fällig am 16.12.2025	£ 200	244	0,01	Liberty Mutual Group, Inc. 3,625 % fällig am 23.05.2059	€ 200	216	0,01	Penn Mutual Life Insurance Co. 3,800 % fällig am 29.04.2061	1.800	1.216	0,06
1,500 % fällig am 07.12.2027 1,542 % fällig am 10.09.2027 1,875 % fällig am 16.12.2030	\$ 800 € 400 £ 1.100	913 363 1.170	0,04 0,02 0,05	Liberty Utilities Finance GP 2,050 % fällig am 15.09.2030	\$ 1.800	1.461	0,07	Physicians Realty LP 3,950 % fällig am 15.01.2028	800	763	0,04
1,992 % fällig am 27.01.2032 2,383 % fällig am 21.07.2032 2,615 % fällig am 22.04.2032	\$ 1.000 900 7.400	808 740 6.214	0,04 0,03 0,29	Low Income Investment Fund 3,711 % fällig am 01.07.2029	300	269	0,01	Piedmont Operating Partnership LP 9,250 % fällig am 20.07.2028	3.100	3.277	0,15
2,640 % fällig am 24.02.2028 2,650 % fällig am 21.10.2032 3,102 % fällig am 24.02.2033	\$ 3.300 900 1.100	3.060 750 945	0,14 0,03 0,04	McLaren Health Care Corp. 4,386 % fällig am 15.05.2048	200	174	0,01	PNC Bank N.A. 2,700 % fällig am 22.10.2029	600	526	0,02
3,125 % fällig am 25.07.2029 3,691 % fällig am 05.06.2028 4,452 % fällig am 30.04.2024	£ 400 \$ 500 € 300	473 478 332	0,02 0,02 0,02	Mercedes-Benz Finance North America LLC 4,300 % fällig am 22.02.2029	2.979	2.952	0,14	PNC Financial Services Group, Inc. 4,758 % fällig am 26.01.2027	5.880	5.836	0,27
5,900 % fällig am 02.05.2024	AUD 2.000	1.366	0,06	Micron Technology, Inc. 2,703 % fällig am 15.04.2032	1.800	1.513	0,07	Principal Life Global Funding 1,250 % fällig am 16.08.2026	2.750	2.495	0,12
Golub Capital BDC, Inc. 7,050 % fällig am 05.12.2028	\$ 4.100	4.302	0,20	MidAmerican Energy Co. 2,700 % fällig am 01.08.2052	1.250	810	0,04	1,375 % fällig am 10.01.2025	2.000	1.922	0,09
Goodman U.S. Finance Five LLC 4,625 % fällig am 04.05.2032	4.100	3.821	0,18	3,150 % fällig am 15.04.2050 3,650 % fällig am 01.08.2048	1.650 4.629	1.181 3.679	0,05 0,17	Prologis Euro Finance LLC 1,500 % fällig am 08.02.2034	€ 3.250	2.941	0,14
Great-West Lifeco Finance LP 4,047 % fällig am 17.05.2028	500	487	0,02	3,950 % fällig am 01.08.2047 5,850 % fällig am 15.09.2054	1.060 600	890 665	0,04 0,03	Prologis LP 2,250 % fällig am 15.01.2032	\$ 600	501	0,02
Haleon U.S. Capital LLC 3,375 % fällig am 24.03.2029	2.550	2.413	0,11	Moody's Corp. 2,000 % fällig am 19.08.2031	700	581	0,03	Protective Life Global Funding 1,618 % fällig am 15.04.2026	800	739	0,03
Hanover Insurance Group, Inc. 2,500 % fällig am 01.09.2030	300	246	0,01	2,550 % fällig am 18.08.2060 3,100 % fällig am 29.11.2061	500 400	289 271	0,01 0,01	1,737 % fällig am 21.09.2030 1,900 % fällig am 06.07.2028	800 300	649 266	0,03 0,01
Hanwha Q Cells Americas Holdings Corp. 5,000 % fällig am 27.07.2028	3.300	3.332	0,15	3,250 % fällig am 15.01.2028	300	287	0,01	6,469 % fällig am 11.12.2024	5.000	5.022	0,23
HAT Holdings LLC 3,375 % fällig am 15.06.2026 3,750 % fällig am 15.09.2030	255 3.200	240 2.699	0,01 0,12	Morgan Stanley 1,102 % fällig am 29.04.2033	€ 600	539	0,02	Providence St. Joseph Health Obligated Group 5,403 % fällig am 01.10.2033	2.900	2.956	0,14
8,000 % fällig am 15.06.2027	4.100	4.275	0,20	1,375 % fällig am 27.10.2026 1,928 % fällig am 28.04.2032	1.350 \$ 8.900	1.418 7.160	0,07 0,33	Public Service Co. of Colorado 2,700 % fällig am 15.01.2051	625	394	0,02
HCA, Inc. 4,125 % fällig am 15.06.2029 4,500 % fällig am 15.02.2027	4.700 1.700	4.497 1.681	0,21 0,08	3,875 % fällig am 27.01.2026 5,050 % fällig am 28.01.2027	11.743 1.000	11.507 1.001	0,53 0,05	3,200 % fällig am 01.03.2050	2.827	2.032	0,09
5,000 % fällig am 15.03.2024	2.000	1.997	0,09	5,123 % fällig am 01.02.2029 6,342 % fällig am 18.10.2033	8.100 6.000	8.141 6.473	0,38 0,30	Public Service Co. of Oklahoma 2,200 % fällig am 15.08.2031	2.800	2.323	0,11
Healthpeak OP LLC 2,125 % fällig am 01.12.2028	1.750	1.540	0,07	MSCI, Inc. 3,250 % fällig am 15.08.2033	1.200	1.004	0,05	3,150 % fällig am 15.08.2051	3.900	2.677	0,12
Host Hotels & Resorts LP 2,900 % fällig am 15.12.2031	2.900	2.435	0,11	3,625 % fällig am 01.09.2030 3,875 % fällig am 15.02.2031	500 200	453 183	0,02 0,01	Public Service Electric & Gas Co. 3,100 % fällig am 15.03.2032	2.950	2.636	0,12
3,375 % fällig am 15.12.2029 3,875 % fällig am 01.04.2024	4.800 100	4.314 99	0,20 0,00	4,000 % fällig am 15.11.2029	100	94	0,00	4,650 % fällig am 15.03.2033	3.200	3.203	0,15
4,000 % fällig am 15.06.2025 4,500 % fällig am 01.02.2026	500 100	489 98	0,02 0,00	Mutual of Omaha Cos. Global Funding 5,450 % fällig am 12.12.2028	2.100	2.146	0,10	Qorvo, Inc. 1,750 % fällig am 15.12.2024	4.900	4.704	0,22
Hudson Pacific Properties LP 3,250 % fällig am 15.01.2030 3,950 % fällig am 01.11.2027	200 300	147 251	0,01 0,01	Netflix, Inc. 3,625 % fällig am 15.06.2030	€ 500	563	0,03	Quanta Services, Inc. 0,950 % fällig am 01.10.2024	3.000	2.892	0,13
5,950 % fällig am 15.02.2028	3.600	3.186	0,15	3,875 % fällig am 15.11.2029	3.400	3.892	0,18	2,900 % fällig am 01.10.2030	5.500	4.829	0,22
Humana, Inc. 1,350 % fällig am 03.02.2027 3,700 % fällig am 23.03.2029	1.250 1.700	1.128 1.634	0,05 0,08	Neuberger Berman Group LLC 4,875 % fällig am 15.04.2045	\$ 200	166	0,01	Rayonier LP 2,750 % fällig am 17.05.2031	2.500	2.088	0,10
3,950 % fällig am 15.03.2027 5,875 % fällig am 01.03.2033	95 3.000	93 3.197	0,00 0,15	New York State Electric & Gas Corp. 2,150 % fällig am 01.10.2031	400	319	0,01	Realty Income Corp. 1,750 % fällig am 13.07.2033	£ 2.000	1.940	0,09
IQVIA, Inc. 5,700 % fällig am 15.05.2028	3.000	3.059	0,14	5,850 % fällig am 15.08.2033	2.000	2.096	0,10	Reinsurance Group of America, Inc. 6,000 % fällig am 15.09.2033	\$ 1.500	1.574	0,07
John Deere Capital Corp. 3,350 % fällig am 18.04.2029	1.900	1.822	0,08	NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 1,900 % fällig am 15.06.2028	7.830	6.954	0,32	Reliance Steel & Aluminum Co. 2,150 % fällig am 15.08.2030	1.000	845	0,04
Jones Lang LaSalle, Inc. 6,875 % fällig am 01.12.2028	1.000	1.060	0,05	NextEra Energy Operating Partners LP 7,250 % fällig am 15.01.2029	5.000	5.238	0,24	RELX Capital, Inc. 4,000 % fällig am 18.03.2029	700	689	0,03
JPMorgan Chase & Co. 1,045 % fällig am 19.11.2026 2,545 % fällig am 08.11.2032	1.500 8.750	1.390 7.304	0,06 0,34	Niagara Mohawk Power Corp. 1,960 % fällig am 27.06.2030	4.000	3.322	0,15	Retail Opportunity Investments Partnership LP 6,750 % fällig am 15.10.2028	1.200	1.262	0,06
2,580 % fällig am 22.04.2032 2,739 % fällig am 15.10.2030 4,203 % fällig am 23.07.2029	7.400 1.800 1.500	6.263 1.602 1.459	0,29 0,07 0,07	5,783 % fällig am 16.09.2052	2.690	2.789	0,13	RGA Global Funding 2,700 % fällig am 18.01.2029	1.000	888	0,04
4,323 % fällig am 26.04.2028 4,912 % fällig am 25.07.2033	4.500 5.600	4.435 5.539	0,20 0,26	Northern States Power Co. 2,600 % fällig am 01.06.2051	1.300	852	0,04	S&P Global, Inc. 2,700 % fällig am 01.03.2029	5.500	5.090	0,23
				2,900 % fällig am 01.03.2050	1.700	1.194	0,06	Salesforce, Inc. 1,500 % fällig am 15.07.2028	1.750	1.557	0,07
				NSTAR Electric Co. 3,100 % fällig am 01.06.2051	1.675	1.181	0,05	San Diego Gas & Electric Co. 2,950 % fällig am 15.08.2051	1.750	1.234	0,06
				4,950 % fällig am 15.09.2052	3.900	3.811	0,18	Santander Holdings USA, Inc. 2,490 % fällig am 06.01.2028	1.400	1.283	0,06
				Nuveen LLC 4,000 % fällig am 01.11.2028	300	293	0,01	SBA Tower Trust 1,631 % fällig am 15.05.2051	1.000	894	0,04
				Oracle Corp. 3,950 % fällig am 25.03.2051 (g)	300	235	0,01	SCE Recovery Funding LLC 4,697 % fällig am 15.06.2042	1.928	1.904	0,09
				Organon & Co. 4,125 % fällig am 30.04.2028	300	276	0,01				

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS			
												BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)
ServiceNow, Inc. 1,400 % fällig am 01.09.2030	\$	3.200	\$ 2.632	0,12	UnitedHealth Group, Inc. 5,350 % fällig am 15.02.2033	1.400	1.482	0,07	University of Pittsburgh of the Commonwealth System of Higher Education, Pennsylvania Revenue Bonds, Series 2017					
SLM Corp. 3,125 % fällig am 02.11.2026		1.400	1.307	0,06	USAA Capital Corp. 5,875 % fällig am 15.02.2053	3.100	3.514	0,16	3,646 % fällig am 15.09.2036	\$	2.000	\$ 1.785	0,08	
Solar Star Funding LLC 5,375 % fällig am 30.06.2035		4.199	4.170	0,19	2,125 % fällig am 01.05.2030	1.000	841	0,04				4.806	0,22	
Southern California Edison Co. 2,500 % fällig am 01.06.2031		200	172	0,01	3,375 % fällig am 01.05.2025	1.300	1.274	0,06	US-REGIERUNGSBEHÖRDEN					
2,750 % fällig am 01.02.2032		2.500	2.153	0,10	VeriSign, Inc. 2,700 % fällig am 15.06.2031	1.100	943	0,04	Freddie Mac 0,375 % fällig am 23.09.2025		1.700	1.587	0,07	
3,600 % fällig am 01.02.2045		1.600	1.246	0,06	Verizon Communications, Inc. 0,375 % fällig am 22.03.2029	€	800	769	0,04	1,020 % fällig am 25.08.2029 (a)		2.318	100	0,00
3,650 % fällig am 01.06.2051		2.500	1.887	0,09	1,500 % fällig am 18.09.2030	\$	5.560	4.583	0,21	Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % fällig am 01.07.2052		6.514	5.767	0,27
3,900 % fällig am 01.12.2041		100	82	0,00	2,100 % fällig am 22.03.2028		700	634	0,03	3,500 % fällig am 01.12.2052		98	90	0,00
4,500 % fällig am 01.09.2040		190	171	0,01	2,850 % fällig am 03.09.2041		1.550	1.146	0,05	4,000 % fällig am 01.12.2052 - 01.07.2053		20.414	19.310	0,89
4,875 % fällig am 01.03.2049		200	184	0,01	3,400 % fällig am 22.03.2041		500	398	0,02	4,500 % fällig am 01.07.2052 - 01.07.2053		28.795	27.930	1,29
5,950 % fällig am 01.11.2032		3.750	4.031	0,19	3,700 % fällig am 22.03.2061		261	200	0,01	5,000 % fällig am 01.02.2053		23.660	23.414	1,08
Southwestern Electric Power Co. 3,250 % fällig am 01.11.2051		3.200	2.163	0,10	3,875 % fällig am 08.02.2029		2.400	2.328	0,11	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.01.2054		35.570	33.665	1,55
Southwestern Public Service Co. 5,150 % fällig am 01.06.2052		2.000	1.815	0,08	4,329 % fällig am 21.09.2028		600	594	0,03	6,000 % fällig am 01.02.2054		111.500	113.220	5,22
Spirit Realty LP 4,450 % fällig am 15.09.2026		100	98	0,00	5,050 % fällig am 09.05.2033		2.000	2.041	0,09			225.083	10,37	
Standard Industries, Inc. 2,250 % fällig am 21.11.2026	€	1.600	1.677	0,08	VF Corp. 2,950 % fällig am 23.04.2030		3.500	2.922	0,13	US-SCHATZOBIGATIONEN				
State Street Corp. 5,751 % fällig am 04.11.2026	\$	2.600	2.642	0,12	4,250 % fällig am 07.03.2029	€	500	532	0,02	U.S. Treasury Bonds				
Stryker Corp. 4,850 % fällig am 08.12.2028		2.500	2.530	0,12	VMware LLC 4,700 % fällig am 15.05.2030	\$	3.000	2.961	0,14	1,875 % fällig am 15.02.2041 (h)		13.050	9.390	0,43
Synchrony Financial 2,875 % fällig am 28.10.2031		500	401	0,02	Warnermedia Holdings, Inc. 4,279 % fällig am 15.03.2032		4.100	3.754	0,17	2,000 % fällig am 15.11.2041		39.500	28.586	1,32
2,425 % fällig am 15.08.2024		1.000	989	0,05	5,391 % fällig am 15.03.2062		500	429	0,02	2,250 % fällig am 15.05.2041		28.900	22.028	1,02
4,375 % fällig am 19.03.2024		650	648	0,03	Wells Fargo & Co. 4,540 % fällig am 15.08.2026		3.100	3.069	0,14	2,375 % fällig am 15.02.2042 (h)		58.900	45.217	2,08
7,250 % fällig am 02.02.2033		800	794	0,04	Westinghouse Air Brake Technologies Corp. 4,700 % fällig am 15.09.2028		2.500	2.474	0,11	3,250 % fällig am 15.05.2042 (h)		38.800	34.059	1,57
T-Mobile USA, Inc. 2,650 % fällig am 15.02.2031		2.000	1.724	0,08	Weyerhaeuser Co. 4,000 % fällig am 15.11.2029		3.000	2.870	0,13	3,375 % fällig am 15.08.2042		9.700	8.653	0,40
2,625 % fällig am 15.02.2029		1.000	901	0,04	6,875 % fällig am 15.12.2033		70	77	0,00	3,875 % fällig am 15.05.2043 (h)		10.100	9.632	0,44
3,300 % fällig am 15.02.2051		900	651	0,03	Wisconsin Electric Power Co. 4,750 % fällig am 30.09.2032		1.250	1.261	0,06	4,000 % fällig am 15.11.2042		27.600	26.831	1,24
3,600 % fällig am 15.11.2060		300	219	0,01	Wisconsin Power & Light Co. 4,950 % fällig am 01.04.2033		8.249	8.275	0,38	4,750 % fällig am 15.11.2043 (i)		33.800	36.266	1,67
Tapestry, Inc. 5,350 % fällig am 27.11.2025	€	2.000	2.256	0,10	Wisconsin Public Service Corp. 2,850 % fällig am 01.12.2051		2.250	1.490	0,07	U.S. Treasury Inflation Protected Securities (d) 0,125 % fällig am 15.10.2024		1.199	1.173	0,05
5,375 % fällig am 27.11.2027		1.600	1.832	0,08	WP Carey, Inc. 2,450 % fällig am 01.02.2032		1.200	976	0,05	0,125 % fällig am 15.02.2051		6.382	3.956	0,18
5,875 % fällig am 27.11.2031		800	930	0,04	Xylem, Inc. 2,250 % fällig am 30.01.2031		1.080	926	0,04	0,250 % fällig am 15.01.2025		4.806	4.666	0,22
7,850 % fällig am 27.11.2033	\$	3.500	3.735	0,17			646.378	29,79		0,625 % fällig am 15.07.2032		31.874	29.139	1,34
Teachers Insurance & Annuity Association of America 4,270 % fällig am 15.05.2047		400	349	0,02						1,375 % fällig am 15.07.2033		12.562	12.188	0,56
Topaz Solar Farms LLC 5,750 % fällig am 30.09.2039		1.271	1.265	0,06						1,500 % fällig am 15.02.2053		4.244	3.852	0,18
Toyota Motor Credit Corp. 3,050 % fällig am 22.03.2027		1.300	1.246	0,06						U.S. Treasury Notes 0,750 % fällig am 30.04.2026		7.400	6.847	0,32
Travel + Leisure Co. 5,650 % fällig am 01.04.2024		300	300	0,01						3,125 % fällig am 31.08.2027		3.250	3.159	0,15
Truist Financial Corp. 1,267 % fällig am 02.03.2027		1.900	1.740	0,08						4,250 % fällig am 31.05.2025 (h)		30.800	30.692	1,41
4,873 % fällig am 26.01.2029		5.250	5.176	0,24						4,625 % fällig am 15.03.2026		310	313	0,01
5,122 % fällig am 26.01.2034		2.750	2.665	0,12						U.S. Treasury STRIPS 0,000 % fällig am 15.05.2046 (c)		2.200	857	0,04
U.S. Bancorp 5,727 % fällig am 21.10.2026		1.800	1.813	0,08								317.504	14,63	
5,836 % fällig am 12.06.2034		600	619	0,03								1.210.249	55,77	
U.S. Bank N.A. 2,800 % fällig am 27.01.2025	\$	600	584	0,03										

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Zu erhaltende Erlöse aus		
							Pensions- geschäfte, zum Wert	Pensions- geschäft ⁽¹⁾	% des Netto- vermögens
SSB	2,600 %	29.12.2023	02.01.2024	\$ 1.300	U.S. Treasury Notes 0,250 % fällig am 31.07.2025	\$ (1.326)	\$ 1.300	\$ 1.300	0,06
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (1.326)	\$ 1.300	\$ 1.300	0,06

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit ESG Fund (Forts.)

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Australia Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2024	357	\$ 812	0,04
Canada Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2024	80	330	0,01
Euro-Bobl March Futures	Short	03.2024	315	(686)	(0,03)
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2024	609	(2.924)	(0,14)
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Short	03.2024	178	(2.220)	(0,10)
Euro-Schatz March Futures	Long	03.2024	85	63	0,00
Japan Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2024	19	(161)	(0,01)
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Long	03.2024	465	1.008	0,05
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Short	03.2024	91	(246)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Short	03.2024	562	(1.996)	(0,09)
U.S. Treasury 10-Year Ultra March Futures	Short	03.2024	938	(4.244)	(0,20)
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Long	03.2024	145	1.308	0,06
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2024	208	(1.813)	(0,08)
United Kingdom Long Gilt March Futures	Short	03.2024	131	(896)	(0,04)
				\$ (11.665)	(0,54)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (11.665)	(0,54)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

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

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Ally Financial, Inc.	5,000 %	20.12.2027	\$ 1.100	\$ 11	0,00
American International Group, Inc.	1,000	20.12.2026	900	1	0,00
American International Group, Inc.	1,000	20.12.2027	1.000	1	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2026	2.500	1	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2028	700	0	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2025	€ 100	0	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2027	300	1	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.06.2028	3.200	12	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2028	400	2	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.12.2028	\$ 4.200	24	0,01
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2027	600	2	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2024	300	0	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2024	800	0	0,00
Goldman Sachs Group, Inc.	1,000	20.12.2026	3.000	2	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20.06.2028	1.700	2	0,00
Telefonica Emisiones S.A.	1,000	20.06.2028	€ 1.000	3	0,00
Tesco PLC	1,000	20.06.2028	600	2	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2026	\$ 700	1	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2026	2.200	3	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2027	700	1	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2028	6.700	16	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2028	1.700	4	0,00
				\$ 89	0,01

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750 %	15.06.2024	\$ 40.600	\$ (739)	(0,03)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,785	12.08.2051	800	(20)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,000	16.06.2026	CAD 13.800	28	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,220	03.03.2025	600	(6)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,235	04.03.2025	1.100	(10)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,275	03.03.2025	600	(6)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,276	03.03.2025	300	(3)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,290	03.03.2025	200	(2)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2030	500	3	0,00
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,750	20.09.2025	43.900	(44)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	4,000	21.06.2025	181.400	181	0,01
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,600	15.12.2050	€ 2.300	(24)	0,00
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	20.03.2054	16.600	(343)	(0,02)
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.03.2034	30.400	445	0,02
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,250	20.03.2029	68.300	768	0,03
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,500	20.03.2026	10.700	62	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,475	16.06.2031	\$ 2.600	4	0,00
					\$ 294	0,01
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ 383	0,02

- (1) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.
- (3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Italy Government International Bond	1,000 %	20.12.2026	\$ 2.300	\$ 11	\$ 26	\$ 37	0,00

- (1) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	01.2024	AUD 3.865	\$ 2.559	\$ 0	\$ (78)	\$ (78)	0,00
BOA	01.2024	691	457	0	(15)	(15)	0,00
	01.2024	£ 21.606	27.356	0	(188)	(188)	(0,01)
	01.2024	\$ 4.624	¥ 682.388	219	0	219	0,01
	01.2024	610	NOK 6.491	29	0	29	0,00
	01.2024	113	SEK 1.182	4	0	4	0,00
BPS	01.2024	€ 231.522	\$ 254.340	0	(1.470)	(1.470)	(0,07)
	01.2024	£ 10.398	13.189	0	(67)	(67)	0,00
	01.2024	¥ 398.600	2.764	0	(65)	(65)	0,00
	01.2024	\$ 1.035	CAD 1.368	3	0	3	0,00
	01.2024	ZAR 32.223	\$ 1.738	0	(22)	(22)	0,00
BRC	01.2024	€ 341.824	375.931	0	(1.751)	(1.751)	(0,08)
	01.2024	\$ 1.272	£ 1.004	8	0	8	0,00
CBK	01.2024	BRL 31.624	\$ 6.495	0	(15)	(15)	0,00
	01.2024	€ 4.276	4.612	0	(113)	(113)	(0,01)
	01.2024	\$ 1.076	CAD 1.455	28	0	28	0,00
	01.2024	147	NOK 1.570	8	0	8	0,00
	02.2024	BRL 5.349	\$ 1.043	0	(57)	(57)	0,00
	04.2024	\$ 6.495	BRL 31.945	27	0	27	0,00
GLM	01.2024	CAD 29.892	\$ 21.996	0	(676)	(676)	(0,03)
	01.2024	\$ 6.406	BRL 31.643	108	0	108	0,01
	01.2024	2.226	¥ 327.303	97	0	97	0,00
	02.2024	2	BRL 9	0	0	0	0,00
MBC	01.2024	AUD 1.813	\$ 1.202	0	(35)	(35)	0,00
	01.2024	€ 8.609	9.293	0	(219)	(219)	(0,01)
	01.2024	£ 175	223	0	0	0	0,00
	01.2024	ZAR 30.846	1.614	0	(71)	(71)	0,00
MYI	01.2024	£ 69	88	0	0	0	0,00
	01.2024	SEK 23.761	2.389	31	0	31	0,00
	01.2024	\$ 20	CHF 17	0	0	0	0,00
	01.2024	2.506	€ 2.256	0	(14)	(14)	0,00
	01.2024	2.770	£ 2.169	0	(5)	(5)	0,00
	01.2024	1.758	¥ 259.216	82	0	82	0,00
RYL	01.2024	CHF 4.560	\$ 5.299	0	(121)	(121)	(0,01)
SCX	01.2024	SEK 13.502	1.300	0	(40)	(40)	0,00
UAG	01.2024	AUD 1.728	1.147	0	(33)	(33)	0,00
	01.2024	£ 59.300	75.043	0	(555)	(555)	(0,03)
	01.2024	\$ 3.384	NOK 36.105	171	0	171	0,01
				\$ 815	\$ (5.610)	\$ (4.795)	(0,22)

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit ESG Fund (Forts.)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 31. Dezember 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	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	01.2024	CHF 87	\$ 102	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	01.2024	\$ 116	CHF 99	2	0	2	0,00
BRC	01.2024	CHF 90	\$ 104	0	(3)	(3)	0,00
	01.2024	\$ 10.141	CHF 8.845	374	0	374	0,02
CBK	01.2024	CHF 358	\$ 414	0	(11)	(11)	0,00
	01.2024	\$ 230	CHF 200	8	0	8	0,00
GLM	01.2024	CHF 236	\$ 270	0	(10)	(10)	0,00
	01.2024	\$ 70.687	CHF 61.946	2.951	0	2.951	0,14
MYI	01.2024	CHF 281	\$ 323	0	(12)	(12)	0,00
	01.2024	\$ 71.049	CHF 62.020	2.679	0	2.679	0,12
SCX	01.2024	CHF 138	\$ 164	1	(1)	0	0,00
UAG	01.2024	\$ 63.468	CHF 55.381	2.367	0	2.367	0,11
				\$ 8.382	\$ (38)	\$ 8.344	0,39

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Investor EUR (Hedged) ausschüttend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	01.2024	€ 7.091	\$ 7.783	\$ 17	\$ (70)	\$ (53)	(0,01)
	01.2024	\$ 298.936	€ 271.895	1.481	0	1.481	0,07
BRC	01.2024	281.817	256.249	1.313	0	1.313	0,06
CBK	01.2024	€ 2.482	\$ 2.734	4	(12)	(8)	0,00
	01.2024	\$ 513	€ 469	5	0	5	0,00
MBC	01.2024	€ 2.404	\$ 2.627	0	(30)	(30)	0,00
	01.2024	\$ 152	€ 140	2	0	2	0,00
UAG	01.2024	281.865	256.249	1.266	0	1.266	0,06
				\$ 4.088	\$ (112)	\$ 3.976	0,18

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend und Class E GBP (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2024	£ 793	\$ 1.003	\$ 0	\$ (8)	\$ (8)	0,00
	01.2024	\$ 12.601	£ 9.947	80	0	80	0,00
BPS	01.2024	£ 4	\$ 5	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 10.038	£ 7.914	51	0	51	0,00
CBK	01.2024	£ 1.758	\$ 2.234	0	(8)	(8)	0,00
	01.2024	\$ 48	£ 38	1	0	1	0,00
GLM	01.2024	2.522	1.979	2	0	2	0,00
MBC	01.2024	£ 2.167	\$ 2.759	0	(4)	(4)	0,00
	01.2024	\$ 67.355	£ 53.473	815	0	815	0,04
MYI	01.2024	£ 551	\$ 704	1	0	1	0,00
	01.2024	\$ 67.160	£ 53.371	880	0	880	0,04
RYL	01.2024	64.362	50.849	462	0	462	0,02
SCX	01.2024	72.609	57.404	572	0	572	0,03
UAG	01.2024	£ 48	\$ 60	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	\$ 80.292	£ 63.441	586	0	586	0,03
				\$ 3.450	\$ (21)	\$ 3.429	0,16

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional SEK (Hedged) thesaurierend und Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2024	\$ 120.378	SEK 1.255.579	\$ 4.240	\$ 0	\$ 4.240	0,19
BRC	01.2024	513	5.257	9	0	9	0,00
CBK	01.2024	SEK 1.370	\$ 131	0	(5)	(5)	0,00
	01.2024	\$ 31.588	SEK 328.483	1.039	(25)	1.014	0,05
GLM	01.2024	SEK 7.276	\$ 697	0	(25)	(25)	0,00
	01.2024	\$ 2.434	SEK 24.916	39	0	39	0,00
MBC	01.2024	2.534	25.712	30	(12)	18	0,00
SCX	01.2024	140.199	1.456.102	4.322	0	4.322	0,20
UAG	01.2024	141.726	1.462.553	3.437	(2)	3.435	0,16
				\$ 13.116	\$ (69)	\$ 13.047	0,60

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 24.038 1,11

Summe Anlagen

\$ 2.424.698 111,73

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (254.491) (11,73)

Nettovermögen

\$ 2.170.207 100,00

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

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

- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
 (b) Wertpapier 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) Bedingt wandelbares Wertpapier.
 (g) Eingeschränkte Wertpapiere: (31. Dezember 2022: 0,87 %:-)

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	4,850 %	25.05.2047	23.09.2021	\$ 1.322	\$ 1.058	0,05
Brookfield Property Finance ULC	7,125	13.02.2028	09.02.2023	820	821	0,04
Citigroup, Inc.	2,572	03.06.2031	29.12.2021	8.152	6.923	0,32
Citigroup, Inc.	6,075	25.01.2026	18.01.2022	2.000	1.989	0,09
Deutsche Bank AG	1,447	01.04.2025	23.09.2021	2.001	1.976	0,09
Deutsche Bank AG	2,129	24.11.2026	29.11.2023	368	375	0,02
Oracle Corp.	3,950	25.03.2051	22.03.2021	300	235	0,01
				\$ 14.963	\$ 13.377	0,62

(h) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 106.702 (31. Dezember 2022: USD 74.895) waren zum 31. Dezember 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheiten verpfändet.

(i) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 36.266 (31. Dezember 2022: USD 22.792) waren zum 31. Dezember 2023 gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.

Barmittel in Höhe von USD 25.394 (31. Dezember 2022: USD 28.652) waren zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 560 (31. Dezember 2022: USD 1.380) waren zum 31. Dezember 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 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	\$ 2.410.642	\$ 0	\$ 2.410.642
Pensionsgeschäfte	0	1.300	0	1.300
Finanzderivate ⁽³⁾	(5.681)	18.437	0	12.756
Summen	\$ (5.681)	\$ 2.430.379	\$ 0	\$ 2.424.698

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.489.771	\$ 0	\$ 1.489.771
Pensionsgeschäfte	0	15.240	0	15.240
Finanzderivate ⁽³⁾	3.729	11.595	0	15.324
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(5.887)	0	(5.887)
Summen	\$ 3.729	\$ 1.510.719	\$ 0	\$ 1.514.448

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

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

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
BOS	5,350 %	29.12.2023	02.01.2024	\$ (2.190)	\$ (2.191)	(0,10)
BPS	4,300	22.11.2023	TBD ⁽¹⁾	(614)	(617)	(0,03)
BRC	5,500	14.12.2023	04.01.2024	(30.646)	(30.730)	(1,42)
JML	1,000	14.11.2023	TBD ⁽¹⁾	£ (998)	(1.274)	(0,06)
	4,100	14.11.2023	TBD ⁽¹⁾	(377)	(481)	(0,02)
MBC	3,400	15.08.2023	TBD ⁽¹⁾	€ (342)	(382)	(0,02)
SCX	5,750	28.12.2023	04.01.2024	\$ (72.311)	(72.357)	(3,33)
Summe umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (108.032)	(4,98)

⁽¹⁾ Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit ESG Fund (Forts.)

Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungs-geschäfte ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
BPG	(0,500) %	28.12.2023	02.01.2024	\$ (36.863)	\$ (36.861)	(1,70)
Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte					\$ (36.861)	(1,70)

⁽¹⁾ In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag sind USD 1 für einen aufgeschobenen Kursrückgang enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement ⁽¹⁾
AZD	\$ (78)	\$ 0	\$ (78)	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ k. A.
BOA	4.398	(5.630)	(1.232)	631	(740)	(109)
BPS	(141)	0	(141)	1	0	1
BRC	(50)	560	510	524	(240)	284
CBK	874	(1.340)	(466)	7.658	(7.770)	(112)
GLM	2.486	(2.440)	46	k. A.	k. A.	k. A.
JPM	k. A.	k. A.	k. A.	(244)	0	(244)
MBC	476	(570)	(94)	(1.588)	1.380	(208)
MYI	3.642	(4.170)	(528)	312	(100)	212
RYL	341	(570)	(229)	k. A.	k. A.	k. A.
SCX	4.854	(6.830)	(1.976)	4.744	(4.520)	224
UAG	7.236	(5.610)	1.626	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. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	84,95	81,73
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	26,04	26,66
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,09	0,36
Pensionsgeschäfte	0,06	1,11
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,54)	0,46
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,02	(0,30)
Freiverkehrsfinanzderivate	1,11	0,96
Leerverkaufte Wertpapiere	k. A.	(0,43)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(4,98)	(5,54)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(1,70)	(5,54)

· Gemäß der Liste der Märkte, die in Anhang 1 zum Prospekt aufgeführt sind und die Kriterien für gemäß OGAW-Vorschriften geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Australien	0,45	0,41
Österreich	0,37	0,22
Belgien	1,46	0,65
Brasilien	0,03	0,02
Kanada	2,31	1,75
Cayman-Inseln	0,09	0,27
Chile	0,32	0,44
Kolumbien	k. A.	0,09
Zypern	k. A.	0,08
Tschechische Republik	0,21	k. A.
Dänemark	1,29	0,79
Finnland	0,60	0,63
Frankreich	6,61	5,16
Deutschland	2,66	2,94
Guernsey, Kanalinseln	0,23	0,32
Hongkong	0,36	0,01
Indien	0,39	0,96
Indonesien	0,03	k. A.
Irland	1,04	1,40
Italien	1,62	1,33
Japan	3,84	3,85
Jersey, Kanalinseln	0,05	0,09
Luxemburg	0,85	1,23
Mauritius	0,21	0,18
Mexiko	0,37	0,32
Multinational	0,32	0,63

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Niederlande	8,70	7,21
Neuseeland	0,03	k. A.
Norwegen	0,28	0,16
Peru	0,08	0,11
Polen	0,07	k. A.
Rumänien	0,31	0,29
Serbien	0,08	0,13
Singapur	0,32	0,35
Südafrika	k. A.	0,02
Südkorea	1,95	1,02
Spanien	1,82	1,34
Supranational	3,75	2,90
Schweden	0,52	0,70
Schweiz	1,44	0,63
Vereinigte Arabische Emirate	0,20	k. A.
Großbritannien	9,90	8,14
USA	55,77	55,93
Jungferninseln (Britisch)	0,15	0,24
Kurzfristige Instrumente	k. A.	5,81
Pensionsgeschäfte	0,06	1,11
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,54)	0,46
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzkauf	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,01	(0,02)
Zinsswaps	0,01	(0,28)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Optionen auf Wertpapiere	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Devisenterminkontrakte	(0,22)	(0,50)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,33	1,46
Leerverkaufte Wertpapiere	k. A.	(0,43)
Sonstige Aktiva und Passiva	(11,73)	(10,55)
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Low Duration Real Return Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE			
AUSTRALIEN			
STAATSEMISSIONEN			
Australia Government International Bond			
0,750 % fällig am 21.11.2027 AUD	13.315	\$ 8.983	0,76
3,000 % fällig am 20.09.2025	6.440	4.521	0,39
Summe Australien		13.504	1,15

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
KANADA			
STAATSEMISSIONEN			
Canadian Government Real Return Bond			
4,250 % fällig am 01.12.2026 (d)	CAD 2.709	2.228	0,19

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
CAYMAN-INSELN			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
Atlas Senior Loan Fund Ltd.			
6,805 % fällig am 16.01.2030	\$ 1.075	1.074	0,09
Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd.			
6,755 % fällig am 15.10.2030	1.093	1.094	0,09
Sound Point CLO Ltd.			
6,605 % fällig am 15.04.2029	993	993	0,09
Summe Cayman-Inseln		3.161	0,27

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
DÄNEMARK			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Jyske Realkredit A/S			
0,500 % fällig am 01.10.2053 DKK	369	40	0,00
1,000 % fällig am 01.10.2050	18	2	0,00
1,000 % fällig am 01.10.2053	2.746	297	0,03
1,500 % fällig am 01.10.2050	490	58	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2053	15.133	1.727	0,15
2,500 % fällig am 01.10.2047	3	0	0,00
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab			
0,500 % fällig am 01.10.2043	10.231	1.233	0,10
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	2.958	316	0,03
1,000 % fällig am 01.01.2024	12.900	1.912	0,16
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	83.150	9.886	0,84
2,000 % fällig am 01.10.2053	8.595	1.052	0,09
2,500 % fällig am 01.10.2047	2	0	0,00
3,000 % fällig am 01.10.2053	49.467	6.887	0,59
3,500 % fällig am 01.10.2053	3.172	455	0,04
5,000 % fällig am 01.10.2053	7.141	1.062	0,09
Realkredit Danmark A/S			
1,000 % fällig am 01.01.2024	31.600	4.683	0,40
1,000 % fällig am 01.10.2050	7.343	852	0,07
1,000 % fällig am 01.10.2053	6.212	712	0,06
1,500 % fällig am 01.10.2050	16.175	1.899	0,16
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	26.557	3.692	0,31
Summe Dänemark		36.768	3,12

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
FRANKREICH			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
FCT CA Leasing			
4,736 % fällig am 26.02.2042	€ 3.166	3.509	0,30
Ginkgo Personal Loans			
4,666 % fällig am 23.09.2044	4.100	4.543	0,38
Summe Frankreich		8.052	0,68

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
STAATSEMISSIONEN			
France Government International Bond			
0,100 % fällig am 01.03.2025 (d)(f)	10.239	11.149	0,95
0,100 % fällig am 01.03.2026 (d)	4.016	4.394	0,37
0,100 % fällig am 01.03.2028 (d)	14.451	15.758	1,34
0,100 % fällig am 01.03.2029 (d)	596	654	0,06
0,100 % fällig am 25.07.2031 (d)	8.162	8.891	0,75
0,100 % fällig am 25.07.2036 (d)	244	255	0,02
0,100 % fällig am 25.07.2038 (d)	232	241	0,02
0,250 % fällig am 25.07.2024 (d)	15.484	16.992	1,44

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
0,550 % fällig am 01.03.2039 (d) €	3.005	\$ 3.279	0,28
1,850 % fällig am 25.07.2027 (d)	14.175	16.562	1,41
Summe Deutschland		78.175	6,64
Summe Frankreich		86.227	7,32

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
DEUTSCHLAND			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
Retail Automotive CP Germany UG			
4,553 % fällig am 21.07.2034	2.775	3.071	0,26

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau			
3,125 % fällig am 10.10.2028	26.000	29.663	2,52

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
STAATSEMISSIONEN			
Bundesrepublik Deutschland			
0,100 % fällig am 15.10.2031 (d)	21.232	23.068	1,96
Summe Deutschland		55.802	4,74

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
IRLAND			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
Adagio CLO DAC			
4,882 % fällig am 10.10.2031	3.000	3.277	0,28

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Ares European CLO DAC			
4,575 % fällig am 15.04.2030	5.464	5.989	0,51
4,745 % fällig am 15.10.2031	4.145	4.536	0,38
4,843 % fällig am 20.04.2032	2.000	2.175	0,18

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Aurium CLO DAC			
4,966 % fällig am 23.03.2032	1.700	1.863	0,16

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Bain Capital Euro CLO DAC			
4,773 % fällig am 20.04.2032	293	321	0,03

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Barings Euro CLO DAC			
4,918 % fällig am 27.07.2031	1.499	1.637	0,14

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Cairn CLO DAC			
4,745 % fällig am 15.10.2031	1.699	1.846	0,16

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Carlyle Euro CLO DAC			
4,665 % fällig am 15.01.2031	793	868	0,07

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Citizen Irish Auto Receivables Trust DAC			
4,623 % fällig am 15.12.2032	2.691	2.985	0,25

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Fidelity Grand Harbour CLO DAC			
5,125 % fällig am 15.03.2032	3.480	3.831	0,33

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Harvest CLO DAC			
4,815 % fällig am 15.01.2032	1.600	1.745	0,15

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Madison Park Euro Funding DAC			
4,872 % fällig am 18.11.2030	1.707	1.869	0,16

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Man GLG Euro CLO DAC			
4,696 % fällig am 25.10.2030	3.277	3.567	0,30

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Palmer Square European Loan Funding DAC			
5,779 % fällig am 15.10.2036	2.100	2.325	0,20

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Palmerston Park CLO DAC			
4,625 % fällig am 18.04.2030	797	877	0,07

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
St. Paul's CLO DAC			
4,786 % fällig am 25.04.2030	4.968	5.432	0,46
Summe Irland		59.700	5,07

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Summe Deutschland		78.175	6,64

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Summe Frankreich		86.227	7,32

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Summe Italien		175.825	14,94

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Summe Japan		75.179	6,39

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Summe Luxemburg		19.193	1,63

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Summe Niederlande		2.101	0,18

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Summe Neuseeland		10.475	0,89

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Summe Australien		13.504	1,15

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Summe Kanada		2.228	0,19

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Summe Cayman-Inseln		3.161	0,27

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Summe Dänemark		36.768	3,12

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Summe Frankreich		8.052	0,68

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Summe Deutschland		78.175	6,64

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Summe Irland		59.700	5,07

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Summe Italien		175.825	14,94

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Summe Japan		75.179	6,39

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Summe Luxemburg		19.193	1,63

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Summe Niederlande		2.101	0,18

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Summe Neuseeland		10.475	0,89

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Summe Australien		13.504	1,15

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Summe Kanada		2.228	0,19

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS	% DES
3,000 % fällig am 20.09.2030	NZD 1.301	\$ 859	0,07	
Summe Neuseeland		7.470	0,63	

PERU STAATSEMISSIONEN

Peru Government International Bond				
5,940 % fällig am 12.02.2029	PEN 700	189	0,02	

SLOWENIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL

Nova Ljubljanska Banka d.d.				
3,400 % fällig am 05.02.2030	€ 600	575	0,05	

SPANIEN FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE

Autonoria Spain				
4,576 % fällig am 30.09.2041	2.600	2.881	0,25	
BBVA Consumer Auto				
0,270 % fällig am 20.07.2031	155	168	0,01	
		3.049	0,26	

STAATSEMISSIONEN

Spain Government International Bond				
0,700 % fällig am 30.11.2033				
(d)	4.503	4.813	0,41	
Summe Spanien		7.862	0,67	

SUPRANATIONAL STAATSEMISSIONEN

Europäische Union				
3,125 % fällig am 05.12.2028	4.000	4.555	0,39	

SCHWEDEN STAATSEMISSIONEN

Sweden Government International Bond				
0,125 % fällig am 01.06.2026	SEK 50.623	4.922	0,42	
0,125 % fällig am 01.12.2027	5.401	523	0,04	
1,000 % fällig am 01.06.2025	65.222	6.428	0,55	
Summe Schweden		11.873	1,01	

SCHWEIZ UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL

Credit Suisse AG				
5,779 % fällig am 02.02.2024	\$ 1.650	1.649	0,14	
UBS Group AG				
4,965 % fällig am 16.01.2026	€ 600	664	0,05	
6,537 % fällig am 12.08.2033	\$ 750	801	0,07	
Summe Schweiz		3.114	0,26	

GROSSBRITANNIEN NON-AGENCY-MBS

Alba PLC				
5,509 % fällig am 17.03.2039	£ 747	924	0,08	
Atlas Funding PLC				
6,120 % fällig am 25.07.2058	2.020	2.577	0,22	
Avon Finance PLC				
0,000 % fällig am 28.12.2049	3.000	3.816	0,32	
Canada Square Funding PLC				
6,000 % fällig am 17.06.2058	1.483	1.882	0,16	
6,070 % fällig am 17.01.2059	3.467	4.394	0,37	
6,170 % fällig am 17.06.2058	1.312	1.670	0,14	
Canterbury Finance PLC				
6,046 % fällig am 16.05.2058	2.525	3.213	0,27	
Eurosail PLC				
4,108 % fällig am 13.03.2045	€ 467	513	0,04	
4,219 % fällig am 10.06.2044	449	494	0,04	
4,219 % fällig am 10.09.2044	719	789	0,07	
5,489 % fällig am 13.03.2045	£ 580	735	0,06	
Friary PLC				
0,000 % fällig am 21.10.2071	2.300	2.942	0,25	
Great Hall Mortgages PLC				
5,469 % fällig am 18.03.2039	9	12	0,00	
5,489 % fällig am 18.06.2038	180	229	0,02	
Jupiter Mortgage PLC				
6,021 % fällig am 20.07.2060	2.375	3.028	0,26	

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS	% DES
Lanebrook Mortgage Transaction PLC				
5,871 % fällig am 20.07.2058	£ 2.753	\$ 3.485	0,30	
London Wall Mortgage Capital PLC				
6,020 % fällig am 15.05.2052	790	1.002	0,09	
Mortimer BTL PLC				
5,920 % fällig am 23.06.2053	2.637	3.342	0,28	
Polaris PLC				
5,995 % fällig am 23.10.2059	2.186	2.773	0,24	
Precise Mortgage Funding PLC				
6,126 % fällig am 16.10.2056	199	253	0,02	
6,420 % fällig am 12.12.2055	813	1.037	0,09	
RMAC PLC				
0,000 % fällig am 15.02.2047	3.000	3.837	0,33	
RMAC Securities PLC				
5,489 % fällig am 12.06.2044	1.388	1.709	0,15	
Rochester Financing PLC				
5,920 % fällig am 18.12.2044	2.618	3.313	0,28	
Stratton BTL Mortgage Funding PLC				
5,951 % fällig am 20.01.2054	3.501	4.450	0,38	
Stratton Mortgage Funding PLC				
5,920 % fällig am 12.12.2043	5.602	7.092	0,60	
6,120 % fällig am 12.03.2052	687	876	0,07	
Towd Point Mortgage Funding PLC				
6,570 % fällig am 20.05.2045	2.792	3.564	0,30	
6,571 % fällig am 20.07.2045	1.925	2.461	0,21	
Tower Bridge Funding PLC				
0,000 % fällig am 20.01.2066 (a)	2.100	2.682	0,23	
5,940 % fällig am 20.12.2063	789	1.001	0,08	
6,000 % fällig am 20.11.2063	3.351	4.262	0,36	
6,721 % fällig am 20.10.2064	4.374	5.609	0,48	
Tudor Rose Mortgages				
5,820 % fällig am 20.06.2048	1.194	1.514	0,13	
Twin Bridges PLC				
5,880 % fällig am 12.09.2055	2.246	2.840	0,24	
6,470 % fällig am 12.12.2054	2.101	2.682	0,23	
		87.002	7,39	

Summe Großbritannien		223.800	19,01	
----------------------	--	---------	-------	--

USA FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE

Aegis Asset-Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Certificates				
6,370 % fällig am 25.10.2034	\$ 312	316	0,03	
Renaissance Home Equity Loan Trust				
6,410 % fällig am 25.05.2034	1.868	1.665	0,14	
Structured Asset Investment Loan Trust				
6,420 % fällig am 25.10.2033	734	724	0,06	
		2.705	0,23	
Summe USA		1.112.470	94,50	

USA FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE

Aegis Asset-Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Certificates				
6,370 % fällig am 25.10.2034	\$ 312	316	0,03	
Renaissance Home Equity Loan Trust				
6,410 % fällig am 25.05.2034	1.868	1.665	0,14	
Structured Asset Investment Loan Trust				
6,420 % fällig am 25.10.2033	734	724	0,06	
		2.705	0,23	

UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL

Sabine Pass Liquefaction LLC				
5,750 % fällig am 15.05.2024	100	100	0,01	
Summe USA		1.112.470	94,50	

NON-AGENCY-MBS

Structured Asset Mortgage Investments Trust				
5,950 % fällig am 19.04.2035	229	216	0,02	
5,970 % fällig am 19.07.2035	44	40	0,00	
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
6,050 % fällig am 25.07.2045	381	357	0,03	
6,110 % fällig am 25.07.2045	73	69	0,01	
		682	0,06	

US-REGIERUNGSBEHÖRDEN

Ginnie Mae				
6,137 % fällig am 20.08.2066	106	106	0,01	
6,138 % fällig am 20.08.2072 - 20.04.2073	9.303	9.233	0,78	

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS	% DES
6,238 % fällig am 20.10.2072	\$ 5.021	\$ 4.925	0,42	
6,246 % fällig am 20.08.2068	1.043	1.023	0,09	
6,338 % fällig am 20.03.2073	5.692	5.613	0,48	
6,438 % fällig am 20.05.2073	3.255	3.272	0,28	

Uniform Mortgage-Backed Security				
4,500 % fällig am 01.08.2052	993	964	0,08	
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				
4,000 % fällig am 01.02.2054	30.500	28.876	2,45	
4,500 % fällig am 01.02.2054	56.300	54.613	4,63	
6,000 % fällig am 01.02.2054	26.900	27.315	2,32	
6,500 % fällig am 01.02.2054	18.500	18.957	1,61	
		154.897	13,15	

US-SCHATZOBIGATIONEN

U.S. Treasury Inflation Protected Securities (d)				
0,125 % fällig am 15.10.2024 (f)	57.322	56.077	4,76	
0,125 % fällig am 15.04.2025 (g)	55.472	53.497	4,54	
0,125 % fällig am 15.10.2025 (f)	53.123	51.089	4,34	
0,125 % fällig am 15.04.2026 (g)	54.003	51.411	4,37	
0,125 % fällig am 15.07.2026 (f)	72.259	68.865	5,85	
0,125 % fällig am 15.10.2026 (f)	71.160	67.588	5,74	
0,125 % fällig am 15.04.2027	22.775	21.406	1,82	
0,125 % fällig am 15.01.2030	2.272	2.060	0,18	
0,125 % fällig am 15.07.2030	6.360	5.749	0,49	
0,125 % fällig am 15.07.2031	4.913	4.371	0,37	
0,125 % fällig am 15.01.2032	1.665	1.463	0,12	
0,125 % fällig am 15.02.2051	355	220	0,02	
0,250 % fällig am 15.01.2025 (f)	73.654	71.498	6,07	
0,250 % fällig am 15.02.2050	479	313	0,03	
0,375 % fällig am 15.07.2025 (f)	58.643	56.824	4,83	
0,375 % fällig am 15.01.2027 (f)	70.181	66.709	5,67	
0,375 % fällig am 15.07.2027	48.424	46.026	3,91	
0,500 % fällig am 15.01.2028 (f)	108.020	102.247	8,69	
0,625 % fällig am 15.01.2026 (f)	66.595	64.265	5,46	
0,625 % fällig am 15.07.2032	7.307	6.680	0,57	
0,750 % fällig am 15.07.2028	30.766	29.453	2,50	
0,750 % fällig am 15.02.2045	1.960	1.534	0,13	
0,875 % fällig am 15.01.2029 (f)	54.101	51.795	4,40	
0,875 % fällig am 15.02.2047	765	603	0,05	
1,375 % fällig am 15.07.2033	6.686	6.487	0,55	
1,375 % fällig am 15.02.2044	1.188	1.063	0,09	
1,625 % fällig am 15.10.2027 (f)	64.396	63.926	5,43	
2,125 % fällig am 15.02.2041	843	867	0,07	
		954.086	81,05	
Summe USA		1.112.470	94,50	

KURZFRISTIGE INSTRUMENTE COMMERCIAL PAPER

AT+T, Inc.				
5,700 % fällig am 19.03.2024	3.800	3.752	0,32	

UNGARISCHE SCHATZWECHSEL

10,900 % fällig am 04.01.2024 (b)(c)	HUF929.000	2.683	0,23	
Summe kurzfristige Instrumente		6.435	0,55	

Summe übertragbare Wertpapiere

	\$ 1.923.658	163,42		
--	--------------	--------	--	--

AKTIEN

INVESTMENTFONDS ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN

PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short - Term Floating NAV Fund (e)	50.773	506	0,04	
Summe Investmentfonds		\$ 506	0,04	

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Low Duration Real Return Fund (Forts.)

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	2,600 %	29.12.2023	02.01.2024	\$ 2.889	U.S. Treasury Notes 4,875 % fällig am 30.11.2025	\$ (2.947)	\$ 2.889	\$ 2.890	0,25
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (2.947)	\$ 2.889	\$ 2.890	0,25

⁽¹⁾ Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month Euribor September Futures	Short	09.2025	438	\$ (378)	(0,03)
3-Month Euribor September Futures	Long	09.2026	438	297	0,02
Australia Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2024	16	(37)	0,00
Euro-Bobl March Futures	Short	03.2024	182	(389)	(0,03)
Euro-BTP Italy Government Bond March Futures	Short	03.2024	304	(931)	(0,08)
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2024	491	(2.040)	(0,17)
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Short	03.2024	29	(367)	(0,03)
Euro-OAT France Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2024	15	(62)	(0,01)
Euro-Schatz March Futures	Short	03.2024	1.032	(650)	(0,06)
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Short	03.2024	148	(146)	(0,01)
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Short	03.2024	1.374	(3.364)	(0,29)
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2024	377	1.446	0,12
U.S. Treasury 10-Year Ultra March Futures	Short	03.2024	271	(1.561)	(0,13)
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Long	03.2024	183	1.040	0,09
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2024	217	(2.754)	(0,23)
United Kingdom Long Gilt March Futures	Long	03.2024	12	107	0,01
				\$ (9.789)	(0,83)

VERKAUFSOPTIONEN

FUTURE-ÄHNLICHE OPTIONEN AUF BÖRSEGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
Call - EUREX Euro-Bund February 2024 Futures	€ 137,000	26.01.2024	51	\$ (37)	\$ (79)	(0,01)
Call - ICE Euribor April 2024 Futures	96,750	12.04.2024	420	(284)	(285)	(0,02)
					(364)	(0,03)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate						\$ (10.153) (0,86)

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	5,000 %	20.03.2029	£ 23.300	\$ (1.697)	(0,14)
Zahlung ⁽¹⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	5,500	20.03.2026	34.900	549	0,05
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	16.06.2029	¥ 1.952.000	(11)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,237	21.11.2053	\$ 8.700	1.693	0,14
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,340	21.11.2028	43.000	(2.448)	(0,21)
Erhalt ⁽¹⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,865	13.02.2054	13.500	780	0,07
Zahlung ⁽¹⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,085	13.02.2034	44.400	(966)	(0,08)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,400	23.02.2033	2.700	(45)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2033	7.300	(78)	(0,01)
Zahlung ⁽¹⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,900	22.03.2026	23.700	40	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	20.12.2025	68.000	(621)	(0,05)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,868	22.12.2025	23.700	(247)	(0,02)
Erhalt ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	20.03.2054	€ 41.660	(5.042)	(0,43)
Zahlung ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.03.2034	148.920	9.334	0,79
Erhalt ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.03.2044	1.400	(192)	(0,02)
Zahlung ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,250	20.03.2029	16.400	656	0,06
Erhalt ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,500	20.03.2026	54.500	(962)	(0,08)
Zahlung	CPTFEMU	1,355	15.02.2050	1.200	(54)	0,00
Zahlung	CPTFEMU	1,375	15.02.2040	1.600	(151)	(0,01)
Zahlung	CPTFEMU	1,946	15.03.2048	800	(134)	(0,01)
Zahlung	CPTFEMU	2,356	15.11.2033	4.200	103	0,01
Erhalt	CPTFEMU	2,359	15.08.2030	1.500	36	0,00

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	CPTFEMU		2,363 %	15.11.2033	€ 2.300	\$ 54	0,00
Zahlung	CPTFEMU		2,390	15.11.2033	2.400	62	0,01
Zahlung	CPTFEMU		2,488	15.05.2037	2.290	(72)	(0,01)
Erhalt	CPTFEMU		2,548	15.11.2053	700	(22)	0,00
Zahlung	CPTFEMU		2,580	15.03.2052	1.400	(57)	0,00
Zahlung	CPTFEMU		2,590	15.12.2052	1.700	57	0,00
Erhalt	CPTFEMU		2,620	15.11.2053	1.500	(91)	(0,01)
Zahlung	CPTFEMU		2,700	15.04.2053	5.500	500	0,04
Zahlung	CPTFEMU		2,763	15.09.2053	2.400	255	0,02
Erhalt	CPTFEMU		2,975	15.08.2027	19.700	(153)	(0,01)
Erhalt	CPTFEMU		3,000	15.05.2027	5.400	44	0,00
Erhalt	CPTFEMU		3,130	15.05.2027	100	1	0,00
Zahlung	CPTFEMU		3,520	15.09.2024	5.200	(21)	0,00
Zahlung	CPTFEMU		3,720	15.09.2024	3.300	0	0,00
Zahlung	CPTFEMU		3,850	15.09.2024	7.700	6	0,00
Erhalt	CPURNSA		1,794	24.08.2027	\$ 6.700	177	0,01
Erhalt	CPURNSA		1,798	25.08.2027	3.400	90	0,01
Zahlung	CPURNSA		1,883	20.11.2029	7.400	(197)	(0,02)
Erhalt	CPURNSA		1,890	27.08.2027	6.500	173	0,01
Zahlung	CPURNSA		1,954	03.06.2029	4.700	(128)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA		1,998	25.07.2029	4.300	(119)	(0,01)
Erhalt	CPURNSA		2,311	24.02.2031	6.600	185	0,02
Zahlung	CPURNSA		2,335	05.02.2028	6.110	(187)	(0,02)
Zahlung	CPURNSA		2,353	09.05.2028	960	(29)	0,00
Zahlung	CPURNSA		2,364	10.05.2028	7.960	(243)	(0,02)
Zahlung	CPURNSA		2,379	09.07.2028	1.900	(59)	(0,01)
Erhalt	CPURNSA		2,419	05.03.2026	400	11	0,00
Zahlung	CPURNSA		2,420	24.08.2024	17.800	(9)	0,00
Zahlung	CPURNSA		2,560	12.09.2024	4.400	7	0,00
Zahlung	CPURNSA		2,565	12.09.2024	4.200	7	0,00
Erhalt	CPURNSA		2,690	01.06.2026	1.300	37	0,00
Erhalt	CPURNSA		2,703	25.05.2026	2.450	70	0,01
Erhalt	CPURNSA		2,768	13.05.2026	3.500	102	0,01
Erhalt	CPURNSA		2,813	14.05.2026	1.600	47	0,00
Zahlung	FRCPXTOB		1,280	15.11.2034	€ 1.700	(138)	(0,01)
Zahlung	FRCPXTOB		1,410	15.11.2039	2.000	(152)	(0,01)
Zahlung	UKRPI		3,330	15.01.2025	£ 400	(51)	0,00
Zahlung	UKRPI		3,346	15.05.2030	550	(39)	0,00
Zahlung	UKRPI		3,850	15.09.2024	2.500	(338)	(0,03)
						\$ 323	0,03
						\$ 323	0,03

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

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

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

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

VERKAUFSOPTIONEN

INFLATION-CAPPED OPTIONS

Kontrahent	Beschreibung	Anfänglicher Index	Variabler Zinssatz	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens
GLM	Cap - OTC CPALEMU	\$ 100,151	Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 3,000 %] oder 0	22.06.2035	1.500	\$ (68)	\$ (55)	0,00
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)	\$ (55)	0,00

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BPS	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,700 %	13.02.2024	44.000	\$ (192)	\$ (651)	(0,05)
BRC	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	3,150	06.10.2025	16.800	(194)	(437)	(0,04)
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,150	06.10.2025	16.800	(194)	(70)	(0,01)
CBK	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,950	15.09.2025	14.000	(169)	(327)	(0,03)
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,950	15.09.2025	14.000	(169)	(77)	(0,01)
FAR	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,760	16.01.2024	39.200	(182)	(553)	(0,05)
GLM	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,900	20.03.2024	47.400	(229)	(264)	(0,02)
	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,900	29.08.2025	8.800	(115)	(193)	(0,02)
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,900	29.08.2025	8.800	(115)	(44)	0,00
GST	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,800	01.09.2025	18.900	(239)	(385)	(0,03)
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,800	01.09.2025	18.900	(239)	(105)	(0,01)
MYC	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,758	16.01.2024	4.000	(18)	(56)	0,00
							\$ (2.055)	\$ (3.162)	(0,27)

(1) Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Low Duration Real Return Fund (Forts.)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
GST	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500 %	17.10.2057	\$ 599	\$ (40)	\$ 40	\$ 0	0,00
SAL	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	1.400	(3)	(3)	(6)	0,00
UAG	CMBX.NA.AAA.9 Index	0,500	17.09.2058	893	(79)	80	1	0,00
					\$ (122)	\$ 117	\$ (5)	0,00

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

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	01.2024	AUD 10.845	\$ 7.184	\$ 0	\$ (218)	\$ (218)	(0,02)
BOA	01.2024	£ 6.911	8.777	0	(32)	(32)	0,00
	01.2024	¥ 4.500.834	30.500	0	(1.446)	(1.446)	(0,12)
	01.2024	\$ 100	MXN 1.702	0	0	0	0,00
	03.2024	CNH 67.588	\$ 9.402	0	(145)	(145)	(0,01)
	06.2024	KRW 6.091.275	4.682	0	(59)	(59)	(0,01)
BPS	01.2024	DKK 101.129	14.911	0	(79)	(79)	(0,01)
	01.2024	€ 25.619	28.201	0	(106)	(106)	(0,01)
	01.2024	£ 27.611	35.012	0	(188)	(188)	(0,02)
	01.2024	HUF 247.002	702	0	(12)	(12)	0,00
	01.2024	¥ 2.624.349	17.899	0	(728)	(728)	(0,06)
	01.2024	KRW 65.689	50	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	\$ 100	BRL 491	1	0	1	0,00
	01.2024	2.932	DKK 19.910	19	0	19	0,00
	01.2024	1.878	€ 1.698	0	(2)	(2)	0,00
	01.2024	2.182	£ 1.716	5	0	5	0,00
	01.2024	1	HUF 405	0	0	0	0,00
	01.2024	150	IDR 2.319.926	1	0	1	0,00
	01.2024	4.328	ZAR 80.230	54	0	54	0,01
BRC	01.2024	€ 350.531	\$ 385.507	0	(1.796)	(1.796)	(0,15)
	01.2024	KRW 193.845	150	0	0	0	0,00
	01.2024	NZD 10.778	6.630	0	(194)	(194)	(0,02)
	01.2024	\$ 2.443	MXN 42.854	77	0	77	0,01
	03.2024	2.599	IDR 40.399.626	21	0	21	0,00
CBK	01.2024	DKK 8.095	\$ 1.186	0	(14)	(14)	0,00
	01.2024	HUF 93.819	268	0	(3)	(3)	0,00
	01.2024	IDR 2.314.281	150	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 1.048	£ 828	7	0	7	0,00
	01.2024	ZAR 2.616	\$ 139	0	(4)	(4)	0,00
	03.2024	PEN 7.116	1.890	0	(28)	(28)	0,00
	03.2024	\$ 150	IDR 2.314.875	0	0	0	0,00
DUB	01.2024	KRW 129.970	\$ 100	0	0	0	0,00
GLM	01.2024	CAD 18.747	13.797	0	(422)	(422)	(0,03)
	01.2024	DKK 123.576	18.229	0	(89)	(89)	(0,01)
	01.2024	¥ 1.158.200	7.899	0	(321)	(321)	(0,03)
JPM	01.2024	DKK 44.370	6.525	0	(50)	(50)	0,00
	01.2024	HUF 547.329	1.560	0	(22)	(22)	0,00
	01.2024	\$ 150	IDR 2.308.050	0	0	0	0,00
	01.2024	50	KRW 64.809	0	0	0	0,00
	02.2024	3.549	BRL 17.408	28	0	28	0,00
	06.2024	KRW 64.254	\$ 50	0	0	0	0,00
MBC	01.2024	AUD 4.417	2.929	0	(86)	(86)	(0,01)
	01.2024	€ 5.847	6.386	0	(75)	(75)	(0,01)
MYI	01.2024	£ 49	63	0	0	0	0,00
	01.2024	HUF 37.894	108	0	(2)	(2)	0,00
	01.2024	¥ 1.709.711	11.597	0	(538)	(538)	(0,04)
	01.2024	\$ 1.989	DKK 13.540	18	0	18	0,00
	01.2024	460	€ 414	0	(2)	(2)	0,00
	01.2024	570	£ 447	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	149	ZAR 2.762	2	0	2	0,00
	03.2024	150	IDR 2.324.475	1	0	1	0,00
SCX	01.2024	SEK 107.612	\$ 10.361	0	(319)	(319)	(0,03)
	01.2024	\$ 1.326	MXN 23.282	43	0	43	0,00
	03.2024	TWD 221.462	\$ 7.120	0	(218)	(218)	(0,02)
	03.2024	\$ 2.373	INR 198.486	4	0	4	0,00
UAG	01.2024	AUD 3.571	\$ 2.369	0	(68)	(68)	(0,01)
	01.2024	£ 143.076	181.066	0	(1.333)	(1.333)	(0,11)
	01.2024	¥ 180.124	1.230	0	(49)	(49)	0,00
	01.2024	\$ 199	MXN 3.492	7	0	7	0,00
	03.2024	2.256	INR 188.801	5	0	5	0,00
				\$ 293	\$ (8.650)	\$ (8.357)	(0,71)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 31. Dezember 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	01.2024	CHF 21	\$ 25	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
BRC	01.2024	\$ 566	CHF 494	21	0	21	0,00
CBK	01.2024	CHF 143	\$ 165	0	(6)	(6)	0,00
	01.2024	\$ 13.900	CHF 12.110	496	0	496	0,04
GLM	01.2024	CHF 27	\$ 31	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	\$ 14.054	CHF 12.316	587	0	587	0,05
MYI	01.2024	14.134	12.338	533	0	533	0,05
SCX	01.2024	CHF 1	\$ 2	0	0	0	0,00
				\$ 1.637	\$ (8)	\$ 1.629	0,14

Zum 31. Dezember 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
BPS	01.2024	€ 13.530	\$ 14.821	\$ 0	\$ (128)	\$ (128)	(0,01)
	01.2024	\$ 1.834	€ 1.673	15	0	15	0,00
BRC	01.2024	153.797	139.843	717	0	717	0,06
CBK	01.2024	€ 3.263	\$ 3.555	0	(50)	(50)	0,00
MBC	01.2024	4.202	4.577	0	(66)	(66)	(0,01)
MYI	01.2024	\$ 157.658	€ 143.440	829	0	829	0,07
UAG	01.2024	157.779	143.440	709	0	709	0,06
				\$ 2.270	\$ (244)	\$ 2.026	0,17

Zum 31. Dezember 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	01.2024	£ 73	\$ 93	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	01.2024	\$ 3.563	£ 2.808	17	0	17	0,00
BPS	01.2024	£ 70	\$ 89	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	\$ 7.584	£ 5.979	38	0	38	0,00
BRC	01.2024	146	115	1	0	1	0,00
CBK	01.2024	£ 577	\$ 731	0	(4)	(4)	0,00
GLM	01.2024	20	25	0	0	0	0,00
MBC	01.2024	1.393	1.766	0	(10)	(10)	0,00
MYI	01.2024	97	123	1	(1)	0	0,00
SCX	01.2024	\$ 43.437	£ 34.341	342	0	342	0,03
SSB	01.2024	£ 81	\$ 102	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	\$ 31.525	£ 24.983	325	0	325	0,03
UAG	01.2024	£ 80	\$ 100	0	(2)	(2)	0,00
	01.2024	\$ 43.430	£ 34.316	318	0	318	0,03
				\$ 1.042	\$ (20)	\$ 1.022	0,09

Zum 31. Dezember 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
AZD	01.2024	\$ 150.987	SGD 201.348	\$ 1.697	\$ 0	\$ 1.697	0,14
BOA	01.2024	150.987	201.436	1.763	0	1.763	0,15
CBK	01.2024	125.608	167.576	1.466	0	1.466	0,13
GLM	01.2024	23.742	31.688	286	0	286	0,02
				\$ 5.212	\$ 0	\$ 5.212	0,44

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (1.690) (0,14)

Summe Anlagen

\$ 1.915.533 162,74

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (738.481) (62,74)

Nettovermögen

\$ 1.177.052 100,00

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

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

- Wertpapier per Emissionstermin.
- Nullkuponwertpapier.
- Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- Mit dem Teilfonds verbunden.

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Low Duration Real Return Fund (Forts.)

Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 620.826 (31. Dezember 2022: USD 183.180) waren zum 31. Dezember 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheiten verpfändet.

(g) Ein Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von USD 24.628 (31. Dezember 2022: USD 79.359) war zum 31. Dezember 2023 gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.

Barmittel in Höhe von USD 3.735 (31. Dezember 2022: USD 286) waren zum 31. Dezember 2023 gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte Barmittel als Sicherheiten erhalten worden.

Barmittel in Höhe von USD 17.518 (31. Dezember 2022: USD 13.037) waren zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 7.060 (31. Dezember 2022: USD 5.380) waren zum 31. Dezember 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 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	\$ 1.920.976	\$ 2.682	\$ 1.923.658
Investmentfonds	506	0	0	506
Pensionsgeschäfte	0	2.889	0	2.889
Finanzderivate ⁽³⁾	(4.814)	(6.706)	0	(11.520)
Summen	\$ (4.308)	\$ 1.917.159	\$ 2.682	\$ 1.915.533

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.661.693	\$ 0	\$ 1.661.693
Investmentfonds	12.424	0	0	12.424
Pensionsgeschäfte	0	1.053	0	1.053
Finanzderivate ⁽³⁾	2.256	18.777	0	21.033
Summen	\$ 14.680	\$ 1.681.523	\$ 0	\$ 1.696.203

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

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

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BOS	5,750 %	28.12.2023	04.01.2024	\$ (3.869)	\$ (3.872)	(0,33)
BRC	3,950	01.11.2023	07.02.2024	€ (8.423)	(9.365)	(0,80)
CIB	5,470	07.12.2023	04.01.2024	\$ (602.489)	(604.777)	(51,38)
Summe umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (618.014)	(52,51)

Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Zahlbar für Rückkauf- Finanzierungs- geschäfte ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
BPG	5,710 %	28.12.2023	04.01.2024	\$ (2.462)	\$ (2.463)	(0,21)
TDM	5,530	19.12.2023	02.01.2024	(22.179)	(22.223)	(1,89)
Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte					\$ (24.686)	(2,10)

(1) In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag sind USD 5 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 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
AZD	\$ 1.479	\$ (1.630)	\$ (151)	\$ 1.129	\$ (820)	\$ 309
BOA	97	0	97	2.665	(2.510)	155
BPS	(1.764)	2.020	256	(530)	450	(80)
BRC	(1.660)	2.920	1.260	166	0	166
CBK	1.456	(2.120)	(664)	6.045	(6.000)	45

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
DUB	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ (1.270)	\$ 1.230	\$ (40)
FAR	(553)	490	(63)	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	(516)	540	24	1.583	(1.500)	83
GST	(490)	470	(20)	(1.050)	1.130	80
JPM	(44)	0	(44)	(314)	640	326
MBC	(237)	310	73	(485)	340	(145)
MYC	(56)	0	(56)	(12)	30	18
MYI	840	(1.770)	(930)	(2.046)	1.530	(516)
RBC	k. A.	k. A.	k. A.	317	(280)	37
RYL	k. A.	k. A.	k. A.	773	(450)	323
SAL	(6)	10	4	(11)	10	(1)
SCX	(148)	300	152	5.105	(4.920)	185
SSB	324	(440)	(116)	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	k. A.	k. A.	k. A.	31	(60)	(29)
UAG	(412)	0	(412)	(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. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	145,93	114,97
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	17,21	6,69
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,28	0,13
Investmentfonds	0,04	0,91
Pensionsgeschäfte	0,25	0,08
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,86)	0,26
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,03	0,40
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,14)	0,88
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(52,51)	(19,18)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(2,10)	(5,83)

* Gemäß der Liste der Märkte, die in Anhang 1 zum Prospekt aufgeführt sind und die Kriterien für gemäß OGAW-Vorschriften geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Australien	1,15	1,01
Kanada	0,19	0,16
Cayman-Inseln	0,27	0,55
Dänemark	3,12	3,10
Frankreich	7,32	5,15
Deutschland	4,74	4,63
Irland	6,40	3,76
Italien	14,94	6,49
Japan	6,39	5,03
Luxemburg	1,63	0,17
Niederlande	0,18	0,19
Neuseeland	0,63	0,52
Peru	0,02	0,09
Slowenien	0,05	0,04
Spanien	0,67	0,35
Supranational	0,39	k. A.
Schweden	1,01	0,82
Schweiz	0,26	k. A.
Großbritannien	19,01	14,56
USA	94,50	75,17
Kurzfristige Instrumente	0,55	k. A.
Investmentfonds	0,04	0,91
Pensionsgeschäfte	0,25	0,08
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,83)	0,26
Verkaufsoptionen		
Future-ähnliche Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	(0,03)	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	k. A.	0,00
Zinsswaps	0,03	0,40
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	k. A.	0,27
Verkaufsoptionen		
Inflation-Capped Options	0,00	(0,01)
Zinsswapoptionen	(0,27)	(0,57)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,00	0,00
Devisenterminkontrakte	(0,71)	(0,55)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,84	1,74
Sonstige Aktiva und Passiva	(62,74)	(24,32)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS	% DES
STAATSEMISSIONEN				
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro				
0,400 % fällig am 15.05.2030 (d) €	26.506	27.372	1,15	
1,250 % fällig am 15.09.2032 (d)	9.408	10.090	0,42	
1,300 % fällig am 15.05.2028 (d)	59.282	65.462	2,75	
1,400 % fällig am 26.05.2025 (d)	70.063	76.178	3,20	
2,400 % fällig am 15.05.2039 (d)	40.803	46.751	1,96	
4,100 % fällig am 01.02.2029	43.400	50.281	2,11	
		<u>276.134</u>	<u>11,59</u>	
Summe Italien		<u>294.881</u>	<u>12,38</u>	

JAPAN				
STAATSEMISSIONEN				
Japan Government International Bond				
0,100 % fällig am 10.03.2025 (d) ¥	368.900	2.682	0,11	
0,100 % fällig am 10.03.2026 (d)	3.592.054	26.485	1,11	
0,100 % fällig am 10.03.2028 (d)	5.035.952	37.543	1,58	
0,100 % fällig am 10.03.2029 (d)	7.379.236	55.143	2,32	
Summe Japan		<u>121.853</u>	<u>5,12</u>	

LUXEMBURG				
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
Compartment VCL				
4,273 % fällig am 21.08.2029 €	6.242	6.901	0,29	
Driver UK Multi-Compartment S.A.				
5,847 % fällig am 25.04.2031 £	6.000	7.662	0,32	
SC Germany S.A. Compartment Consumer				
4,578 % fällig am 15.09.2037 €	5.600	6.212	0,26	
Summe Luxemburg		<u>20.775</u>	<u>0,87</u>	

NIEDERLANDE				
NON-AGENCY-MBS				
Eurosail BV				
5,485 % fällig am 17.10.2040	202	223	0,01	

STAATSEMISSIONEN				
BNG Bank NV				
0,500 % fällig am 21.12.2026 £	7.700	8.848	0,37	
Nederlandse Waterschapsbank NV				
0,875 % fällig am 30.09.2026	7.500	8.762	0,37	
		<u>17.610</u>	<u>0,74</u>	
Summe Niederlande		<u>17.833</u>	<u>0,75</u>	

NEUSEELAND				
STAATSEMISSIONEN				
New Zealand Government International Bond				
2,000 % fällig am 20.09.2025 NZD	70.602	44.561	1,87	
3,000 % fällig am 20.09.2030	55	36	0,00	
Summe Neuseeland		<u>44.597</u>	<u>1,87</u>	

PERU				
STAATSEMISSIONEN				
Peru Government International Bond				
5,940 % fällig am 12.02.2029 PEN	1.200	324	0,01	

SLOWENIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Nova Ljubljanska Banka d.d.				
3,400 % fällig am 05.02.2030 €	1.100	1.055	0,04	

SPANIEN				
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
Autonoria Spain				
4,576 % fällig am 30.09.2041	5.200	5.763	0,24	

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS	% DES
BBVA Consumer Auto				
0,270 % fällig am 20.07.2031 €	325	\$ 351	0,02	
		<u>6.114</u>	<u>0,26</u>	
STAATSEMISSIONEN				
Spain Government International Bond				
0,500 % fällig am 31.10.2031	200	186	0,01	
0,600 % fällig am 31.10.2029	24.400	24.053	1,01	
0,700 % fällig am 30.11.2033 (d)	17.891	19.123	0,80	
0,850 % fällig am 30.07.2037	400	326	0,01	
1,000 % fällig am 30.11.2030 (d)	2.797	3.121	0,13	
3,150 % fällig am 30.04.2033	228	256	0,01	
3,550 % fällig am 31.10.2033	160	185	0,01	
3,900 % fällig am 30.07.2039	500	585	0,03	
		<u>47.835</u>	<u>2,01</u>	
Summe Spanien		<u>53.949</u>	<u>2,27</u>	

SUPRANATIONAL				
STAATSEMISSIONEN				
Europäische Union				
3,125 % fällig am 05.12.2028	7.800	8.882	0,37	

SCHWEDEN				
STAATSEMISSIONEN				
Sweden Government International Bond				
0,125 % fällig am 01.06.2026 SEK	117.724	11.447	0,48	
0,125 % fällig am 01.12.2027	17.102	1.657	0,07	
0,125 % fällig am 01.06.2032	58.430	5.624	0,24	
1,000 % fällig am 01.06.2025	131.355	12.945	0,54	
Summe Schweden		<u>31.673</u>	<u>1,33</u>	

SCHWEIZ				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
UBS Group AG				
2,125 % fällig am 13.10.2026 €	900	967	0,04	
2,875 % fällig am 02.04.2032	700	724	0,03	
4,965 % fällig am 16.01.2026	300	332	0,02	
6,373 % fällig am 15.07.2026 \$	750	759	0,03	
7,750 % fällig am 01.03.2029 €	1.000	1.274	0,05	
Summe Schweiz		<u>4.056</u>	<u>0,17</u>	

GROSSBRITANNIEN				
NON-AGENCY-MBS				
Alba PLC				
5,509 % fällig am 17.03.2039 £	1.779	2.200	0,09	
Atlas Funding PLC				
6,120 % fällig am 25.07.2058	4.489	5.726	0,24	
Avon Finance PLC				
0,000 % fällig am 28.12.2049	6.500	8.269	0,35	
Brants Bridge PLC				
6,120 % fällig am 14.06.2066	4.422	5.627	0,24	
Canada Square Funding PLC				
6,070 % fällig am 17.01.2059	8.007	10.148	0,43	
Canterbury Finance PLC				
6,046 % fällig am 16.05.2058	4.882	6.212	0,26	

Eurosail PLC				
4,108 % fällig am 13.03.2045 €	937	1.028	0,04	
4,219 % fällig am 10.06.2044	937	1.031	0,04	
4,219 % fällig am 10.09.2044	1.438	1.579	0,07	
5,489 % fällig am 13.03.2045 £	1.304	1.651	0,07	
Friary PLC				
0,000 % fällig am 21.10.2071	2.200	2.814	0,12	
Great Hall Mortgages PLC				
5,469 % fällig am 18.03.2039	13	16	0,00	
5,489 % fällig am 18.06.2038	7	9	0,00	
London Wall Mortgage Capital PLC				
6,020 % fällig am 15.05.2052	1.843	2.339	0,10	
Polaris PLC				
5,985 % fällig am 23.12.2058	3.223	4.100	0,17	
5,995 % fällig am 23.10.2059	8.232	10.444	0,44	
Precise Mortgage Funding PLC				
6,420 % fällig am 12.12.2055	2.282	2.911	0,12	
RMAC PLC				
0,000 % fällig am 15.02.2047	5.500	7.034	0,30	

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS	% DES
Rochester Financing PLC				
5,920 % fällig am 18.12.2044 £	5.934	\$ 7.509	0,32	
Stratton BTL Mortgage Funding PLC				
5,951 % fällig am 20.01.2054	3.573	4.541	0,19	
Stratton Mortgage Funding PLC				
5,920 % fällig am 12.12.2043	4.971	6.293	0,26	
6,120 % fällig am 12.03.2052	1.489	1.898	0,08	
Towd Point Mortgage Funding PLC				
6,365 % fällig am 20.10.2051	2.281	2.911	0,12	
6,571 % fällig am 20.07.2045	7.336	9.376	0,39	
Tower Bridge Funding PLC				
0,000 % fällig am 20.01.2066 (a)	4.200	5.363	0,22	
5,940 % fällig am 20.12.2063	1.825	2.314	0,10	
6,000 % fällig am 20.11.2063	1.500	1.908	0,08	
Twain Bridges PLC				
5,880 % fällig am 12.09.2055	4.942	6.248	0,26	
6,470 % fällig am 12.12.2054	4.952	6.322	0,27	
		<u>127.821</u>	<u>5,37</u>	

STAATSEMISSIONEN				
United Kingdom Gilt				
0,125 % fällig am 10.08.2028 (d)	36.668	47.331	1,99	
0,125 % fällig am 10.08.2031 (d)	20.075	25.972	1,09	
0,125 % fällig am 22.03.2039 (d)	3.693	4.340	0,18	
0,125 % fällig am 10.08.2041 (d)	16.213	18.591	0,78	
0,125 % fällig am 22.03.2044 (d)	14.078	15.472	0,65	
0,125 % fällig am 22.03.2046 (d)	7.181	7.680	0,32	
0,125 % fällig am 10.08.2048 (d)	5.678	5.943	0,25	
0,125 % fällig am 22.03.2051 (d)	13.219	13.440	0,56	
0,125 % fällig am 22.11.2056 (d)	7.915	7.838	0,33	
0,125 % fällig am 22.03.2058 (d)	14.558	14.155	0,59	
0,125 % fällig am 22.11.2065 (d)	9.936	9.471	0,40	
0,125 % fällig am 22.03.2068 (d)	14.072	13.410	0,56	
0,125 % fällig am 22.03.2073 (d)	2.696	2.747	0,12	
0,250 % fällig am 22.03.2052 (d)	20.303	21.315	0,90	
0,375 % fällig am 22.03.2062 (d)	18.136	19.139	0,80	
0,500 % fällig am 22.03.2050 (d)	11.827	13.436	0,56	
0,500 % fällig am 22.10.2061	6.200	2.664	0,11	
0,625 % fällig am 22.03.2040 (d)	18.601	23.501	0,99	
0,625 % fällig am 22.11.2042 (d)	15.025	18.624	0,78	
0,625 % fällig am 22.03.2045 (d)	17.025	20.630	0,87	
0,625 % fällig am 22.10.2058 (d)	2.400	1.351	0,06	
0,750 % fällig am 22.03.2034 (d)	25.380	34.022	1,43	
0,750 % fällig am 22.11.2047 (d)	11.784	14.375	0,60	
1,125 % fällig am 22.11.2037 (d)	22.231	30.741	1,29	
1,250 % fällig am 22.11.2027 (d)	27.447	36.922	1,55	
1,250 % fällig am 22.11.2032 (d)	40.395	56.982	2,39	
1,250 % fällig am 22.10.2041	400	331	0,01	
1,250 % fällig am 22.11.2055 (d)	15.887	21.890	0,92	
1,500 % fällig am 22.07.2047	3.900	3.017	0,13	
2,000 % fällig am 26.01.2035	3.675	5.476	0,23	
2,500 % fällig am 17.07.2024	14.218	17.974	0,76	
4,125 % fällig am 22.07.2030	13.870	22.324	0,94	
		<u>551.104</u>	<u>23,14</u>	
Summe Großbritannien		<u>678.925</u>	<u>28,51</u>	

USA				
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
Accredited Mortgage Loan Trust				
5,730 % fällig am 25.09.2036 \$	1.108	1.093	0,05	
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust				
6,520 % fällig am 25.12.2033	1.099	1.087	0,05	
Amerquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
6,430 % fällig am 25.10.2035	1.678	1.537	0,06	
Amresco Residential Securities Corp. Mortgage Loan Trust				
6,410 % fällig am 25.06.2029	8	7	0,00	
Asset-Backed Funding Certificates Trust				
5,610 % fällig am 25.10.2036	5.962	5.515	0,23	
Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust				
6,826 % fällig am 15.04.2033	144	143	0,01	
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				
5,356 % fällig am 25.05.2035	196	195	0,01	
Carrington Mortgage Loan Trust				
5,720 % fällig am 25.04.2036	12.546	10.821	0,45	
Citigroup Mortgage Loan Trust				
5,760 % fällig am 25.09.2036	397	379	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	2,600 %	29.12.2023	02.01.2024	\$ 2.878	U.S. Treasury Notes 4,875 % fällig am 30.11.2025	\$ (2.936)	\$ 2.878	\$ 2.879	0,12
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (2.936)	\$ 2.878	\$ 2.879	0,12

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month Euribor September Futures	Short	09.2025	868	\$ (744)	(0,03)
3-Month Euribor September Futures	Long	09.2026	868	589	0,03
Australia Government 3-Year Note March Futures	Short	03.2024	205	(149)	(0,01)
Australia Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2024	43	98	0,00
Euro-Bobl March Futures	Short	03.2024	766	(1.500)	(0,06)
Euro-BTP Italy Government Bond March Futures	Short	03.2024	216	(807)	(0,03)
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2024	632	(3.033)	(0,13)
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Long	03.2024	5	(8)	0,00
Euro-OAT France Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2024	413	1.695	0,07
Euro-Schatz March Futures	Short	03.2024	4.611	(2.987)	(0,13)
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Short	03.2024	57	(56)	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Short	03.2024	2.117	(4.471)	(0,19)
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Short	03.2024	608	(2.159)	(0,09)
U.S. Treasury 10-Year Ultra March Futures	Short	03.2024	4	(23)	0,00
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Long	03.2024	4	37	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2024	176	(2.081)	(0,09)
United Kingdom Long Gilt March Futures	Short	03.2024	437	(2.387)	(0,10)
				\$ (17.986)	(0,76)

VERKAUFSOPTIONEN

FUTURE-ÄHNLICHE OPTIONEN AUF BÖRSEGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
Call - ICE Euribor April 2024 Futures	€ 96,750	12.04.2024	848	\$ (573)	\$ (574)	(0,02)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					\$ (18.560)	(0,78)

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	5,000 %	20.03.2029	£ 2.000	\$ (146)	(0,01)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	16.06.2029	¥ 5.177.000	(25)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,237	21.11.2053	\$ 27.000	5.253	0,22
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,340	21.11.2028	113.800	(6.478)	(0,27)
Erhalt ⁽¹⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,865	13.02.2054	26.100	1.512	0,06
Zahlung ⁽¹⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,085	13.02.2034	82.600	(1.798)	(0,08)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,400	23.02.2033	5.300	(88)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2033	16.700	(178)	(0,01)
Zahlung ⁽¹⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,900	22.03.2026	53.800	90	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	20.12.2025	133.100	(1.193)	(0,05)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,868	22.12.2025	53.800	(561)	(0,02)
Erhalt ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	20.03.2054	€ 72.330	(9.169)	(0,39)
Zahlung ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.03.2034	275.690	17.255	0,72
Erhalt ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.03.2044	2.500	(343)	(0,01)
Zahlung	CPTFEMU	2,356	15.11.2033	8.200	201	0,01
Erhalt	CPTFEMU	2,359	15.08.2030	25.700	449	0,02
Zahlung	CPTFEMU	2,363	15.11.2033	4.500	107	0,00
Zahlung	CPTFEMU	2,390	15.11.2033	4.700	121	0,01
Erhalt	CPTFEMU	2,470	15.07.2032	12.900	221	0,01
Erhalt	CPTFEMU	2,548	15.11.2053	1.400	(45)	0,00
Erhalt	CPTFEMU	2,600	15.05.2032	20.300	310	0,01
Erhalt	CPTFEMU	2,620	15.11.2053	3.000	(182)	(0,01)
Zahlung	CPTFEMU	2,680	15.04.2053	6.400	497	0,02
Zahlung	CPTFEMU	2,700	15.04.2053	8.500	787	0,03

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Real Return Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
Erhalt	CPTFEMU	2,720 %	15.06.2032	€ 63.300	\$ (594)	(0,02)
Zahlung	CPTFEMU	2,763	15.09.2053	6.900	703	0,03
Erhalt	CPTFEMU	2,975	15.08.2027	17.800	(97)	0,00
Zahlung	CPTFEMU	3,520	15.09.2024	23.800	(134)	(0,01)
Zahlung	CPTFEMU	3,720	15.09.2024	6.400	1	0,00
Zahlung	CPURNSA	1,760	04.11.2029	\$ 23.300	(3.506)	(0,15)
Zahlung	CPURNSA	1,883	20.11.2029	300	(42)	0,00
Zahlung	CPURNSA	1,954	03.06.2029	6.200	(819)	(0,03)
Zahlung	CPURNSA	1,998	25.07.2029	1.800	(226)	(0,01)
Erhalt	CPURNSA	2,311	24.02.2031	6.500	676	0,03
Erhalt	CPURNSA	2,314	26.02.2026	14.400	1.423	0,06
Zahlung	CPURNSA	2,364	10.05.2028	800	(67)	0,00
Zahlung	CPURNSA	2,370	06.06.2028	12.900	(1.096)	(0,05)
Zahlung	CPURNSA	2,379	09.07.2028	700	(58)	0,00
Zahlung	CPURNSA	2,510	08.09.2024	9.500	9	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,573	26.08.2028	2.200	131	0,01
Erhalt	CPURNSA	2,645	10.09.2028	3.600	186	0,01
Erhalt	CPURNSA	2,690	01.06.2026	2.300	170	0,01
Erhalt	CPURNSA	2,703	25.05.2026	8.980	666	0,03
Erhalt	CPURNSA	2,768	13.05.2026	13.900	1.005	0,04
Erhalt	CPURNSA	2,813	14.05.2026	20.100	1.404	0,06
Zahlung	UKRPI	4,143	15.10.2032	£ 7.800	(206)	(0,01)
Erhalt	UKRPI	4,615	15.02.2027	12.300	467	0,02
Erhalt	UKRPI	5,200	15.06.2024	5.500	284	0,01
Erhalt	UKRPI	5,330	15.06.2024	11.900	574	0,02
Erhalt	UKRPI	6,290	15.03.2024	5.500	426	0,02
Erhalt	UKRPI	6,440	15.05.2024	2.200	136	0,01
Zahlung	UKRPI	6,500	15.03.2024	26.700	(1.914)	(0,08)
Erhalt	UKRPI	6,600	15.05.2024	5.400	309	0,01
					\$ 6.408	0,27
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ 6.408	0,27

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

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

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

VERKAUFSOPTIONEN

INFLATION-CAPPED OPTIONS

Kontrahent	Beschreibung	Anfänglicher Index	Variabler Zinssatz	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens
GLM	Cap - OTC CPALEMU	\$ 100,151	Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 3,000 %] oder 0	22.06.2035	7.800	\$ (356)	\$ (286)	(0,01)
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)	\$ (286)	(0,01)

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BPS	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,700 %	13.02.2024	83.800	\$ (366)	\$ (1.240)	(0,05)
CBK	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,950	15.09.2025	26.700	(323)	(623)	(0,03)
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,950	15.09.2025	26.700	(323)	(146)	(0,01)
FAR	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,760	16.01.2024	80.300	(373)	(1.133)	(0,05)
GLM	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,900	20.03.2024	96.900	(467)	(540)	(0,02)
	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,465	04.12.2025	17.700	(213)	(282)	(0,01)
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,465	04.12.2025	17.700	(213)	(151)	(0,01)
	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,900	29.08.2025	16.800	(218)	(368)	(0,01)
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,900	29.08.2025	16.800	(218)	(84)	0,00
GST	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,800	01.09.2025	36.200	(458)	(738)	(0,03)
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,800	01.09.2025	36.200	(458)	(201)	(0,01)
MYC	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,758	16.01.2024	1.900	(9)	(27)	0,00
						\$ (3.639)	\$ (5.533)	(0,23)	

(1) Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Netto- vermögens
GST	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500 %	17.10.2057	\$ 12.175	\$ (711)	\$ 718	\$ 7	0,00
SAL	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	2.500	(5)	(4)	(9)	0,00
					\$ (716)	\$ 714	\$ (2)	0,00

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEVIENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens						
AZD	01.2024	AUD	23.435	\$	15.524	\$	(470)	(0,02)					
BOA	01.2024	£	18.652		23.607		(172)	(0,01)					
	01.2024	¥	7.302.079		49.482		(2.345)	(0,10)					
BPS	01.2024	\$	100	MXN	1.702		0	0,00					
	03.2024	CNH	130.795	\$	18.194		(280)	(0,01)					
	06.2024	KRW	11.793.745		9.065		(115)	0,00					
	01.2024	DKK	164.463		24.259		(119)	(0,01)					
	01.2024	€	714.922		786.126		(3.794)	(0,16)					
	01.2024	HUF	418.709		1.192		(18)	0,00					
	01.2024	¥	4.301.501		29.351		(1.181)	(0,05)					
	01.2024	KRW	197.067		150		(2)	0,00					
	01.2024	SGD	1		1		0	0,00					
	01.2024	\$	100	BRL	491		1	0,00					
BRC	01.2024		1.499	€	1.370		14	0,00					
	01.2024		6.786	£	5.378		70	0,00					
	01.2024		3	HUF	1.054		0	0,00					
	01.2024		350	IDR	5.413.713		1	0,00					
	01.2024		8.357	ZAR	154.919		103	0,01					
	01.2024	KRW	387.690	\$	300		1	0,00					
	01.2024	\$	3.133	DKK	21.175		6	0,00					
	01.2024		4.733	MXN	83.030		149	0,01					
	01.2024		298	ZAR	5.546		5	0,00					
	03.2024		4.997	IDR	77.691.593		41	0,00					
CBK	01.2024	HUF	114.515	\$	327		(4)	0,00					
	01.2024	IDR	4.628.561		301		0	0,00					
	01.2024	NZD	68.936		42.554		(1.094)	(0,04)					
	01.2024	\$	1.124	£	888		8	0,00					
	01.2024		99	MXN	1.730		3	0,00					
	01.2024	ZAR	5.244	\$	278		(8)	0,00					
	03.2024	PEN	9.017		2.395		(35)	0,00					
	03.2024	\$	301	IDR	4.629.749		0	0,00					
	06.2024		19	KRW	25.240		0	0,00					
	01.2024	KRW	194.955	\$	150		0	0,00					
GLM	01.2024	CAD	76.029		55.951		(1.715)	(0,07)					
	01.2024	DKK	217.881		32.140		(156)	(0,01)					
JPM	01.2024	¥	1.748.200		11.923		(485)	(0,02)					
	01.2024	ZAR	2.849		150		(6)	0,00					
	01.2024	DKK	85.360		12.552		(97)	0,00					
	01.2024	HUF	1.265.609		3.605		(52)	0,00					
MBC	01.2024	\$	300	IDR	4.616.100		(1)	0,00					
	01.2024		150	KRW	194.424		0	0,00					
	02.2024		6.899	BRL	33.835		55	0,00					
	03.2024	SGD	21	\$	16		0	0,00					
	06.2024	KRW	192.758		150		0	0,00					
	01.2024	AUD	9.545		6.329		(185)	(0,01)					
	01.2024	CAD	3.360		2.483		(66)	0,00					
	01.2024	DKK	16.035		2.321		(56)	0,00					
	01.2024	€	38.147		41.711		(438)	(0,02)					
	01.2024	£	353		445		(5)	0,00					
MYI	01.2024	HUF	22.526		64		(1)	0,00					
	01.2024	DKK	14.530		2.169		15	0,00					
	01.2024	£	1		1		0	0,00					
	01.2024	¥	2.773.807		18.815		(873)	(0,04)					
RYL	01.2024	\$	1.072	DKK	7.295		10	0,00					
	01.2024		1.059	€	956		(4)	0,00					
	01.2024		2.510	£	1.986		(2)	0,00					
	01.2024		102	ZAR	1.865		0	0,00					
	03.2024		299	IDR	4.648.950		2	0,00					
	01.2024		1.195	£	934		(4)	0,00					
	01.2024	£	519.188	\$	656.710		(5.171)	(0,22)					
	01.2024	SGD	9		7		0	0,00					
	01.2024	\$	2.569	MXN	45.110		83	0,00					
	03.2024	TWD	427.105	\$	13.732		(421)	(0,02)					
UAG	03.2024	\$	4.593	INR	384.167		8	0,00					
	01.2024	AUD	7.716	\$	5.120		(147)	(0,01)					
	01.2024	¥	292.230		1.995		(79)	0,00					
	01.2024	SEK	293.658		28.453		(693)	(0,03)					
SCX	01.2024	\$	385	MXN	6.766		13	0,00					
	03.2024		4.367	INR	365.422		9	0,00					
					\$	621		(20.294)		\$	(19.673)		(0,83)

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Real Return Fund (Forts.)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilklassen 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
BPS	01.2024	\$ 362	CHF 309	\$ 5	\$ 0	\$ 5	0,00
BRC	01.2024	\$ 3.380	\$ 2.948	\$ 125	\$ 0	\$ 125	0,01
CBK	01.2024	CHF 105	\$ 121	\$ 0	(5)	(5)	0,00
	01.2024	\$ 27.382	CHF 23.857	977	0	977	0,04
GLM	01.2024	CHF 321	\$ 368	0	(14)	(14)	0,00
	01.2024	\$ 30.456	CHF 26.687	1.269	0	1.269	0,05
MYI	01.2024	CHF 252	\$ 289	0	(10)	(10)	0,00
	01.2024	\$ 29.926	CHF 26.123	1.128	0	1.128	0,05
SCX	01.2024	CHF 19	\$ 22	0	0	0	0,00
				\$ 3.504	\$ (29)	\$ 3.475	0,15

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilklasse Institutional USD (Currency Exposure) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2024	\$ 457	AUD 691	\$ 15	\$ 0	\$ 15	0,00
	01.2024	902	£ 712	5	0	5	0,00
	01.2024	581	¥ 85.664	28	0	28	0,00
	01.2024	251	NZD 412	10	0	10	0,00
BPS	01.2024	29	DKK 196	0	0	0	0,00
	01.2024	1.414	£ 1.115	7	0	7	0,00
	01.2024	365	¥ 53.664	16	0	16	0,00
CBK	01.2024	DKK 0	\$ 0	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 1	SEK 9	0	0	0	0,00
GLM	01.2024	777	CAD 1.056	24	0	24	0,00
MBC	01.2024	CAD 0	\$ 0	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 50	AUD 75	2	0	2	0,00
	01.2024	9.281	€ 8.441	46	0	46	0,00
MYI	01.2024	221	¥ 32.541	10	0	10	0,00
SCX	01.2024	290	SEK 3.017	9	0	9	0,00
UAG	01.2024	38	DKK 260	0	0	0	0,00
	01.2024	7.666	£ 6.058	56	0	56	0,01
				\$ 228	\$ 0	\$ 228	0,01

Zum 31. Dezember 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
BPS	01.2024	€ 10.195	\$ 11.143	\$ 2	\$ (123)	\$ (121)	(0,01)
	01.2024	\$ 399.605	€ 363.351	1.862	0	1.862	0,08
BRC	01.2024	355.686	323.415	1.657	0	1.657	0,07
CBK	01.2024	€ 8.224	\$ 8.944	1	(144)	(143)	(0,01)
MBC	01.2024	2.876	3.123	0	(54)	(54)	0,00
	01.2024	\$ 319.539	€ 292.235	3.353	0	3.353	0,14
UAG	01.2024	2.499	2.272	11	0	11	0,00
				\$ 6.886	\$ (321)	\$ 6.565	0,27

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend und Class R GBP (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2024	£ 183	\$ 231	\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	0,00
	01.2024	\$ 14.232	£ 11.230	85	0	85	0,00
BPS	01.2024	£ 127	\$ 160	0	(2)	(2)	0,00
	01.2024	\$ 16.619	£ 13.102	84	0	84	0,00
BRC	01.2024	291	230	2	0	2	0,00
CBK	01.2024	£ 1.967	\$ 2.487	0	(20)	(20)	0,00
GLM	01.2024	17	22	0	0	0	0,00
MBC	01.2024	2.100	2.668	0	(9)	(9)	0,00
MYI	01.2024	488	623	1	(1)	0	0,00
SCX	01.2024	\$ 95.786	£ 75.727	754	0	754	0,03
SSB	01.2024	£ 230	\$ 289	0	(4)	(4)	0,00
	01.2024	\$ 63.045	£ 49.962	649	0	649	0,03
UAG	01.2024	£ 1.500	\$ 1.877	0	(35)	(35)	0,00
	01.2024	\$ 95.780	£ 75.681	702	0	702	0,03
				\$ 2.277	\$ (73)	\$ 2.204	0,09

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
DUB	01.2024	\$ 58.525	SGD 77.798	\$ 470	\$ 0	\$ 470	0,02
JPM	01.2024	12.438	16.589	141	0	141	0,01
MYI	01.2024	54.569	72.791	629	0	629	0,03
TOR	01.2024	52.083	69.493	613	0	613	0,02
				\$ 1.853	\$ 0	\$ 1.853	0,08
Summe Freiverkehrsfina n z d e r i v a t e						\$ (11.169)	(0,47)
Summe Anlagen						\$ 3.703.023	155,52
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ (1.321.930)	(55,52)
Nettovermögen						\$ 2.381.093	100,00

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Nullkuponwertpapier.

(c) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(d) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(e) Mit dem Teilfonds verbunden.

Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 1.193.907 (31. Dezember 2022: USD 734.559) waren zum 31. Dezember 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheiten verpfändet.

Ein Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD null (31. Dezember 2022: USD 9.544) war zum 31. Dezember 2023 gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.

Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 4.789 (31. Dezember 2022: USD 101) und Barmittel in Höhe von USD 3.304 (31. Dezember 2022: USD null) waren zum 31. Dezember 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheiten erhalten worden.

Barmittel in Höhe von USD 32.998 (31. Dezember 2022: USD 24.192) waren zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 20.690 (31. Dezember 2022: USD 21.490) waren zum 31. Dezember 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 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	\$ 3.694.700	\$ 5.369	\$ 3.700.069
Investmentfonds	23.397	0	0	23.397
Pensionsgeschäfte	0	2.878	0	2.878
Finanzderivate ⁽³⁾	(9.807)	(13.514)	0	(23.321)
Summen	\$ 13.590	\$ 3.684.064	\$ 5.369	\$ 3.703.023

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 3.391.396	\$ 0	\$ 3.391.396
Investmentfonds	7.043	0	0	7.043
Pensionsgeschäfte	0	2.245	0	2.245
Finanzderivate ⁽³⁾	(4.808)	18.214	0	13.406
Summen	\$ 2.235	\$ 3.411.855	\$ 0	\$ 3.414.090

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

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

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

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Real Return Fund (Forts.)

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften		% des Nettovermögens
					\$	\$	
CIB	5,470 %	21.11.2023	04.01.2024	\$ (157.548)	\$ (158.529)	(6,66)	
	5,470	13.12.2023	04.01.2024	(34.825)	(34.926)	(1,47)	
NOM	5,500	07.12.2023	18.01.2024	(377.351)	(378.792)	(15,91)	
SCX	3,920	01.11.2023	07.02.2024	€ (63.384)	(70.474)	(2,96)	
STR	5,540	02.01.2024	03.01.2024	\$ (435.389)	(435.389)	(18,28)	
	5,660	29.12.2023	02.01.2024	(478.632)	(478.858)	(20,11)	
Summe umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (1.556.968)	(65,39)	

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
AZD	\$ (470)	\$ 350	\$ (120)	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ k. A.
BOA	(2.771)	2.700	(71)	3.056	(2.990)	66
BOM	k. A.	k. A.	k. A.	110	0	110
BPS	(4.313)	6.400	2.087	(381)	580	199
BRC	1.986	(3.850)	(1.864)	(156)	130	(26)
CBK	(1.090)	660	(430)	11.029	(10.872)	157
DUB	470	(350)	120	(3.859)	3.720	(139)
FAR	(1.133)	1.000	(133)	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	(2.794)	2.320	(474)	(1.194)	610	(584)
GST	(932)	900	(32)	(2.425)	2.410	(15)
JPM	46	0	46	(2.608)	2.180	(428)
MBBC	2.587	(4.050)	(1.463)	8.954	(8.240)	714
MYC	(27)	0	(27)	(36)	90	54
MYI	928	(1.200)	(272)	(3.890)	2.910	(980)
RBC	k. A.	k. A.	k. A.	44	0	44
RYL	(4)	0	(4)	k. A.	k. A.	k. A.
SAL	(9)	130	121	(20)	130	110
SCX	(4.738)	5.720	982	(7.751)	7.310	(441)
SSB	645	(560)	85	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	613	(440)	173	(270)	1.420	1.150
UAG	(163)	510	347	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. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	131,53	115,82
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	23,61	15,81
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,26	0,25
Investmentfonds	0,98	0,27
Pensionsgeschäfte	0,12	0,09
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,78)	(0,09)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,27	0,58
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,47)	0,02
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(65,39)	(30,96)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	k. A.	(0,37)

* Gemäß der Liste der Märkte, die in Anhang 1 zum Prospekt aufgeführt sind und die Kriterien für gemäß OGAW-Vorschriften geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Australien	1,22	1,83
Belgien	0,08	0,07
Kanada	1,61	1,46
Cayman-Inseln	1,09	1,58
Dänemark	2,92	4,20
Frankreich	9,43	7,82
Deutschland	3,63	0,86
Irland	9,23	8,54
Italien	12,38	7,79
Japan	5,12	4,27
Luxemburg	0,87	0,02
Niederlande	0,75	0,71
Neuseeland	1,87	1,63
Peru	0,01	0,07
Slowenien	0,04	0,04

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Spanien	2,27	1,71
Supranational	0,37	k. A.
Schweden	1,33	1,15
Schweiz	0,17	k. A.
Großbritannien	28,51	25,93
USA	71,99	62,20
Kurzfristige Instrumente	0,51	k. A.
Investmentfonds	0,98	0,27
Pensionsgeschäfte	0,12	0,09
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,76)	(0,09)
Verkaufsoptionen		
Future-ähnliche Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	(0,02)	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	k. A.	0,00
Zinsswaps	0,27	0,58
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	k. A.	0,46
Verkaufsoptionen		
Inflation-Capped Options	(0,01)	(0,02)
Zinsswapoptionen	(0,23)	(0,88)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,00	0,00
Devisenterminkontrakte	(0,83)	(0,96)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,60	1,42
Sonstige Aktiva und Passiva	(55,52)	(32,75)
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				BNP Paribas Issuance BV			
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				BANKEN UND FINANZEN							
American Airlines, Inc.				ABN AMRO Bank NV				0,00 % fällig am 09.04.2029	\$ 10	\$ 1.652.088	2,34
10,427 % fällig am 20.04.2028	\$ 58.950	\$ 60.649	0,09	6,575 % fällig am 13.10.2026	\$ 99.500	\$ 101.192	0,14	BPCE S.A.			
Avolon TLB Borrower (U.S.) LLC				Adler Financing SARL (12,500 % bar oder 12,500 % PIK)				1,652 % fällig am 06.10.2026	1.027	956	0,00
7,708 % fällig am 22.06.2028	4.102	4.111	0,01	12,500 % fällig am 30.06.2025 (d)	€ 903	1.053	0,00	6,612 % fällig am 19.10.2027	207.300	213.498	0,30
Carnival Corp.				AGFC Capital Trust				6,714 % fällig am 19.10.2029	188.100	198.264	0,28
7,593 % fällig am 30.06.2025	€ 60.916	67.501	0,10	7,405 % fällig am 15.01.2067	\$ 23.000	11.697	0,02	7,003 % fällig am 19.10.2034	152.500	165.924	0,24
8,720 % fällig am 18.10.2028	\$ 15.234	15.278	0,02	AGPS BondCo PLC				Brandywine Operating Partnership LP			
Cengage Learning, Inc.				5,000 % fällig am 27.04.2027	€ 1.100	409	0,00	3,950 % fällig am 15.11.2027	7.918	7.083	0,01
10,405 % fällig am 14.07.2026	28.669	28.796	0,04	5,500 % fällig am 13.11.2026	200	78	0,00	7,800 % fällig am 15.03.2028	3.832	3.880	0,01
Charter Communications Operating LLC				AIB Group PLC				CaixaBank S.A.			
7,133 % fällig am 01.02.2027	34.569	34.613	0,05	5,250 % fällig am 23.10.2031	€ 92.600	110.677	0,16	6,208 % fällig am 18.01.2029	64.050	65.389	0,09
Diamond Sports Group LLC				6,608 % fällig am 13.09.2029	\$ 20.300	21.408	0,03	6,684 % fällig am 13.09.2027	21.400	21.952	0,03
TBD % - 15,420 % fällig am 25.05.2026	4.030	3.053	0,00	Ally Financial, Inc.				6,840 % fällig am 13.09.2034	21.000	22.197	0,03
DirectTV Financing LLC				5,800 % fällig am 01.05.2025	20.282	20.317	0,03	CIFI Holdings Group Co. Ltd.			
10,650 % fällig am 02.08.2027	35.427	35.491	0,05	Ambac Assurance Corp.				4,375 % fällig am 12.04.2027 ^	2.000	117	0,00
Emerald TopCo, Inc.				5,100 % (i)	0	0	0,00	4,450 % fällig am 17.08.2026 ^	1.700	117	0,00
8,970 % fällig am 24.07.2026	3.548	3.523	0,01	American Assets Trust LP				4,800 % fällig am 17.05.2028 ^	700	50	0,00
Envision Healthcare Corp.				3,375 % fällig am 01.02.2031	4.800	3.918	0,01	5,250 % fällig am 13.05.2026 ^	1.100	65	0,00
13,258 % fällig am 15.09.2028	58.953	58.953	0,08	American Tower Corp.				5,950 % fällig am 20.10.2025 ^	1.300	91	0,00
Finastra USA, Inc.				3,650 % fällig am 15.03.2027	6.200	5.967	0,01	6,000 % fällig am 16.07.2025 ^	2.000	135	0,00
0,500 % - 12,616 % fällig am 13.09.2029 µ	2.979	2.978	0,00	Armor Holdco, Inc.				6,450 % fällig am 07.11.2024 ^	3.300	235	0,00
12,713 % fällig am 13.09.2029	28.721	28.683	0,04	8,500 % fällig am 15.11.2029	800	726	0,00	Citigroup, Inc.			
iHeartCommunications, Inc.				Army Hawaii Family Housing Trust Certificates				2,572 % fällig am 03.06.2031 (l)	5.000	4.274	0,01
8,470 % fällig am 01.05.2026	256.394	222.277	0,32	5,876 % fällig am 15.06.2050	102.010	71.550	0,10	3,106 % fällig am 08.04.2026	1.800	1.750	0,00
8,720 % fällig am 01.05.2026	10.691	9.220	0,01	Aroundtown S.A.				Corestate Capital Holding S.A. (10,000 % bar oder 11,000 % PIK)			
Lealand Finance Co. BV				1,500 % fällig am 28.05.2026	€ 300	297	0,00	10,000 % fällig am 31.12.2026 (d)	€ 1.000	1.105	0,00
8,470 % fällig am 28.06.2024	2.771	1.926	0,00	5,375 % fällig am 21.03.2029	\$ 33.840	27.896	0,04	Corestate Capital Holding S.A. (8,000 % bar oder 9,000 % PIK)			
Lealand Finance Co. BV (6,470 % bar und 3,000 % PIK)				Asian Development Bank				8,000 % fällig am 31.12.2026 ^ (d)	6.482	3.750	0,01
3,000 % - 6,470 % fällig am 30.06.2025 (d)	6.706	2.806	0,00	4,700 % fällig am 12.03.2024	MX N 99.000	5.765	0,01	Country Garden Holdings Co. Ltd.			
Poseidon Bidco SASU				Avolon Holdings Funding Ltd.				2,700 % fällig am 12.07.2026 ^ \$	8.400	646	0,00
9,175 % fällig am 30.09.2028	€ 103.800	114.806	0,16	2,528 % fällig am 18.11.2027	\$ 165.597	146.862	0,21	3,125 % fällig am 22.10.2025 ^	13.400	1.167	0,00
PUG LLC				Banca Monte dei Paschi di Siena SpA				3,875 % fällig am 22.10.2030 ^	6.400	503	0,00
8,970 % fällig am 12.02.2027	\$ 13.051	12.875	0,02	1,875 % fällig am 09.01.2026	€ 33.400	35.094	0,05	4,800 % fällig am 06.08.2030 ^	1.000	84	0,00
9,720 % fällig am 12.02.2027	973	968	0,00	2,625 % fällig am 28.04.2025	5.400	5.823	0,01	5,125 % fällig am 17.01.2025 ^	1.600	125	0,00
SCUR-Alpha 1503 GmbH				3,625 % fällig am 24.09.2024	4.800	5.268	0,01	5,400 % fällig am 27.05.2025 ^	1.600	133	0,00
9,448 % fällig am 29.03.2030	€ 62.100	63.013	0,09	6,750 % fällig am 02.03.2026	129.460	146.449	0,21	5,625 % fällig am 14.01.2030 ^	700	57	0,00
10,883 % fällig am 29.03.2030	\$ 112.849	104.151	0,15	7,708 % fällig am 18.01.2028	5.000	5.537	0,01	6,150 % fällig am 17.09.2025 ^	1.000	84	0,00
Sotera Health Holdings LLC				8,000 % fällig am 22.01.2030	26.444	29.467	0,04	6,500 % fällig am 08.04.2024 ^	500	44	0,00
8,395 % fällig am 11.12.2026	17.409	17.423	0,02	8,500 % fällig am 10.09.2030	12.200	13.584	0,02	8,000 % fällig am 27.01.2024 ^	2.800	224	0,00
SS&C European Holdings SARL				Banco de Credito del Peru S.A.				CPI Property Group S.A.			
7,220 % fällig am 16.04.2025	8.319	8.341	0,01	4,650 % fällig am 17.09.2024	PE N 95.500	25.051	0,04	1,500 % fällig am 27.01.2031	€ 2.200	1.286	0,00
SS&C Technologies, Inc.				Banco Espirito Santo S.A.				2,750 % fällig am 12.05.2026	2.600	2.405	0,00
7,220 % fällig am 16.04.2025	14.149	14.184	0,02	2,625 % fällig am 08.05.2017 ^	€ 16.200	4.921	0,01	2,750 % fällig am 22.01.2028	€ 1.700	1.527	0,00
Syniverse Holdings, Inc.				4,750 % fällig am 15.01.2018 ^	8.100	2.461	0,00	Credit Agricole S.A.			
12,348 % fällig am 13.05.2027	39.299	34.755	0,05	Banco Santander S.A.				6,316 % fällig am 03.10.2029	\$ 23.650	24.794	0,04
TransDigm, Inc.				1,849 % fällig am 25.03.2026	\$ 5.000	4.631	0,01	Credit Suisse AG			
8,598 % fällig am 22.02.2027	36.573	36.772	0,05	4,250 % fällig am 11.04.2027	2.800	2.715	0,00	0,495 % fällig am 02.02.2024	17.400	17.324	0,02
8,598 % fällig am 24.08.2028	83.172	83.655	0,12	4,379 % fällig am 12.04.2028	1.200	1.167	0,00	5,500 % fällig am 20.08.2026	€ 78.600	91.319	0,13
U.S. Renal Care, Inc.				6,527 % fällig am 07.11.2027	47.800	49.460	0,07	Credit Suisse AG AT1 Claim	\$ 138.872	16.664	0,02
10,470 % fällig am 20.06.2028	24.981	19.048	0,03	6,607 % fällig am 07.11.2028	30.800	32.818	0,05	Deutsche Bank AG			
United Airlines, Inc.				Bank of America Corp.				1,375 % fällig am 17.02.2032	€ 39.900	36.284	0,05
9,220 % fällig am 21.04.2028	18.607	18.700	0,03	3,419 % fällig am 20.12.2028	19.850	18.711	0,03	1,750 % fällig am 19.11.2030	5.000	4.809	0,01
Veritas U.S., Inc.				3,824 % fällig am 20.01.2028	2.692	2.588	0,00	2,129 % fällig am 24.11.2026 (l)	\$ 24.300	22.792	0,03
10,470 % fällig am 01.09.2025	1.976	1.649	0,00	4,571 % fällig am 27.04.2033	3.000	2.861	0,00	3,035 % fällig am 28.05.2032 (l)	45.920	38.388	0,05
Wesco Aircraft Holdings, Inc.				4,827 % fällig am 22.07.2026	3.300	3.276	0,00	3,547 % fällig am 18.09.2031	20.300	17.827	0,03
TBD % - 13,988 % fällig am 01.03.2024	7.371	7.821	0,01	5,202 % fällig am 25.04.2029	7.300	7.350	0,01	6,720 % fällig am 18.01.2029	34.800	36.463	0,05
Westmoreland Coal Co.				5,288 % fällig am 25.04.2034	51.100	51.245	0,07	6,819 % fällig am 20.11.2029	26.700	28.128	0,04
8,000 % fällig am 04.11.2030	1.962	1.452	0,00	Bank of Nova Scotia				East Lane Re Ltd.			
Windstream Services LLC				4,900 % fällig am 04.06.2025 (i)(k)	3.346	3.204	0,00	14,582 % fällig am 31.03.2026	14.900	14.974	0,02
11,706 % fällig am 21.09.2027	27.107	25.718	0,04	Barclays PLC				EPR Properties			
Wm Morrison Supermarkets Ltd.				4,972 % fällig am 16.05.2029	81.215	79.804	0,11	3,600 % fällig am 15.11.2031	841	698	0,00
8,752 % fällig am 04.11.2027	€ 112.376	118.220	0,17	5,501 % fällig am 09.08.2028	40.884	41.095	0,06	3,750 % fällig am 15.08.2029	2.887	2.543	0,00
Worldpay LLC				6,490 % fällig am 13.09.2029	13.300	13.860	0,02	4,500 % fällig am 01.06.2027	5.100	4.816	0,01
TBD % fällig am 31.01.2031	\$ 25.200	25.342	0,04	6,496 % fällig am 13.09.2027	31.300	32.191	0,05	4,750 % fällig am 15.12.2026	7.623	7.300	0,01
		1.288.751	1,83	6,692 % fällig am 13.09.2034	26.900	28.777	0,04	4,950 % fällig am 15.04.2028	7.610	7.226	0,01
				7,385 % fällig am 02.11.2028	21.400	22.883	0,03	Equinix, Inc.			
				7,437 % fällig am 02.11.2033	35.850	40.169	0,06	2,900 % fällig am 18.11.2026	2.400	2.281	0,00
				Bevco Lux SARL				Erste Group Bank AG			
				1,000 % fällig am 16.01.2030	€ 15.000	13.904	0,02	4,250 % fällig am 15.10.2027 (i)(k)	€ 29.000	27.518	0,04
				Blue Ridge Re Ltd.				Essential Properties LP			
				10,582 % fällig am 08.01.2031	\$ 11.486	11.492	0,02	2,950 % fällig am 15.07.2031	\$ 4.000	3.150	0,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS					
Extra Space Storage LP				Morgan Stanley				SLM Student Loan Trust								
5,900 % fällig am 15.01.2031	\$	12.500	13,055	0,02	0,000 % fällig am 02.04.2032	\$	68.500	41,638	0,06	4,475 % fällig am 15.12.2033	€	10.742	\$	11.018	0,02	
Ford Motor Credit Co. LLC				(i)				Societe Generale S.A.								
2,748 % fällig am 14.06.2024	£	17.601	22,139	0,03	2,188 % fällig am 28.04.2026	1,400	1,345	0,00	2,889 % fällig am 09.06.2032	\$	14.300	11,812	0,02			
7,200 % fällig am 10.06.2030	\$	3.200	3,412	0,00	3,622 % fällig am 01.04.2031	13.200	12,165	0,02	6,446 % fällig am 10.01.2029	51,300	53,112	0,08				
7,350 % fällig am 04.11.2027	2,800	2,955	0,00	4,679 % fällig am 17.07.2026	2,400	2,378	0,00	6,447 % fällig am 12.01.2027	42,900	43,674	0,06					
Gateway Casinos & Entertainment Ltd.				5,123 % fällig am 01.02.2029	4,237	4,259	0,01	6,691 % fällig am 10.01.2034	137,100	144,927	0,21					
5,000 % fällig am				6,138 % fällig am 16.10.2026	2,000	2,037	0,00	Standard Chartered PLC								
12.03.2038	CAD	46.366	32,032	0,05	National Health Investors, Inc.			2,678 % fällig am 29.06.2032	3,500	2,849	0,00					
GLP Capital LP				3,000 % fällig am 01.02.2031	9,000	7,207	0,01	6,170 % fällig am 09.01.2027	5,500	5,586	0,01					
3,250 % fällig am 15.01.2032	\$	4.100	3,466	0,01	Nationwide Building Society			6,750 % fällig am 08.02.2028	154,900	159,680	0,23					
2,748 % fällig am 14.06.2024	17,715	15,974	0,02	3,960 % fällig am 18.07.2030	163,883	153,224	0,22	7,018 % fällig am 08.02.2030	4,800	5,071	0,01					
7,200 % fällig am 10.06.2030	3,502	3,492	0,01	4,302 % fällig am 08.03.2029	34,100	32,699	0,05	Stichting AK Rabobank Certificaten								
7,350 % fällig am 04.11.2027	16,214	16,130	0,02	4,500 % fällig am 01.11.2026	€	73.400	83,677	0,12	6,500 % (i)	€	206,326	228,841	0,32			
Goldman Sachs Group, Inc.				6,557 % fällig am 18.10.2027	\$	97,120	100,596	0,14	Sunac China Holdings Ltd.							
3,750 % fällig am 25.02.2026	5,700	5,571	0,01	Nature Coast Re Ltd.				6,000 % fällig am 30.09.2026	\$	337	35	0,00				
4,223 % fällig am 01.05.2029	7,100	6,873	0,01	10,000 % fällig am 07.12.2030	11,206	11,211	0,02	6,250 % fällig am 30.09.2027	337	27	0,00					
6,484 % fällig am 24.10.2029	150,000	159,265	0,23	NatWest Group PLC				6,500 % fällig am 30.09.2027	675	53	0,00					
Goodman U.S. Finance Three LLC				4,445 % fällig am 08.05.2030	121,125	116,168	0,16	6,750 % fällig am 30.09.2028	1,012	46	0,00					
3,700 % fällig am 15.03.2028	11,640	10,845	0,02	4,892 % fällig am 18.05.2029	62,833	61,762	0,09	7,000 % fällig am 30.09.2029	1,012	55	0,00					
Hexagon RE Ltd.				5,076 % fällig am 27.01.2030	134,670	132,721	0,19	7,250 % fällig am 30.09.2030	476	19	0,00					
13,871 % fällig am 07.01.2031	€	10,684	11,770	0,02	6,016 % fällig am 02.03.2034	62,800	66,003	0,09	SVB Financial Group							
Highwoods Realty LP				Navient Corp.				3,125 % fällig am 05.06.2030	300	197	0,00					
3,050 % fällig am 15.02.2030	\$	1.100	910	0,00	5,625 % fällig am 25.01.2025	3,549	3,338	0,00	^A							
HSBC Holdings PLC				New Metro Global Ltd.				Taranis Reinsurance DAC								
2,357 % fällig am 18.08.2031	46,700	38,715	0,06	4,500 % fällig am 02.05.2026	4,600	1,162	0,00	9,958 % fällig am 07.01.2031	€	6,700	7,407	0,01				
2,804 % fällig am 24.05.2032	25,700	21,466	0,03	4,625 % fällig am 15.10.2025	800	230	0,00	12,155 % fällig am 08.01.2031	9,400	10,391	0,01					
2,848 % fällig am 04.06.2031	3,600	3,099	0,00	4,800 % fällig am 15.12.2024	7,900	3,140	0,00	U.S. Capital Funding Ltd.								
3,973 % fällig am 22.05.2030	46,600	43,567	0,06	Nissan Motor Acceptance Co. LLC				5,948 % fällig am 10.07.2043	\$	5,010	3,857	0,01				
4,583 % fällig am 19.06.2029	15,300	14,848	0,02	2,750 % fällig am 09.03.2028	21,400	18,899	0,03	6,389 % fällig am 01.08.2034	400	398	0,00					
5,402 % fällig am 11.08.2033	7,000	7,034	0,01	Nomura Holdings, Inc.				UBS AG								
5,887 % fällig am 14.08.2027	54,600	55,381	0,08	2,172 % fällig am 14.07.2028	14,968	13,160	0,02	5,125 % fällig am 15.05.2024	49,785	49,436	0,07					
6,254 % fällig am 09.03.2034	126,700	134,731	0,19	Nordea Kredit Realkreditatieselskab				(k)								
Hudson Pacific Properties LP				2,000 % fällig am 01.10.2047DKK	0	0	0,00	UBS Group AG								
3,250 % fällig am 15.01.2030	500	368	0,00	Nykredit Realkredit A/S				2,746 % fällig am 11.02.2033	3,116	2,558	0,00					
3,950 % fällig am 01.11.2027	4,445	3,726	0,01	2,000 % fällig am 01.07.2037	0	0	0,00	3,091 % fällig am 14.05.2032	57,350	48,871	0,07					
4,650 % fällig am 01.04.2029	4,517	3,670	0,01	2,000 % fällig am 01.10.2047	0	0	0,00	3,126 % fällig am 13.08.2030	19,222	17,167	0,02					
5,950 % fällig am 15.02.2028	14,077	12,459	0,02	Orange Capital RE DAC				3,750 % fällig am 26.03.2025	20,900	20,493	0,03					
InCaps Funding Ltd.				11,475 % fällig am 08.01.2027	€	9,900	10,942	0,02	3,869 % fällig am 12.01.2029	5,750	5,426	0,01				
7,639 % fällig am 01.06.2033	1,998	1,878	0,00	Park Aerospace Holdings Ltd.				4,194 % fällig am 01.04.2031	83,637	77,949	0,11					
Intesa Sanpaolo SpA				5,500 % fällig am 15.02.2024	\$	13,831	13,806	0,02	5,959 % fällig am 12.01.2034	93,281	96,514	0,14				
7,200 % fällig am 28.11.2033	37,900	40,429	0,06	Preferred Term Securities Ltd.				6,246 % fällig am 22.09.2029	29,700	31,005	0,04					
7,800 % fällig am 28.11.2053	25,000	27,473	0,04	5,735 % fällig am 22.03.2038	9,159	8,472	0,01	6,301 % fällig am 22.09.2034	10,000	10,594	0,02					
8,248 % fällig am 21.11.2033	3,900	4,235	0,01	5,785 % fällig am 22.03.2038	7,962	6,609	0,01	6,327 % fällig am 22.12.2027	30,800	31,760	0,05					
JPMorgan Chase & Co.				5,846 % fällig am 22.12.2036	362	329	0,00	6,373 % fällig am 15.07.2026	32,250	32,636	0,05					
2,083 % fällig am 22.04.2026	3,100	2,970	0,00	5,936 % fällig am 22.06.2037	13,278	11,685	0,02	6,442 % fällig am 11.08.2028	115,850	120,385	0,17					
3,509 % fällig am 23.01.2029	3,500	3,319	0,00	5,946 % fällig am 22.03.2037	15,905	14,473	0,02	6,537 % fällig am 12.08.2033	102,073	108,991	0,15					
3,960 % fällig am 29.01.2027	7,000	6,841	0,01	5,946 % fällig am 22.09.2037	15,903	13,517	0,02	7,375 % fällig am 07.09.2033	€	6,500	9,560	0,01				
4,005 % fällig am 23.04.2029	7,000	6,741	0,01	5,956 % fällig am 22.12.2036	19,295	18,234	0,03	7,750 % fällig am 01.03.2029	€	108,880	138,774	0,20				
6,070 % fällig am 22.10.2027	95,400	98,177	0,14	5,986 % fällig am 22.09.2036	1,108	1,030	0,00	9,016 % fällig am 15.11.2033	\$	38,550	47,417	0,07				
6,087 % fällig am 23.10.2029	88,860	93,475	0,13	5,996 % fällig am 22.12.2035	9,146	8,460	0,01	Unique Pub Finance Co. PLC								
6,254 % fällig am 23.10.2034	49,400	53,578	0,08	6,016 % fällig am 22.09.2037	11,769	9,298	0,01	7,395 % fällig am 28.03.2024	€	586	746	0,00				
Kaisa Group Holdings Ltd.				6,026 % fällig am 22.09.2035	437	435	0,00	Uniti Group LP								
9,375 % fällig am 30.06.2024	1,800	65	0,00	6,026 % fällig am 22.03.2037	13,130	9,979	0,01	4,750 % fällig am 15.04.2028	\$	11,366	9,808	0,01				
^A				6,046 % fällig am 22.03.2038	4,532	4,079	0,01	10,500 % fällig am 15.02.2028	72,952	74,021	0,11					
9,750 % fällig am 28.09.2023	800	29	0,00	6,076 % fällig am 22.12.2035	2,164	1,818	0,00	Ursa Re Ltd.								
^A				6,096 % fällig am 22.03.2038	9,085	7,858	0,01	10,871 % fällig am 07.12.2026	19,400	19,399	0,03					
10,500 % fällig am	400	15	0,00	6,126 % fällig am 23.09.2035	6,643	5,879	0,01	14,121 % fällig am 07.12.2026	24,900	24,898	0,04					
15.01.2025	400	15	0,00	6,226 % fällig am 23.03.2035	10,000	8,750	0,01	VICI Properties LP								
11,250 % fällig am	800	26	0,00	6,482 % fällig am 03.07.2033	274	261	0,00	3,500 % fällig am 15.02.2025	42,516	41,455	0,06					
16.04.2025	800	26	0,00	6,546 % fällig am 22.03.2038	735	705	0,00	3,750 % fällig am 15.02.2027	39,100	36,933	0,05					
11,500 % fällig am	600	20	0,00	Realkredit Danmark A/S				3,875 % fällig am 15.02.2029	14,180	13,037	0,02					
30.01.2023	600	20	0,00	2,500 % fällig am 01.04.2047DKK	0	0	0,00	4,125 % fällig am 15.08.2030	10,116	9,225	0,01					
11,700 % fällig am	2,600	94	0,00	Santander UK Group Holdings PLC				4,250 % fällig am 01.12.2026	31,400	30,238	0,04					
11.11.2025	2,600	94	0,00	2,469 % fällig am 11.01.2028	\$	5,600	5,108	0,01	4,500 % fällig am 01.09.2026	11,028	10,682	0,02				
11,950 % fällig am	800	29	0,00	3,823 % fällig am 03.11.2028	25,600	24,078	0,03	4,500 % fällig am 15.01.2028	2,000	1,909	0,00					

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Yango Group Co. Ltd. 6,900 % fällig am 31.10.2022 ^	CNY	50.000	\$ 995	3,900 % fällig am 01.06.2052	\$ 89.600	\$ 60.344	0,09	Noble Finance LLC 8,000 % fällig am 15.04.2030	\$ 5.779	\$ 6.018	0,01
			0,00	3,950 % fällig am 30.06.2062	21.300	13.424	0,02	NPC Ukrenerg 6,875 % fällig am 09.11.2028	1.000	272	0,00
		8.649.588	12,26	4,400 % fällig am 01.12.2061	38.000	26.303	0,04	Oracle Corp. 3,850 % fällig am 01.04.2060	2.776	2.016	0,00
INDUSTRIEWERTE				Community Health Systems, Inc. 5,625 % fällig am 15.03.2027	79.160	73.654	0,10	4,100 % fällig am 25.03.2061 (I)	13.100	10.003	0,01
Air Canada Pass-Through Trust 5,250 % fällig am 01.10.2030	\$	32.406	31.808	8,000 % fällig am 15.03.2026	33.087	33.007	0,05	PeaceHealth Obligated Group 3,218 % fällig am 15.11.2050	13.300	8.743	0,01
Alaska Airlines Pass-Through Trust 4,800 % fällig am 15.02.2029		19.407	18.886	Constellation Oil Services Holding S.A. 13,500 % fällig am 30.06.2025	1.150	1.140	0,00	Petroleos de Venezuela S.A. 5,375 % fällig am 12.04.2037	53.114	5.922	0,01
Altice Financing S.A. 5,750 % fällig am 15.08.2029		63.003	55.994	Constellation Oil Services Holding S.A. (3,000 % bar oder 4,000 % PIK) 3,000 % fällig am 31.12.2026 (d)	2.993	2.178	0,00	5,500 % fällig am 12.04.2047	50.574	5.690	0,01
Altice France S.A. 8,125 % fällig am 01.02.2027		24.392	22.505	CoStar Group, Inc. 2,800 % fällig am 15.07.2030	11.362	9.669	0,01	6,000 % fällig am 16.05.2034	47.576	5.470	0,01
Amdocs Ltd. 2,538 % fällig am 15.06.2030		3.500	3.021	CVS Pass-Through Trust 4,163 % fällig am 11.08.2036	1.366	1.218	0,00	6,000 % fällig am 15.11.2036	63.177	7.344	0,01
American Airlines Pass-Through Trust 2,875 % fällig am 11.01.2036		14.394	12.244	4,704 % fällig am 10.01.2036	5.109	4.748	0,01	9,750 % fällig am 17.05.2045	28.330	3.683	0,01
3,000 % fällig am 15.04.2030		2.641	2.387	5,926 % fällig am 10.01.2034	715	725	0,00	Petroleos Mexicanos 2,750 % fällig am 21.04.2027	€ 3.000	2.796	0,00
3,150 % fällig am 15.08.2033		729	639	6,036 % fällig am 10.12.2028	2.347	2.371	0,00	5,950 % fällig am 28.01.2031	\$ 43.161	34.518	0,05
3,200 % fällig am 15.12.2029		3.103	2.829	6,943 % fällig am 10.01.2030	4.827	4.932	0,01	6,700 % fällig am 16.02.2032	303.442	252.148	0,36
3,350 % fällig am 15.04.2031		9.840	8.898	7,507 % fällig am 10.01.2032	5.671	5.967	0,01	6,750 % fällig am 21.09.2047	2.466	1.617	0,00
3,375 % fällig am 01.11.2028		22.982	21.082	8,353 % fällig am 10.07.2031	4.448	4.804	0,01	6,950 % fällig am 28.01.2060	60.850	40.153	0,06
3,575 % fällig am 15.07.2029		9.274	8.659	Delta Air Lines Pass-Through Trust 2,000 % fällig am 10.12.2029	198	176	0,00	7,690 % fällig am 23.01.2050	9.240	6.583	0,01
3,600 % fällig am 22.03.2029		1.741	1.631	DISH DBS Corp. 5,250 % fällig am 01.12.2026	72.570	62.310	0,09	Prime Healthcare Services, Inc. 7,250 % fällig am 01.11.2025	35.984	35.124	0,05
3,700 % fällig am 01.04.2028		29.456	27.439	5,750 % fällig am 01.12.2028	81.200	64.917	0,09	Prosus NV 1,985 % fällig am 13.07.2033	€ 10.500	8.603	0,01
4,000 % fällig am 15.01.2027		273	262	Energy Transfer LP 4,950 % fällig am 15.05.2028	2.500	2.490	0,00	2,085 % fällig am 19.01.2030	3.900	3.612	0,01
4,000 % fällig am 15.08.2030		5.078	4.560	6,050 % fällig am 01.12.2026	18.300	18.825	0,03	2,778 % fällig am 19.01.2034	8.700	7.517	0,01
Baptist Healthcare System Obligated Group 3,540 % fällig am 15.08.2050		13.100	9.679	6,100 % fällig am 01.12.2028	6.250	6.581	0,01	3,061 % fällig am 13.07.2031	\$ 4.600	3.719	0,01
BAT Capital Corp. 6,343 % fällig am 02.08.2030		5.300	5.569	6,400 % fällig am 01.12.2030	25.000	26.758	0,04	4,193 % fällig am 19.01.2032	3.700	3.195	0,00
6,421 % fällig am 02.08.2033		4.300	4.503	Exela Intermediate LLC 11,500 % fällig am 15.04.2026	5.011	902	0,00	RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc. 9,750 % fällig am 01.12.2026	2.700	2.682	0,00
BAT International Finance PLC 5,931 % fällig am 02.02.2029		50.000	51.985	Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A. 2,250 % fällig am 22.11.2024	€ 500	442	0,00	Roadster Finance DAC 2,375 % fällig am 08.12.2032	€ 7.000	6.826	0,01
Bayer U.S. Finance LLC 6,125 % fällig am 21.11.2026		15.000	15.256	2,949 % fällig am 24.01.2024	€ 56.890	51.846	0,07	Rolls-Royce PLC 4,625 % fällig am 16.02.2026	17.996	20.273	0,03
6,250 % fällig am 21.01.2029		20.500	20.972	4,250 % fällig am 06.04.2024	€ 500	519	0,00	5,750 % fällig am 15.10.2027	£ 9.371	12.021	0,02
6,375 % fällig am 21.11.2030		15.700	16.165	4,950 % fällig am 23.03.2027	\$ 20.300	14.108	0,02	RTX Corp. 5,750 % fällig am 08.11.2026	\$ 25.000	25.696	0,04
6,500 % fällig am 21.11.2033		30.000	31.024	4,950 % fällig am 06.02.2028	24.600	17.097	0,02	5,750 % fällig am 15.01.2029	23.250	24.318	0,03
6,875 % fällig am 21.11.2053		14.100	15.032	5,150 % fällig am 11.02.2026	32.700	24.525	0,04	Russian Railways Via RZD Capital PLC 7,487 % fällig am 25.03.2031 ^	£ 13.950	11.559	0,02
Biocceanico Sovereign Certificate Ltd. 0,000 % fällig am 05.06.2034 (f)		1.171	839	7,288 % fällig am 16.08.2037	18.510	14.931	0,02	Sandoz Finance BV 3,970 % fällig am 17.04.2027	€ 15.000	16.913	0,02
Boeing Co. 5,705 % fällig am 01.05.2040		16.239	16.807	8,625 % fällig am 28.04.2034	38.699	35.291	0,05	4,220 % fällig am 17.04.2030	5.000	5.740	0,01
5,805 % fällig am 01.05.2050		58.907	61.042	Global Payments, Inc. 1,200 % fällig am 01.03.2026	2.664	2.449	0,00	4,500 % fällig am 17.11.2033	10.000	11.746	0,02
5,930 % fällig am 01.05.2060		65.888	68.345	Greene King Finance PLC 4,064 % fällig am 15.03.2035	£ 3.683	4.295	0,01	Sands China Ltd. 4,300 % fällig am 08.01.2026	\$ 9.337	8.972	0,01
British Airways Pass-Through Trust 2,900 % fällig am 15.09.2036		7.029	6.025	5,106 % fällig am 15.03.2034	2.969	3.679	0,01	5,375 % fällig am 08.08.2025	21.176	20.896	0,03
3,300 % fällig am 15.06.2034		3.221	2.870	GTCR W-2 Merger Sub LLC 7,500 % fällig am 15.01.2031	\$ 3.300	3.489	0,01	5,650 % fällig am 08.08.2028	21.010	20.848	0,03
3,800 % fällig am 20.03.2033		2.306	2.160	Imperial Brands Finance Netherlands BV 1,750 % fällig am 18.03.2033	€ 5.290	4.585	0,01	Spirit Airlines Pass-Through Trust 4,100 % fällig am 01.10.2029	1.633	1.502	0,00
4,250 % fällig am 15.05.2034		6.303	5.885	Imperial Brands Finance PLC 3,500 % fällig am 26.07.2026	\$ 3.094	2.953	0,00	Sprint Spectrum Co. LLC 4,738 % fällig am 20.09.2029	5.217	5.175	0,01
Broadcom, Inc. 2,450 % fällig am 15.02.2031		41.000	35.083	Integris Baptist Medical Center, Inc. 3,875 % fällig am 15.08.2050	10.500	8.070	0,01	Sutter Health 3,161 % fällig am 15.08.2040	1.500	1.178	0,00
2,600 % fällig am 15.02.2033		10.810	8.911	Intelsat Jackson Holdings S.A. 6,500 % fällig am 15.03.2030	337.627	322.469	0,46	3,361 % fällig am 15.08.2050	16.300	12.111	0,02
3,137 % fällig am 15.11.2035		2.408	1.978	IQVIA, Inc. 6,250 % fällig am 01.02.2029	14.600	15.260	0,02	Syngenta Finance NV 4,892 % fällig am 24.04.2025	4.948	4.884	0,01
3,187 % fällig am 15.11.2036		61.996	50.273	JetBlue Pass-Through Trust 4,000 % fällig am 15.05.2034	37.657	34.567	0,05	Times Square Hotel Trust 8,528 % fällig am 01.08.2026	1.272	1.270	0,00
3,419 % fällig am 15.04.2033		13.920	12.232	Las Vegas Sands Corp. 3,200 % fällig am 08.08.2024	5.950	5.838	0,01	Topaz Solar Farms LLC 4,875 % fällig am 30.09.2039	5.258	4.856	0,01
3,469 % fällig am 15.04.2034		73.631	64.092	Market Bidco Finco PLC 4,750 % fällig am 04.11.2027	€103.700	103.022	0,15	5,750 % fällig am 30.09.2039	44.878	44.682	0,06
California Institute of Technology 4,283 % fällig am 01.09.2116		9.100	7.219	Mitchells & Butlers Finance PLC 6,013 % fällig am 15.12.2030	£ 5.469	6.616	0,01	U.S. Airways Pass-Through Trust 3,950 % fällig am 15.05.2027	2.469	2.361	0,00
Carvana Co. 12,000 % fällig am 01.12.2028		55.640	45.052	6,135 % fällig am 15.12.2030	\$ 3.658	3.397	0,01	U.S. Renal Care, Inc. 10,625 % fällig am 28.06.2028	3.879	2.977	0,00
13,000 % fällig am 01.06.2030		88.679	70.842	Netflix, Inc. 3,875 % fällig am 15.11.2029	€ 18.758	21.470	0,03	United Airlines Pass-Through Trust 2,700 % fällig am 01.11.2033	19.345	16.408	0,02
14,000 % fällig am 01.06.2031		109.179	88.269	Nissan Motor Co. Ltd. 3,522 % fällig am 17.09.2025	\$ 58.000	55.866	0,08	3,500 % fällig am 01.09.2031	1.899	1.734	0,00
CDW LLC 2,670 % fällig am 01.12.2026		7.600	7.118	4,345 % fällig am 17.09.2027	82.724	79.200	0,11	3,750 % fällig am 03.03.2028	7.635	7.283	0,01
3,569 % fällig am 01.12.2031		26.300	23.359	4,810 % fällig am 17.09.2030	43.097	40.318	0,06	4,000 % fällig am 11.10.2027	482	460	0,00
Cellnex Finance Co. S.A. 3,875 % fällig am 07.07.2041		6.300	4.885	NMG Holding Co., Inc. 7,125 % fällig am 01.04.2026	92.700	89.154	0,13	4,150 % fällig am 11.10.2025	2.528	2.517	0,00
CGI, Inc. 1,450 % fällig am 14.09.2026		8.100	7.351					4,150 % fällig am 25.02.2033	727	672	0,00
Charter Communications Operating LLC 3,850 % fällig am 01.04.2061		6.100	3.807					5,875 % fällig am 15.04.2029	96.562	97.875	0,14
								Valaris Ltd. 8,375 % fällig am 30.04.2030	1.327	1.361	0,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Venture Global Calcasieu Pass LLC				Summe Unternehmensanleihen und Wechsel	14.341.315	20,33		3,500 % fällig am			
3,875 % fällig am 15.08.2029	\$ 44.300	\$ 40.244	0,06					01.07.2046 - 01.05.2049	\$ 8.113	\$ 7.600	0,01
3,875 % fällig am 01.11.2033	164.900	139.942	0,20	WANDELANLEIHEN & WECHSEL				4,000 % fällig am			
4,125 % fällig am 15.08.2031	40.000	35.291	0,05	Multiplan Corp. (6,000 % bar oder 7,000 % PIK)				01.04.2025 - 01.11.2047	40	39	0,00
Venture Global LNG, Inc.				6,000 % fällig am 15.10.2027	\$ 30.000	\$ 19.920	0,03	4,000 % fällig am 15.06.2049			
8,125 % fällig am 01.06.2028	67.900	68.634	0,10	(d)				(a)	4.353	811	0,00
8,375 % fällig am 01.06.2031	61.000	61.060	0,09	Sunac China Holdings Ltd.				4,312 % fällig am 25.10.2052	120.984	116.703	0,17
9,500 % fällig am 01.02.2029	210.250	222.611	0,32	1,000 % fällig am 30.09.2032	581	45	0,00	4,443 % fällig am 25.11.2052	139.560	137.441	0,20
9,875 % fällig am 01.02.2032	70.050	73.011	0,10					4,500 % fällig am 01.08.2048	7.635	7.539	0,01
Veritas U.S., Inc.								4,500 % fällig am 15.05.2049			
7,500 % fällig am 01.09.2025	4.090	3.380	0,00	KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL				(a)	3.319	638	0,00
Wesco Aircraft Holdings, Inc. (7,500 % bar und 3,000 % PIK)				Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Bonds, Series 2022				5,000 % fällig am			
10,500 % fällig am				0,000 % fällig am 01.11.2043	52.921	28.908	0,04	15.02.2049 (a)	1.483	260	0,00
15.11.2026 ^ (d)	30.072	27.366	0,04	Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Bonds, (ST APPROP Insured), Series 2021				5,500 % fällig am			
Windstream Escrow LLC				3,000 % fällig am 01.06.2046	3.000	2.732	0,01	01.08.2033 - 01.04.2036	0	0	0,00
7,750 % fällig am 15.08.2028	73.300	64.278	0,09	Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Bonds, Series 2021				6,000 % fällig am 01.01.2033	0	0	0,00
Wynn Macau Ltd.				3,850 % fällig am 01.06.2050	2.225	2.062	0,00	6,500 % fällig am			
5,500 % fällig am 15.01.2026	6.250	6.105	0,01	4,214 % fällig am 01.06.2050	13.300	10.047	0,02	01.02.2032 - 25.11.2049	2.787	2.972	0,00
		3.974.836	5,64	Illinois State General Obligation Bonds, (BABs), Series 2010				6,556 % fällig am 25.12.2047	2.090	2.088	0,00
VERSORGUNGSUNTERNEHMEN				6,630 % fällig am 01.02.2035	7.334	7.688	0,01	7,000 % fällig am			
Enel Finance America LLC				6,725 % fällig am 01.04.2035	2.488	2.623	0,00	01.12.2025 - 01.06.2037	6	2	0,00
7,100 % fällig am 14.10.2027	3.200	3.417	0,00	7,350 % fällig am 01.07.2035	6.874	7.474	0,01	8,000 % fällig am 01.07.2030	0	0	0,00
Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC				Pennsylvania Higher Education Assistance Agency Revenue Bonds, (GTD STD LNS Insured), Series 2006				Ginnie Mae			
2,950 % fällig am 27.01.2029	183.800	105.685	0,15	5,726 % fällig am 25.10.2036	5.119	5.088	0,01	0,000 % fällig am 20.12.2040	1.731	1.487	0,00
ONEOK, Inc.				Puerto Rico Electric Power Authority Revenue Bonds, (BABs), Series 2010				0,000 % fällig am 20.01.2049			
6,050 % fällig am 01.09.2033	11.000	11.660	0,02	6,050 % fällig am 01.07.2032 ^	6.790	1.664	0,00	(a)	45.143	847	0,00
6,625 % fällig am 01.09.2053	5.100	5.714	0,01	6,125 % fällig am 01.07.2040 ^	435	107	0,00	0,153 % fällig am 16.05.2050			
Pacific Gas & Electric Co.				Puerto Rico Electric Power Authority Revenue Bonds, Series 2008				(a)	787	2	0,00
2,100 % fällig am 01.08.2027	7.177	6.473	0,01	5,375 % fällig am 01.07.2022	2.355	612	0,00	0,677 % fällig am 16.01.2043			
2,500 % fällig am 01.02.2031	12.391	10.233	0,01	University of California Revenue Bonds, Series 2012				(a)	562	40	0,00
2,950 % fällig am 01.03.2026	104.155	98.722	0,14	4,858 % fällig am 15.05.2112	12.280	11.605	0,02	2,500 % fällig am 20.04.2052	58.563	51.220	0,07
3,000 % fällig am 15.06.2028	31.800	29.006	0,04	US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				2,625 % fällig am 20.12.2045	2.692	2.668	0,00
3,150 % fällig am 01.01.2026	60.363	57.923	0,08	Fannie Mae				3,500 % fällig am 20.03.2043			
3,250 % fällig am 01.06.2031	37.030	32.104	0,05	0,000 % fällig am 25.03.2035 (a)	115	4	0,00	(a)	645	98	0,00
3,300 % fällig am 15.03.2027	19.465	18.213	0,03	0,000 % fällig am 25.05.2041	36	29	0,00	3,500 % fällig am 20.02.2053	429	402	0,00
3,300 % fällig am 01.12.2027	113.802	106.317	0,15	0,206 % fällig am 25.08.2033	170	156	0,00	3,625 % fällig am 20.07.2045	5.964	5.953	0,01
3,400 % fällig am 15.08.2024	52.193	51.338	0,07	0,548 % fällig am 25.10.2049 (a)	38.353	5.394	0,01	4,122 % fällig am 20.04.2037	6	7	0,00
3,450 % fällig am 01.07.2025	103.044	99.778	0,14	0,598 % fällig am 25.04.2044 - 25.02.2049 (a)	6.155	703	0,00	4,500 % fällig am			
3,500 % fällig am 15.06.2025	63.544	61.611	0,09	0,748 % fällig am 25.05.2048 (a)	14.640	2.081	0,00	15.07.2030 - 20.07.2053	150.934	150.487	0,21
3,500 % fällig am 01.08.2050	12.179	8.434	0,01	2,500 % fällig am				5,000 % fällig am			
3,750 % fällig am 15.02.2024	29.892	29.802	0,04	25.12.2027 - 25.02.2028 (a)	3.295	108	0,00	20.11.2032 - 20.06.2049	203.597	206.534	0,29
3,750 % fällig am 01.07.2028	113.694	106.587	0,15	3,000 % fällig am				5,283 % fällig am 20.06.2067	3.026	3.035	0,00
3,750 % fällig am 15.08.2042	20.803	15.410	0,02	25.06.2042 - 25.02.2046 (a)	498	66	0,00	5,431 % fällig am 20.06.2067	12.981	13.022	0,02
3,950 % fällig am 01.12.2047	4.700	3.449	0,01	3,000 % fällig am 01.09.2057	16.833	14.839	0,02	5,500 % fällig am 20.07.2053	592.762	597.265	0,85
4,000 % fällig am 01.12.2046	16.783	12.330	0,02	3,500 % fällig am 25.12.2049 (a)	5.770	1.267	0,00	5,616 % fällig am 20.06.2067	6.372	6.382	0,01
4,200 % fällig am 01.03.2029	32.300	30.566	0,04	4,000 % fällig am 01.01.2059	8.676	8.300	0,01	5,659 % fällig am 20.09.2067	11.654	11.738	0,02
4,200 % fällig am 01.06.2041	4.900	3.929	0,01	4,500 % fällig am 25.09.2040	2.250	2.209	0,00	5,787 % fällig am 20.08.2065	2.019	2.007	0,00
4,250 % fällig am 15.03.2046	20.053	15.469	0,02	4,500 % fällig am 25.12.2042 (a)	129	22	0,00	5,788 % fällig am 20.01.2072	577	572	0,00
4,300 % fällig am 15.03.2045	64.134	50.363	0,07	5,000 % fällig am				5,887 % fällig am 20.08.2066	13	13	0,00
4,400 % fällig am 01.03.2032	33.000	30.563	0,04	01.05.2034 - 01.06.2037	6	5	0,00	6,000 % fällig am 15.04.2037 - 20.11.2038	0	0	0,00
4,450 % fällig am 15.04.2042	33.647	27.233	0,04	5,500 % fällig am				6,007 % fällig am 20.04.2062	299	298	0,00
4,500 % fällig am 01.07.2040	80.778	68.443	0,10	01.05.2033 - 25.05.2038	124	125	0,00	6,037 % fällig am 20.01.2062	12	12	0,00
4,500 % fällig am 15.12.2041	4.657	3.659	0,01	6,000 % fällig am				6,087 % fällig am 20.02.2070	577	576	0,00
4,550 % fällig am 01.07.2030	210.515	200.687	0,28	01.08.2036 - 01.05.2038	0	0	0,00	6,114 % fällig am 20.09.2066	7.675	7.816	0,01
4,600 % fällig am 15.06.2043	41.543	34.301	0,05	6,500 % fällig am 01.03.2029	0	0	0,00	6,137 % fällig am 20.08.2066	1.520	1.516	0,00
4,650 % fällig am 01.08.2028	4.100	3.940	0,01	6,889 % fällig am 25.07.2037	4	5	0,00	6,237 % fällig am 20.06.2066	6.973	6.943	0,01
4,750 % fällig am 15.02.2044	31.088	26.027	0,04	7,000 % fällig am 01.04.2029	0	0	0,00	6,287 % fällig am 20.07.2066	2.017	2.008	0,00
4,950 % fällig am 08.06.2025	15.300	15.211	0,02	Freddie Mac				6,357 % fällig am 20.07.2065	10.890	10.861	0,02
4,950 % fällig am 01.07.2050	150.401	128.797	0,18	0,000 % fällig am 15.01.2041	437	393	0,00	6,391 % fällig am 20.09.2066	17.003	17.409	0,03
5,250 % fällig am 01.03.2052	24.400	21.745	0,03	0,548 % fällig am 25.12.2049 (a)	21.984	1.834	0,00	6,500 % fällig am 15.05.2028 - 15.09.2037	4	2	0,00
5,450 % fällig am 15.06.2027	8.500	8.574	0,01	0,697 % fällig am 15.11.2042 (a)	3.292	385	0,00	6,525 % fällig am 20.07.2067	13.477	13.553	0,02
5,900 % fällig am 15.06.2032	10.000	10.180	0,01	0,747 % fällig am 15.01.2042 (a)	193	13	0,00	7,000 % fällig am			
Peru LNG SRL				0,968 % fällig am 25.04.2029 (a)	42.755	1.329	0,00	15.01.2025 - 15.05.2038	2	1	0,00
5,375 % fällig am 22.03.2030	600	497	0,00	1,297 % fällig am 15.03.2037 (a)	67	6	0,00	7,500 % fällig am			
PG&E Wildfire Recovery Funding LLC				2,500 % fällig am 15.09.2027 (a)	3.751	127	0,00	20.03.2024 - 20.01.2030	0	0	0,00
4,263 % fällig am 01.06.2038	20.100	19.077	0,03	2,972 % fällig am 25.10.2046	5.152	4.982	0,01	8,000 % fällig am			
4,377 % fällig am 03.06.2041	22.200	20.802	0,03	3,000 % fällig am				15.07.2024 - 15.05.2032	1	0	0,00
4,451 % fällig am 01.12.2049	22.830	20.661	0,03	15.12.2032 - 15.04.2049 (a)	3.583	793	0,00	8,500 % fällig am 15.01.2031	0	0	0,00
Rio Oil Finance Trust				3,000 % fällig am				Ginnie Mae, TBA			
8,200 % fällig am 06.04.2028	14.929	15.293	0,02	15.12.2032 - 15.04.2049 (a)	3.583	793	0,00	3,500 % fällig am 01.01.2054	607.100	565.457	0,80
9,750 % fällig am 06.01.2027	6.150	6.407	0,01	3,000 % fällig am				4,000 % fällig am 01.02.2054	136.800	130.751	0,19
Sprint Capital Corp.				01.11.2046 - 01.05.2049	2.094	1.909	0,00	4,500 % fällig am 01.02.2054	163.522	159.754	0,23
8,750 % fällig am 15.03.2032	12.200	15.072	0,02	3,102 % fällig am 15.10.2033	353	339	0,00	5,000 % fällig am 01.02.2054	85.500	84.966	0,12
Sprint LLC				3,500 % fällig am				Uniform Mortgage-Backed Security			
7,125 % fällig am 15.06.2024	43.552	43.770	0,06	15.12.2032 - 15.06.2049 (a)	7.354	1.132	0,00	2,500 % fällig am			
7,625 % fällig am 01.03.2026	20.490	21.419	0,03					01.06.2031 - 01.03.2032	268	253	0,00
		1.716.891	2,43					3,000 % fällig am			
								01.02.2025 - 01.12.2052	2.445.110	2.169.500	3,08
								3,500			

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
5,500 % fällig am 01.12.2034 - 01.12.2053	\$ 2.409.309	\$2.421.660	3,43	2,000 % fällig am 15.02.2025	15.000	\$ 14.561	0,02	Ashford Hospitality Trust			
6,000 % fällig am 01.08.2031 - 01.11.2053	2.751.428	2.796.738	3,96	2,000 % fällig am 15.08.2025	110.000	105.871	0,15	6,434 % fällig am 15.04.2035	\$ 927	\$ 916	0,00
6,500 % fällig am 01.09.2024 - 01.10.2053	1.484.110	1.521.390	2,16	2,000 % fällig am 15.11.2026	\$ 9.100	8.604	0,01	6,784 % fällig am 15.04.2035	3.000	2.938	0,01
7,500 % fällig am 01.04.2029 - 01.10.2030	1	0	0,00	2,125 % fällig am 15.05.2025	132.200	128.007	0,18	6,934 % fällig am 15.04.2035	2.500	2.446	0,00
8,000 % fällig am 01.03.2030	0	0	0,00	2,250 % fällig am 15.11.2025	57.430	55.323	0,08	Atlas Funding PLC			
8,500 % fällig am 01.04.2025	0	0	0,00	2,250 % fällig am 15.02.2027	262.600	249.332	0,35	6,120 % fällig am 25.07.2058	£ 20.201	25.769	0,04
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				2,375 % fällig am 31.03.2029	139.700	129.725	0,18	6,348 % fällig am 20.01.2061	27.098	34.718	0,05
2,000 % fällig am 01.01.2039	200	179	0,00	2,375 % fällig am 15.05.2029	255.400	236.774	0,34	Atrium Hotel Portfolio Trust			
2,500 % fällig am 01.01.2039 - 01.02.2054	1.350	1.241	0,00	2,625 % fällig am 31.01.2026	631.400	611.644	0,87	6,589 % fällig am 15.12.2036	\$ 37.889	36.049	0,05
3,000 % fällig am 01.01.2039 - 01.03.2054	503.600	451.860	0,64	2,750 % fällig am 15.08.2032	832.400	762.540	1,08	7,159 % fällig am 15.04.2036	4.000	3.674	0,01
3,500 % fällig am 01.01.2054	3.334.184	3.061.832	4,34	2,875 % fällig am 15.08.2028	500	479	0,00	7,959 % fällig am 15.06.2035	47.513	45.561	0,07
4,000 % fällig am 01.01.2054	1.762.853	1.668.767	2,37	2,875 % fällig am 15.05.2032	171.690	159.159	0,23	Avon Finance PLC			
4,500 % fällig am 01.01.2054	2.274.300	2.206.123	3,13	4,000 % fällig am 31.10.2029	592.900	595.783	0,84	0,000 % fällig am 28.12.2049	£ 47.000	59.789	0,09
5,000 % fällig am 01.01.2054	5.207.864	5.153.819	7,31								
5,500 % fällig am 01.01.2054	5.466.360	5.490.555	7,78								
6,000 % fällig am 01.01.2054	6.659.100	6.762.037	9,59								
6,500 % fällig am 01.01.2054	4.051.000	4.151.292	5,89								
7,000 % fällig am 01.03.2054	476.000	490.187	0,70								
		44.437.876	62,99								
						15.095.389	21,40				
US-SCHATZ Obligationen				NON-AGENCY-MBS							
U.S. Treasury Bonds				1211 Avenue of the Americas Trust							
2,500 % fällig am 15.02.2045	59.000	44.699	0,06	3,901 % fällig am 10.08.2035	1.500	1.438	0,00	Banc of America Alternative Loan Trust			
2,875 % fällig am 15.05.2043	69.079	56.736	0,08	4,092 % fällig am 10.08.2035	9.600	9.002	0,01	5,500 % fällig am 25.12.2035	\$ 149	127	0,00
2,875 % fällig am 15.08.2045	510.010	411.435	0,58	4,142 % fällig am 10.08.2035	7.400	6.660	0,01	5,870 % fällig am 25.01.2037	1.708	1.278	0,00
3,000 % fällig am 15.11.2044	371.252	307.414	0,44					5,913 % fällig am 25.10.2036	9.825	2.857	0,01
3,000 % fällig am 15.08.2048	81.815	66.628	0,09					6,000 % fällig am 25.11.2035	186	158	0,00
3,000 % fällig am 15.02.2049	10.169	8.279	0,01					6,000 % fällig am 25.04.2037	356	286	0,00
3,125 % fällig am 15.02.2043	178.076	152.290	0,22	20 Times Square Trust				6,000 % fällig am 25.06.2037	470	388	0,00
3,125 % fällig am 15.08.2044	283.117	239.842	0,34	3,100 % fällig am 15.05.2035	44.318	37.140	0,05	6,000 % fällig am 25.06.2046	2.027	1.562	0,00
3,125 % fällig am 15.05.2048	55.840	46.543	0,07	225 Liberty Street Trust				6,000 % fällig am 25.07.2046	1.343	1.135	0,00
3,375 % fällig am 15.05.2044	416.095	367.025	0,52	3,597 % fällig am 10.02.2036	18.260	16.732	0,02	6,500 % fällig am 25.03.2036	1.710	1.503	0,00
3,625 % fällig am 15.02.2044	145.436	133.313	0,19								
3,750 % fällig am 15.11.2043	80.988	75.721	0,11	280 Park Avenue Mortgage Trust				Banc of America Funding Corp.			
4,375 % fällig am 15.08.2043	208.600	213.000	0,30	6,538 % fällig am 15.09.2034	700	673	0,00	4,407 % fällig am 25.09.2048	1.557	1.423	0,00
				6,908 % fällig am 15.09.2034	2.000	1.839	0,00	Banc of America Funding Trust			
U.S. Treasury Inflation Protected Securities (h)				Adjustable Rate Mortgage Trust				3,369 % fällig am 29.04.2037	7.118	6.394	0,01
0,125 % fällig am 15.07.2024	1.321.763	1.299.165	1,84	3,046 % fällig am 25.08.2035	305	239	0,00	3,806 % fällig am 20.05.2035	725	632	0,00
0,125 % fällig am 15.10.2024	1.153.892	1.128.828	1,60	3,492 % fällig am 25.09.2035	2.411	2.027	0,00	4,222 % fällig am 26.10.2036	9.406	8.872	0,01
0,125 % fällig am 15.04.2025	187.934	181.243	0,26	4,126 % fällig am 25.05.2036	106	88	0,00	4,306 % fällig am 20.10.2047	152	125	0,00
0,125 % fällig am 15.07.2030	309.089	279.381	0,40	4,856 % fällig am 25.03.2037	830	684	0,00	4,391 % fällig am 27.08.2036	15.536	14.499	0,02
0,125 % fällig am 15.01.2031	11.347	10.133	0,01	4,983 % fällig am 25.04.2035	5	5	0,00	4,427 % fällig am 20.05.2036	213	184	0,00
0,125 % fällig am 15.07.2031	59.498	52.927	0,07	5,418 % fällig am 25.01.2036	502	363	0,00	4,446 % fällig am 20.11.2035	3.048	2.562	0,00
0,125 % fällig am 15.01.2032	48.613	42.723	0,06	5,556 % fällig am 25.01.2036	39	36	0,00	4,482 % fällig am 20.07.2047	834	789	0,00
0,250 % fällig am 15.01.2025	826.203	802.021	1,14	5,710 % fällig am 25.08.2036	11.666	3.824	0,01	4,699 % fällig am 20.06.2047	4.744	4.156	0,01
0,250 % fällig am 15.07.2029	884.442	817.736	1,16	5,810 % fällig am 25.05.2036	5.567	2.191	0,00	4,718 % fällig am 20.09.2046	80	65	0,00
0,250 % fällig am 15.02.2050	116.203	75.860	0,11	5,890 % fällig am 25.06.2037	2.639	3.145	0,01	4,733 % fällig am 20.05.2036	1.046	959	0,00
0,375 % fällig am 15.01.2027	19.387	18.428	0,03	5,990 % fällig am 25.01.2036	2.26	210	0,00	4,817 % fällig am 20.09.2035	2.305	1.818	0,00
0,375 % fällig am 15.07.2027	5.232	4.973	0,01	6,010 % fällig am 25.02.2036	168	97	0,00	4,934 % fällig am 20.06.2032	3	3	0,00
0,500 % fällig am 15.04.2024	544.914	538.054	0,76	6,263 % fällig am 25.11.2037	760	492	0,00	4,953 % fällig am 20.02.2036	40	32	0,00
0,625 % fällig am 15.01.2024	953.520	950.991	1,35	6,420 % fällig am 25.08.2035	1.258	1.127	0,00	5,061 % fällig am 20.01.2047	1.618	1.387	0,00
0,625 % fällig am 15.07.2032	532.862	487.129	0,69	6,620 % fällig am 25.01.2035	1.487	1.265	0,00	5,168 % fällig am 20.05.2036	219	195	0,00
0,625 % fällig am 15.02.2043	16.193	12.663	0,02	6,620 % fällig am 25.03.2035	1.772	1.506	0,00	5,404 % fällig am 20.11.2034	6	6	0,00
0,750 % fällig am 15.07.2028	172.629	165.266	0,23					5,478 % fällig am 20.07.2036	85	80	0,00
0,750 % fällig am 15.02.2042	45.887	37.232	0,05	Alba PLC				5,490 % fällig am 20.02.2036	45	42	0,00
0,750 % fällig am 15.02.2045	152.439	119.322	0,17	5,509 % fällig am 17.03.2039	£ 5.835	7.215	0,01	5,500 % fällig am 26.07.2035	115	95	0,00
0,875 % fällig am 15.01.2029	207.497	198.653	0,28	5,559 % fällig am 15.12.2038	7.952	9.514	0,01	5,500 % fällig am 25.01.2036	33	32	0,00
0,875 % fällig am 15.02.2047	117.899	93.025	0,13	5,579 % fällig am 17.03.2039	4.816	5.790	0,01	5,500 % fällig am 25.03.2036	44	38	0,00
1,000 % fällig am 15.02.2046	63.237	51.791	0,07	5,629 % fällig am 17.03.2039	7.693	9.105	0,01	5,530 % fällig am 25.01.2037	2.194	1.900	0,00
1,000 % fällig am 15.02.2048	140.116	113.195	0,16	5,689 % fällig am 25.11.2042	957	1.164	0,00	5,570 % fällig am 25.04.2037	3.090	2.529	0,00
1,000 % fällig am 15.02.2049	368.546	297.036	0,42	Alliance Bancorp Trust				5,599 % fällig am 20.11.2035	202	184	0,00
1,125 % fällig am 15.01.2033	52.263	49.478	0,07	5,950 % fällig am 25.07.2037	\$ 948	801	0,00	5,657 % fällig am 20.11.2034	36	35	0,00
1,375 % fällig am 15.07.2033	880.158	853.999	1,21	American Home Mortgage Assets Trust				5,680 % fällig am 26.05.2037	6.458	5.591	0,01
1,375 % fällig am 15.02.2044	17.690	15.829	0,02	3,210 % fällig am 25.11.2035	1.070	798	0,00	5,717 % fällig am 26.07.2036	5.061	4.112	0,01
1,500 % fällig am 15.02.2053	167.473	151.999	0,22	5,590 % fällig am 25.10.2046	5.776	4.947	0,01	5,750 % fällig am 25.11.2035	0	0	0,00
2,125 % fällig am 15.02.2040	23.345	23.998	0,03	5,595 % fällig am 25.03.2047	1.209	1.067	0,00	5,750 % fällig am 25.03.2036	102	77	0,00
2,125 % fällig am 15.02.2041	10.537	10.832	0,02	5,660 % fällig am 25.10.2046	10.042	5.987	0,01	5,773 % fällig am 25.05.2037	81	70	0,00
2,375 % fällig am 15.01.2025	46.846	46.483	0,07	5,660 % fällig am 25.12.2046	5.112	4.295	0,01	5,792 % fällig am 20.02.2047	2.978	2.570	0,00
				5,680 % fällig am 25.10.2046	3.947	2.096	0,00	5,846 % fällig am 25.01.2037	184	161	0,00
U.S. Treasury Notes				5,712 % fällig am 25.02.2047	24.416	8.996	0,01	5,852 % fällig am 20.10.2036	7.476	5.602	0,01
0,375 % fällig am 30.09.2027	38.660	33.914	0,05	5,850 % fällig am 25.09.2046	2.220	1.992	0,00	5,852 % fällig am 20.12.2046	2.336	1.915	0,00
0,500 % fällig am 31.10.2027	46.600	40.977	0,06	5,932 % fällig am 25.11.2046	30.571	8.614	0,01	5,892 % fällig am 20.04.2047	765	602	0,00
0,625 % fällig am 30.11.2027	542.910	478.609	0,68	5,952 % fällig am 25.10.2046	4.024	2.741	0,01	5,892 % fällig am 20.05.2047	6.244	5.624	0,01
0,625 % fällig am 31.12.2027	230.260	202.494	0,29	6,050 % fällig am 25.08.2037	1.740	1.540	0,00	5,892 % fällig am 20.06.2047	533	419	0,00
0,750 % fällig am 31.01.2028	199.210	175.667	0,25	6,750 % fällig am 25.11.2046	5.169	4.458	0,				

BESCHREIBUNG	PARI (000\$)	MARKT- WERT (000\$)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000\$)	MARKT- WERT (000\$)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000\$)	MARKT- WERT (000\$)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
3,819 % fällig am 14.07.2037	\$ 8.000	\$ 7.006	0,01	5,790 % fällig am 25.08.2036	\$ 5.483	\$ 4.764	0,01	5,301 % fällig am 25.02.2037	\$ 182	\$ 174	0,00
4,185 % fällig am 15.08.2046	400	314	0,00	5,790 % fällig am 25.11.2036	2.059	1.796	0,00	5,500 % fällig am 25.11.2035	2.001	1.460	0,00
5,883 % fällig am 17.06.2050	200	48	0,00	5,790 % fällig am 25.06.2046	3.011	2.658	0,01	5,697 % fällig am 25.07.2037	146	92	0,00
Banc of America Mortgage Trust				5,790 % fällig am 25.01.2047	1.665	1.359	0,00	6,000 % fällig am 25.05.2036	2.678	1.199	0,00
3,875 % fällig am 25.02.2036	277	225	0,00	5,810 % fällig am 25.08.2036	15.804	14.063	0,02	6,000 % fällig am 25.11.2036	944	395	0,00
3,943 % fällig am 20.10.2046	208	175	0,00	5,810 % fällig am 25.12.2046	5.528	4.840	0,01	6,000 % fällig am 25.05.2037	2.484	1.134	0,00
4,705 % fällig am 25.01.2036	73	60	0,00	5,850 % fällig am 25.05.2036	10.234	8.252	0,01	6,000 % fällig am 25.06.2037	5.774	2.507	0,00
4,994 % fällig am 20.11.2046	147	130	0,00	5,910 % fällig am 25.04.2036	2.677	2.362	0,00	ChaseFlex Trust			
5,033 % fällig am 25.01.2035	598	574	0,00	5,950 % fällig am 25.02.2036	2.741	2.426	0,00	4,414 % fällig am 25.09.2036	569	501	0,00
5,121 % fällig am 25.08.2035	1.290	1.217	0,00	5,970 % fällig am 25.01.2036	4.713	4.331	0,01	5,000 % fällig am 25.07.2037	1.443	478	0,00
5,217 % fällig am 25.07.2035	958	890	0,00	5,990 % fällig am 25.11.2035	10.154	9.252	0,01	6,000 % fällig am 25.02.2035	1.177	976	0,00
5,373 % fällig am 25.09.2035	623	490	0,00	6,010 % fällig am 25.10.2035	2.689	2.510	0,00	6,070 % fällig am 25.07.2037	6.376	5.315	0,01
6,000 % fällig am 25.03.2037	574	466	0,00	6,110 % fällig am 25.04.2034	2	1	0,00	ChaseFlex Trust Multi-Class Mortgage Pass-Through			
6,000 % fällig am 25.05.2037	200	151	0,00	6,145 % fällig am 25.07.2035	1.151	1.134	0,00	Certificates Trust			
6,000 % fällig am 25.07.2046	17	14	0,00	6,170 % fällig am 25.10.2035	212	198	0,00	4,204 % fällig am 25.08.2037	587	462	0,00
Barclays Commercial Mortgage Securities Trust				6,190 % fällig am 25.08.2035	4.254	4.021	0,01	5,930 % fällig am 25.08.2037	5.391	5.089	0,01
3,966 % fällig am 10.08.2033	10.300	9.594	0,01	6,370 % fällig am 25.11.2034	1.015	994	0,00	Chester A PLC			
4,197 % fällig am 10.08.2035	1.300	1.193	0,00	6,445 % fällig am 25.07.2035	1.500	1.365	0,00	0,000 % fällig am 17.03.2046			
7,550 % fällig am 15.07.2037	10.000	9.569	0,01	6,595 % fällig am 25.01.2035	1.557	1.443	0,00	(f)(l)	£ 13.675	16.418	0,02
8,050 % fällig am 15.07.2037	28.583	26.847	0,04	7,120 % fällig am 25.09.2034	1.111	1.075	0,00	0,000 % fällig am 20.05.2046 (l)	1	5.173	0,01
BCAP LLC Trust				Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				6,020 % fällig am 17.03.2046 (l)	41.821	53.351	0,08
0,000 % fällig am 26.08.2036	1.226	484	0,00	5,125 % fällig am 25.03.2034	219	242	0,00	6,470 % fällig am 17.03.2046 (l)	14.727	18.769	0,03
3,662 % fällig am 26.01.2037	3.979	3.503	0,01	5,500 % fällig am 25.08.2035	1.734	1.076	0,00	6,970 % fällig am 17.03.2046 (l)	13.675	17.407	0,03
3,768 % fällig am 26.07.2037	3.320	2.893	0,01	5,500 % fällig am 25.09.2035	153	143	0,00	7,470 % fällig am 17.03.2046 (l)	8.415	10.687	0,02
3,851 % fällig am 26.03.2037	0	0	0,00	5,500 % fällig am 25.12.2035	2.811	1.368	0,00	8,220 % fällig am 17.03.2046 (l)	4.207	5.337	0,01
4,031 % fällig am 26.02.2036	507	505	0,00	5,750 % fällig am 25.11.2034	1.474	1.266	0,00	Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates			
4,344 % fällig am 26.04.2047	2.643	2.423	0,00	5,870 % fällig am 25.10.2034	54	46	0,00	5,411 % fällig am 25.08.2035	\$ 666	522	0,00
4,533 % fällig am 26.03.2037	164	160	0,00	6,500 % fällig am 25.03.2037	1.463	1.250	0,00	5,620 % fällig am 25.01.2036	71	63	0,00
4,549 % fällig am 26.07.2037	561	494	0,00	Bear Stearns Mortgage Funding Trust				5,620 % fällig am 25.01.2036	164	142	0,00
5,250 % fällig am 26.05.2037	2.736	1.338	0,00	5,610 % fällig am 25.03.2037	2.312	1.963	0,00	5,650 % fällig am 25.05.2036	664	595	0,00
5,500 % fällig am 26.02.2036	854	599	0,00	5,630 % fällig am 25.12.2046	8.517	7.107	0,01	5,670 % fällig am 25.01.2036	643	574	0,00
5,750 % fällig am 25.04.2037	1.440	1.311	0,00	5,790 % fällig am 25.06.2047	2.695	2.278	0,00	5,670 % fällig am 25.10.2036	933	851	0,00
5,810 % fällig am 25.01.2037	2.492	2.315	0,00	5,810 % fällig am 25.06.2047	6.478	5.476	0,01	5,700 % fällig am 25.10.2035	650	599	0,00
5,830 % fällig am 25.03.2037	5.838	5.025	0,01	5,850 % fällig am 25.01.2037	9.754	8.865	0,01	5,720 % fällig am 25.08.2035	652	609	0,00
5,850 % fällig am 25.10.2036	50	49	0,00	5,870 % fällig am 25.02.2037	8.576	7.845	0,01	5,740 % fällig am 25.05.2035	551	520	0,00
5,890 % fällig am 25.04.2037	57	51	0,00	5,870 % fällig am 25.09.2047	10.646	9.581	0,01	5,750 % fällig am 25.01.2035	237	223	0,00
5,890 % fällig am 25.05.2047	223	211	0,00	Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust				5,770 % fällig am 25.08.2035	108	99	0,00
5,970 % fällig am 25.02.2047	1.004	881	0,00	3,993 % fällig am 26.12.2046	1.679	1.269	0,00	5,790 % fällig am 25.05.2035	152	140	0,00
6,250 % fällig am 26.08.2036	3.181	1.405	0,00	4,805 % fällig am 26.01.2036	1.424	1.054	0,00	5,830 % fällig am 25.03.2035	147	141	0,00
6,770 % fällig am 25.09.2047	1.031	891	0,00	BellaVista Mortgage Trust				6,050 % fällig am 25.10.2035	309	278	0,00
7,870 % fällig am 25.10.2047	2.376	1.841	0,00	6,191 % fällig am 22.01.2045	411	356	0,00	6,150 % fällig am 25.10.2034	374	344	0,00
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust				BNPP Mortgage Securities LLC Trust				Citigroup Commercial Mortgage Trust			
3,730 % fällig am 25.05.2047	115	88	0,00	6,000 % fällig am 27.08.2037	1.144	399	0,00	0,233 % fällig am 11.03.2047			
3,877 % fällig am 25.05.2047	3.016	2.706	0,01	Braemar Hotels & Resorts Trust				(a)	25.416	1	0,00
3,912 % fällig am 25.07.2036	189	161	0,00	6,354 % fällig am 15.06.2035	315	313	0,00	3,518 % fällig am 10.05.2035	7.410	6.706	0,01
4,125 % fällig am 25.08.2047	1.456	1.258	0,00	Brants Bridge PLC				6,876 % fällig am 15.12.2036	4.150	4.069	0,01
4,134 % fällig am 25.03.2035	0	0	0,00	6,120 % fällig am 14.06.2066	£ 20.476	26.056	0,04	7,526 % fällig am 15.12.2036	6.675	6.505	0,01
4,492 % fällig am 25.10.2046	1.492	1.268	0,00	Bridgegate Funding PLC				8,526 % fällig am 15.12.2036	4.000	3.879	0,01
4,647 % fällig am 25.06.2035	37	34	0,00	7,470 % fällig am 16.10.2062	63.770	81.758	0,12	Citigroup Mortgage Loan Trust			
4,699 % fällig am 25.02.2047	2.286	1.990	0,00	8,220 % fällig am 16.10.2062	44.065	55.960	0,08	3,280 % fällig am 25.02.2037	3.103	2.373	0,00
4,828 % fällig am 25.04.2033	29	28	0,00	9,220 % fällig am 16.10.2062	25.165	32.000	0,05	3,657 % fällig am 25.03.2037	237	207	0,00
4,874 % fällig am 25.06.2035	14	12	0,00	10,220 % fällig am 16.10.2062	18.898	23.960	0,04	3,692 % fällig am 25.08.2047	219	188	0,00
4,954 % fällig am 25.08.2035	611	501	0,00	BWAY Mortgage Trust				3,732 % fällig am 25.03.2037	3.843	3.332	0,01
5,018 % fällig am 25.02.2036	1.973	1.743	0,00	2,917 % fällig am 10.01.2035	\$ 20.818	13.336	0,02	3,813 % fällig am 25.04.2036	713	411	0,00
5,099 % fällig am 25.07.2034	1	1	0,00	BX Trust				4,095 % fällig am 25.03.2036	319	289	0,00
5,224 % fällig am 25.11.2034	2	2	0,00	6,459 % fällig am 15.05.2030	8.100	8.028	0,01	4,145 % fällig am 25.01.2082	25.004	21.370	0,03
5,500 % fällig am 25.08.2033	1	1	0,00	7,629 % fällig am 15.05.2035	662	650	0,00	4,203 % fällig am 25.03.2037	1.240	1.066	0,00
5,566 % fällig am 25.10.2035	421	403	0,00	8,844 % fällig am 15.07.2034	14.854	14.846	0,02	4,261 % fällig am 25.10.2035	73	65	0,00
5,611 % fällig am 25.10.2033	1	1	0,00	9,944 % fällig am 15.07.2034	2.140	2.121	0,00	4,267 % fällig am 25.06.2036	1.106	1.020	0,00
6,340 % fällig am 25.02.2033	1	1	0,00	BXP Trust				4,407 % fällig am 25.09.2064	13.083	11.047	0,02
7,660 % fällig am 25.02.2036	1.003	939	0,00	3,379 % fällig am 13.06.2039	90.000	83.754	0,12	4,504 % fällig am 25.07.2037	1.223	1.068	0,00
8,065 % fällig am 25.12.2046	3.697	3.019	0,01	Canada Square Funding PLC				4,523 % fällig am 25.09.2037	2.134	1.839	0,00
Bear Stearns ALT-A Trust				6,000 % fällig am 17.06.2058	£ 13.459	17.079	0,03	4,751 % fällig am 25.04.2037	1.436	1.232	0,00
3,764 % fällig am 25.05.2036	888	804	0,00	6,070 % fällig am 17.01.2059	2.956	3.746	0,01	4,781 % fällig am 25.11.2036	1.965	1.736	0,00
3,884 % fällig am 25.04.2037	244	177	0,00	6,170 % fällig am 17.06.2058	12.943	16.483	0,02	4,812 % fällig am 25.05.2042	913	833	0,00
4,007 % fällig am 25.01.2047	535	242	0,00	6,470 % fällig am 17.12.2057	10.147	12.980	0,02	4,838 % fällig am 20.02.2036	1.682	1.521	0,00
4,235 % fällig am 25.08.2036	7.328	3.707	0,01	Canterbury Finance PLC				5,033 % fällig am 25.07.2036	127	92	0,00
4,347 % fällig am 25.07.2035	542	466	0,00	6,046 % fällig am 16.05.2058	58.919	74.969	0,11	5,322 % fällig am 25.08.2035	339	282	0,00
4,454 % fällig am 25.09.2035	1.680	654	0,00	Cascade Funding Mortgage Trust				5,500 % fällig am 25.09.2035	867	853	0,00
4,488 % fällig am 25.05.2035	584	553	0,00	4,000 % fällig am 25.10.2068	\$ 8.173	8.181	0,01	5,600 % fällig am 25.06.2036	5.220	4.900	0,01
4,492 % fällig am 25.11.2036	10.098	5.268	0,01	Chase Mortgage Finance Trust				5,663 % fällig am 25.07.2036	1.466	1.112	0,00
4,517 % fällig am 25.08.2046	4.326	3.065	0,01	4,114 % fällig am 25.03.2037	2.836	2.653	0,01	5,737 % fällig am 25.08.2036	10.894	4.564	0,01
4,520 % fällig am 25.09.2047	19.542	11.346	0,02	4,457 % fällig am 25.01.2036	485	440	0,00	5,750 % fällig am 25.11.2035	2.472	1.871	0,00
4,529 % fällig am 25.07.2035	315	226	0,00	4,523 % fällig am 25.07.2037	497	393	0,00	5,790 % fällig am 25.09.2036	297	270	0,00
4,730 % fällig am 25.09.2035	1.481	878	0,00	4,738 % fällig am 25.02.2037	1.177	1.137	0,00	5,970 % fällig am 25.01.2037	3.153	2.666	0,01
4,766 % fällig am 25.09.2035	3.547	1.436	0,00	4,770 % fällig am 25.12.2035	1.729	1.599	0,00	5,956 % fällig am 25.11.2036	487	346	0,00
4,795 % fällig am 25.10.2035	690	581	0,00	4,796 % fällig am 25.12.2035	80	70	0,00	5,970 % fällig am 25.09.2036	3.858	3.508	

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
5,027 % fällig am 25.04.2035	\$ 383	\$ 362	0,00	5,820 % fällig am 25.10.2036	\$ 1.476	\$ 715	0,00	6,570 % fällig am 25.02.2036	\$ 66	\$ 51	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. Mortgage Pass-Through Certificates				5,820 % fällig am 25.11.2036	4.954	4.107	0,01	6,612 % fällig am 25.08.2035	1.784	1.431	0,00
4,150 % fällig am 25.09.2035	1.293	1.145	0,00	5,830 % fällig am 25.09.2046	1.848	1.569	0,00	6,657 % fällig am 25.06.2035	1.926	1.677	0,00
CitiMortgage Alternative Loan Trust				5,830 % fällig am 25.05.2047	280	238	0,00	6,750 % fällig am 25.10.2036	1.411	399	0,00
5,500 % fällig am 25.04.2036	213	185	0,00	5,830 % fällig am 25.06.2047	4.357	3.576	0,01	7,000 % fällig am 25.10.2037	5.565	2.092	0,00
5,750 % fällig am 25.12.2036	1.686	1.448	0,00	5,840 % fällig am 25.02.2037	736	259	0,00	7,500 % fällig am 25.07.2036	1.790	1.235	0,00
5,750 % fällig am 25.02.2037	518	457	0,00	5,850 % fällig am 25.07.2046	1.359	1.340	0,00	Countrywide Asset-Backed Certificates Trust			
5,750 % fällig am 25.03.2037	549	491	0,00	5,850 % fällig am 25.08.2046	14.178	11.867	0,02	5,950 % fällig am 25.04.2036	717	622	0,00
5,750 % fällig am 25.04.2037	3.513	3.201	0,01	5,862 % fällig am 25.11.2046	5.612	4.683	0,01	6,190 % fällig am 25.11.2035	114	108	0,00
5,970 % fällig am 25.05.2037	3.826	3.085	0,01	5,870 % fällig am 25.05.2036	3.454	2.972	0,01	Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust			
6,000 % fällig am 25.07.2036	894	760	0,00	5,870 % fällig am 25.12.2036	3.876	916	0,00	1,616 % fällig am 20.01.2035	27	21	0,00
6,000 % fällig am 25.09.2036	190	167	0,00	5,870 % fällig am 25.04.2037	2.043	711	0,00	1,730 % fällig am 25.05.2036	(a)	333	54
6,000 % fällig am 25.10.2036	201	170	0,00	5,890 % fällig am 25.07.2046	5.333	4.596	0,01	(a)	333	54	0,00
6,000 % fällig am 25.11.2036	3.009	2.721	0,01	5,892 % fällig am 20.03.2046	4.862	3.949	0,01	3,164 % fällig am 25.02.2035	1.904	1.540	0,00
6,000 % fällig am 25.12.2036	1.538	1.245	0,00	5,892 % fällig am 20.05.2046	15.260	12.869	0,02	3,396 % fällig am 25.05.2047	2.347	1.995	0,00
6,000 % fällig am 25.01.2037	4.551	3.702	0,01	5,910 % fällig am 25.09.2047	4.279	3.866	0,01	3,695 % fällig am 25.04.2035	1.677	1.156	0,00
6,000 % fällig am 25.02.2037	1.429	1.165	0,00	5,930 % fällig am 25.03.2036	2.998	2.864	0,01	3,789 % fällig am 25.04.2037	1.508	1.379	0,00
6,000 % fällig am 25.03.2037	2.491	2.078	0,00	5,930 % fällig am 25.11.2036	3.396	2.763	0,01	3,873 % fällig am 20.05.2036	1.082	1.026	0,00
6,000 % fällig am 25.05.2037	396	342	0,00	5,932 % fällig am 20.07.2035	1.554	1.438	0,00	4,001 % fällig am 20.06.2036	1.604	1.395	0,00
6,000 % fällig am 25.06.2037	6.289	5.494	0,01	5,950 % fällig am 25.07.2035	1.274	1.004	0,00	4,039 % fällig am 20.05.2036	1.078	974	0,00
Commercial Mortgage Trust				5,950 % fällig am 25.01.2037	3.124	2.549	0,00	4,042 % fällig am 20.04.2036	1.044	930	0,00
0,000 % fällig am 10.04.2047				5,952 % fällig am 25.06.2046	4.477	3.639	0,01	4,110 % fällig am 20.02.2036	2.191	1.929	0,00
(a)	58.900	1	0,00	5,970 % fällig am 25.07.2036	2.233	1.000	0,00	4,126 % fällig am 20.09.2036	2.059	1.782	0,00
1,303 % fällig am 10.10.2049				5,970 % fällig am 25.09.2036	107	44	0,00	4,152 % fällig am 20.03.2036	361	294	0,00
(a)	66.181	1.663	0,00	5,970 % fällig am 25.05.2037	146	66	0,00	4,225 % fällig am 25.03.2037	128	117	0,00
3,140 % fällig am 10.10.2036	10.000	8.793	0,01	5,970 % fällig am 25.05.2037	1.779	629	0,00	4,290 % fällig am 25.11.2037	1.321	1.228	0,00
3,178 % fällig am 10.02.2035	29.775	28.304	0,04	5,970 % fällig am 25.06.2037	3.356	2.837	0,01	4,294 % fällig am 25.11.2037	1.736	1.541	0,00
3,505 % fällig am 10.08.2048	7.213	7.002	0,01	5,970 % fällig am 25.09.2037	824	331	0,00	4,366 % fällig am 19.01.2034	8	7	0,00
3,611 % fällig am 10.08.2049	13.175	11.965	0,02	5,970 % fällig am 25.07.2046	2.558	2.161	0,00	4,442 % fällig am 20.12.2035	1.510	1.362	0,00
3,651 % fällig am 10.02.2049	13.740	13.312	0,02	5,990 % fällig am 25.07.2035	1.220	1.062	0,00	4,448 % fällig am 20.06.2035	4	3	0,00
3,961 % fällig am 10.05.2051	39.998	37.740	0,05	5,990 % fällig am 25.12.2035	1.010	887	0,00	4,448 % fällig am 20.06.2035	15	14	0,00
6,658 % fällig am 15.09.2033	10.849	9.802	0,02	6,000 % fällig am 25.03.2027	19	18	0,00	4,541 % fällig am 20.02.2036	657	581	0,00
Countrywide Alternative Loan Resecuritization Trust				6,000 % fällig am 25.10.2033	5	5	0,00	4,723 % fällig am 20.09.2035	1.279	1.148	0,00
6,000 % fällig am 25.05.2036	272	156	0,00	6,000 % fällig am 25.11.2034	3.412	3.403	0,01	4,741 % fällig am 20.07.2034	103	94	0,00
6,250 % fällig am 25.08.2037	1.176	584	0,00	6,000 % fällig am 25.12.2034	691	619	0,00	4,765 % fällig am 25.11.2034	32	28	0,00
7,000 % fällig am 25.01.2037	286	59	0,00	6,000 % fällig am 25.02.2035	1.303	1.100	0,00	4,859 % fällig am 25.01.2036	172	159	0,00
Countrywide Alternative Loan Trust				6,000 % fällig am 25.08.2035	53	22	0,00	5,107 % fällig am 20.10.2034	218	198	0,00
1,030 % fällig am 25.09.2037				6,000 % fällig am 25.12.2035	3.752	2.769	0,01	5,308 % fällig am 20.04.2035	110	100	0,00
(a)	824	125	0,00	6,000 % fällig am 25.01.2036	1.960	1.388	0,00	5,377 % fällig am 20.09.2035	73	62	0,00
1,480 % fällig am 25.10.2037				6,000 % fällig am 25.02.2036	1.579	1.369	0,00	5,500 % fällig am 25.05.2035	556	456	0,00
(a)	1.546	261	0,00	6,000 % fällig am 25.03.2036	3.157	1.428	0,00	5,500 % fällig am 25.09.2035	403	362	0,00
3,533 % fällig am 25.05.2035	1.953	1.452	0,00	6,000 % fällig am 25.04.2036	7.886	3.906	0,01	5,500 % fällig am 25.10.2035	863	500	0,00
3,713 % fällig am 25.07.2021	3	3	0,00	6,000 % fällig am 25.05.2036	4.187	1.845	0,00	5,500 % fällig am 25.11.2035	1.741	1.093	0,00
3,810 % fällig am 25.11.2035	6.226	5.787	0,01	6,000 % fällig am 25.08.2036	16.681	11.008	0,02	5,500 % fällig am 25.01.2036	603	386	0,00
3,913 % fällig am 25.03.2047	629	562	0,00	6,000 % fällig am 25.10.2036	4.632	2.562	0,00	5,750 % fällig am 25.12.2035	1.308	650	0,00
4,282 % fällig am 25.03.2047	669	594	0,00	6,000 % fällig am 25.11.2036	8.344	4.871	0,01	5,750 % fällig am 25.02.2037	3.071	1.513	0,00
4,297 % fällig am 25.06.2037	6.211	5.419	0,01	6,000 % fällig am 25.12.2036	2.126	655	0,00	5,750 % fällig am 25.06.2037	1.874	938	0,00
4,394 % fällig am 25.10.2035	162	130	0,00	6,000 % fällig am 25.01.2037	1.236	730	0,00	5,770 % fällig am 25.05.2036	333	114	0,00
4,450 % fällig am 25.04.2036	189	162	0,00	6,000 % fällig am 25.02.2037	10.649	4.266	0,01	5,771 % fällig am 20.12.2035	21	20	0,00
5,000 % fällig am 25.08.2035	2.335	1.613	0,00	6,000 % fällig am 25.03.2037	5.002	1.908	0,00	5,800 % fällig am 25.02.2035	23	19	0,00
5,036 % fällig am 25.09.2034	1.060	1.005	0,00	6,000 % fällig am 25.04.2037	6.753	3.769	0,01	5,850 % fällig am 25.05.2036	260	116	0,00
5,250 % fällig am 25.06.2035	1.351	1.034	0,00	6,000 % fällig am 25.05.2037	10.858	5.068	0,01	5,870 % fällig am 25.08.2035	2.284	1.645	0,00
5,250 % fällig am 25.10.2035	209	146	0,00	6,000 % fällig am 25.07.2037	6.366	3.146	0,01	5,870 % fällig am 25.09.2037	3.974	1.658	0,00
5,500 % fällig am 25.04.2035	2.317	1.937	0,00	6,000 % fällig am 25.08.2037	18.089	9.392	0,01	5,870 % fällig am 25.04.2046	2.222	1.852	0,00
5,500 % fällig am 25.05.2035	5.269	4.127	0,01	6,000 % fällig am 25.02.2047	2.135	1.071	0,00	5,950 % fällig am 25.03.2036	3.194	2.896	0,01
5,500 % fällig am 25.06.2035	4.027	2.813	0,01	6,010 % fällig am 25.01.2036	2.305	2.044	0,00	6,000 % fällig am 25.04.2036	1.098	570	0,00
5,500 % fällig am 25.07.2035	1.831	1.454	0,00	6,010 % fällig am 25.07.2036	2.647	2.274	0,00	6,000 % fällig am 25.05.2036	2.785	1.294	0,00
5,500 % fällig am 25.08.2035	2.756	2.191	0,00	6,012 % fällig am 25.12.2035	946	832	0,00	6,000 % fällig am 25.07.2036	2.444	1.279	0,00
5,500 % fällig am 25.09.2035	6.333	4.385	0,01	6,012 % fällig am 25.02.2036	135	122	0,00	6,000 % fällig am 25.02.2037	4.031	2.061	0,00
5,500 % fällig am 25.10.2035	682	405	0,00	6,030 % fällig am 25.08.2035	2.855	2.609	0,01	6,000 % fällig am 25.03.2037	4.010	1.862	0,00
5,500 % fällig am 25.11.2035	3.275	2.003	0,00	6,030 % fällig am 25.02.2037	4.704	3.792	0,01	6,000 % fällig am 25.04.2037	2.666	1.315	0,00
5,500 % fällig am 25.12.2035	9.825	7.133	0,01	6,030 % fällig am 25.10.2046	7.025	6.416	0,01	6,000 % fällig am 25.05.2037	8.686	3.950	0,01
5,500 % fällig am 25.01.2036	866	616	0,00	6,030 % fällig am 25.08.2047	5.366	4.425	0,01	6,000 % fällig am 25.07.2037	1.112	482	0,00
5,500 % fällig am 25.02.2036	6.090	4.086	0,01	6,050 % fällig am 25.02.2036	1.089	962	0,00	6,000 % fällig am 25.08.2037	3.412	1.526	0,00
5,500 % fällig am 25.04.2036	506	391	0,00	6,070 % fällig am 25.12.2035	1.697	1.279	0,00	6,000 % fällig am 25.10.2037	1.240	880	0,00
5,500 % fällig am 25.04.2037	483	253	0,00	6,070 % fällig am 25.01.2036	1.357	1.191	0,00	6,000 % fällig am 25.01.2038	6.776	3.145	0,01
5,652 % fällig am 20.02.2047	5.098	3.930	0,01	6,070 % fällig am 25.10.2036	630	264	0,00	6,050 % fällig am 25.04.2035	1.064	973	0,00
5,662 % fällig am 20.03.2047	5.900	4.832	0,01	6,072 % fällig am 20.11.2035	1.259	1.145	0,00	6,050 % fällig am 25.04.2035	134	119	0,00
5,667 % fällig am 20.12.2046	8.124	6.990	0,01	6,090 % fällig am 25.08.2035	1.329	1.174	0,00	6,084 % fällig am 25.08.2034	378	343	0,00
5,710 % fällig am 25.06.2036	1.683	1.491	0,00	6,110 % fällig am 25.11.2035	743	593	0,00	6,090 % fällig am 25.03.2035	1.137	965	0,00
5,710 % fällig am 25.12.2046	641	551									

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
5,810 % fällig am 25.06.2035	\$ 42	\$ 40	0,00	Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust	\$ 601	\$ 528	0,00	Formentera Issuer PLC	£ 14.610	\$ 18.453	0,03
5,890 % fällig am 25.07.2036	305	280	0,00	4,448 % fällig am 25.02.2036	366	240	0,00	FWD Securitization Trust			
6,000 % fällig am 25.03.2035	275	264	0,00	4,500 % fällig am 25.10.2035	1.967	1.727	0,00	2,240 % fällig am 25.01.2050	\$ 6.125	5.606	0,01
Countrywide Mortgage-Backed Securities, Inc.				5,500 % fällig am 25.11.2035	664	653	0,00	GC Pastor Hipotecario FTA			
5,945 % fällig am 27.11.2035	222	208	0,00	5,500 % fällig am 25.11.2035	2	1	0,00	4,093 % fällig am 21.06.2046	€ 1.231	1.190	0,00
Countrywide, Inc.				5,500 % fällig am 25.12.2035	629	507	0,00	Glen Securities Finance DAC			
5,693 % fällig am 27.11.2035	0	0	0,00	Deutsche ALT-B Securities Mortgage Loan Trust				6,052 % fällig am 28.10.2038	3.287	3.642	0,01
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.				6,005 % fällig am 25.10.2036	1.240	1.043	0,00	7,052 % fällig am 28.10.2038	2.484	2.719	0,01
4,186 % fällig am 25.06.2046	21.367	20.591	0,03	6,445 % fällig am 25.02.2036	3.524	3.087	0,01	7,852 % fällig am 28.10.2038	1.187	1.282	0,00
5,000 % fällig am 25.07.2035	554	510	0,00	Deutsche ALT-B Securities, Inc. Mortgage Loan Trust				Glenbeigh Issuer DAC			
5,084 % fällig am 25.03.2033	68	65	0,00	4,793 % fällig am 25.06.2036	243	207	0,00	4,666 % fällig am 24.03.2046	18.607	20.549	0,03
5,500 % fällig am 25.07.2035	1.456	1.331	0,00	4,793 % fällig am 25.06.2036	1.829	1.597	0,00	4,666 % fällig am 24.06.2050	6.214	6.860	0,01
6,000 % fällig am 25.12.2035	1.869	835	0,00	Deutsche Mortgage & Asset Receiving Corp.				4,916 % fällig am 24.06.2050	15.867	17.373	0,03
6,500 % fällig am 25.12.2035	426	210	0,00	6,500 % fällig am 27.07.2037	493	383	0,00	5,716 % fällig am 24.03.2046	2.593	2.850	0,01
7,000 % fällig am 25.12.2035	1.296	255	0,00	Deutsche Mortgage Securities, Inc. Mortgage Loan Trust				GMAC Commercial Mortgage Asset Corp.			
7,000 % fällig am 25.01.2036	4.856	761	0,00	6,445 % fällig am 25.06.2034	179	180	0,00	5,456 % fällig am 10.03.2051	\$ 18.032	17.007	0,03
Credit Suisse First Boston Mortgage-Backed Pass-Through Certificates				Deutsche Mortgage Securities, Inc. Re-REMIC Trust Certificates				5,550 % fällig am 10.08.2038	18.640	17.977	0,03
5,553 % fällig am 25.07.2035	2.034	1.902	0,00	4,042 % fällig am 27.06.2037	500	431	0,00	GMAC Mortgage Corp. Loan Trust			
6,053 % fällig am 25.10.2033	5	5	0,00	Dilosk RMBS DAC				3,357 % fällig am 19.04.2036	298	231	0,00
Credit Suisse Mortgage Capital Certificates				4,956 % fällig am 20.10.2062	€ 6.963	7.724	0,01	3,637 % fällig am 18.03.2035	15	12	0,00
2,139 % fällig am 27.02.2046	6.636	3.476	0,01	Domi BV				3,644 % fällig am 19.11.2035	59	48	0,00
3,193 % fällig am 30.11.2037	7.008	6.355	0,01	4,775 % fällig am 15.06.2051	4.154	4.594	0,01	6,750 % fällig am 19.07.2035	145	123	0,00
4,106 % fällig am 27.07.2037	710	680	0,00	Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust				Great Hall Mortgages PLC			
4,337 % fällig am 26.08.2036	4.172	3.634	0,01	5,660 % fällig am 19.10.2036	\$ 5.998	4.954	0,01	4,152 % fällig am 18.03.2039	€ 1.500	1.590	0,00
4,448 % fällig am 27.02.2036	2.475	1.694	0,00	5,670 % fällig am 19.10.2036	3.846	2.634	0,00	4,462 % fällig am 18.06.2039	1.960	1.933	0,00
4,592 % fällig am 27.01.2036	2.887	2.730	0,01	6,050 % fällig am 19.10.2045	3.137	2.656	0,00	5,132 % fällig am 18.06.2039	8.800	8.724	0,01
4,679 % fällig am 26.06.2036	3.256	2.835	0,01	6,210 % fällig am 19.10.2045	2.800	2.585	0,00	5,469 % fällig am 18.03.2039	€ 1.603	2.031	0,00
4,725 % fällig am 27.07.2037	949	886	0,00	6,290 % fällig am 19.09.2044	7	6	0,00	5,479 % fällig am 18.06.2039	68	86	0,00
5,338 % fällig am 27.11.2036	12.945	15.887	0,02	Dutch Property Finance BV				5,489 % fällig am 18.06.2038	800	1.019	0,00
5,620 % fällig am 29.09.2036	246	238	0,00	4,602 % fällig am 28.07.2054	€ 10.259	11.326	0,02	5,639 % fällig am 18.06.2039	2.390	2.936	0,01
5,737 % fällig am 27.10.2036	8.578	6.501	0,01	4,852 % fällig am 28.04.2064	47.025	52.089	0,08	5,812 % fällig am 18.06.2039	\$ 136	135	0,00
5,750 % fällig am 26.12.2035	399	261	0,00	Eurohome UK Mortgages PLC				6,119 % fällig am 18.03.2039	€ 1.710	1.917	0,00
6,000 % fällig am 25.07.2037	793	668	0,00	4,165 % fällig am 15.06.2044	€ 2.735	3.438	0,01	6,589 % fällig am 18.06.2039	2.000	2.274	0,00
12,427 % fällig am 27.11.2037	393	394	0,00	5,689 % fällig am 15.09.2044	2.250	2.749	0,01	GreenPoint Mortgage Funding Trust			
Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust				5,939 % fällig am 15.09.2044	7.250	8.550	0,01	5,870 % fällig am 25.10.2046	\$ 6.678	6.038	0,01
5,500 % fällig am 25.08.2036	1.132	809	0,00	European Loan Conduit DAC				5,890 % fällig am 25.04.2036	286	244	0,00
5,837 % fällig am 25.04.2037	5.208	1.301	0,00	4,994 % fällig am 17.02.2030	€ 64.025	69.805	0,10	5,910 % fällig am 25.06.2045	576	544	0,00
5,942 % fällig am 25.02.2037	1.030	248	0,00	Eurosail PLC				5,990 % fällig am 25.10.2045	2.849	2.790	0,01
6,000 % fällig am 25.10.2021	9	3	0,00	4,165 % fällig am 15.12.2044	575	630	0,00	6,050 % fällig am 25.02.2036	1.397	1.215	0,00
6,000 % fällig am 25.03.2036	4.013	1.737	0,00	4,198 % fällig am 13.03.2045	5.105	5.548	0,01	6,090 % fällig am 25.10.2045	2.381	2.173	0,00
6,396 % fällig am 25.04.2036	268	143	0,00	4,219 % fällig am 10.06.2044	762	839	0,00	Grifonas Finance PLC			
6,421 % fällig am 25.10.2037	4.230	2.590	0,00	4,408 % fällig am 13.03.2045	4.000	3.811	0,01	4,212 % fällig am 28.08.2039	€ 16.670	17.980	0,03
Credit Suisse Mortgage Capital Trust				4,419 % fällig am 10.09.2044	3.200	3.428	0,01	GS Mortgage Securities Corp. Trust			
2,318 % fällig am 25.07.2057	3.499	2.732	0,01	5,489 % fällig am 13.03.2045	€ 873	1.105	0,00	4,591 % fällig am 10.10.2032	\$ 35.288	32.291	0,05
2,443 % fällig am 25.09.2048	12.592	9.990	0,02	5,789 % fällig am 10.09.2044	1.200	1.485	0,00	6,609 % fällig am 15.07.2035	11.979	9.057	0,01
2,500 % fällig am 25.07.2057	55.973	49.643	0,07	6,109 % fällig am 13.09.2045	11.715	14.276	0,02	GS Mortgage Securities Corp. Trust			
2,825 % fällig am 25.12.2048	12.053	10.936	0,02	6,289 % fällig am 13.06.2045	10.707	13.572	0,02	7,473 % fällig am 15.07.2025	12.349	12.069	0,02
3,068 % fällig am 25.02.2056	117.46			6,339 % fällig am 13.06.2045	1.321	1.563	0,00	8,659 % fällig am 15.11.2032	19.350	18.467	0,03
	151.907	7	0,17	Finsbury Square PLC				GSC Capital Corp. Mortgage Trust			
3,142 % fällig am 25.07.2057	52.751	31.142	0,05	6,020 % fällig am 16.12.2071	1.258	1.600	0,00	5,870 % fällig am 25.02.2036	1.428	1.302	0,00
3,260 % fällig am 25.07.2058	268.266	208.595	0,30	First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust				GSMPMS Mortgage Loan Trust			
3,726 % fällig am 25.10.2058	508	431	0,00	4,700 % fällig am 25.09.2035	\$ 153	127	0,00	3,849 % fällig am 25.06.2034	4.012	3.665	0,01
3,896 % fällig am 25.09.2057	1.210	1.016	0,00	5,148 % fällig am 25.02.2037	390	221	0,00	5,820 % fällig am 25.03.2035	5.821	5.126	0,01
4,000 % fällig am 01.08.2057	5.786	5.429	0,01	5,207 % fällig am 25.03.2035	446	268	0,00	5,820 % fällig am 25.09.2035	6.695	5.645	0,01
4,089 % fällig am 25.06.2048	45.151	39.492	0,06	5,249 % fällig am 25.11.2035	1.438	901	0,00	5,870 % fällig am 25.06.2034	1.283	1.132	0,00
4,278 % fällig am 25.09.2057	28.617	24.146	0,04	5,500 % fällig am 25.11.2035	69	35	0,00	7,060 % fällig am 20.10.2032	1.117	998	0,00
4,509 % fällig am 25.04.2058	48.960	44.238	0,06	5,542 % fällig am 25.02.2036	110	82	0,00	GSMSC Resecuritization Trust			
5,852 % fällig am 01.06.2050	93.420	92.681	0,13	5,574 % fällig am 25.01.2037	764	566	0,00	2,167 % fällig am 26.04.2037	9.344	2.463	0,00
6,194 % fällig am 15.07.2032	21.261	20.296	0,03	5,956 % fällig am 25.11.2036	746	520	0,00	4,699 % fällig am 26.08.2036	66	66	0,00
6,444 % fällig am 15.07.2032	22.200	20.983	0,03	6,000 % fällig am 25.05.2036	673	288	0,00	5,637 % fällig am 26.09.2036	7.859	5.033	0,01
7,344 % fällig am 15.07.2032	9.193	8.457	0,01	6,000 % fällig am 25.02.2037	742	303	0,00	GSR Mortgage Loan Trust			
Curzon Mortgages PLC				6,250 % fällig am 25.11.2036	2.047	639	0,00	3,679 % fällig am 25.05.2037	1.288	721	0,00
6,970 % fällig am 28.07.2049	£ 3.253	4.124	0,01	First Horizon Asset Securities, Inc.				3,904 % fällig am 25.04.2036	3.553	2.363	0,00
DBUBS Mortgage Trust				4,846 % fällig am 25.01.2036	28	16	0,00	4,285 % fällig am 25.03.2047	5.583	3.573	0,01
3,452 % fällig am 10.10.2034	\$ 2.000	1.837	0,00	First Horizon Mortgage Pass-Through Trust				4,315 % fällig am 25.05.2037	2.434	2.195	0,00
Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust				4,022 % fällig am 25.11.2036	333	210	0,00	4,630 % fällig am 25.01.2036	725	661	0,00
5,610 % fällig am 25.07.2047	9.040	8.307	0,01	4,510 % fällig am 25.07.2037	234	149	0,00	4,649 % fällig am 25.07.2035	45	41	0,00
5,670 % fällig am 25.08.2047	2.773	2.533	0,00	5,673 % fällig am 25.11.2037	279	216	0,00	5,349 % fällig am 25.10.2035	84	77	0,00
5,710 % fällig am 25.08.2036	477	436	0,00	5,806 % fällig am 25.08.2037	236	79	0,00	5,500 % fällig am 25.09.2034	632	613	0,00
5,730 % fällig am 25.08.2047	5.171	4.577	0,01	5,967 % fällig am 25.09.2035	5	5	0,00	5,500 % fällig am 25.07.2035	425	384	0,00
5,770 % fällig am 25.03.2037	5.742	5.133	0,01	6,000 % fällig am 25.05.2036	173	78	0,00	5,545 % fällig am 25.05.2037	119	101	0,00
5,770 % fällig am 25.09.2047	10.963	9.331	0,01	6,000 % fällig am 25.08.2037	247	101	0,00	5,700 % fällig am 25.05.2037	11.934	5.892	0,01
5,790 % fällig am 25.03.2037	13.345	6.824	0,01	Fondo de Titulacion de Activos UCI				5,750 % fällig am 25.03.2036	226	194	0,00
5,800 % fällig am 25.08.2037	11.824	9.361	0,01	4,082 % fällig am 16.06.2049	€ 9.363	10.086	0,02	5,750 % fällig am 25.05.2037	113	290	0,00
5,830 % fällig am 25.01.2047	1.932	1.707	0,00					5,820 % fällig am 25.0			

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
6,000 % fällig am 25.07.2036	\$ 1.866	1.082	0,00	IndyMac Mortgage Loan Trust				JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust			
6,000 % fällig am 25.07.2037	451	285	0,00	3,088 % fällig am 25.06.2037	\$ 2.949	\$ 2.522	0,00	0,945 % fällig am 15.04.2046			
6,250 % fällig am 25.08.2036	2.170	744	0,00	3,112 % fällig am 25.06.2037	1.731	1.478	0,00	(a)	\$ 813	\$ 0	0,00
6,500 % fällig am 25.05.2036	907	320	0,00	3,278 % fällig am 25.05.2037	1.479	1.159	0,00	2,854 % fällig am 06.09.2038	11.700	10.818	0,02
6,870 % fällig am 25.05.2034	15	12	0,00	3,284 % fällig am 25.07.2037	6.629	5.880	0,01	4,128 % fällig am 05.07.2031	32.860	29.483	0,04
HarborView Mortgage Loan Trust				3,323 % fällig am 25.08.2037	4.623	3.460	0,01	4,248 % fällig am 05.07.2033	10.000	8.806	0,01
4,209 % fällig am 19.07.2035	18	13	0,00	3,342 % fällig am 25.04.2037	3.622	3.216	0,01	4,549 % fällig am 05.07.2033	3.839	3.174	0,01
4,232 % fällig am 19.06.2036	2.105	1.041	0,00	3,355 % fällig am 25.06.2036	5.429	3.490	0,01	4,950 % fällig am 05.07.2033	38.900	30.305	0,04
5,265 % fällig am 19.11.2034	320	291	0,00	3,536 % fällig am 25.03.2037	307	236	0,00	5,337 % fällig am 15.05.2047	999	961	0,00
5,650 % fällig am 19.11.2046	823	567	0,00	3,536 % fällig am 25.04.2037	6.741	6.094	0,01	5,350 % fällig am 05.07.2033	9.940	7.270	0,01
5,660 % fällig am 19.09.2037	8.452	7.184	0,01	3,551 % fällig am 25.03.2036	3.292	2.390	0,00	6,826 % fällig am 15.12.2036	17.100	13.217	0,02
5,720 % fällig am 25.02.2036	147	39	0,00	3,599 % fällig am 25.05.2037	1.954	1.309	0,00	7,026 % fällig am 15.02.2035	2.184	2.147	0,00
5,730 % fällig am 19.03.2037	5.929	5.269	0,01	3,601 % fällig am 25.08.2037	2.700	1.965	0,00	7,485 % fällig am 05.07.2033	10.109	8.446	0,01
5,770 % fällig am 25.01.2047	11.120	9.921	0,02	3,636 % fällig am 25.05.2036	151	132	0,00	JPMorgan Mortgage Trust			
5,780 % fällig am 19.09.2035	8.543	4.523	0,01	3,671 % fällig am 25.08.2036	155	123	0,00	3,750 % fällig am 27.07.2037	424	390	0,00
5,806 % fällig am 19.11.2036	15.416	13.480	0,02	3,674 % fällig am 25.08.2035	60	43	0,00	4,009 % fällig am 25.05.2036	1.252	1.015	0,00
5,810 % fällig am 19.12.2036	494	463	0,00	3,822 % fällig am 25.07.2036	3.340	2.358	0,00	4,032 % fällig am 25.05.2036	37	32	0,00
5,850 % fällig am 19.01.2038	8.131	7.124	0,01	3,916 % fällig am 25.09.2036	81	70	0,00	4,153 % fällig am 25.04.2037	3	2	0,00
5,862 % fällig am 19.12.2036	1.867	1.575	0,00	3,940 % fällig am 25.06.2037	6.191	3.690	0,01	4,189 % fällig am 25.05.2037	1.296	1.125	0,00
5,880 % fällig am 19.12.2036	34.251	27.366	0,04	3,951 % fällig am 25.11.2035	34	24	0,00	4,218 % fällig am 25.04.2036	2.768	2.410	0,00
5,890 % fällig am 19.11.2036	12.709	10.953	0,02	4,010 % fällig am 25.05.2035	51	37	0,00	4,251 % fällig am 25.05.2037	349	302	0,00
5,910 % fällig am 19.05.2035	3.002	2.723	0,01	4,118 % fällig am 25.09.2035	279	188	0,00	4,362 % fällig am 25.01.2037	1.281	1.045	0,00
5,927 % fällig am 19.12.2035	490	465	0,00	4,245 % fällig am 25.01.2037	156	131	0,00	4,396 % fällig am 25.05.2036	2.560	2.247	0,00
5,970 % fällig am 19.01.2036	3.122	1.885	0,00	4,246 % fällig am 25.09.2036	124	107	0,00	4,399 % fällig am 25.08.2036	3.362	2.747	0,01
6,010 % fällig am 19.03.2035	580	569	0,00	4,265 % fällig am 25.12.2035	3.270	2.467	0,00	4,406 % fällig am 25.10.2036	192	140	0,00
6,032 % fällig am 20.10.2045	3.597	2.232	0,00	4,270 % fällig am 25.09.2035	44	38	0,00	4,522 % fällig am 25.08.2036	95	68	0,00
6,070 % fällig am 19.04.2034	58	51	0,00	4,353 % fällig am 25.11.2035	1.413	1.141	0,00	4,688 % fällig am 25.10.2037	2.230	1.806	0,00
6,090 % fällig am 19.11.2035	155	105	0,00	4,435 % fällig am 25.09.2036	1.356	922	0,00	4,769 % fällig am 25.08.2035	182	156	0,00
6,110 % fällig am 19.08.2045	2.360	1.801	0,00	4,598 % fällig am 25.09.2037	11.839	8.783	0,01	4,879 % fällig am 25.11.2035	1.677	1.376	0,00
6,150 % fällig am 19.01.2035	150	141	0,00	4,727 % fällig am 25.08.2034	66	60	0,00	5,057 % fällig am 25.11.2035	3.114	2.552	0,00
6,188 % fällig am 19.07.2045	18	16	0,00	5,630 % fällig am 25.04.2037	921	830	0,00	5,111 % fällig am 25.07.2035	248	223	0,00
6,470 % fällig am 25.10.2037	11.358	10.445	0,02	5,660 % fällig am 25.04.2037	1.550	1.395	0,00	5,168 % fällig am 25.04.2035	293	266	0,00
6,512 % fällig am 19.09.2035	98	83	0,00	5,680 % fällig am 25.02.2046	4.781	3.394	0,01	5,201 % fällig am 25.06.2034	8	8	0,00
6,822 % fällig am 20.06.2035	846	732	0,00	5,680 % fällig am 25.04.2046	2.572	2.117	0,00	5,309 % fällig am 25.08.2035	541	538	0,00
7,010 % fällig am 19.02.2036	1.808	939	0,00	5,690 % fällig am 25.04.2046	2.420	1.992	0,00	5,484 % fällig am 25.09.2035	345	313	0,00
7,012 % fällig am 19.10.2035	6.524	3.708	0,01	5,710 % fällig am 25.07.2036	4.364	4.280	0,01	5,500 % fällig am 25.07.2036	2.870	1.453	0,00
7,012 % fällig am 19.01.2036	951	395	0,00	5,720 % fällig am 25.09.2037	4.137	3.864	0,01	5,750 % fällig am 25.01.2036	983	458	0,00
Harbour Energy PLC				5,730 % fällig am 25.10.2036	2.440	2.170	0,00	5,822 % fällig am 25.08.2035	6	6	0,00
6,020 % fällig am 28.01.2054	£ 18.123	23.105	0,03	5,810 % fällig am 25.01.2037	7.583	6.785	0,01	6,000 % fällig am 25.08.2037	16.928	8.277	0,01
6,120 % fällig am 28.01.2054	21.500	27.226	0,04	5,820 % fällig am 25.06.2036	2.755	2.255	0,00	6,250 % fällig am 25.08.2037	5.078	1.561	0,00
Hilton Orlando Trust				5,830 % fällig am 25.08.2036	7.918	5.508	0,01	6,500 % fällig am 25.01.2035	1.283	1.293	0,00
9,309 % fällig am 15.12.2034	\$ 2.213	2.147	0,00	5,830 % fällig am 25.02.2037	5.565	5.131	0,01	6,500 % fällig am 25.07.2036	227	86	0,00
Hilton USA Trust				5,830 % fällig am 25.07.2047	3.306	2.254	0,00	6,500 % fällig am 25.08.2036	4.328	1.480	0,00
2,828 % fällig am 05.11.2035	9.623	7.733	0,01	5,850 % fällig am 25.10.2036	4.922	2.044	0,00	JPMorgan Resecuritization Trust			
Hipocat FTA				5,870 % fällig am 25.10.2036	5.340	4.142	0,01	4,500 % fällig am 26.04.2037	1.376	650	0,00
4,109 % fällig am 24.10.2039	€ 1.270	1.396	0,00	5,870 % fällig am 25.11.2046	6.084	5.526	0,01	5,250 % fällig am 26.09.2036	241	214	0,00
HomeBanc Mortgage Trust				5,890 % fällig am 25.05.2046	298	270	0,00	5,559 % fällig am 26.09.2037	1.239	913	0,00
3,815 % fällig am 25.04.2037	\$ 464	411	0,00	5,890 % fällig am 25.05.2046	7.102	6.226	0,01	5,750 % fällig am 26.05.2037	127	55	0,00
4,344 % fällig am 25.04.2047	988	884	0,00	5,930 % fällig am 25.04.2035	251	225	0,00	6,000 % fällig am 26.09.2036	500	369	0,00
5,990 % fällig am 25.01.2036	470	445	0,00	5,970 % fällig am 25.11.2036	3.505	3.472	0,01	Jupiter Mortgage PLC			
6,205 % fällig am 25.01.2036	6.736	5.796	0,01	5,990 % fällig am 25.07.2035	5.658	3.709	0,01	6,621 % fällig am 20.07.2060	£ 5.900	7.520	0,01
6,210 % fällig am 25.12.2034	54	50	0,00	6,000 % fällig am 25.07.2037	681	483	0,00	6,921 % fällig am 20.07.2060	4.233	5.392	0,01
Hops Hill PLC				6,000 % fällig am 25.08.2037	943	363	0,00	7,121 % fällig am 20.07.2060	2.250	2.865	0,01
6,148 % fällig am 27.05.2054	£ 24.765	31.587	0,05	6,010 % fällig am 25.10.2036	2.005	840	0,00	Kinbane DAC			
HSI Asset Loan Obligation Trust				6,050 % fällig am 25.01.2036	2.961	2.037	0,00	4,685 % fällig am 25.09.2062	€ 39.396	43.135	0,06
1,160 % fällig am 25.12.2036	\$ 1.489	150	0,00	6,070 % fällig am 25.07.2035	1.058	848	0,00	Kirkby RMBS PLC			
(a)				6,070 % fällig am 25.11.2035	43	26	0,00	0,000 % fällig am 22.02.2045	£ 1	2.341	0,00
5,840 % fällig am 25.12.2036	1.910	442	0,00	6,250 % fällig am 25.12.2034	695	540	0,00	2,250 % fällig am 22.02.2045	4.258	2.967	0,01
Impac CMB Trust				6,270 % fällig am 25.07.2046	4.658	4.062	0,01	6,140 % fällig am 22.02.2045	24.167	30.430	0,04
6,010 % fällig am 25.05.2035	157	144	0,00	6,290 % fällig am 25.11.2034	954	814	0,00	7,340 % fällig am 22.02.2045	13.150	16.007	0,02
6,060 % fällig am 25.10.2034	321	328	0,00	6,330 % fällig am 25.09.2034	41	35	0,00	Landmark Mortgage Securities PLC			
6,100 % fällig am 25.02.2036	1.447	1.151	0,00	6,500 % fällig am 25.07.2037	371	118	0,00	5,539 % fällig am 17.06.2039	7.275	9.024	0,01
6,110 % fällig am 25.11.2034	1.088	1.051	0,00	6,500 % fällig am 25.09.2037	1.786	1.043	0,00	6,140 % fällig am 17.04.2044	8.336	10.078	0,02
6,110 % fällig am 25.03.2035	2.349	2.079	0,00	6,500 % fällig am 25.10.2037	2.709	1.421	0,00	Lanebrook Mortgage Transaction PLC			
6,150 % fällig am 25.01.2035	1.867	1.758	0,00	JPMorgan Alternative Loan Trust				6,320 % fällig am 12.06.2057	11.473	14.662	0,02
Impac Secured Assets CMN Owner Trust				3,930 % fällig am 25.03.2036	648	499	0,00	Lansdowne Mortgage Securities PLC			
5,450 % fällig am 25.03.2033	200	194	0,00	3,930 % fällig am 25.10.2036	4.067	3.505	0,01	4,225 % fällig am 15.06.2045	€ 2.720	2.848	0,01
Impac Secured Assets Corp.				4,127 % fällig am 25.03.2037	895	812	0,00	Legacy Mortgage Asset Trust			
6,110 % fällig am 25.03.2036	1.227	992	0,00	4,412 % fällig am 25.01.2036	342	223	0,00	0,000 % fällig am 25.12.2056			
6,895 % fällig am 25.02.2035	255	255	0,00	5,790 % fällig am 25.07.2036	2.611	2.292	0,00	(a)	\$ 114.375	806	0,00
Impac Secured Assets Trust				5,830 % fällig am 25.05.2036	2.647	2.078	0,00	0,125 % fällig am 26.12.2057			
5,690 % fällig am 25.05.2037	522	421	0,00	5,843 % fällig am 26.05.2037	2.601	1.949	0,00	(a)	66.813	318	0,00
5,870 % fällig am 25.11.2036	159	155	0,00	6,000 % fällig am 27.12.2036	1.085	577	0,00	0,442 % fällig am 26.12.2057			
5,950 % fällig am 25.03.2037	4.078	3.425	0								

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Lehman Mortgage Trust				Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				New Century Home Equity Loan Trust			
5,750 % fällig am 25.01.2037	\$ 299	\$ 175	0,00	0,187 % fällig am 25.01.2029	\$ 461	\$ 2	0,00	3,750 % fällig am 25.08.2055	\$ 4.305	\$ 4.065	0,01
5,970 % fällig am 25.07.2037	319	262	0,00	(a)				New Residential Mortgage Loan Trust			
6,000 % fällig am 25.01.2036	2.406	538	0,00	4,347 % fällig am 25.05.2036	3	3	0,00	4,000 % fällig am 25.04.2057	6.790	6.451	0,01
6,000 % fällig am 25.07.2036	661	340	0,00	5,303 % fällig am 25.11.2035	80	74	0,00	4,500 % fällig am 25.05.2058	15.112	14.637	0,02
6,000 % fällig am 25.12.2036	1.092	891	0,00	5,630 % fällig am 25.12.2035	21	19	0,00	Newgate Funding PLC			
6,370 % fällig am 25.12.2035	592	356	0,00	5,630 % fällig am 25.12.2035	1.699	1.593	0,00	4,138 % fällig am 01.12.2050	€ 4.323	4.612	0,01
Lehman XS Trust				5,808 % fällig am 25.01.2037	30	29	0,00	4,195 % fällig am 01.12.2050	1.245	1.233	0,00
5,710 % fällig am 25.08.2036	50	50	0,00	5,829 % fällig am 25.12.2034	132	124	0,00	4,525 % fällig am 15.12.2050	10.765	11.661	0,02
5,740 % fällig am 25.02.2036	304	269	0,00	5,930 % fällig am 25.04.2029	384	358	0,00	5,500 % fällig am 15.12.2050	€ 8.499	10.412	0,02
5,770 % fällig am 25.11.2035	3.312	3.255	0,01	6,130 % fällig am 25.06.2028	0	0	0,00	5,509 % fällig am 01.12.2050	23.861	29.324	0,04
5,850 % fällig am 25.12.2036	5.442	4.132	0,01	6,130 % fällig am 25.09.2029	11	10	0,00	5,510 % fällig am 01.12.2050	3.198	3.909	0,01
5,850 % fällig am 25.09.2046	118	99	0,00	6,146 % fällig am 25.01.2037	0	0	0,00	6,340 % fällig am 15.12.2050	2.458	3.017	0,01
5,870 % fällig am 25.08.2046	3.924	3.584	0,01	6,190 % fällig am 25.08.2035	2.952	2.798	0,01	6,590 % fällig am 15.12.2050	392	465	0,00
5,870 % fällig am 25.11.2046	725	669	0,00	6,295 % fällig am 25.11.2029	544	471	0,00	Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust			
5,870 % fällig am 25.03.2047	14.220	12.141	0,02	6,415 % fällig am 25.08.2036	1.814	1.610	0,00	4,863 % fällig am 25.06.2036	\$ 262	193	0,00
5,870 % fällig am 25.06.2047	5.393	4.392	0,01	6,485 % fällig am 25.01.2029	35	33	0,00	5,034 % fällig am 25.05.2035	1.571	807	0,00
5,880 % fällig am 25.08.2046	7.888	7.111	0,01	6,606 % fällig am 25.09.2029	95	88	0,00	5,688 % fällig am 25.07.2035	389	371	0,00
5,890 % fällig am 25.11.2046	12.716	11.727	0,02	7,299 % fällig am 25.12.2032	6	6	0,00	5,970 % fällig am 25.06.2037	588	470	0,00
5,910 % fällig am 25.06.2047	5.324	4.732	0,01	Merrill Lynch Mortgage-Backed Securities Trust				5,990 % fällig am 25.12.2035	766	201	0,00
5,970 % fällig am 25.08.2037	2.679	2.471	0,00	7,520 % fällig am 25.08.2036	1.481	1.299	0,00	6,169 % fällig am 25.03.2047	777	695	0,00
5,990 % fällig am 25.02.2046	8.458	7.480	0,01	Metlife Securitization Trust				6,408 % fällig am 25.05.2036	722	141	0,00
6,012 % fällig am 25.11.2035	72	69	0,00	3,750 % fällig am 25.03.2057	4.734	4.525	0,01	6,470 % fällig am 25.05.2035	1.162	910	0,00
6,370 % fällig am 25.08.2047	9.264	7.680	0,01	Miravet SARL				6,490 % fällig am 25.08.2034	290	274	0,00
6,512 % fällig am 25.03.2047	2.797	2.401	0,00	4,706 % fällig am 26.05.2065	€ 3.609	3.950	0,01	6,495 % fällig am 25.03.2047	1.429	1.278	0,00
7,170 % fällig am 25.09.2047	1.371	1.196	0,00	4,806 % fällig am 26.05.2065	32.260	35.346	0,05	7,341 % fällig am 25.02.2036	32	26	0,00
London Wall Mortgage Capital PLC				Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust				Nomura Resecuritization Trust			
6,020 % fällig am 15.05.2052	£ 7.342	9.317	0,01	0,812 % fällig am 15.02.2047				1,634 % fällig am 26.03.2037	2.296	1.893	0,00
Ludgate Funding PLC				(a)	\$ 134	0	0,00	6,370 % fällig am 25.07.2036	19.953	19.076	0,03
4,115 % fällig am 01.01.2061	€ 2.666	2.835	0,01	3,046 % fällig am 15.04.2048	40.000	38.771	0,06	NovaStar Mortgage Funding Trust			
4,195 % fällig am 01.01.2061	730	731	0,00	Morgan Stanley Capital Trust				0,523 % fällig am 25.09.2046	10.181	3.572	0,01
4,265 % fällig am 01.12.2060	1.658	1.603	0,00	6,259 % fällig am 15.08.2033	7.568	6.328	0,01	OBX Trust			
4,265 % fällig am 01.01.2061	2.432	2.414	0,00	7,609 % fällig am 15.07.2035	34.709	33.966	0,05	6,120 % fällig am 25.06.2057	1.670	1.596	0,00
4,655 % fällig am 01.01.2061	10.336	11.001	0,02	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				6,320 % fällig am 25.04.2048	316	315	0,00
5,539 % fällig am 01.12.2060	£ 876	1.077	0,00	2,194 % fällig am 25.06.2037	3.689	1.831	0,00	Paragon Mortgages PLC			
5,649 % fällig am 01.12.2060	2.163	2.425	0,00	3,253 % fällig am 25.11.2037	91	56	0,00	6,270 % fällig am 15.05.2045	£ 3.516	4.488	0,01
5,654 % fällig am 01.01.2061	5.350	6.196	0,01	3,278 % fällig am 25.11.2037	6.447	4.291	0,01	Pepper Residential Securities Trust			
6,014 % fällig am 01.01.2061	3.239	3.991	0,01	4,189 % fällig am 25.10.2037	652	437	0,00	6,380 % fällig am 18.11.2060	\$ 388	388	0,00
Luminent Mortgage Trust				4,521 % fällig am 25.05.2036	1.657	911	0,00	PHH Alternative Mortgage Trust			
5,750 % fällig am 25.01.2037	\$ 2.221	1.823	0,00	4,768 % fällig am 25.03.2036	37	23	0,00	5,790 % fällig am 25.02.2037	4.026	2.977	0,01
5,810 % fällig am 25.12.2036	2.715	2.339	0,00	5,245 % fällig am 25.08.2034	24	22	0,00	5,950 % fällig am 25.05.2037	1.758	1.610	0,00
5,830 % fällig am 25.12.2036	92	84	0,00	5,500 % fällig am 25.10.2037	306	287	0,00	6,170 % fällig am 25.07.2037	823	785	0,00
5,850 % fällig am 25.05.2046	835	688	0,00	5,750 % fällig am 25.02.2036	459	405	0,00	Pierpont BTL PLC			
5,870 % fällig am 25.02.2046	1.728	1.288	0,00	5,790 % fällig am 25.06.2036	3.586	748	0,00	6,320 % fällig am 21.09.2054	£ 9.376	11.980	0,02
Madison Avenue Mortgage Trust				5,810 % fällig am 25.08.2036	5.772	1.464	0,00	Polaris PLC			
3,188 % fällig am 15.08.2034	8.074	7.262	0,01	5,980 % fällig am 25.02.2047	7.126	2.858	0,01	5,985 % fällig am 23.12.2058	2.540	3.231	0,01
Mansard Mortgages PLC				6,000 % fällig am 25.12.2035	2.597	1.045	0,00	7,845 % fällig am 23.05.2059	2.768	3.562	0,01
5,520 % fällig am 15.04.2047	£ 1.837	2.278	0,00	6,000 % fällig am 25.08.2036	3.313	1.843	0,00	Precise Mortgage Funding PLC			
6,589 % fällig am 15.12.2049	2.930	3.637	0,01	6,000 % fällig am 25.10.2037	10.720	5.660	0,01	0,000 % fällig am 12.12.2055			
7,339 % fällig am 15.12.2049	2.604	3.209	0,01	6,354 % fällig am 25.08.2036	1.264	241	0,00	(f)	0	1.337	0,00
MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust				6,500 % fällig am 25.02.2036	100	45	0,00	6,126 % fällig am 16.10.2056	7.470	9.521	0,01
3,227 % fällig am 25.02.2035	\$ 156	126	0,00	6,595 % fällig am 25.09.2035	2.124	2.059	0,00	6,646 % fällig am 16.10.2056	1.200	1.524	0,00
3,597 % fällig am 25.03.2035	467	393	0,00	7,035 % fällig am 25.06.2036	1.028	1.014	0,00	6,896 % fällig am 16.10.2056	1.000	1.270	0,00
3,989 % fällig am 25.03.2035	86	75	0,00	7,195 % fällig am 25.11.2035	1.855	1.796	0,00	7,146 % fällig am 16.10.2056	1.000	1.269	0,00
4,612 % fällig am 25.03.2035	49	39	0,00	7,450 % fällig am 25.09.2035	1.029	1.004	0,00	8,296 % fällig am 16.10.2056	1.000	1.261	0,00
5,412 % fällig am 25.09.2034	805	715	0,00	Morgan Stanley Re-REMIC Trust				Prime Mortgage Trust			
5,862 % fällig am 25.12.2046	8.987	8.153	0,01	3,918 % fällig am 26.12.2036	2.378	2.018	0,00	6,000 % fällig am 25.06.2036	\$ 9	8	0,00
6,570 % fällig am 25.09.2037	7.382	3.239	0,01	Morgan Stanley Resecuritization Trust				Primrose Residential DAC			
7,678 % fällig am 25.12.2035	784	770	0,00	4,080 % fällig am 26.11.2046	2.980	2.506	0,00	4,626 % fällig am 24.03.2061	€ 3.538	3.897	0,01
MASTR Alternative Loan Trust				4,209 % fällig am 26.06.2047	5.501	4.182	0,01	4,876 % fällig am 24.10.2061	29.843	32.781	0,05
5,500 % fällig am 25.04.2035	2.280	2.089	0,00	Mortgage Equity Conversion Asset Trust				Proteus RMBS DAC			
5,750 % fällig am 25.08.2035	1.331	683	0,00	5,290 % fällig am 25.02.2042	3.611	3.531	0,01	0,000 % fällig am 29.10.2054	13.990	11.476	0,02
6,500 % fällig am 25.05.2034	61	59	0,00	Mortgage Funding PLC				(b)(f)			
MASTR Asset Securitization Trust				6,439 % fällig am 13.03.2046	£ 10.212	12.983	0,02	0,000 % fällig am 29.10.2054	200	0	0,00
5,000 % fällig am 25.07.2019	0	0	0,00	MortgageIT Securities Corp. Mortgage Loan Trust				4,852 % fällig am 29.10.2054	37.443	41.511	0,06
6,000 % fällig am 25.06.2036	1.678	979	0,00	5,930 % fällig am 25.06.2047	\$ 7.965	6.567	0,01	5,302 % fällig am 29.10.2054	8.681	9.567	0,01
6,000 % fällig am 25.10.2036	651	532	0,00	5,970 % fällig am 25.09.2037	3.285	2.449	0,00	5,602 % fällig am 29.10.2054	6.313	6.901	0,01
MASTR Reperforming Loan Trust				MortgageIT Trust				6,582 % fällig am 29.10.2054	4.735	5.166	0,01
5,830 % fällig am 25.07.2035	2.936	1.544	0,00	6,030 % fällig am 25.10.2035	121	118	0,00	8,452 % fällig am 29.10.2054	3.946	4.296	0,01
7,000 % fällig am 25.08.2034	10	7	0,00	6,070 % fällig am 25.08.2035	1.526	1.452	0,00	RBSGC Mortgage Loan Trust			
MASTR Seasoned Securitization Trust				6,090 % fällig am 25.12.2035	1.464	1.431	0,00	5,920 % fällig am 25.01.2037	\$ 520	166	0,00
5,870 % fällig am 25.10.2032	126	111	0,00	6,355 % fällig am 25.02.2035	314	294	0,00	RBSGC Structured Trust			
Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust				6,707 % fällig am 25.02.2035	2	2	0,00	5,500 % fällig am 25.11.2035	62	52	0,00
5,916 % fällig am 15.12.2030	2	2	0,00	Mortimer BTL PLC				RBSSP Resecuritization Trust			
5,956 % fällig am 15.06.2030	311	298	0,00	0,000 % fällig am 22.12.2056	£ 38.800	49.588	0,07	3,918 % fällig am 26.12.2036	3.036	2.817	0,01
Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust				MSDB Trust				4,720 % fällig am 26.01.2036	4.706	4.203	0,01
5,870 % fällig am 25.03.2037	625	160	0,00	3,316 % fällig am 11.07.20							

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Residential Accredit Loans, Inc. Trust				6,500 % fällig am 25.04.2037	\$ 9.889	\$ 2.680	0,00	6,721 % fällig am 20.07.2060	£ 9.236	\$ 11.770	0,02
1,080 % fällig am 25.12.2036 (a)	\$ 1.839	\$ 217	0,00	6,500 % fällig am 25.06.2037	6.886	1.575	0,00	7,721 % fällig am 20.07.2060	5.907	7.526	0,01
1,170 % fällig am 25.01.2037 (a)	1.819	194	0,00	6,609 % fällig am 25.02.2037	11.448	2.725	0,01	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust			
1,180 % fällig am 25.12.2036 (a)	738	69	0,00	Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust				4,233 % fällig am 25.10.2036	\$ 1.983	1.773	0,00
1,730 % fällig am 25.12.2036 (a)	1.116	162	0,00	2,450 % fällig am 25.09.2036	68	25	0,00	4,562 % fällig am 25.07.2035	621	529	0,00
4,129 % fällig am 25.02.2035	440	383	0,00	3,847 % fällig am 25.06.2035	251	153	0,00	4,635 % fällig am 25.07.2035	171	90	0,00
4,556 % fällig am 25.08.2035	113	99	0,00	4,003 % fällig am 25.08.2035	37	16	0,00	4,669 % fällig am 25.02.2036	2.883	2.301	0,00
5,045 % fällig am 25.02.2035	419	209	0,00	4,500 % fällig am 25.10.2018	13	5	0,00	4,831 % fällig am 25.11.2035	46	29	0,00
5,065 % fällig am 25.02.2035	800	751	0,00	4,657 % fällig am 25.04.2037	86	72	0,00	4,856 % fällig am 25.11.2037	320	262	0,00
5,500 % fällig am 25.06.2035	852	702	0,00	4,657 % fällig am 25.04.2037	337	274	0,00	4,924 % fällig am 25.08.2036	3.044	2.019	0,00
5,500 % fällig am 25.09.2035	1.327	1.088	0,00	4,742 % fällig am 25.04.2037	118	61	0,00	4,965 % fällig am 25.05.2034	831	608	0,00
5,500 % fällig am 25.02.2036	544	440	0,00	4,878 % fällig am 27.07.2037	377	283	0,00	5,193 % fällig am 25.01.2035	491	454	0,00
5,660 % fällig am 25.07.2037	3.941	3.560	0,01	5,091 % fällig am 25.09.2035	2.326	1.552	0,00	5,193 % fällig am 25.01.2035	198	179	0,00
5,670 % fällig am 25.05.2037	96	87	0,00	5,363 % fällig am 25.08.2036	1.124	794	0,00	5,348 % fällig am 25.11.2037	179	119	0,00
5,720 % fällig am 25.03.2037	1.984	1.417	0,00	6,000 % fällig am 25.06.2036	256	213	0,00	5,770 % fällig am 25.09.2034	297	259	0,00
5,750 % fällig am 25.01.2037	1.463	1.098	0,00	6,000 % fällig am 25.07.2036	185	155	0,00	5,790 % fällig am 25.01.2037	1.802	1.594	0,00
5,770 % fällig am 25.08.2035	141	106	0,00	6,000 % fällig am 25.09.2036	701	519	0,00	5,890 % fällig am 25.10.2035	1.896	1.733	0,00
5,770 % fällig am 25.12.2036	3.427	2.275	0,00	6,250 % fällig am 25.08.2036	1.175	953	0,00	5,910 % fällig am 25.05.2037	755	656	0,00
5,770 % fällig am 25.06.2037	902	836	0,00	Residential Mortgage Securities PLC				5,926 % fällig am 25.09.2034	2	1	0,00
5,770 % fällig am 25.02.2047	1.378	1.197	0,00	6,470 % fällig am 20.06.2070	£ 9.750	12.453	0,02	5,950 % fällig am 25.05.2037	1.383	1.192	0,00
5,790 % fällig am 25.01.2037	4.576	4.012	0,01	7,120 % fällig am 20.06.2070	1.355	1.729	0,00	6,020 % fällig am 25.09.2034	3.943	3.395	0,01
5,791 % fällig am 25.10.2037	4.585	3.873	0,01	RESIMAC Bastille Trust				6,212 % fällig am 25.02.2035	2.495	2.365	0,00
5,810 % fällig am 25.12.2036	2.299	2.272	0,00	5,590 % fällig am 05.09.2057AUD	9.566	6.529	0,01	6,227 % fällig am 25.04.2036	316	265	0,00
5,810 % fällig am 25.01.2037	1.798	1.530	0,00	RESIMAC Premier				6,383 % fällig am 25.01.2035	43	40	0,00
5,814 % fällig am 25.05.2046	69	0	0,00	5,595 % fällig am 07.02.2052	2.646	1.808	0,00	6,445 % fällig am 25.08.2035	1.620	1.417	0,00
5,820 % fällig am 25.12.2036	1.975	1.436	0,00	6,524 % fällig am 07.02.2052	\$ 897	897	0,00	6,798 % fällig am 25.10.2035	86	76	0,00
5,830 % fällig am 25.07.2036	6.678	3.178	0,01	Resloc UK PLC				7,068 % fällig am 25.12.2034	11	11	0,00
5,830 % fällig am 25.01.2037	1.823	1.215	0,00	5,559 % fällig am 15.12.2043	£ 2.235	2.648	0,00	Structured Asset Mortgage Investments Trust			
5,850 % fällig am 25.07.2036	1.187	1.109	0,00	5,578 % fällig am 15.12.2043	\$ 12.331	11.967	0,02	3,743 % fällig am 25.05.2047	2.964	2.367	0,00
5,850 % fällig am 25.09.2036	1.620	1.557	0,00	Ripon Mortgages PLC				3,887 % fällig am 25.01.2037	287	238	0,00
5,850 % fällig am 25.12.2036	1.369	1.180	0,00	5,920 % fällig am 28.08.2056	£ 417.156	530.215	0,75	4,736 % fällig am 27.12.2035	24	24	0,00
5,850 % fällig am 25.05.2047	910	797	0,00	River Green Finance DAC				5,590 % fällig am 25.08.2036	9.130	7.810	0,01
5,870 % fällig am 25.08.2036	136	101	0,00	4,702 % fällig am 22.01.2032	€ 13.186	13.860	0,02	5,590 % fällig am 25.10.2036	3.839	3.313	0,01
5,870 % fällig am 25.05.2037	2.893	2.065	0,00	RiverView HECM Trust				5,640 % fällig am 25.02.2036	1.960	1.605	0,00
5,900 % fällig am 25.05.2046	2.518	2.155	0,00	5,740 % fällig am 25.05.2047	\$ 3.122	2.897	0,01	5,650 % fällig am 25.01.2037	1.975	1.665	0,00
6,000 % fällig am 25.09.2035	1.977	1.649	0,00	RMAC PLC				5,790 % fällig am 25.01.2037	3.074	2.705	0,00
6,000 % fällig am 25.12.2035	1.653	1.437	0,00	0,000 % fällig am 15.02.2047	£ 27.973	35.784	0,05	5,830 % fällig am 25.07.2046	3.773	3.114	0,01
6,000 % fällig am 25.04.2036	971	766	0,00	RMAC Securities PLC				5,830 % fällig am 25.09.2047	185	166	0,00
6,000 % fällig am 25.05.2036	432	341	0,00	4,100 % fällig am 12.06.2044	€ 1.713	1.833	0,00	5,870 % fällig am 25.02.2036	306	243	0,00
6,000 % fällig am 25.06.2036	2.505	1.928	0,00	4,190 % fällig am 12.06.2044	5.527	5.759	0,01	5,890 % fällig am 25.05.2036	2.498	1.682	0,00
6,000 % fällig am 25.07.2036	260	202	0,00	4,220 % fällig am 12.06.2044	1.605	1.677	0,00	5,890 % fällig am 25.09.2047	12.423	10.308	0,02
6,000 % fällig am 25.08.2036	4.784	3.906	0,01	4,420 % fällig am 12.06.2044	5.411	5.572	0,01	5,910 % fällig am 25.05.2036	9.866	7.761	0,01
6,000 % fällig am 25.09.2036	855	645	0,00	5,489 % fällig am 12.06.2044	£ 2.710	3.337	0,01	5,910 % fällig am 25.09.2047	9.091	7.831	0,01
6,000 % fällig am 25.11.2036	175	130	0,00	5,509 % fällig am 12.06.2044	20.094	24.686	0,04	5,930 % fällig am 25.02.2036	1.074	911	0,00
6,000 % fällig am 25.01.2037	3.753	2.905	0,01	5,769 % fällig am 12.06.2044	693	834	0,00	5,930 % fällig am 25.05.2045	54	48	0,00
6,000 % fällig am 25.03.2037	4.794	3.625	0,01	5,827 % fällig am 12.06.2044	\$ 270	261	0,00	5,950 % fällig am 19.04.2035	2	2	0,00
6,000 % fällig am 25.04.2037	333	259	0,00	6,169 % fällig am 12.06.2044	£ 1.325	1.593	0,00	5,970 % fällig am 19.07.2035	32	29	0,00
6,000 % fällig am 25.05.2037	296	228	0,00	Rochester Financing PLC				6,020 % fällig am 25.09.2047	5.030	4.070	0,01
6,000 % fällig am 25.06.2037	425	320	0,00	5,920 % fällig am 18.12.2044	2.048	2.591	0,00	6,030 % fällig am 25.02.2036	75	62	0,00
6,010 % fällig am 25.02.2046	68	40	0,00	Roundstone Securities DAC				6,070 % fällig am 19.07.2034	409	359	0,00
6,010 % fällig am 25.05.2046	2.309	1.804	0,00	0,000 % fällig am 28.09.2055	€ 19.776	20.612	0,03	6,070 % fällig am 25.08.2036	6.369	4.491	0,01
6,012 % fällig am 25.01.2046	157	124	0,00	1,000 % fällig am 28.09.2055	3.941	4.147	0,01	6,170 % fällig am 19.12.2034	91	81	0,00
6,070 % fällig am 25.04.2036	1.929	1.661	0,00	4,516 % fällig am 28.09.2055	97.600	107.774	0,15	6,412 % fällig am 25.12.2035	1.228	982	0,00
6,250 % fällig am 25.01.2037	107	87	0,00	4,666 % fällig am 28.09.2055	15.538	17.135	0,03	6,472 % fällig am 25.03.2046	737	656	0,00
6,250 % fällig am 25.02.2037	2.634	2.040	0,00	4,916 % fällig am 28.09.2055	10.594	11.677	0,02	6,512 % fällig am 25.08.2047	9.043	7.300	0,01
6,288 % fällig am 25.11.2037	420	343	0,00	5,416 % fällig am 28.09.2055	6.356	6.985	0,01	6,595 % fällig am 19.12.2033	322	303	0,00
6,342 % fällig am 25.02.2036	1.833	1.566	0,00	6,166 % fällig am 28.09.2055	10.594	11.622	0,02	Structured Asset Securities Corp.			
6,372 % fällig am 25.09.2045	341	298	0,00	Sequoia Mortgage Trust				5,720 % fällig am 25.07.2035	1.660	1.514	0,00
6,500 % fällig am 25.09.2036	470	217	0,00	3,917 % fällig am 20.07.2037	\$ 1.425	1.050	0,00	5,750 % fällig am 25.01.2036	68	56	0,00
6,500 % fällig am 25.11.2036	226	181	0,00	4,021 % fällig am 20.06.2037	3.258	2.674	0,00	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust			
6,500 % fällig am 25.02.2037	4.498	3.543	0,01	6,112 % fällig am 20.11.2034	617	565	0,00	5,720 % fällig am 25.05.2036	1.900	1.541	0,00
6,512 % fällig am 25.08.2035	1.546	1.266	0,00	6,429 % fällig am 20.02.2034	195	173	0,00	SunTrust Adjustable Rate Mortgage Loan Trust			
6,750 % fällig am 25.06.2037	893	372	0,00	Sestante Finance SRL				4,169 % fällig am 25.06.2037	995	908	0,00
Residential Asset Securitization Trust				4,222 % fällig am 23.07.2046	€ 14.480	14.716	0,02	4,456 % fällig am 25.10.2037	517	445	0,00
5,500 % fällig am 25.08.2034	774	750	0,00	Shamrock Residential DAC				TBW Mortgage-Backed Trust			
5,500 % fällig am 25.09.2035	2.568	1.246	0,00	4,726 % fällig am 24.01.2061	44.094	48.543	0,07	5,500 % fällig am 25.07.2036	10	1	0,00
5,500 % fällig am 25.11.2035	107	53	0,00	4,876 % fällig am 24.06.2071	28.767	31.626	0,05	5,965 % fällig am 25.07.2037	3.607	1.110	0,00
5,750 % fällig am 25.02.2036	1.238	1.156	0,00	5,126 % fällig am 24.02.2071	40.477	44.648	0,06	6,450 % fällig am 25.03.2037	13.097	2.875	0,01
5,780 % fällig am 25.04.2037	4.141	955	0,00	Stratton BTL Mortgage Funding PLC				TDA Mixto Fondo de Titulizacion de Activos			
6,000 % fällig am 25.07.2035	1.311	865	0,00	5,951 % fällig am 20.01.2054	£ 20.580	26.158	0,04	4,096 % fällig am 22.06.2040	€ 5.534	5.657	0,01
6,000 % fällig am 25.02.2036	17.178	7.109	0,01	Stratton Hawksmoor PLC				Temple Quay PLC			
6,000 % fällig am 25.04.2036	2.892	1.345	0,00	6,720 % fällig am 25.02.2053	63.113	79.782	0,11	7,220 % fällig am 24.07.2085	£ 15.905	20.100	0,03
6,000 % fällig am 25.06.2036	3.962	1.682	0,00	6,970 % fällig am 25.02.2053	37.882	47.505	0,07</				

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES	
		MARKT- WERT	NETTO- VERMÖ- GENS			MARKT- WERT	NETTO- VERMÖ- GENS			MARKT- WERT	NETTO- VERMÖ- GENS
5,309 % fällig am 25.07.2036	\$ 1.278	\$ 1.042	0,00	4,544 % fällig am 25.08.2036	\$ 632	\$ 541	0,00	Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust			
6,815 % fällig am 25.06.2037	102	88	0,00	4,544 % fällig am 25.08.2036	169	142	0,00	4,346 % fällig am 25.04.2037	\$ 459	\$ 383	0,00
Towd Point Mortgage Funding PLC				4,549 % fällig am 25.07.2037	3.642	3.042	0,01	4,604 % fällig am 25.03.2036	1.139	1.048	0,00
5,891 % fällig am 20.10.2051	£ 16.600	21.090	0,03	4,853 % fällig am 25.05.2046	42	35	0,00	4,773 % fällig am 25.04.2036	1.633	1.535	0,00
6,271 % fällig am 20.10.2051	13.000	16.419	0,02	4,923 % fällig am 25.12.2035	5.237	4.754	0,01	4,792 % fällig am 25.04.2036	1.231	1.166	0,00
6,365 % fällig am 20.10.2051	4.475	5.710	0,01	4,951 % fällig am 25.07.2034	170	105	0,00	5,742 % fällig am 25.08.2036	938	884	0,00
6,421 % fällig am 20.10.2051	6.118	7.749	0,01	5,240 % fällig am 25.01.2035	1.684	1.527	0,00	5,872 % fällig am 25.10.2036	93	80	0,00
6,570 % fällig am 20.05.2045	46.879	59.851	0,09	5,712 % fällig am 25.02.2047	2.359	1.972	0,00	5,924 % fällig am 25.11.2037	249	216	0,00
6,571 % fällig am 20.07.2045	34.703	44.361	0,06	5,712 % fällig am 25.03.2047	488	404	0,00	5,948 % fällig am 25.10.2036	1.880	1.729	0,00
6,621 % fällig am 20.10.2051	4.000	5.062	0,01	5,762 % fällig am 25.06.2047	11.284	9.081	0,01	5,951 % fällig am 25.08.2035	720	694	0,00
6,690 % fällig am 20.02.2045	12.599	16.025	0,02	5,772 % fällig am 25.04.2047	200	171	0,00	6,000 % fällig am 25.06.2037	739	670	0,00
7,271 % fällig am 20.10.2051	13.500	17.043	0,03	5,782 % fällig am 25.04.2047	1.632	1.326	0,00	6,029 % fällig am 25.10.2037	79	66	0,00
7,721 % fällig am 20.10.2051	4.500	5.670	0,01	5,782 % fällig am 25.05.2047	4.349	3.480	0,01	6,132 % fällig am 25.09.2036	1.040	977	0,00
Towd Point Mortgage Trust				5,810 % fällig am 25.07.2047	1.497	1.243	0,00	6,355 % fällig am 25.12.2036	708	686	0,00
2,750 % fällig am 25.06.2057	\$ 5.305	5.104	0,01	5,822 % fällig am 25.07.2047	11.826	9.407	0,01	Wells Fargo-RBS Commercial Mortgage Trust			
2,750 % fällig am 25.10.2057	8.909	8.561	0,01	5,892 % fällig am 25.10.2046	5.981	4.987	0,01	0,469 % fällig am 15.03.2047			
3,000 % fällig am 25.06.2058	1.792	1.676	0,00	5,930 % fällig am 25.04.2045	7.540	7.316	0,01	(a)	83.200	66	0,00
3,250 % fällig am 25.07.2056	5.700	5.538	0,01	5,932 % fällig am 25.09.2046	2.958	2.582	0,00	0,617 % fällig am 15.03.2047			
3,750 % fällig am 25.04.2055	6.605	6.351	0,01	6,002 % fällig am 25.06.2046	1.640	1.418	0,00	(a)	65.193	3	0,00
3,750 % fällig am 25.10.2056	23.315	22.433	0,03	6,010 % fällig am 25.07.2045	508	476	0,00	Worldwide Plaza Trust			
Tower Bridge Funding PLC				6,012 % fällig am 25.02.2046	2.374	2.084	0,00	3,596 % fällig am 10.11.2036	62.600	14.049	0,02
0,000 % fällig am 20.01.2066				6,060 % fällig am 25.08.2046	2.161	1.749	0,00				
(c)	£ 25.550	32.627	0,05	6,090 % fällig am 25.01.2045	783	758	0,00				
5,940 % fällig am 20.12.2063	2.219	2.814	0,01	6,170 % fällig am 25.12.2045	1.448	1.298	0,00				
6,000 % fällig am 20.11.2063	12.317	15.667	0,02	6,190 % fällig am 25.10.2045	105	98	0,00				
6,320 % fällig am 20.11.2063	1.500	1.900	0,00	6,210 % fällig am 25.01.2045	1.906	1.849	0,00				
Trinity Square PLC				6,262 % fällig am 25.01.2047	4.826	4.271	0,01	FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
6,620 % fällig am 15.07.2059	34.300	43.641	0,06	6,270 % fällig am 25.06.2044	113	103	0,00	Aames Mortgage Investment Trust			
6,920 % fällig am 15.07.2059	12.400	15.758	0,02	6,370 % fällig am 25.10.2045	7.227	6.033	0,01	6,250 % fällig am 25.10.2035	7.983	7.842	0,01
7,220 % fällig am 15.07.2059	9.600	12.156	0,02	6,450 % fällig am 25.10.2045	327	304	0,00	7,495 % fällig am 25.01.2035	1.292	1.215	0,00
7,970 % fällig am 15.07.2059	5.700	7.215	0,01	6,470 % fällig am 25.12.2045	5.473	5.348	0,01	Accredited Mortgage Loan Trust			
Tudor Rose Mortgages				6,490 % fällig am 25.08.2045	3.941	3.707	0,01	5,690 % fällig am 25.02.2037	1.000	950	0,00
5,820 % fällig am 20.06.2048	5.310	6.734	0,01	6,512 % fällig am 25.09.2046	2.225	2.056	0,00	5,730 % fällig am 25.09.2036	4.147	4.092	0,01
Twin Bridges PLC				6,512 % fällig am 25.10.2046	2.013	1.803	0,00	5,740 % fällig am 25.09.2036	12.825	11.980	0,02
6,170 % fällig am 14.06.2055	32.721	41.666	0,06	6,512 % fällig am 25.11.2046	1.765	1.557	0,00	5,740 % fällig am 25.02.2037	8.675	7.366	0,01
6,432 % fällig am 15.05.2056	38.456	49.129	0,07	Warwick Finance Residential Mortgages PLC				5,930 % fällig am 25.12.2035	12.334	9.086	0,01
6,470 % fällig am 12.12.2054	22.507	28.737	0,04	0,000 % fällig am 21.12.2049				6,340 % fällig am 25.09.2035	5.921	5.533	0,01
7,220 % fällig am 12.06.2055	5.819	7.448	0,01	(f)	£ 2	10.270	0,02	6,490 % fällig am 25.07.2035	2.496	2.298	0,00
UBS Commercial Mortgage Trust				6,170 % fällig am 21.12.2049	51.222	65.467	0,09	6,550 % fällig am 25.10.2034	1.591	1.518	0,00
6,259 % fällig am 15.02.2032	\$ 1.737	1.726	0,00	6,239 % fällig am 21.03.2042	2.310	2.950	0,01	Accunia European CLO DAC			
Uropa Securities PLC				6,870 % fällig am 21.12.2049	12.810	16.195	0,02	4,973 % fällig am 20.04.2033	€ 6.100	6.635	0,01
4,183 % fällig am 10.10.2040	€ 5.295	5.641	0,01	7,370 % fällig am 21.12.2049	6.405	8.051	0,01	ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust			
5,690 % fällig am 10.10.2040	£ 6.899	8.004	0,01	7,870 % fällig am 21.12.2049	3.660	4.585	0,01	5,590 % fällig am 25.12.2036	\$ 10.504	5.433	0,01
Verus Securitization Trust				8,370 % fällig am 21.12.2049	3.660	4.507	0,01	5,640 % fällig am 25.11.2036	18.399	7.595	0,01
1,977 % fällig am 25.03.2060	\$ 184	182	0,00	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust				5,650 % fällig am 25.01.2037	1.839	1.101	0,00
3,035 % fällig am 25.03.2060	700	682	0,00	4,052 % fällig am 25.09.2036	\$ 598	191	0,00	5,650 % fällig am 25.02.2037	5.925	2.506	0,00
3,889 % fällig am 25.03.2060	1.000	970	0,00	4,157 % fällig am 25.10.2036	9.500	3.390	0,01	5,710 % fällig am 25.01.2037	8.519	2.076	0,00
Wachovia Mortgage Loan Trust				4,282 % fällig am 25.10.2036	3.920	1.124	0,00	5,730 % fällig am 25.12.2036	1.134	679	0,00
1,823 % fällig am 25.08.2036	1.289	452	0,00	5,500 % fällig am 25.05.2035	2.960	2.385	0,00	5,730 % fällig am 25.12.2036	24.901	13.580	0,02
1,850 % fällig am 25.01.2037	2.054	754	0,00	5,500 % fällig am 25.06.2035	307	237	0,00	5,750 % fällig am 25.07.2036	4.913	4.465	0,01
Wachovia Mortgage Loan Trust LLC				5,500 % fällig am 25.07.2035	954	860	0,00	5,770 % fällig am 25.07.2036	32.514	10.736	0,02
5,373 % fällig am 20.08.2035	131	125	0,00	5,500 % fällig am 25.11.2035	82	71	0,00	5,780 % fällig am 25.08.2036	4.734	4.504	0,01
6,161 % fällig am 20.10.2035	200	189	0,00	5,750 % fällig am 25.01.2036	2.017	1.710	0,00	5,790 % fällig am 25.12.2036	1.641	568	0,00
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				5,750 % fällig am 25.02.2036	125	111	0,00	5,810 % fällig am 25.01.2037	3.715	2.224	0,00
3,224 % fällig am 25.01.2037	756	621	0,00	5,772 % fällig am 25.04.2047	4.121	3.381	0,01	5,840 % fällig am 25.02.2037	5.810	2.457	0,00
3,374 % fällig am 25.01.2037	2.656	2.326	0,00	5,790 % fällig am 25.02.2037	684	521	0,00	5,910 % fällig am 25.12.2036	193	67	0,00
3,461 % fällig am 25.03.2037	956	763	0,00	5,820 % fällig am 25.02.2036	1.268	1.095	0,00	5,910 % fällig am 25.01.2037	10.498	2.510	0,00
3,657 % fällig am 25.02.2037	1.420	1.225	0,00	5,842 % fällig am 25.11.2046	98	80	0,00	5,950 % fällig am 25.04.2036	6.034	5.444	0,01
3,698 % fällig am 25.02.2037	3.675	3.294	0,01	5,850 % fällig am 25.06.2037	391	362	0,00	5,950 % fällig am 25.07.2036	7.133	2.167	0,00
3,787 % fällig am 25.02.2037	7.976	7.252	0,01	5,932 % fällig am 25.09.2046	3.657	2.638	0,00	5,970 % fällig am 25.01.2037	1.134	679	0,00
3,814 % fällig am 25.06.2037	1.436	1.230	0,00	5,952 % fällig am 25.04.2046	3.875	3.016	0,01	6,030 % fällig am 25.06.2037	1.488	1.352	0,00
3,834 % fällig am 25.06.2037	1.265	1.079	0,00	5,952 % fällig am 25.07.2046	5.984	3.652	0,01	6,070 % fällig am 25.02.2036	546	537	0,00
3,858 % fällig am 25.02.2037	1.658	1.447	0,00	5,972 % fällig am 25.08.2046	3.626	1.997	0,00	6,085 % fällig am 25.12.2035	3.889	3.590	0,01
3,880 % fällig am 25.05.2037	1.060	879	0,00	5,990 % fällig am 25.12.2035	2.570	2.139	0,00	6,130 % fällig am 25.11.2035	1.506	1.530	0,00
3,901 % fällig am 25.05.2037	1.356	1.141	0,00	6,000 % fällig am 25.11.2035	2.141	2.049	0,00	6,250 % fällig am 25.04.2034	869	802	0,00
3,910 % fällig am 25.09.2036	109	91	0,00	6,000 % fällig am 25.07.2036	4.200	3.239	0,01	6,370 % fällig am 25.12.2034	3.235	2.930	0,01
3,927 % fällig am 25.04.2035	1.318	1.264	0,00	6,000 % fällig am 25.04.2037	2.095	1.776	0,00	6,370 % fällig am 25.08.2035	3.118	3.023	0,01
4,007 % fällig am 25.06.2037	917	797	0,00	6,262 % fällig am 25.04.2047	16.942	14.105	0,02	6,415 % fällig am 25.05.2035	3.000	2.701	0,00
4,020 % fällig am 25.11.2036	4.305	3.689	0,01	6,500 % fällig am 25.11.2035	3.293	2.191	0,00	6,445 % fällig am 25.11.2033	661	644	0,00
4,063 % fällig am 25.12.2036	673	574	0,00	6,500 % fällig am 25.03.2036	3.148	2.241	0,00	6,490 % fällig am 25.04.2035	1.447	1.408	0,00
4,077 % fällig am 25.03.2035	1.848	1.772	0,00	6,812 % fällig am 25.07.2036	10.686	2.663	0,00	Adagio CLO DAC			
4,106 % fällig am 25.07.2037	4.446	3.849	0,01	6,949 % fällig am 25.07.2036	1.943	484	0,00	4,895 % fällig am 15.04.2032	€ 14.700	16.089	0,02
4,172 % fällig am 25.09.2036	3.871	3.313	0,01	7,000 % fällig am 25.02.2036	2.578	1.8					

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
5,993 % fällig am 23.12.2035 \$	7.979	\$ 7.660	0,01	6,170 % fällig am 25.06.2034 \$	2.840	\$ 2.782	0,00	Blackrock European CLO DAC			
6,013 % fällig am 23.09.2037	2.000	1.540	0,00	6,250 % fällig am 25.11.2033	892	850	0,00	4,815 % fällig am 15.07.2030 €	8.373	\$ 9.193	0,01
6,063 % fällig am 23.12.2036	5.000	3.950	0,01	6,370 % fällig am 25.02.2034	176	174	0,00	BNC Mortgage Loan Trust			
6,363 % fällig am 23.09.2038	6.698	6.095	0,01	Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust				4,291 % fällig am 25.10.2036 \$	5.508	3.892	0,01
Allegro CLO Ltd.				3,008 % fällig am 25.07.2036	480	378	0,00	5,630 % fällig am 25.03.2037	9.646	9.090	0,01
6,755 % fällig am 13.06.2031	30.395	30.390	0,04	3,367 % fällig am 25.03.2036	13	13	0,00	5,720 % fällig am 25.07.2037	9.737	8.394	0,01
Amerquest Mortgage Securities Trust				3,367 % fällig am 25.03.2036	2.345	1.937	0,00	5,780 % fällig am 25.05.2037	5.647	5.128	0,01
5,570 % fällig am 25.10.2036	21.274	6.267	0,01	3,646 % fällig am 25.03.2036	1.062	911	0,00	5,790 % fällig am 25.11.2036	972	933	0,00
5,645 % fällig am 25.10.2036	11.832	6.602	0,01	3,920 % fällig am 25.12.2036	2.017	1.903	0,00	BNPP AM Euro CLO DAC			
5,980 % fällig am 25.04.2036	212	211	0,00	4,120 % fällig am 25.12.2036	3.665	3.297	0,01	4,615 % fällig am 15.10.2031 €	11.671	12.729	0,02
6,025 % fällig am 25.04.2036	6.319	6.062	0,01	5,815 % fällig am 25.11.2036	5.552	5.163	0,01	Bombardier Capital Mortgage Securitization Corp. Trust			
Amerquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				6,280 % fällig am 25.06.2034	776	760	0,00	7,180 % fällig am 15.12.2029 \$	980	110	0,00
3,110 % fällig am 25.06.2033	1.225	1.105	0,00	6,370 % fällig am 25.11.2035	3.597	3.381	0,01	7,440 % fällig am 15.12.2029	10.140	1.181	0,00
4,532 % fällig am 25.11.2034	3.695	3.577	0,01	6,445 % fällig am 25.11.2033	903	918	0,00	7,575 % fällig am 15.06.2030	936	109	0,00
4,635 % fällig am 25.06.2034	1.648	1.538	0,00	6,445 % fällig am 25.10.2034	1.108	1.068	0,00	Bosporus CLO DAC			
4,742 % fällig am 25.07.2034	178	173	0,00	6,445 % fällig am 25.06.2035	2.111	1.818	0,00	4,745 % fällig am 15.12.2030 €	9.321	10.207	0,02
5,184 % fällig am 25.12.2033	277	264	0,00	6,490 % fällig am 25.07.2035	3.159	3.011	0,01	Cairn CLO DAC			
6,050 % fällig am 25.11.2035	5.438	4.953	0,01	7,315 % fällig am 25.05.2035	2.887	2.635	0,00	4,618 % fällig am 31.01.2030	25.338	27.746	0,04
6,145 % fällig am 25.01.2036	7.973	7.797	0,01	Atlas Senior Loan Fund Ltd.				Camber PLC			
6,175 % fällig am 25.01.2036	164	164	0,00	6,805 % fällig am 16.01.2030	14.073	14.054	0,02	5,832 % fällig am 09.11.2053 \$	30.714	3	0,00
6,220 % fällig am 25.01.2036	5.050	4.886	0,01	6,840 % fällig am 24.10.2031	7.456	7.451	0,01	Carbone CLO Ltd.			
6,400 % fällig am 25.05.2035	1.410	1.390	0,00	Atrium CDO Corp.				6,817 % fällig am 20.01.2031	3.833	3.836	0,01
6,430 % fällig am 25.10.2035	5.095	4.667	0,01	6,854 % fällig am 21.11.2030	16.570	16.561	0,02	Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd.			
6,445 % fällig am 25.05.2035	2.000	1.888	0,00	Aurium CLO DAC				6,634 % fällig am 17.04.2031	13.234	13.226	0,02
6,445 % fällig am 25.07.2035	10.140	9.443	0,01	4,635 % fällig am 16.04.2030 €	29.716	32.466	0,05	6,691 % fällig am 15.05.2031	49.906	49.857	0,07
6,445 % fällig am 25.09.2035	5.750	4.594	0,01	4,846 % fällig am 22.06.2034	5.000	5.413	0,01	6,699 % fällig am 27.07.2031	17.416	17.404	0,03
6,490 % fällig am 25.09.2034	221	217	0,00	4,966 % fällig am 23.03.2032	15.500	16.990	0,02	6,795 % fällig am 15.07.2031	22.399	22.373	0,03
6,490 % fällig am 25.01.2035	1.663	1.481	0,00	Auto ABS Spanish Loans				Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC			
6,520 % fällig am 25.05.2035	1.961	1.707	0,00	5,665 % fällig am 28.02.2032	4.881	5.349	0,01	4,925 % fällig am 16.01.2033 €	24.500	26.649	0,04
6,565 % fällig am 25.09.2034	3.520	3.243	0,01	6,365 % fällig am 28.02.2032	7.875	8.582	0,01	Carlyle U.S. CLO Ltd.			
7,030 % fällig am 25.01.2035	1.315	1.088	0,00	Avoca Static CLO DAC				6,835 % fällig am 15.01.2030 \$	8.254	8.254	0,01
7,120 % fällig am 25.11.2034	2.642	2.294	0,00	5,690 % fällig am 15.10.2030	26.900	29.702	0,04	Carrington Mortgage Loan Trust			
7,195 % fällig am 25.08.2035	2.000	1.753	0,00	Bain Capital Euro CLO DAC				5,620 % fällig am 25.04.2036	1.871	1.809	0,00
7,345 % fällig am 25.07.2034	1.221	1.184	0,00	4,733 % fällig am 20.01.2032	4.427	4.830	0,01	5,620 % fällig am 25.08.2036	8.159	7.777	0,01
8,230 % fällig am 25.05.2034	1.323	1.164	0,00	4,773 % fällig am 20.04.2032	58.473	64.132	0,09	5,630 % fällig am 25.10.2036	10.036	9.741	0,01
Anchorage Capital CLO Ltd.				4,865 % fällig am 15.04.2032	10.000	10.906	0,02	5,730 % fällig am 25.02.2037	14.078	12.976	0,02
6,855 % fällig am 15.10.2031	22.500	22.532	0,03	Bastille Euro CLO DAC				6,070 % fällig am 25.01.2036	965	927	0,00
Apidos CLO				5,115 % fällig am 15.01.2034	20.000	21.817	0,03	6,220 % fällig am 25.10.2035	6.824	6.577	0,01
6,735 % fällig am 15.04.2031	7.014	7.012	0,01	Bayview Financial Mortgage Pass-Through Trust				6,235 % fällig am 25.12.2035	2.922	2.177	0,00
6,755 % fällig am 16.07.2031	5.025	5.028	0,01	6,341 % fällig am 28.04.2036 \$	1.229	1.213	0,00	6,265 % fällig am 25.09.2035	2.325	2.260	0,00
6,847 % fällig am 20.10.2031	4.750	4.755	0,01	Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				6,460 % fällig am 25.06.2035	5.260	5.159	0,01
Arbour CLO DAC				4,724 % fällig am 25.07.2036	24	23	0,00	6,520 % fällig am 25.05.2035	3.904	3.759	0,01
4,905 % fällig am 15.03.2033 €	43.600	47.520	0,07	5,031 % fällig am 25.11.2035	1.772	1.723	0,00	CarVal CLO Ltd.			
Ares CLO Ltd.				5,401 % fällig am 25.06.2035	3.349	3.275	0,01	6,815 % fällig am 16.07.2031	33.800	33.841	0,05
6,825 % fällig am 15.10.2030 \$	23.890	23.913	0,03	5,543 % fällig am 25.12.2035	2.334	2.082	0,00	CBAM Ltd.			
Ares European CLO DAC				5,602 % fällig am 25.10.2036	45	45	0,00	6,684 % fällig am 17.04.2031	17.569	17.542	0,03
4,575 % fällig am 15.04.2030 €	1.917	2.101	0,00	5,602 % fällig am 25.10.2036	43	40	0,00	Cedar Funding CLO Ltd.			
4,915 % fällig am 15.01.2036	4.200	4.538	0,01	5,610 % fällig am 25.03.2037	1.976	1.810	0,00	6,657 % fällig am 20.04.2031	13.053	13.057	0,02
5,122 % fällig am 21.10.2033	28.450	31.108	0,04	5,612 % fällig am 25.09.2034	1.336	1.313	0,00	6,677 % fällig am 20.01.2031	26.394	26.369	0,04
Argent Securities Trust				5,612 % fällig am 25.09.2034	91	83	0,00	Centex Home Equity Loan Trust			
5,580 % fällig am 25.09.2036 \$	13.614	4.376	0,01	5,630 % fällig am 25.01.2037	6.036	5.987	0,01	5,950 % fällig am 25.06.2036	1.200	1.166	0,00
5,690 % fällig am 25.05.2036	3.957	966	0,00	5,639 % fällig am 25.08.2034	415	383	0,00	6,060 % fällig am 25.09.2034	666	657	0,00
5,710 % fällig am 25.09.2036	10.669	3.429	0,01	5,653 % fällig am 25.04.2036	1.678	1.668	0,00	6,190 % fällig am 25.01.2035	1.003	997	0,00
5,770 % fällig am 25.06.2036	15.055	9.770	0,01	5,700 % fällig am 25.02.2037	1.500	1.402	0,00	6,220 % fällig am 25.01.2035	1.492	1.453	0,00
5,770 % fällig am 25.07.2036	32.417	28.252	0,04	5,720 % fällig am 25.04.2037	1.414	2.116	0,00	6,385 % fällig am 25.10.2035	2	2	0,00
5,790 % fällig am 25.05.2036	11.345	2.771	0,00	5,750 % fällig am 25.11.2036	457	435	0,00	6,400 % fällig am 25.09.2034	194	188	0,00
5,820 % fällig am 25.04.2036	1.542	859	0,00	5,770 % fällig am 25.06.2047	161	156	0,00	6,430 % fällig am 25.03.2035	2.466	2.370	0,00
5,850 % fällig am 25.03.2036	14.388	10.707	0,02	5,780 % fällig am 25.11.2034	345	343	0,00	Chase Funding Trust			
6,010 % fällig am 25.05.2036	671	164	0,00	5,788 % fällig am 25.01.2035	2.044	2.058	0,00	6,220 % fällig am 25.09.2033	0	0	0,00
Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				5,810 % fällig am 25.05.2035	10	9	0,00	CIFC Funding Ltd.			
5,940 % fällig am 25.01.2036	6.264	6.099	0,01	5,810 % fällig am 25.12.2036	8.263	7.963	0,01	6,640 % fällig am 24.04.2031	7.708	7.710	0,01
5,950 % fällig am 25.05.2035	7.908	6.668	0,01	5,820 % fällig am 25.06.2047	7.641	6.603	0,01	6,710 % fällig am 24.04.2030	9.965	9.944	0,01
6,130 % fällig am 25.11.2035	8.104	7.821	0,01	5,830 % fällig am 25.10.2036	212	206	0,00	6,784 % fällig am 22.01.2031	13.032	13.033	0,02
6,230 % fällig am 25.02.2036	12.434	9.643	0,01	5,920 % fällig am 25.01.2047	2.031	1.960	0,00	6,814 % fällig am 17.10.2031	7.300	7.306	0,01
6,235 % fällig am 25.10.2035	5.750	5.114	0,01	5,970 % fällig am 25.08.2036	4.592	4.154	0,01	6,844 % fällig am 16.11.2030	3.201	3.203	0,01
6,370 % fällig am 25.05.2034	1.674	1.448	0,00	5,970 % fällig am 25.05.2037	2.137	2.048	0,00	6,897 % fällig am 20.07.2030	1.641	1.643	0,00
6,595 % fällig am 25.11.2034	2.287	2.250	0,00	5,990 % fällig am 25.09.2036	1.845	1.688	0,00	CIT Mortgage Loan Trust			
Armada Euro CLO DAC				6,168 % fällig am 25.02.2034	249	250	0,00	6,786 % fällig am 25.10.2037	0	0	0,00
4,762 % fällig am 15.11.2031 €	12.518	13.723	0,02	6,205 % fällig am 25.09.2035	144	143	0,00	6,970 % fällig am 25.10.2037	71.370	70.632	0,10
Asset-Backed Funding Certificates Trust				6,310 % fällig am 25.08.2036	1.300	1.259	0,00	Citigroup Mortgage Loan Trust			
5,600 % fällig am 25.01.2037 \$	480	337	0,00	6,490 % fällig am 25.10.2035	1.618	1.588	0,00	4,254 % fällig am 25.10.2037	1.872	1.801	0,00
5,610 % fällig am 25.10.2036	694	642	0,00	6,500 % fällig am 25.10.2036	2.298	980	0,00	5,540 % fällig am 25.05.2037	1.898	1.239	0,00
5,630 % fällig am 25.01.2037	10.816	6.217	0,01	6,520 % fällig am 25.08.2037	10.162	8.844	0,01	5,610 % fällig am 25.01.2037	9.406	8.601	0,01
5,690 % fällig am 25.10.2036	8.670	7.351	0,01	6,595 % fällig am 25.02.2035	698	695	0,00	5,645 % f			

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
5,760 % fällig am 25.09.2036	\$ 5.677	\$ 5.430	0,01	5,640 % fällig am 25.06.2047	\$ 14.497	\$ 13.705	0,02	Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC			
5,770 % fällig am 25.12.2036	924	369	0,00	5,650 % fällig am 25.06.2047	442	417	0,00	3,072 % fällig am 25.12.2036	\$ 4.086	\$ 3.363	0,01
5,790 % fällig am 25.09.2036	1.386	1.006	0,00	5,650 % fällig am 25.11.2047	1.295	1.440	0,00	3,114 % fällig am 25.05.2036	3.509	2.244	0,00
5,790 % fällig am 25.12.2036	17.399	9.719	0,01	5,660 % fällig am 25.11.2037	7.983	7.399	0,01	3,224 % fällig am 25.12.2036	190	183	0,00
5,870 % fällig am 25.11.2046	4.278	4.141	0,01	5,670 % fällig am 25.06.2047	9.565	8.557	0,01	3,267 % fällig am 25.04.2037	3.211	2.001	0,00
5,890 % fällig am 25.12.2036	3.539	3.453	0,01	5,680 % fällig am 25.05.2047	6.324	5.591	0,01	3,454 % fällig am 25.10.2037	5.575	3.353	0,01
5,890 % fällig am 25.01.2037	2.154	2.106	0,00	5,690 % fällig am 25.06.2037	421	406	0,00	3,580 % fällig am 25.03.2034	312	319	0,00
5,920 % fällig am 25.01.2037	434	405	0,00	5,690 % fällig am 25.08.2037	15.337	13.780	0,02	4,715 % fällig am 25.12.2037	584	648	0,00
5,950 % fällig am 25.08.2036	3.018	2.707	0,00	5,690 % fällig am 25.09.2037	8.563	8.729	0,01	5,770 % fällig am 25.10.2036	2.875	2.374	0,00
5,970 % fällig am 25.08.2036	473	461	0,00	5,690 % fällig am 25.06.2047	21.119	19.744	0,03	8,845 % fällig am 25.01.2033	267	243	0,00
5,990 % fällig am 25.03.2036	3.699	3.328	0,01	5,700 % fällig am 25.07.2037	15.720	13.343	0,02	Credit-Based Asset Servicing & Securitization Mortgage Loan Trust			
6,070 % fällig am 25.12.2035	1.646	1.566	0,00	5,700 % fällig am 25.10.2047	4.059	3.984	0,01	3,319 % fällig am 25.03.2037	107	40	0,00
6,145 % fällig am 25.03.2037	6.005	5.908	0,01	5,720 % fällig am 25.06.2047	11.232	10.748	0,02	3,541 % fällig am 25.02.2037	674	417	0,00
6,352 % fällig am 25.05.2036	1.000	383	0,00	5,730 % fällig am 25.12.2036	6.643	6.038	0,01	Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust			
6,851 % fällig am 25.12.2036	504	193	0,00	5,730 % fällig am 25.04.2046	807	747	0,00	3,201 % fällig am 25.01.2037	10.164	3.164	0,01
7,250 % fällig am 25.05.2036	11.454	5.955	0,01	5,730 % fällig am 25.06.2047	12.311	9.763	0,01	3,400 % fällig am 25.07.2036	2.009	1.849	0,00
7,275 % fällig am 25.10.2036	973	564	0,00	5,750 % fällig am 25.02.2037	499	469	0,00	5,690 % fällig am 25.11.2036	9.593	4.257	0,01
Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates				5,750 % fällig am 25.04.2047	5.562	5.133	0,01	5,770 % fällig am 25.11.2036	1.704	756	0,00
6,475 % fällig am 25.10.2034	3.643	3.254	0,01	5,750 % fällig am 25.04.2047	1.921	1.843	0,00	5,930 % fällig am 25.11.2036	5.407	2.399	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				5,805 % fällig am 25.04.2036	421	372	0,00	5,950 % fällig am 25.10.2036	9.650	6.118	0,01
5,730 % fällig am 25.03.2037	5.392	4.658	0,01	5,905 % fällig am 25.01.2045	2.395	2.173	0,00	CSAB Mortgage-Backed Trust			
5,820 % fällig am 25.03.2037	1.931	1.589	0,00	5,910 % fällig am 25.05.2037	5.772	5.410	0,01	5,858 % fällig am 25.05.2037	5.319	1.288	0,00
5,830 % fällig am 25.11.2034	227	225	0,00	5,930 % fällig am 25.05.2037	11.900	11.020	0,02	5,898 % fällig am 25.05.2037	799	194	0,00
5,905 % fällig am 25.11.2036	3.919	3.848	0,01	5,950 % fällig am 25.02.2037	8.520	8.172	0,01	5,930 % fällig am 25.11.2036	7.833	1.099	0,00
5,920 % fällig am 25.10.2036	2.646	2.629	0,00	5,950 % fällig am 25.03.2037	13.984	12.973	0,02	6,580 % fällig am 25.09.2036	2.103	658	0,00
5,935 % fällig am 25.08.2036	2.105	1.946	0,00	5,950 % fällig am 25.03.2037	6.950	5.775	0,01	Cumulus Static CLO DAC			
5,950 % fällig am 25.11.2036	400	372	0,00	5,970 % fällig am 25.04.2046	4.839	4.649	0,01	5,499 % fällig am 25.04.2033	€ 23.200	25.613	0,04
5,965 % fällig am 25.10.2036	400	386	0,00	5,971 % fällig am 25.09.2046	389	391	0,00	CVC Cordatus Loan Fund DAC			
6,100 % fällig am 25.02.2035	1.872	1.712	0,00	5,989 % fällig am 25.10.2046	43	42	0,00	4,652 % fällig am 21.07.2030	35.517	38.791	0,06
6,145 % fällig am 25.10.2035	1.869	1.814	0,00	5,990 % fällig am 25.09.2046	18.772	17.706	0,03	5,042 % fällig am 20.08.2034	5.000	5.448	0,01
6,205 % fällig am 25.09.2035	2.052	2.026	0,00	5,995 % fällig am 25.08.2036	3.796	3.669	0,01	5,169 % fällig am 23.10.2034	10.598	11.599	0,02
6,250 % fällig am 25.01.2036	584	581	0,00	6,025 % fällig am 25.07.2036	2.908	2.682	0,00	Dryden CLO Ltd.			
7,150 % fällig am 25.07.2035	3.840	3.144	0,01	6,055 % fällig am 25.04.2036	1.000	912	0,00	6,627 % fällig am 18.04.2031	\$ 19.014	18.981	0,03
Clarinda Park CLO DAC				6,055 % fällig am 25.06.2036	4.060	3.905	0,01	6,675 % fällig am 15.04.2031	3.581	3.581	0,01
4,902 % fällig am 15.02.2034	€ 1.750	1.899	0,00	6,070 % fällig am 25.06.2036	736	730	0,00	6,705 % fällig am 15.07.2031	2.268	2.268	0,00
Commonbond Student Loan Trust				6,160 % fällig am 25.04.2036	14.848	14.242	0,02	6,775 % fällig am 15.01.2031	30.800	30.839	0,04
2,550 % fällig am 25.05.2041	\$ 1.782	1.672	0,00	6,170 % fällig am 25.03.2036	5.446	4.751	0,01	Dryden Euro CLO BV			
6,320 % fällig am 25.05.2041	107	105	0,00	6,175 % fällig am 25.09.2035	1.393	1.326	0,00	4,715 % fällig am 15.07.2032	€ 929	1.016	0,00
Conseco Finance Corp.				6,190 % fällig am 25.08.2035	1.794	1.551	0,00	Dryden Euro CLO DAC			
6,560 % fällig am 01.11.2028	552	550	0,00	6,310 % fällig am 25.10.2047	1.040	995	0,00	4,625 % fällig am 15.04.2033	4.079	4.440	0,01
6,920 % fällig am 01.12.2030	1.984	1.986	0,00	6,370 % fällig am 25.02.2036	3.422	3.178	0,01	4,715 % fällig am 15.07.2032	16.718	18.294	0,03
7,060 % fällig am 01.02.2031	1.285	1.144	0,00	6,370 % fällig am 25.05.2036	193	187	0,00	4,752 % fällig am 15.05.2032	9.275	10.102	0,02
7,500 % fällig am 01.03.2030	12.653	4.476	0,01	6,445 % fällig am 25.12.2035	464	459	0,00	4,775 % fällig am 15.01.2032	3.242	3.554	0,01
7,860 % fällig am 01.03.2030	4.673	1.722	0,00	6,445 % fällig am 25.01.2036	5.761	5.595	0,01	4,845 % fällig am 15.04.2034	7.100	7.695	0,01
Conseco Finance Securitizations Corp.				6,460 % fällig am 25.02.2036	4.000	3.490	0,01	4,905 % fällig am 15.01.2034	50.000	54.444	0,08
7,100 % fällig am 01.02.2033	58	58	0,00	6,475 % fällig am 25.10.2035	2.895	2.850	0,00	Dryden Senior Loan Fund			
7,217 % fällig am 01.09.2033	1.493	1.475	0,00	6,535 % fällig am 25.07.2035	1.973	1.957	0,00	6,625 % fällig am 15.04.2031	\$ 20.998	20.975	0,03
7,770 % fällig am 01.09.2031	734	734	0,00	6,535 % fällig am 25.08.2035	1.196	1.194	0,00	ECMC Group Student Loan Trust			
7,970 % fällig am 01.05.2032	1.887	344	0,00	6,535 % fällig am 25.10.2035	7.500	7.093	0,01	6,502 % fällig am 25.05.2067	14.646	14.518	0,02
8,060 % fällig am 01.09.2029	14.402	2.754	0,00	6,550 % fällig am 25.05.2036	13.726	9.983	0,02	Edsouth Indenture LLC			
8,260 % fällig am 01.12.2030	13.372	3.222	0,01	6,565 % fällig am 25.07.2035	137	136	0,00	6,182 % fällig am 25.04.2039	2.452	2.443	0,00
8,310 % fällig am 01.05.2032	20.172	3.832	0,01	6,565 % fällig am 25.04.2036	4.800	4.538	0,01	EFS Volunteer LLC			
Countrywide Asset-Backed Certificates				6,595 % fällig am 25.11.2035	270	264	0,00	6,446 % fällig am 25.10.2035	318	318	0,00
5,750 % fällig am 25.03.2037	2.054	1.947	0,00	6,610 % fällig am 25.01.2036	3.000	2.895	0,00	Elevation CLO Ltd.			
5,950 % fällig am 25.04.2037	719	611	0,00	6,670 % fällig am 25.11.2035	6.987	6.355	0,01	6,775 % fällig am 15.07.2031	14.628	14.629	0,02
5,965 % fällig am 25.03.2037	6.442	5.754	0,01	6,770 % fällig am 25.10.2046	6.897	4.817	0,01	7,505 % fällig am 15.07.2029	18.300	18.336	0,03
5,970 % fällig am 25.01.2046	11.308	10.578	0,02	6,970 % fällig am 25.10.2034	390	385	0,00	Ellington Loan Acquisition Trust			
6,220 % fällig am 25.05.2034	147	143	0,00	6,970 % fällig am 25.10.2047	5.000	3.498	0,01	6,520 % fällig am 25.05.2037	9.477	9.211	0,01
6,370 % fällig am 25.03.2047	1.474	1.127	0,00	7,120 % fällig am 25.06.2035	1.694	1.664	0,00	6,570 % fällig am 25.05.2037	12.053	11.694	0,02
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				7,420 % fällig am 25.08.2035	4.950	4.542	0,01	6,970 % fällig am 25.05.2037	1.474	1.438	0,00
3,508 % fällig am 25.04.2036	2.653	2.398	0,00	7,570 % fällig am 25.08.2035	605	473	0,00	Encore Credit Receivables Trust			
3,934 % fällig am 25.03.2035	7.700	6.513	0,01	7,870 % fällig am 25.10.2034	534	518	0,00	6,205 % fällig am 25.07.2035	1.393	1.263	0,00
3,934 % fällig am 25.04.2035	1.043	1.018	0,00	Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.				6,370 % fällig am 25.01.2036	828	787	0,00
4,306 % fällig am 25.01.2037	6.397	6.192	0,01	5,970 % fällig am 25.10.2034	3.306	3.207	0,01	6,400 % fällig am 25.11.2035	4.103	3.790	0,01
4,330 % fällig am 25.11.2034	7.589	7.351	0,01	6,010 % fällig am 25.12.2034	4.836	4.697	0,01	6,445 % fällig am 25.01.2036	4.142	3.683	0,01
4,347 % fällig am 25.10.2046	10.102	9.818	0,01	6,190 % fällig am 25.07.2034	444	442	0,00	6,490 % fällig am 25.07.2035	2.138	1.881	0,00
4,348 % fällig am 25.12.2034	1.811	1.779	0,00	6,325 % fällig am 25.08.2034	474	476	0,00	EquiFirst Loan Securitization Trust			
4,357 % fällig am 25.01.2035	2.085	1.654	0,00	Countrywide Asset-Backed Certificates, Inc.				5,640 % fällig am 25.04.2037	1.536	1.401	0,00
4,486 % fällig am 25.01.2037	13.000	11.491	0,02	5,171 % fällig am 25.03.2035	4.704	4.606	0,01	EquiFirst Mortgage Loan Trust			
4,512 % fällig am 25.07.2036	4.485	4.041	0,01	6,210 % fällig am 25.08.2047	12.056	11.513	0,02	7,270 % fällig am 25.04.2035	1.091	935	0,00
4,877 % fällig am 25.05.2036	23.145	22.451	0,03	6,220 % fällig am 25.03.2034	2.636	2.618	0,00	8,095 % fällig am 25.12.2034	657	563	0,00
5,115 % fällig am 25.10.2035	1.250	1.102	0,00	6,970 % fällig am 25.02.2035	5.197	5.108	0,01	8,845 % fällig am 25.10.2034	1.104	1.052	0,00
5,348 % fällig am 25.02.2036	6.262	5.260	0,01	7,270 % fällig am 25.02.2035	5.032	4.292	0,01	Equity One Mortgage Pass-Through Trust			
5,505 % fällig am 25.07.2035	2.050	1.966	0,00	Countrywide Asset-Backed Securities Notes Trust				3,882 % fällig am 25.07.2034	114	97	0,00
5,555 % fällig am 25.07.2035	3.535	3.179	0,01	7,470 % fällig am 25.08.2047	52	50	0,00	FAB CBO BV			
5,610 % fällig am 25.06.2035	12.799	11.203	0,02	Countrywide Revolving Home Equity Loan Trust				4,941 % fällig am 20.08.2080	€ 259	282	0,00
5,610 % fällig am 25.											

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Fidelity Grand Harbour CLO DAC				6,130 % fällig am 25.12.2035	\$	1.707	0,00	5,845 % fällig am 25.10.2046			
5,125 % fällig am 15.03.2032	€ 5.196	\$ 5.719	0,01	GE-WMC Mortgage Securities Trust				\$	6.000	\$ 4.908	0,01
Fieldstone Mortgage Investment Trust				5,730 % fällig am 25.08.2036	6.293	5.726	0,01	5,950 % fällig am 25.06.2036	1.998	1.054	0,00
5,697 % fällig am 25.11.2036	\$ 3.232	1.872	0,00	Gilbert Park CLO Ltd.				5,950 % fällig am 25.03.2046	201	195	0,00
5,737 % fällig am 25.11.2036	6.968	6.236	0,01	6,845 % fällig am 15.10.2030	12.744	12.731	0,02	5,990 % fällig am 25.02.2046	736	684	0,00
5,850 % fällig am 25.05.2036	6.655	4.636	0,01	Golden Bar Securitisation SRL				6,010 % fällig am 25.02.2036	552	525	0,00
5,937 % fällig am 25.11.2036	2.584	1.496	0,00	6,816 % fällig am 22.09.2043	€ 14.590	16.333	0,02	6,055 % fällig am 25.01.2036	120	123	0,00
6,115 % fällig am 25.02.2036	9.528	8.419	0,01	7,516 % fällig am 22.09.2043	3.090	3.448	0,01	6,070 % fällig am 25.01.2047	2.983	1.570	0,00
7,495 % fällig am 25.02.2035	816	785	0,00	GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC				6,085 % fällig am 25.01.2036	2.504	2.275	0,00
Finance America Mortgage Loan Trust				4,723 % fällig am 20.10.2030	869	953	0,00	6,115 % fällig am 25.11.2035	4.170	3.735	0,01
6,415 % fällig am 25.11.2034	629	541	0,00	GoldenTree Loan Opportunities Ltd.				6,355 % fällig am 25.07.2045	5.659	5.023	0,01
6,490 % fällig am 25.11.2034	459	359	0,00	6,797 % fällig am 20.07.2031	\$ 1.000	1.001	0,00	6,370 % fällig am 25.11.2035	3.622	3.424	0,01
First Franklin Mortgage Loan Trust				Golub Capital Partners CLO 26B Ltd.				6,445 % fällig am 25.03.2035	1.099	1.023	0,00
4,757 % fällig am 25.03.2036	1.180	1.171	0,00	6,697 % fällig am 20.04.2031	16.298	16.318	0,02	6,445 % fällig am 25.04.2035	1.921	1.783	0,00
5,585 % fällig am 25.07.2036	1.054	1.005	0,00	Goodgreen Trust				6,520 % fällig am 25.06.2034	455	430	0,00
5,590 % fällig am 25.11.2036	6.826	6.359	0,01	3,930 % fällig am 15.10.2053	10.385	9.190	0,01	8,845 % fällig am 25.02.2047	1.500	1.441	0,00
5,590 % fällig am 25.12.2036	7.448	7.010	0,01	Greenwood Park CLO Ltd.				Harvest CLO DAC			
5,630 % fällig am 25.10.2036	4.493	4.410	0,01	6,665 % fällig am 15.04.2031	3.643	3.646	0,01	4,815 % fällig am 15.01.2032			
5,630 % fällig am 25.11.2036	6.524	6.405	0,01	Greystone Commercial Real Estate Notes Ltd.				€	23.100	25.192	0,04
5,670 % fällig am 25.03.2037	4.913	2.369	0,00	6,656 % fällig am 15.09.2037	8.475	8.462	0,01	2,987	3.271	0,01	
5,690 % fällig am 25.12.2037	520	491	0,00	Griffith Park CLO DAC				Hayfin Emerald CLO DAC			
5,750 % fällig am 25.12.2036	13.424	5.484	0,01	4,704 % fällig am 21.11.2031	€ 14.937	16.239	0,02	0,000 % fällig am 25.01.2037 (c)	22.600	24.965	0,04
5,770 % fällig am 25.08.2036	1.061	963	0,00	GSAA Home Equity Trust				5,660 % fällig am 15.04.2035	21.000	23.372	0,03
5,770 % fällig am 25.03.2037	619	300	0,00	5,558 % fällig am 25.05.2035	\$ 290	270	0,00	Hildene TruPS Financials Note Securitization Ltd.			
5,780 % fällig am 25.07.2036	4.053	3.882	0,01	5,570 % fällig am 25.09.2036	4.003	893	0,00	7,028 % fällig am 10.10.2038	\$ 21.856	21.092	0,03
5,780 % fällig am 25.09.2036	5.359	4.986	0,01	5,570 % fällig am 25.12.2046	2.364	1.141	0,00	Home Equity Asset Trust			
5,790 % fällig am 25.04.2036	6.021	5.796	0,01	5,590 % fällig am 25.05.2036	6.521	1.544	0,00	5,770 % fällig am 25.11.2036	1.321	1.278	0,00
5,790 % fällig am 25.06.2036	5.257	5.102	0,01	5,590 % fällig am 25.11.2036	5.010	1.170	0,00	5,950 % fällig am 25.10.2036	3.813	2.292	0,00
5,790 % fällig am 25.12.2037	7.713	6.724	0,01	5,610 % fällig am 25.12.2046	6.901	1.940	0,00	6,070 % fällig am 25.07.2036	3.250	2.964	0,01
5,890 % fällig am 25.12.2037	11.392	9.950	0,01	5,630 % fällig am 25.02.2037	5.981	1.677	0,00	6,130 % fällig am 25.04.2036	2.529	2.305	0,00
5,950 % fällig am 25.08.2036	6.923	6.341	0,01	5,650 % fällig am 25.07.2036	1.323	275	0,00	6,145 % fällig am 25.02.2036	3.197	3.089	0,01
5,950 % fällig am 25.10.2036	13.158	8.536	0,01	5,670 % fällig am 25.03.2037	7.925	2.161	0,00	6,175 % fällig am 25.01.2036	2.658	2.488	0,00
6,070 % fällig am 25.07.2035	1.057	1.041	0,00	5,676 % fällig am 25.09.2035	3.225	2.101	0,00	6,265 % fällig am 25.11.2035	413	399	0,00
6,070 % fällig am 25.02.2036	3.736	3.409	0,01	5,788 % fällig am 25.05.2037	5.797	2.630	0,00	6,310 % fällig am 25.01.2035	729	712	0,00
6,145 % fällig am 25.11.2035	1.222	1.196	0,00	5,790 % fällig am 25.06.2036	4.295	877	0,00	6,325 % fällig am 25.08.2034	88	87	0,00
6,160 % fällig am 25.01.2036	3.122	2.883	0,00	5,810 % fällig am 25.09.2036	5.447	1.221	0,00	6,370 % fällig am 25.12.2034	22	21	0,00
6,190 % fällig am 25.08.2034	848	783	0,00	5,810 % fällig am 25.03.2047	19.284	5.313	0,01	6,415 % fällig am 25.11.2035	523	498	0,00
6,190 % fällig am 25.11.2035	2.424	2.239	0,00	5,830 % fällig am 25.03.2036	11.367	3.815	0,01	6,415 % fällig am 25.12.2035	620	575	0,00
6,220 % fällig am 25.12.2035	3.866	3.721	0,01	5,830 % fällig am 25.12.2036	13.040	3.507	0,01	6,715 % fällig am 25.05.2035	1.048	999	0,00
6,280 % fällig am 25.10.2035	3.347	3.609	0,01	5,850 % fällig am 25.03.2036	8.195	2.901	0,00	6,970 % fällig am 25.03.2035	867	818	0,00
6,295 % fällig am 25.06.2034	193	192	0,00	5,917 % fällig am 25.03.2037	2.302	459	0,00	7,120 % fällig am 25.12.2034	575	560	0,00
6,415 % fällig am 25.03.2035	652	641	0,00	5,950 % fällig am 25.11.2036	7.312	2.395	0,00	7,170 % fällig am 25.11.2034	608	596	0,00
6,415 % fällig am 25.09.2035	4.052	3.588	0,01	5,970 % fällig am 25.12.2035	4.051	2.279	0,00	7,220 % fällig am 25.11.2034	297	288	0,00
6,745 % fällig am 25.07.2034	1.581	1.551	0,00	6,000 % fällig am 25.10.2037	87	69	0,00	Home Equity Loan Trust			
6,895 % fällig am 25.10.2034	364	364	0,00	6,032 % fällig am 25.05.2037	4.519	2.049	0,00	5,700 % fällig am 25.04.2037	387	374	0,00
7,270 % fällig am 25.09.2034	1.708	1.732	0,00	6,070 % fällig am 25.03.2036	3.264	1.750	0,00	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust			
First NLC Trust				6,070 % fällig am 25.03.2037	180	70	0,00	5,590 % fällig am 25.04.2037	5.561	3.830	0,01
5,540 % fällig am 25.08.2037	6.075	3.018	0,01	6,070 % fällig am 25.05.2047	107	65	0,00	5,610 % fällig am 25.11.2036	5.059	4.622	0,01
5,610 % fällig am 25.08.2037	183	91	0,00	6,190 % fällig am 25.10.2035	2.105	1.921	0,00	5,630 % fällig am 25.11.2036	3.481	3.046	0,01
5,650 % fällig am 25.08.2037	3.295	1.638	0,00	6,205 % fällig am 25.06.2035	2.019	1.944	0,00	5,640 % fällig am 25.04.2037	9.848	6.784	0,01
5,750 % fällig am 25.08.2037	46	23	0,00	6,230 % fällig am 25.01.2036	465	38	0,00	5,660 % fällig am 25.04.2037	9.270	5.994	0,01
6,205 % fällig am 25.02.2036	4.467	3.727	0,01	6,300 % fällig am 25.03.2037	5.586	1.337	0,00	5,660 % fällig am 25.07.2037	7.811	3.150	0,01
Fremont Home Loan Trust				6,376 % fällig am 25.09.2036	698	184	0,00	5,670 % fällig am 25.07.2037	9.099	4.919	0,01
5,600 % fällig am 25.11.2036	5.198	1.801	0,00	6,415 % fällig am 25.08.2035	2.004	1.811	0,00	5,680 % fällig am 25.04.2037	1.197	825	0,00
5,605 % fällig am 25.10.2036	11.389	10.001	0,02	6,459 % fällig am 25.09.2036	4.674	1.232	0,00	5,710 % fällig am 25.11.2036	602	465	0,00
5,610 % fällig am 25.01.2037	20.977	10.339	0,02	6,483 % fällig am 25.03.2037	5.207	1.558	0,00	5,710 % fällig am 25.04.2037	10.086	6.523	0,01
5,620 % fällig am 25.10.2036	12.368	4.996	0,01	6,500 % fällig am 25.10.2037	1.122	635	0,00	5,830 % fällig am 25.06.2036	2.682	2.497	0,00
5,670 % fällig am 25.08.2036	6.641	2.137	0,00	6,599 % fällig am 25.03.2037	2.068	493	0,00	5,850 % fällig am 25.06.2036	38	37	0,00
5,690 % fällig am 25.11.2036	6.564	2.275	0,00	GSAMP Trust				5,950 % fällig am 25.08.2036	4.884	4.334	0,01
5,750 % fällig am 25.02.2037	12.646	9.682	0,01	3,689 % fällig am 25.11.2034	1.219	1.145	0,00	6,130 % fällig am 25.03.2036	4.756	4.334	0,01
5,790 % fällig am 25.05.2036	7.695	4.490	0,01	5,520 % fällig am 25.12.2046	299	148	0,00	6,535 % fällig am 25.08.2035	1.800	1.724	0,00
5,810 % fällig am 25.02.2036	3.751	3.555	0,01	5,570 % fällig am 25.12.2046	1.343	666	0,00	6,715 % fällig am 25.03.2035	2.748	2.675	0,00
6,010 % fällig am 25.02.2036	300	255	0,00	5,590 % fällig am 25.12.2036	4.869	2.297	0,00	HSI Asset Securitization Corp. Trust			
6,085 % fällig am 25.11.2035	5.829	5.111	0,01	5,600 % fällig am 25.12.2046	5.153	2.756	0,00	5,620 % fällig am 25.12.2036	2.456	2.197	0,00
6,130 % fällig am 25.01.2036	1.242	1.174	0,00	5,610 % fällig am 25.11.2036	4.786	2.307	0,00	5,660 % fällig am 25.01.2037	12.954	9.015	0,01
6,145 % fällig am 25.01.2036	6.546	4.996	0,01	5,610 % fällig am 25.03.2047	6.201	5.565	0,01	5,690 % fällig am 25.12.2036	15.535	6.666	0,01
6,150 % fällig am 25.11.2035	188	185	0,00	5,620 % fällig am 25.12.2046	453	225	0,00	5,730 % fällig am 25.04.2037	11.604	5.979	0,01
6,180 % fällig am 25.06.2035	4.251	4.077	0,01	5,630 % fällig am 25.08.2036	2.171	1.692	0,00	5,790 % fällig am 25.10.2036	18.299	7.400	0,01
6,220 % fällig am 25.06.2035	1.036	1.007	0,00	5,630 % fällig am 25.01.2037	15.080	8.695	0,01	5,845 % fällig am 25.05.2037	4.026	3.886	0,01
6,250 % fällig am 25.07.2035	1.909	1.780	0,00	5,640 % fällig am 25.12.2036	7.127	3.363	0,01	5,910 % fällig am 25.12.2036	17.556	4.651	0,01
6,340 % fällig am 25.05.2034	865	815	0,00	5,640 % fällig am 25.01.2037	4.461	4.323	0,01	5,995 % fällig am 25.02.2036	3.065	2.534	0,00
6,400 % fällig am 25.07.2035	2.103	1.616	0,00	5,670 % fällig am 25.11.2036	1.168	555	0,00	6,010 % fällig am 25.12.2035	147	146	0,00
6,490 % fällig am 25.01.											

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Invesco Euro CLO DAC				5,670 % fällig am 25.07.2036	\$ 6.237	\$ 2.443	0,00	Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust			
4,905 % fällig am 15.07.2034	€ 40.000	\$ 43.417	0,06	5,690 % fällig am 25.11.2036	322	100	0,00	5,750 % fällig am 25.04.2037	\$ 641	\$ 275	0,00
IXIS Real Estate Capital Trust				5,710 % fällig am 25.08.2036	19.089	7.577	0,01	5,830 % fällig am 25.06.2037	653	501	0,00
5,530 % fällig am 25.05.2037	\$ 21.093	5.019	0,01	5,760 % fällig am 25.07.2036	4.828	3.371	0,01	6,150 % fällig am 25.04.2037	11.592	4.616	0,01
5,770 % fällig am 25.01.2037	13.908	4.973	0,01	5,770 % fällig am 25.05.2036	9.433	5.083	0,01	6,470 % fällig am 25.10.2037	6.790	5.620	0,01
5,790 % fällig am 25.08.2036	3.182	904	0,00	5,770 % fällig am 25.07.2036	2.425	955	0,00	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust			
5,870 % fällig am 25.03.2036	1.389	723	0,00	5,770 % fällig am 25.09.2036	849	543	0,00	4,330 % fällig am 25.11.2037	7.806	3.858	0,01
Jamestown CLO Ltd.				5,770 % fällig am 25.11.2036	14.756	10.578	0,02	4,471 % fällig am 25.11.2037	3.494	1.219	0,00
6,790 % fällig am 25.04.2030	23.593	23.559	0,03	5,790 % fällig am 25.05.2036	11.064	3.308	0,01	5,690 % fällig am 25.07.2037	6.005	2.615	0,00
JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.				5,790 % fällig am 25.08.2036	2.425	965	0,00	5,710 % fällig am 25.02.2037	3.920	1.178	0,00
3,110 % fällig am 25.10.2035	4.669	4.078	0,01	5,790 % fällig am 25.09.2036	10.357	2.888	0,00	5,750 % fällig am 25.05.2037	5.084	2.592	0,00
5,980 % fällig am 25.02.2036	2.289	2.243	0,00	5,790 % fällig am 25.10.2036	28.477	9.024	0,01	5,770 % fällig am 25.06.2037	3.559	883	0,00
6,010 % fällig am 25.02.2036	2.711	2.331	0,00	5,790 % fällig am 25.12.2036	22.530	15.386	0,02	5,770 % fällig am 25.08.2037	13.899	9.479	0,01
6,010 % fällig am 25.03.2036	6.003	5.746	0,01	5,790 % fällig am 25.05.2046	11.920	11.069	0,02	5,790 % fällig am 25.03.2037	10.088	9.003	0,01
6,055 % fällig am 25.05.2035	1.041	1.022	0,00	5,810 % fällig am 25.12.2036	84	30	0,00	5,790 % fällig am 25.07.2037	2.892	1.644	0,00
6,100 % fällig am 25.05.2035	5.614	5.199	0,01	5,830 % fällig am 25.03.2046	19.060	15.271	0,02	5,850 % fällig am 25.04.2047	6.197	2.525	0,00
6,175 % fällig am 25.09.2035	181	179	0,00	5,850 % fällig am 25.03.2046	2.677	965	0,00	5,970 % fällig am 25.07.2037	3.435	822	0,00
6,220 % fällig am 25.06.2035	4.027	3.908	0,01	5,930 % fällig am 25.12.2036	1.398	501	0,00	5,990 % fällig am 25.03.2037	2.607	725	0,00
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust				5,950 % fällig am 25.08.2036	2.989	1.196	0,00	5,990 % fällig am 25.07.2037	5.245	2.323	0,00
4,258 % fällig am 25.07.2036	1.786	1.745	0,00	5,990 % fällig am 25.08.2045	523	507	0,00	6,070 % fällig am 25.12.2036	2.993	2.254	0,00
4,433 % fällig am 25.11.2036	4.112	3.702	0,01	6,030 % fällig am 25.10.2034	4.508	4.311	0,01	6,070 % fällig am 25.01.2037	5.003	4.556	0,01
4,470 % fällig am 25.01.2037	2.176	1.151	0,00	6,070 % fällig am 25.01.2036	13.493	12.200	0,02	6,370 % fällig am 25.02.2047	206	122	0,00
4,724 % fällig am 25.11.2036	6.434	6.495	0,01	6,070 % fällig am 25.02.2036	11.683	9.365	0,01	6,400 % fällig am 25.07.2035	2.945	2.921	0,00
5,550 % fällig am 25.12.2036	3.007	1.599	0,00	6,250 % fällig am 25.08.2035	6.618	6.468	0,01	6,475 % fällig am 25.06.2036	3.274	2.546	0,00
5,620 % fällig am 25.12.2036	5.493	2.942	0,01	6,265 % fällig am 25.06.2034	2.065	2.030	0,00	6,550 % fällig am 25.10.2035	114	114	0,00
5,650 % fällig am 25.07.2036	500	211	0,00	6,520 % fällig am 25.06.2035	4.897	4.724	0,01	6,595 % fällig am 25.08.2036	1.330	1.357	0,00
5,660 % fällig am 25.03.2047	1.020	1.013	0,00	6,595 % fällig am 25.04.2035	2.500	2.377	0,00	METAL Cayman Ltd.			
5,680 % fällig am 25.10.2036	3.096	3.042	0,01	6,620 % fällig am 25.09.2034	1.014	1.017	0,00	4,581 % fällig am 15.10.2042	24.392	15.123	0,02
5,680 % fällig am 25.12.2036	5.495	2.957	0,01	6,895 % fällig am 25.02.2035	6.008	5.551	0,01	MKS CLO Ltd.			
5,700 % fällig am 25.05.2037	2.290	2.199	0,00	Madison Park Euro Funding DAC				6,867 % fällig am 20.01.2031	29.741	29.771	0,04
5,710 % fällig am 25.05.2037	5.475	5.424	0,01	4,696 % fällig am 25.10.2030	€ 2.681	2.919	0,00	MMcapS Funding Ltd.			
5,730 % fällig am 25.03.2037	2.551	2.486	0,00	4,715 % fällig am 15.01.2032	18.100	19.703	0,03	5,989 % fällig am 01.12.2035	2.762	2.638	0,00
5,730 % fällig am 25.06.2037	926	925	0,00	Madison Park Funding Ltd.				Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust			
5,740 % fällig am 25.08.2036	6.700	6.090	0,01	0,000 % fällig am 29.07.2030	\$ 15.779	15.780	0,02	3,938 % fällig am 25.01.2035	1.822	1.618	0,00
5,770 % fällig am 25.01.2037	437	422	0,00	6,405 % fällig am 15.04.2029	9.768	9.732	0,01	5,540 % fällig am 25.10.2036	2.823	1.470	0,00
5,770 % fällig am 25.03.2037	7.847	7.214	0,01	6,707 % fällig am 20.04.2030	3.571	3.569	0,01	5,550 % fällig am 25.11.2036	5.099	2.899	0,00
5,875 % fällig am 25.05.2036	2.126	2.061	0,00	Magnette Ltd.				5,560 % fällig am 25.01.2037	15.768	7.001	0,01
5,875 % fällig am 25.07.2036	2.838	2.759	0,00	6,777 % fällig am 18.10.2031	5.225	5.226	0,01	5,570 % fällig am 25.07.2036	6.425	2.374	0,00
5,905 % fällig am 25.05.2036	4.653	4.375	0,01	Man GLG Euro CLO DAC				5,570 % fällig am 25.10.2036	1.337	577	0,00
5,905 % fällig am 25.07.2036	144	140	0,00	4,645 % fällig am 15.10.2030	€ 5.362	5.886	0,01	5,570 % fällig am 25.11.2036	4.733	2.692	0,00
5,920 % fällig am 25.07.2036	3.786	3.267	0,01	4,705 % fällig am 15.10.2030	11.277	12.365	0,02	5,580 % fällig am 25.10.2036	5.060	2.639	0,00
5,980 % fällig am 25.04.2036	4.745	3.976	0,01	4,775 % fällig am 15.10.2032	7.161	7.815	0,01	5,580 % fällig am 25.12.2036	3.615	1.838	0,00
6,000 % fällig am 25.01.2037	4.943	4.303	0,01	4,835 % fällig am 15.01.2030	6.556	7.239	0,01	5,580 % fällig am 25.02.2037	3.246	1.051	0,00
6,040 % fällig am 25.07.2036	1.800	1.732	0,00	5,779 % fällig am 15.10.2036	22.120	24.492	0,04	5,580 % fällig am 25.03.2037	420	180	0,00
6,130 % fällig am 25.07.2036	1.998	1.792	0,00	MAPS Ltd.				5,600 % fällig am 25.01.2037	96	43	0,00
6,630 % fällig am 25.07.2036	9.767	2.838	0,00	4,212 % fällig am 15.05.2043	\$ 15.204	13.648	0,02	5,600 % fällig am 25.02.2037	72	64	0,00
Jubilee CLO DAC				Marlay Park CLO DAC				5,610 % fällig am 25.10.2036	16.853	7.277	0,01
4,756 % fällig am 26.07.2030	€ 10.000	10.927	0,02	4,705 % fällig am 15.10.2030	€ 2.648	2.906	0,00	5,610 % fällig am 25.05.2037	23.280	18.451	0,03
KKR CLO Ltd.				MASTR Asset-Backed Securities Trust				5,620 % fällig am 25.11.2036	6.926	3.943	0,01
6,785 % fällig am 16.10.2030	\$ 2.262	2.264	0,00	5,520 % fällig am 25.10.2036	\$ 5.114	1.686	0,00	5,620 % fällig am 25.12.2036	10.688	5.436	0,01
6,835 % fällig am 15.01.2031	2.173	2.173	0,00	5,570 % fällig am 25.11.2036	101	32	0,00	5,620 % fällig am 25.02.2037	4.764	2.258	0,00
Kodiak CDO Ltd.				5,615 % fällig am 25.01.2037	22.031	6.195	0,01	5,650 % fällig am 25.02.2037	1.942	630	0,00
6,112 % fällig am 07.08.2037	1.977	1.918	0,00	5,620 % fällig am 25.10.2036	6.755	2.244	0,00	5,670 % fällig am 25.05.2037	6.807	3.926	0,01
LCM Loan Income Fund Income Note Issuer Ltd.				5,670 % fällig am 25.08.2036	8.282	3.044	0,01	5,680 % fällig am 25.01.2037	5.026	2.234	0,00
6,735 % fällig am 16.07.2031	11.426	11.427	0,02	5,670 % fällig am 25.10.2036	5.333	2.659	0,00	5,720 % fällig am 25.07.2036	7.916	6.950	0,01
LCM LP				5,680 % fällig am 25.05.2037	5.928	5.638	0,01	5,720 % fällig am 25.12.2036	0	0	0,00
6,697 % fällig am 20.04.2031	40.373	40.422	0,06	5,690 % fällig am 25.11.2036	6.888	2.214	0,00	5,720 % fällig am 25.03.2037	5.220	2.238	0,00
6,785 % fällig am 15.10.2031	49.300	49.248	0,07	5,730 % fällig am 25.10.2036	502	229	0,00	5,730 % fällig am 25.02.2037	823	390	0,00
Lehman ABS Manufactured Housing Contract Trust				5,740 % fällig am 25.08.2036	7.324	2.886	0,00	5,770 % fällig am 25.06.2036	3.626	1.890	0,00
6,630 % fällig am 15.04.2040	2.364	2.381	0,00	5,770 % fällig am 25.04.2036	4.169	984	0,00	5,770 % fällig am 25.07.2036	3.401	1.271	0,00
Lehman XS Trust				5,770 % fällig am 25.06.2036	3.478	1.257	0,00	5,790 % fällig am 25.09.2036	4.022	1.720	0,00
4,555 % fällig am 25.06.2036	5	5	0,00	5,770 % fällig am 25.08.2036	13.951	5.023	0,01	5,800 % fällig am 25.02.2037	12.455	5.905	0,01
5,011 % fällig am 25.01.2036	1.977	1.738	0,00	5,790 % fällig am 25.10.2036	6.982	3.481	0,01	5,950 % fällig am 25.06.2036	21.422	14.408	0,02
5,670 % fällig am 25.02.2037	9.770	8.731	0,01	5,910 % fällig am 25.11.2036	9.259	5.477	0,01	5,950 % fällig am 25.09.2036	24.476	8.708	0,01
5,780 % fällig am 25.03.2037	2.324	2.031	0,00	5,950 % fällig am 25.03.2036	2.947	1.810	0,00	5,965 % fällig am 25.03.2036	5.666	4.707	0,01
5,790 % fällig am 25.05.2036	3.042	2.627	0,00	5,950 % fällig am 25.06.2036	208	76	0,00	5,970 % fällig am 25.04.2036	8.518	7.993	0,01
5,810 % fällig am 25.10.2036	1.630	1.475	0,00	5,950 % fällig am 25.08.2036	4.016	1.499	0,00	5,970 % fällig am 25.07.2036	1.614	609	0,00
5,810 % fällig am 25.12.2036	3.786	3.522	0,01	5,970 % fällig am 25.11.2035	2.563	1.471	0,00	6,040 % fällig am 25.12.2035	87	84	0,00
5,890 % fällig am 25.06.2046	4.262	3.853	0,01	6,040 % fällig am 25.01.2036	2.118	2.080	0,00	6,040 % fällig am 25.12.2035	5.111	4.139	0,01
5,930 % fällig am 25.02.2037	4.660	3.473	0,01	6,050 % fällig am 25.01.2036	420	413	0,00	6,070 % fällig am 25.12.2035	3.500	3.211	0,01
5,990 % fällig am 25.05.2046	1.501	1.312	0,00	6,170 % fällig am 25.09.2034	1.995	1.838	0,00	6,130 % fällig am 25.01.2035	2.814		

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
6,400 % fällig am 25.02.2035 \$	2.224	\$ 1.985	0,00	Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust	8.985	\$ 7.156	0,01	6,205 % fällig am 25.09.2035 \$	5.868	\$ 5.663	0,01
6,415 % fällig am 25.01.2035	3.746	3.339	0,01	5,750 % fällig am 25.07.2036	1.963	1.850	0,00	6,265 % fällig am 25.07.2035	2.450	2.415	0,00
6,470 % fällig am 25.07.2037	5.069	4.951	0,01	5,950 % fällig am 25.03.2036	4.902	4.450	0,01	6,445 % fällig am 25.07.2035	5.600	4.191	0,01
6,520 % fällig am 25.04.2035	1.890	1.792	0,00	5,965 % fällig am 25.03.2036	3.903	3.722	0,01	6,475 % fällig am 25.06.2035	2.888	2.703	0,00
6,520 % fällig am 25.06.2035	2.755	2.442	0,00	6,130 % fällig am 25.11.2035	7.070	1.577	0,00	6,505 % fällig am 25.05.2035	3.000	2.390	0,00
6,720 % fällig am 25.07.2037	8.600	7.246	0,01	6,130 % fällig am 25.10.2036	2.136	2.097	0,00	6,520 % fällig am 25.09.2034	2.493	2.462	0,00
7,270 % fällig am 25.05.2034	277	269	0,00	6,235 % fällig am 25.05.2035	9.740	2.856	0,00	6,520 % fällig am 25.06.2035	1.992	1.600	0,00
8,095 % fällig am 25.03.2034	794	804	0,00	6,270 % fällig am 25.02.2037	5.210	1.432	0,00	6,595 % fällig am 25.03.2035	722	701	0,00
Morgan Stanley Capital, Inc. Trust				6,492 % fällig am 25.02.2037	2.638	619	0,00	6,790 % fällig am 25.01.2036	5.451	5.071	0,01
6,010 % fällig am 25.02.2036	3.571	3.236	0,01	6,532 % fällig am 25.10.2036	12.500	13.665	0,02	7,045 % fällig am 25.02.2035	7.209	6.909	0,01
6,010 % fällig am 25.03.2036	9.137	7.272	0,01	North Westerly ESG CLO DAC				7,240 % fällig am 25.10.2034	5.729	5.359	0,01
6,025 % fällig am 25.01.2036	2.869	2.292	0,00	4,972 % fällig am 05.07.2032 €	11.026	11.047	0,02	7,270 % fällig am 25.12.2034	8.508	8.390	0,01
6,050 % fällig am 25.01.2036	1.847	1.772	0,00	Northwoods Capital Ltd.				7,345 % fällig am 25.12.2034	5.706	5.194	0,01
6,050 % fällig am 25.02.2036	212	209	0,00	7,246 % fällig am 15.06.2031 \$	5.700	5.334	0,01	7,570 % fällig am 25.09.2034	107	92	0,00
Morgan Stanley Home Equity Loan Trust				2,907 % fällig am 25.01.2036	3.045	1.025	0,00	Penta CLO DAC			
5,640 % fällig am 25.04.2037	6.642	4.763	0,01	5,620 % fällig am 25.03.2037	26.180	8.809	0,01	4,906 % fällig am 25.01.2033 €	64.000	69.734	0,10
5,790 % fällig am 25.04.2036	204	107	0,00	5,650 % fällig am 25.03.2037	3.655	3.340	0,01	People's Choice Home Loan Securities Trust			
5,820 % fällig am 25.04.2037	5.534	5.035	0,01	5,650 % fällig am 25.09.2037	9.191	8.887	0,01	6,150 % fällig am 25.12.2035 \$	4.957	4.748	0,01
5,980 % fällig am 25.02.2036	1	0	0,00	5,670 % fällig am 25.09.2037	2.780	1.977	0,00	6,325 % fällig am 25.08.2035	4.075	3.871	0,01
Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital Trust				5,770 % fällig am 25.06.2036	5.963	2.487	0,00	6,415 % fällig am 25.05.2035	610	556	0,00
5,520 % fällig am 25.11.2036	6.879	2.308	0,00	5,790 % fällig am 25.05.2036	2.647	2.603	0,00	6,445 % fällig am 25.05.2035	7.624	4.589	0,01
5,540 % fällig am 25.11.2036	5.657	1.899	0,00	5,810 % fällig am 25.11.2036	1.253	378	0,00	People's Financial Realty Mortgage Securities Trust			
5,620 % fällig am 25.11.2036	1.548	520	0,00	5,810 % fällig am 25.01.2037	18.759	6.626	0,01	5,710 % fällig am 25.09.2036	10.692	1.994	0,00
5,690 % fällig am 25.11.2036	13.528	5.451	0,01	6,010 % fällig am 25.05.2036	400	377	0,00	Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust			
5,770 % fällig am 25.07.2036	1.376	393	0,00	6,175 % fällig am 25.01.2036	729	720	0,00	3,428 % fällig am 25.11.2035	174	172	0,00
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				6,190 % fällig am 25.10.2035	1.947	1.923	0,00	5,730 % fällig am 25.11.2036	3	3	0,00
5,630 % fällig am 25.11.2036	14.708	4.115	0,01	6,205 % fällig am 25.01.2036	5.000	4.740	0,01	5,780 % fällig am 25.06.2047	868	801	0,00
5,710 % fällig am 25.04.2037	8.027	2.336	0,00	6,295 % fällig am 25.06.2034	1.863	1.804	0,00	5,917 % fällig am 25.04.2035	2.290	2.205	0,00
5,810 % fällig am 25.10.2036	4.477	1.277	0,00	7,195 % fällig am 25.12.2034	770	680	0,00	5,965 % fällig am 25.07.2036	2.144	1.998	0,00
5,810 % fällig am 25.01.2047	3.702	1.132	0,00	7,345 % fällig am 25.03.2035	2.489	2.447	0,00	6,055 % fällig am 25.02.2036	704	697	0,00
5,950 % fällig am 25.04.2037	3.527	988	0,00	Oakwood Mortgage Investors, Inc.				Pretium Mortgage Credit Partners LLC			
6,010 % fällig am 25.04.2037	15.569	5.619	0,01	5,050 % fällig am 15.11.2019	122	115	0,00	2,240 % fällig am 27.09.2060	9.534	9.582	0,01
6,070 % fällig am 25.02.2037	3.909	2.209	0,00	OCF Euro CLO DAC				Project Silver			
6,077 % fällig am 25.10.2046	4.311	1.066	0,00	4,775 % fällig am 15.01.2032 €	5.931	6.518	0,01	3,967 % fällig am 15.07.2044	15.811	13.276	0,02
6,190 % fällig am 25.04.2037	3.421	958	0,00	Option One Mortgage Loan Trust				RAAC Trust			
6,263 % fällig am 25.01.2047	1.227	378	0,00	5,570 % fällig am 25.07.2036 \$	2.011	929	0,00	5,970 % fällig am 25.02.2037	2.408	2.317	0,00
6,298 % fällig am 25.10.2036	8.705	1.978	0,00	5,590 % fällig am 25.03.2037	5.540	5.260	0,01	6,070 % fällig am 25.06.2044	1.146	965	0,00
6,326 % fällig am 25.09.2046	11.401	2.526	0,00	5,600 % fällig am 25.07.2037	10.744	6.837	0,01	6,120 % fällig am 25.06.2047	2.343	2.266	0,00
6,488 % fällig am 25.11.2036	6.239	1.458	0,00	5,610 % fällig am 25.01.2037	16.506	10.249	0,02	6,160 % fällig am 25.11.2036	71	69	0,00
6,592 % fällig am 25.10.2036	1.780	577	0,00	5,610 % fällig am 25.02.2037	19.312	12.528	0,02	6,230 % fällig am 25.10.2046	1.857	1.779	0,00
Mountain View CLO LLC				5,610 % fällig am 25.03.2037	14.014	7.849	0,01	6,325 % fällig am 25.03.2037	607	605	0,00
6,745 % fällig am 16.10.2029	19.315	19.321	0,03	5,640 % fällig am 25.05.2037	19.446	10.413	0,02	6,670 % fällig am 25.10.2045	0	0	0,00
Nassau Ltd.				5,650 % fällig am 25.04.2037	655	312	0,00	Raptor Aircraft Finance LLC			
6,805 % fällig am 15.10.2029	3.501	3.501	0,01	5,650 % fällig am 25.07.2037	4.470	2.844	0,00	4,213 % fällig am 23.08.2044	45.081	36.328	0,05
6,805 % fällig am 15.07.2031	41.812	41.815	0,06	5,660 % fällig am 25.07.2037	1.910	1.649	0,00	Regatta Funding Ltd.			
6,905 % fällig am 15.01.2030	23.775	23.808	0,03	5,670 % fällig am 25.07.2036	10.106	5.683	0,01	6,914 % fällig am 17.10.2030	2.274	2.273	0,00
National Collegiate Student Loan Trust				5,690 % fällig am 25.01.2037	7.078	4.015	0,01	Renaissance Home Equity Loan Trust			
5,780 % fällig am 25.05.2032	5.085	4.911	0,01	5,690 % fällig am 25.04.2037	32.938	22.577	0,03	5,285 % fällig am 25.01.2037	2.814	945	0,00
5,790 % fällig am 27.10.2031	7.184	7.060	0,01	5,690 % fällig am 25.05.2037	4.860	2.879	0,00	5,294 % fällig am 25.01.2037	18.457	6.206	0,01
5,820 % fällig am 25.03.2033	6.700	6.359	0,01	5,720 % fällig am 25.03.2037	2.473	1.206	0,00	5,434 % fällig am 25.08.2035	1.580	1.571	0,00
5,840 % fällig am 25.06.2033	2.209	2.106	0,00	6,010 % fällig am 25.01.2036	19.098	17.389	0,03	5,512 % fällig am 25.04.2037	8.724	2.322	0,00
Nationstar Home Equity Loan Trust				6,205 % fällig am 25.05.2035	2.810	2.656	0,00	5,545 % fällig am 25.01.2037	2.529	891	0,00
5,645 % fällig am 25.06.2037	5.049	4.868	0,01	6,265 % fällig am 25.05.2034	1.838	1.783	0,00	5,608 % fällig am 25.05.2036	6.712	3.202	0,01
5,790 % fällig am 25.04.2037	6.915	6.766	0,01	6,340 % fällig am 25.05.2035	700	586	0,00	5,612 % fällig am 25.04.2037	5.992	1.624	0,00
Navient Private Education Loan Trust				6,400 % fällig am 25.08.2035	490	396	0,00	5,675 % fällig am 25.06.2037	421	111	0,00
4,100 % fällig am 16.12.2058	3.860	3.719	0,01	Option One Mortgage Loan Trust Asset-Backed Certificates				5,731 % fällig am 25.11.2036	4.836	1.732	0,00
6,926 % fällig am 16.07.2040	10.798	10.842	0,02	6,160 % fällig am 25.11.2035	2.466	2.327	0,00	5,742 % fällig am 25.04.2037	19.235	5.334	0,01
7,626 % fällig am 15.12.2045	4.785	4.812	0,01	Owinit Mortgage Loan Trust				5,744 % fällig am 25.06.2037	5.934	1.590	0,00
Nelnet Student Loan Trust				3,192 % fällig am 25.12.2035	1.676	958	0,00	5,746 % fällig am 25.05.2036	2.134	1.043	0,00
5,910 % fällig am 27.09.2066	27.492	27.394	0,04	5,690 % fällig am 25.07.2037	1.117	949	0,00	5,761 % fällig am 25.04.2037	2.781	774	0,00
New Century Home Equity Loan Trust				OZLM Ltd.				5,762 % fällig am 25.08.2036	8.258	3.295	0,01
5,790 % fällig am 25.08.2036	5.705	5.493	0,01	6,727 % fällig am 20.04.2031	1.427	1.427	0,00	5,797 % fällig am 25.08.2036	12.841	5.155	0,01
5,830 % fällig am 25.05.2036	1.017	1.001	0,00	OZLME DAC				5,812 % fällig am 25.11.2036	8.748	3.176	0,01
6,115 % fällig am 25.12.2035	7.106	6.740	0,01	4,723 % fällig am 24.08.2030 €	2.113	2.312	0,00	5,857 % fällig am 25.05.2035	2.027	1.681	0,00
6,145 % fällig am 25.03.2035	1.545	1.554	0,00	Palmer Square CLO Ltd.				5,879 % fällig am 25.06.2037	2.974	816	0,00
6,190 % fällig am 25.03.2035	4.567	4.487	0,01	6,794 % fällig am 17.01.2031 \$	584	585	0,00	5,893 % fällig am 25.06.2037	28.633	7.876	0,01
6,205 % fällig am 25.10.2035	6.885	5.820	0,01	Palmer Square European CLO DAC				5,906 % fällig am 25.06.2037	7.657	2.111	0,00
6,235 % fällig am 25.02.2035	3.486	3.369	0,01	1,970 % fällig am 15.04.2035 €	6.000	5.838	0,01	6,011 % fällig am 25.05.2036	3.091	1.578	0,00
6,355 % fällig am 25.08.2034	424	418	0,00	Palmer Square European Loan Funding DAC				6,120 % fällig am 25.11.2036	11.903	4.547	0,01
6,400 % fällig am 25.11.2034	2.796	2.737	0,00	0,000 % fällig am 15.05.2033	26.600	29.312	0,04	6,166 % fällig am 25.05.2036	3.374	1.765	0,00
6,415 % fällig am 25.06.2035	438	441	0,00	5,602 % fällig am 15.11.2032	34.369	37.961	0,05	6,210 % fällig am 25.08.2035	2.697	2.402	0,00
6,415 % fällig am 25.09.2035	7.903	7.711	0,01	Park Place Securities, Inc.				6,230 % fällig am 25.12.2032	41	37	0,00
6,445 % fällig am 25.11.2034	204	202	0,00	6,205 % fällig am 25.09.2035 \$	5.589	5.463	0,01	6,511 % fällig			

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES				
		MARKT- WERT	NETTO- VERMÖ- GENS			MARKT- WERT	NETTO- VERMÖ- GENS			MARKT- WERT	NETTO- VERMÖ- GENS			
6,115 % fällig am 25.02.2036	\$ 500	\$	475	0,00	5,600 % fällig am 25.05.2037	\$ 8	\$	6	0,00	6,160 % fällig am 25.12.2035	\$ 8.776	\$	7.973	0,01
6,150 % fällig am 25.12.2035	4.854		4.257	0,01	5,630 % fällig am 25.08.2036	2.739		890	0,00	6,220 % fällig am 25.01.2035	450		410	0,00
6,170 % fällig am 25.08.2035	1.865		1.812	0,00	5,670 % fällig am 25.05.2037	4.792		2.908	0,00	6,310 % fällig am 25.08.2035	4.301		3.847	0,01
6,250 % fällig am 25.07.2035	95		94	0,00	5,690 % fällig am 25.12.2036	12.712		2.900	0,00	6,370 % fällig am 25.10.2037	16.155		12.691	0,02
6,250 % fällig am 25.09.2035	1.533		1.428	0,00	5,730 % fällig am 25.12.2036	6.853		6.202	0,01	6,400 % fällig am 25.11.2035	41		41	0,00
6,415 % fällig am 25.10.2035	2.384		1.981	0,00	5,750 % fällig am 25.05.2036	7.344		3.851	0,01	6,420 % fällig am 25.09.2037	1.664		1.331	0,00
6,445 % fällig am 25.07.2035	1.906		1.773	0,00	5,750 % fällig am 25.06.2036	1.823		1.181	0,00	6,445 % fällig am 25.03.2036	2.722		2.478	0,00
6,490 % fällig am 25.05.2035	740		732	0,00	5,750 % fällig am 25.09.2036	3.954		3.589	0,01	6,470 % fällig am 25.09.2037	4.071		2.830	0,00
6,535 % fällig am 25.05.2035	2.096		1.980	0,00	5,750 % fällig am 25.01.2037	6.063		5.265	0,01	6,505 % fällig am 25.05.2035	607		600	0,00
6,595 % fällig am 25.06.2035	2.600		2.509	0,00	5,770 % fällig am 25.03.2036	2.569		1.573	0,00	6,550 % fällig am 25.07.2035	467		462	0,00
6,670 % fällig am 25.01.2035	2.266		2.110	0,00	5,770 % fällig am 25.09.2036	5.730		2.008	0,00	6,570 % fällig am 25.09.2037	1.503		1.202	0,00
					5,770 % fällig am 25.12.2036	540		280	0,00					
Residential Asset Securities Corp. Trust					5,790 % fällig am 25.09.2036	1.606		1.077	0,00	Southern Pacific Secured Asset Corp.				
5,453 % fällig am 25.04.2034	439		426	0,00	5,790 % fällig am 25.10.2036	1.068		360	0,00	5,870 % fällig am 25.03.2028	60		56	0,00
5,678 % fällig am 25.01.2037	6.370		5.399	0,01	5,810 % fällig am 25.08.2036	12.117		3.936	0,01	Specialty Underwriting & Residential Finance Trust				
5,690 % fällig am 25.02.2037	6.524		6.256	0,01	5,910 % fällig am 25.01.2037	1.035		753	0,00	5,590 % fällig am 25.04.2037	736		503	0,00
5,712 % fällig am 25.06.2034	1.719		1.688	0,00	5,950 % fällig am 25.07.2036	7.336		2.541	0,00	5,670 % fällig am 25.04.2037	2.772		1.906	0,00
5,730 % fällig am 25.07.2036	14		14	0,00	6,010 % fällig am 25.03.2036	463		415	0,00	5,690 % fällig am 25.09.2037	3.187		1.040	0,00
5,750 % fällig am 25.07.2036	3.837		3.670	0,01	6,070 % fällig am 25.11.2035	3.509		2.882	0,00	5,750 % fällig am 25.09.2037	6.979		6.247	0,01
5,750 % fällig am 25.09.2036	3.150		3.076	0,01	6,115 % fällig am 25.10.2035	2.216		1.754	0,00	5,770 % fällig am 25.06.2037	1.790		1.030	0,00
5,810 % fällig am 25.04.2037	6.342		5.997	0,01	6,145 % fällig am 25.01.2035	516		452	0,00	5,770 % fällig am 25.11.2037	8.617		4.721	0,01
5,905 % fällig am 25.06.2036	3.157		3.060	0,01	6,190 % fällig am 25.10.2035	1.750		1.446	0,00	5,820 % fällig am 25.03.2037	1.501		818	0,00
5,910 % fällig am 25.01.2037	3.566		3.362	0,01	6,355 % fällig am 25.10.2035	2.927		2.454	0,00	5,820 % fällig am 25.04.2037	396		275	0,00
5,980 % fällig am 25.04.2036	4.426		4.026	0,01	6,430 % fällig am 25.01.2036	594		540	0,00	6,445 % fällig am 25.12.2035	1.231		1.212	0,00
6,010 % fällig am 25.07.2036	2.325		2.031	0,00						6,640 % fällig am 25.12.2035	852		821	0,00
6,030 % fällig am 25.04.2036	1.140		1.126	0,00	Segovia European CLO DAC					St. Paul's CLO DAC				
6,055 % fällig am 25.03.2036	2.180		2.150	0,00	4,873 % fällig am 20.07.2032	€ 4.600		5.017	0,01	4,885 % fällig am 15.04.2033	€ 1.200		1.310	0,00
6,070 % fällig am 25.02.2036	1.348		1.327	0,00	SG Mortgage Securities Trust					START Ltd.				
6,085 % fällig am 25.11.2035	94		88	0,00	5,790 % fällig am 25.07.2036	\$ 23.025		5.008	0,01	4,089 % fällig am 15.03.2044	\$ 11.771		10.704	0,02
6,100 % fällig am 25.02.2036	2.810		2.671	0,00	5,830 % fällig am 25.02.2036	3.578		1.784	0,00	Starwood Commercial Mortgage Trust				
6,115 % fällig am 25.03.2035	72		71	0,00	6,010 % fällig am 25.02.2036	1.882		949	0,00	6,556 % fällig am 15.07.2038	10.193		10.086	0,02
6,130 % fällig am 25.11.2035	294		293	0,00	6,175 % fällig am 25.10.2035	921		824	0,00	6,876 % fällig am 15.07.2038	14.830		14.314	0,02
6,130 % fällig am 25.12.2035	3.988		3.833	0,01	6,355 % fällig am 25.10.2035	1.083		845	0,00	7,076 % fällig am 15.07.2038	5.930		5.531	0,01
6,150 % fällig am 25.05.2037	1.074		1.052	0,00	Signal Peak CLO Ltd.					Steele Creek CLO Ltd.				
6,160 % fällig am 25.11.2035	598		594	0,00	6,750 % fällig am 25.04.2031	11.956		11.973	0,02	6,744 % fällig am 21.04.2031	10.924		10.940	0,02
6,175 % fällig am 25.09.2035	838		787	0,00	SLM Private Credit Student Loan Trust					6,905 % fällig am 15.10.2030	2.227		2.226	0,00
6,175 % fällig am 25.10.2035	2.047		1.720	0,00	5,976 % fällig am 15.06.2039	12.502		12.119	0,02	Structured Asset Investment Loan Trust				
6,175 % fällig am 25.11.2035	476		457	0,00	SLM Student Loan Trust					5,600 % fällig am 25.07.2036	699		506	0,00
6,190 % fällig am 25.01.2036	4.882		4.742	0,01	4,356 % fällig am 25.10.2039	€ 2.118		2.182	0,00	5,620 % fällig am 25.07.2036	2.055		1.992	0,00
6,340 % fällig am 25.11.2035	3.825		3.077	0,01	4,475 % fällig am 15.12.2033	8.971		9.183	0,01	5,643 % fällig am 25.07.2036	15.257		9.131	0,01
6,430 % fällig am 25.08.2035	2.568		2.524	0,00	4,506 % fällig am 25.07.2039	11.859		12.331	0,02	5,790 % fällig am 25.05.2036	77		75	0,00
6,505 % fällig am 25.10.2035	2.013		1.908	0,00	4,506 % fällig am 25.01.2040	24.600		24.843	0,04	5,850 % fällig am 25.03.2036	1.333		1.296	0,00
6,715 % fällig am 25.03.2035	1.010		967	0,00	6,252 % fällig am 25.03.2026	\$ 14.151		14.009	0,02	6,020 % fällig am 25.09.2034	3.891		3.659	0,01
7,270 % fällig am 25.04.2035	653		635	0,00	6,346 % fällig am 25.04.2023	7.141		7.089	0,01	6,070 % fällig am 25.04.2036	8.610		4.561	0,01
7,420 % fällig am 25.11.2034	994		971	0,00	7,296 % fällig am 25.07.2023	6.179		6.181	0,01	6,090 % fällig am 25.01.2036	3.615		3.328	0,01
					SMB Private Education Loan Trust					6,100 % fällig am 25.11.2035	6.171		5.933	0,01
Residential Funding Mortgage Securities Home Equity Loan Trust					3,500 % fällig am 16.12.2041	4.000		3.707	0,01	6,175 % fällig am 25.03.2034	140		137	0,00
5,400 % fällig am 25.12.2035	1.548		238	0,00	6,276 % fällig am 15.02.2036	1.067		1.059	0,00	6,190 % fällig am 25.04.2033	498		497	0,00
					SoFi Alternative Trust					6,190 % fällig am 25.04.2035	2.312		2.258	0,00
Rockford Tower CLO Ltd.					5,203 % fällig am 15.06.2050	14.450		13.977	0,02	6,190 % fällig am 25.07.2035	262		244	0,00
6,729 % fällig am 20.05.2031	10.073		10.066	0,02	5,219 % fällig am 16.05.2050	15.188		14.812	0,02	6,190 % fällig am 25.09.2035	2.516		2.468	0,00
6,837 % fällig am 20.10.2031	10.200		10.198	0,02	Soloso CDO Ltd.					6,190 % fällig am 25.10.2035	104		101	0,00
					5,928 % fällig am 07.10.2037	3.701		3.460	0,01	6,190 % fällig am 25.01.2036	3.745		3.569	0,01
Romark WM-R Ltd.					Sound Point CLO Ltd.					6,220 % fällig am 25.07.2035	1.459		1.391	0,00
6,707 % fällig am 20.04.2031	26.346		26.350	0,04	6,797 % fällig am 21.01.2031	15.523		15.509	0,02	6,235 % fällig am 25.08.2035	1.972		1.891	0,00
RRE Loan Management DAC					Sound Point Euro CLO Funding DAC					6,370 % fällig am 25.05.2035	3.567		3.477	0,01
5,005 % fällig am 15.10.2036	€ 3.500		3.803	0,01	5,065 % fällig am 15.01.2035	€ 43.500		47.599	0,07	6,400 % fällig am 25.01.2035	4.134		4.009	0,01
RYE Harbour CLO DAC					Soundview Home Loan Trust					6,400 % fällig am 25.06.2035	5.218		4.943	0,01
4,902 % fällig am 21.01.2031	4.040		4.442	0,01	5,550 % fällig am 25.06.2037	\$ 3.153		2.082	0,00	6,470 % fällig am 25.09.2034	3.135		3.053	0,01
Sapphire Aviation Finance Ltd.					5,590 % fällig am 25.11.2036	8.636		2.610	0,00	6,595 % fällig am 25.07.2033	362		362	0,00
4,250 % fällig am 15.03.2040	\$ 17.042		15.194	0,02	5,620 % fällig am 25.03.2037	4.766		4.436	0,01	6,670 % fällig am 25.12.2034	331		330	0,00
					5,620 % fällig am 25.06.2037	16.727		11.046	0,02	6,745 % fällig am 25.12.2034	1.302		1.256	0,00
Saranac CLO Ltd.					5,630 % fällig am 25.01.2037	8.626		6.146	0,01	6,850 % fällig am 25.04.2033	13		12	0,00
7,233 % fällig am 22.06.2030	19.029		19.058	0,03	5,640 % fällig am 25.07.2037	737		630	0,00	6,970 % fällig am 25.11.2034	616		628	0,00
					5,640 % fällig am 25.08.2037	7.878		6.652	0,01	Structured Asset Securities Corp.				
Saxon Asset Securities Trust					5,650 % fällig am 25.07.2037	6.156		5.315	0,01	4,819 % fällig am 25.02.2035	1.505		1.510	0,00
1,458 % fällig am 25.11.2035	5.217		4.685	0,01	5,670 % fällig am 25.02.2037	32.906		10.392	0,02	6,610 % fällig am 25.02.2035	584		571	0,00
2,011 % fällig am 25.05.2035	3.689		3.287	0,01	5,670 % fällig am 25.06.2037	21.678		15.278	0,02	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				
4,129 % fällig am 25.08.2035	3.323		3.301	0,01	5,770 % fällig am 25.07.2036	41		41	0,00	5,033 % fällig am 25.08.2034	59		57	0,00
5,650 % fällig am 25.05.2037	2.485		1.739	0,00	5,770 % fällig am 25.01.2037	3.400		3.199	0,01	5,620 % fällig am 25.04.2036	2.109		2.069	0,00
5,670 % fällig am 25.05.2047	8.473		7.399	0,01	5,810 % fällig am 25.11.2036	5.349		1.616	0,00	5,625 % fällig am 25.09.2036	9.267		5.753	0,01
5,710 % fällig am 25.10.2046	16.837		13.914	0,02	5,875 % fällig am 25.12.2036	5.746		5.604	0,01	5,630 % fällig am 25.01.2037	7.735		7.261	0,01
5,780 % fällig am 25.09.2037	8.792													

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS				
5,810 % fällig am 25.12.2036	\$ 491	\$ 479	0,00	Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust	792	\$ 589	0,00	3,000 % fällig am 03.12.2026 (h)	MXN 844.054	\$ 46.302	0,07				
5,890 % fällig am 25.02.2037	161	155	0,00	Wellfleet CLO Ltd.	400	399	0,00	4,000 % fällig am 30.11.2028 (h)	3.053.841	176.351	0,25				
5,900 % fällig am 25.03.2037	3.743	2.768	0,00	Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust	3.200	3.061	0,01	Peru Government International Bond							
5,970 % fällig am 25.11.2037	18.208	13.714	0,02	5,815 % fällig am 25.01.2037	3.450	3.330	0,01	5,350 % fällig am 12.08.2040	PEN 2.300	533	0,00				
5,995 % fällig am 25.07.2036	1.471	1.402	0,00	5,890 % fällig am 25.03.2037	1.416	1.392	0,00	5,400 % fällig am 12.08.2034	121	30	0,00				
6,090 % fällig am 25.12.2036	13.350	7.600	0,01	5,930 % fällig am 25.04.2037	1.993	1.927	0,00	5,940 % fällig am 12.02.2029	13.761	3.716	0,01				
6,090 % fällig am 25.02.2037	4.331	4.140	0,01	5,980 % fällig am 25.05.2036	3.877	3.788	0,01	6,150 % fällig am 12.08.2032	12.060	3.185	0,00				
6,145 % fällig am 25.04.2035	113	102	0,00	6,070 % fällig am 25.04.2037	1.000	681	0,00	6,900 % fällig am 12.08.2037	7.647	2.082	0,00				
6,145 % fällig am 25.06.2035	107	101	0,00	6,470 % fällig am 25.10.2034	745	739	0,00	6,950 % fällig am 12.08.2031	30.370	8.482	0,01				
6,370 % fällig am 25.08.2037	2.470	2.442	0,00	7,195 % fällig am 25.11.2035	3.238	3.215	0,01	Provincia de Buenos Aires							
6,400 % fällig am 25.05.2035	357	352	0,00	7,570 % fällig am 25.11.2035	2.472	2.391	0,00	129,126 % fällig am 12.04.2025 (a)	ARS 3.331.617	2.780	0,00				
6,475 % fällig am 25.11.2035	1.000	985	0,00	7,870 % fällig am 25.12.2034	1.435	1.416	0,00	Republic of Greece Government International Bond							
7,495 % fällig am 25.07.2035	1.430	1.476	0,00	8,020 % fällig am 25.04.2035	542	555	0,00	3,750 % fällig am 30.01.2028	€ 4.618	5.350	0,01				
7,570 % fällig am 25.11.2035	129	124	0,00	9,220 % fällig am 25.04.2035	1.147	1.218	0,00	3,900 % fällig am 30.01.2033	9.948	11.702	0,02				
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Pass-Through Certificates				Wells Fargo Home Equity Trust Mortgage Pass-Through Certificates				4,000 % fällig am 30.01.2037							
6,295 % fällig am 25.01.2035	438	437	0,00	6,210 % fällig am 25.04.2034	192	185	0,00	4,200 % fällig am 30.01.2042	3.488	4.125	0,01				
Structured Asset Securities Corp. Trust				Whitehorse Ltd.				Romania Government International Bond							
5,740 % fällig am 25.05.2031	318	222	0,00	6,905 % fällig am 15.10.2031	21.200	21.232	0,03	1,750 % fällig am 13.07.2030	2.600	2.329	0,00				
7,099 % fällig am 25.05.2031	1.197	929	0,00	Wind River CLO Ltd.				2,000 % fällig am 14.04.2033	11.400	9.454	0,01				
Symphony CLO Ltd.				6,707 % fällig am 18.07.2031				13.304	13.301	0,02	2,125 % fällig am 07.03.2028	3.100	3.115	0,00	
6,535 % fällig am 15.04.2028	991	992	0,00	6,779 % fällig am 20.11.2030	2.050	2.048	0,00	2,750 % fällig am 14.04.2041	30.800	22.922	0,03				
Taberna Preferred Funding Ltd.				6,448.950				9,14	3,750 % fällig am 07.02.2034						
5,994 % fällig am 05.05.2038	4.921	4.675	0,01	STAATSEMISSIONEN				5,500 % fällig am 18.09.2028	98.000	111.484	0,16				
6,014 % fällig am 05.12.2036	23.162	20.266	0,03	Argentina Government International Bond				6,375 % fällig am 18.09.2033	98.000	114.681	0,16				
6,084 % fällig am 05.11.2035	14.418	13.409	0,02	0,750 % fällig am 09.07.2030	312.485	122.580	0,17	Russia Government International Bond							
6,146 % fällig am 05.07.2035	8.313	7.565	0,01	1,000 % fällig am 09.07.2029	18.219	7.274	0,01	1,850 % fällig am 20.11.2032 ^	2.800	1.059	0,00				
Terwin Mortgage Trust				3,500 % fällig am 09.07.2041				198.256	67.727	0,10	4,250 % fällig am 23.06.2027 ^	\$ 116.200	74.949	0,11	
4,395 % fällig am 25.08.2036	1.084	199	0,00	3,625 % fällig am 09.07.2035	278.448	93.215	0,13	4,375 % fällig am 21.03.2029 ^	6.000	3.390	0,01				
5,810 % fällig am 25.07.2037	4.663	4.477	0,01	3,625 % fällig am 09.07.2046	8.050	2.789	0,00	4,750 % fällig am 27.05.2026 ^	115.600	81.498	0,12				
6,270 % fällig am 25.09.2036	3.125	1.342	0,00	4,250 % fällig am 09.01.2038	115.791	46.032	0,07	5,100 % fällig am 28.03.2035 ^	20.000	8.100	0,01				
6,410 % fällig am 25.11.2033	6	5	0,00	Australia Government International Bond				5,250 % fällig am 23.06.2047 ^	345.400	122.617	0,17				
TIAA CLO Ltd.				1,750 % fällig am 21.06.2051				AUD 204.800	82.618	0,12	5,625 % fällig am 04.04.2042 ^	98.400	66.164	0,09	
6,805 % fällig am 16.01.2031	8.998	9.001	0,01	Autonomous City of Buenos Aires				5,875 % fällig am 16.09.2043 ^	26.600	16.806	0,02				
TICP CLO Ltd.				113,333 % fällig am 29.03.2024 (a)				ARS 1	0	0,00	7,150 % fällig am 12.11.2025 ^	RUB 20.520.713	94.111	0,13	
6,817 % fällig am 20.01.2031	10.419	10.433	0,02	122,642 % fällig am 22.02.2028 (a)	766.034	675	0,00	7,500 % fällig am 31.03.2030 ^	\$ 16.872	11.059	0,02				
Tikehau CLO BV				Export-Credit Bank of Turkey				8,250 % fällig am 24.01.2024	\$ 13.400	13.430	0,02	7,950 % fällig am 07.10.2026 ^	RUB 7.973.492	32.777	0,05
4,948 % fällig am 07.09.2035	€ 5.800	6.272	0,01	Israel Government International Bond				3,800 % fällig am 13.05.2060	161.411	116.209	0,16				
Tikehau CLO DAC				5,000 % fällig am 30.10.2026				€ 739.900	836.489	1,19	South Africa Government International Bond				
5,065 % fällig am 15.04.2032	15.000	16.449	0,02	Mexico Government International Bond				2,750 % fällig am 27.11.2031 (h)	MXN 4.990.177	260.207	0,37	10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR 11.472.400	656.745	0,93
Toro European CLO DAC				2,750 % fällig am 27.11.2031 (h)				MXN 4.990.177	260.207	0,37	State Agency of Roads of Ukraine				
4,705 % fällig am 15.10.2030	1.113	1.220	0,00	2,750 % fällig am 27.11.2031 (h)				MXN 4.990.177	260.207	0,37	6,250 % fällig am 24.06.2030	\$ 1.500	386	0,00	
4,885 % fällig am 15.07.2030	907	1.003	0,00	2,750 % fällig am 27.11.2031 (h)				MXN 4.990.177	260.207	0,37	Turkey Government International Bond				
Tralee CLO Ltd.				2,750 % fällig am 27.11.2031 (h)				MXN 4.990.177	260.207	0,37	4,250 % fällig am 13.03.2025	201.100	197.722	0,28	
7,577 % fällig am 20.07.2029	\$ 16.550	16.585	0,02	2,750 % fällig am 27.11.2031 (h)				MXN 4.990.177	260.207	0,37	5,250 % fällig am 13.03.2030	155.000	142.619	0,20	
Trapeza CDO Ltd.				2,750 % fällig am 27.11.2031 (h)				MXN 4.990.177	260.207	0,37	6,125 % fällig am 24.10.2028	28.900	28.488	0,04	
5,907 % fällig am 09.11.2042	602	554	0,00	2,750 % fällig am 27.11.2031 (h)				MXN 4.990.177	260.207	0,37	7,625 % fällig am 26.04.2029	94.000	97.532	0,14	
5,974 % fällig am 06.04.2042	5.935	5.312	0,01	2,750 % fällig am 27.11.2031 (h)				MXN 4.990.177	260.207	0,37					
6,008 % fällig am 10.10.2041	3.704	3.241	0,01	2,750 % fällig am 27.11.2031 (h)				MXN 4.990.177	260.207	0,37					
6,024 % fällig am 06.07.2041	8.699	7.481	0,01	2,750 % fällig am 27.11.2031 (h)				MXN 4.990.177	260.207	0,37					
6,084 % fällig am 06.07.2041	9.000	6.750	0,01	2,750 % fällig am 27.11.2031 (h)				MXN 4.990.177	260.207	0,37					
Tropic CDO Ltd.				2,750 % fällig am 27.11.2031 (h)				MXN 4.990.177	260.207	0,37					
5,975 % fällig am 15.07.2036	12.653	11.704	0,02	2,750 % fällig am 27.11.2031 (h)				MXN 4.990.177	260.207	0,37					
6,405 % fällig am 15.04.2034	117	117	0,00	2,750 % fällig am 27.11.2031 (h)				MXN 4.990.177	260.207	0,37					
Truman Capital Mortgage Loan Trust				2,750 % fällig am 27.11.2031 (h)				MXN 4.990.177	260.207	0,37					
5,950 % fällig am 25.03.2036	1.294	1.152	0,00	2,750 % fällig am 27.11.2031 (h)				MXN 4.990.177	260.207	0,37					
TruPS Financials Note Securitization Ltd.				2,750 % fällig am 27.11.2031 (h)				MXN 4.990.177	260.207	0,37					
6,762 % fällig am 30.03.2039	28.348	27.710	0,04	2,750 % fällig am 27.11.2031 (h)				MXN 4.990.177	260.207	0,37					
7,202 % fällig am 20.09.2039	6.656	6.323	0,01	2,750 % fällig am 27.11.2031 (h)				MXN 4.990.177	260.207	0,37					
Tymon Park CLO DAC				2,750 % fällig am 27.11.2031 (h)				MXN 4.990.177	260.207	0,37					
4,952 % fällig am 21.07.2034	€ 4.600	4.983	0,01	2,750 % fällig am 27.11.2031 (h)				MXN 4.990.177	260.207	0,37					
Venture CLO Ltd.				2,750 % fällig am 27.11.2031 (h)				MXN 4.990.177	260.207	0,37					
6,535 % fällig am 15.04.2027	\$ 11.014	11.012	0,02	2,750 % fällig am 27.11.2031 (h)				MXN 4.990.177	260.207	0,37					
6,915 % fällig am 15.01.2032	8.000	7.985	0,01	2,750 % fällig am 27.11.2031 (h)				MXN 4.990.177	260.207	0,37					
7,333 % fällig am 10.09.2029	4.950	4.957	0,01	2,750 % fällig am 27.11.2031 (h)				MXN 4.990.177	260.207	0,37					
Vesey Park CLO DAC				2,750 % fällig am 27.11.2031 (h)				MXN 4.990.177	260.207	0,37					
4,947 % fällig am 16.11.2032	€ 4.500	4.913	0,01	2,750 % fällig am 27.11.2031 (h)				MXN 4.990.177	260.207	0,37					
Voya Euro CLO DAC				2,750 % fällig am 27.11.2031 (h)				MXN 4.990.177	260.207	0,37					
4,715 % fällig am 15.10.2030	8.475	9.276	0,01	2,750 % fällig am 27.11.2031 (h)				MXN 4.990.177	260.207	0,37					
WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust				2,750 % fällig am 27.11.2031 (h)				MXN 4.990.177	260.207	0,37					
5,600 % fällig am 25.07.2047	\$ 5.710	3.373	0,01	2,750 % fällig am 27.11.2031 (h)				MXN 4.990.177	260.207	0,37					
5,620 % fällig am 25.01.2037	19.588	16.439	0,02	2,750 % fällig am 27.11.2031 (h)				MXN 4.990.177	260.207	0,37					
5,640 % fällig am 25.05.2037	3.294	2.826	0,00	2,750 % fällig am 27.11.2031 (h)				MXN 4.990.177	260.207	0,37					
5,640 % fällig am 25.07.2047	563	406	0,00	2,750 % fällig am 27.11.2031 (h)				MXN 4.990.177	260.207	0,37					
5,660 % fällig am 25.04.2037	24.600	9.271	0,01	2,750 % fällig am 27.11.2031 (h)				MXN 4.990.177	260.207	0,37					
5,695 % fällig am 25.05.2037	738	684	0,00	2,750 % fällig am 27.11.2031 (h)				MXN 4.990.177	260.207	0,37					
5,720 % fällig am 25.05.2037	3.157	2.722	0,00	2,750 % fällig am 27.11.2031 (h)				MXN 4.990.177	260.207	0,37					
5,720 % fällig am 25.07.2047	5.479	3.243	0,01	2,750 % fällig am 27.11.2031 (h)				MXN 4.990.177	260.207	0,37					
5,830 % fällig am 25.04.2037	778	295	0,00	2,750 % fällig am 27.11.2031 (h)				MXN 4.990.177	260.207	0,37					

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	
Ukraine Government International Bond												
4,375 % fällig am 27.01.2032	€	18.760	\$ 4.310	0,01								
Venezuela Government International Bond												
6,000 % fällig am 09.12.2020 ^	\$	9.289	1.302	0,00								
7,000 % fällig am 31.03.2048 ^		14.228	2.177	0,00								
7,650 % fällig am 21.04.2035 ^		28.167	4.436	0,01								
7,750 % fällig am 13.10.2029 ^		5.850	832	0,00								
8,250 % fällig am 13.10.2034 ^		35.331	5.555	0,01								
9,000 % fällig am 07.05.2049 ^		13.516	2.136	0,00								
9,250 % fällig am 15.09.2037 ^		34.519	6.606	0,01								
9,250 % fällig am 07.05.2038 ^		39.817	6.950	0,01								
11,750 % fällig am 21.10.2026 ^		3.990	778	0,00								
12,750 % fällig am 23.08.2032 ^		6.170	1.023	0,00								
			<u>3.874.333</u>	<u>5,49</u>								
AKTIEN												
STAMMAKTIEN												
KOMMUNIKATIONSDIENSTE												
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc. (e)	26.868.244	48.900	0,07									
iHeartMedia, Inc. 'A' (e)	6.332.872	16.909	0,02									
iHeartMedia, Inc. 'B' (e)	4.913.662	11.808	0,02									
Intelsat Emergence S.A. (e)(l)	4.659.508	132.746	0,19									
Windstream Holdings, Inc. (e)	2.022.886	59.860	0,08									
		<u>270.223</u>	<u>0,38</u>									
BASISKONSUMGÜTER												
Neiman Marcus Group Ltd. LLC (e)(l)	1.179.713	176.804	0,25									
ENERGIE												
Constellation Oil Services Holding S.A. 'B' (e)(l)	3.258.324	353	0,00									
FINANZWERTE												
Cairo Mezz PLC (e)	3.408.327	685	0,00									
Corestate Capital Holding S.A. (e)(l)	2.109.837	0	0,00									
Eurobank Ergasias Services and Holdings S.A. 'A' (e)	20.532.490	36.504	0,05									
Stearns Holdings LLC 'B' (e)	1.114.539	0	0,00									
UBS Group AG	126.509	3.927	0,01									
Voyager Aviation Holdings LLC (e)	2.155	0	0,00									
		<u>41.116</u>	<u>0,06</u>									
GESUNDHEITSWESEN												
AMSURG Corp. (e)(l)	3.513.233	180.198	0,26									
INDUSTRIEWERTE												
Serta Simmons Bedding LLC (e)(l)	\$	842	\$ 10	0,00								
Sierra Hamilton Holder LLC (e)(l)	2.210.032	0	0,00									
Westmoreland Mining Holdings LLC (e)(l)	51.186	205	0,00									
Westmoreland Mining LLC (e)(l)	50.992	179	0,00									
		<u>394</u>	<u>0,00</u>									
IMMOBILIEN												
Adler Group S.A. (e)	10.156	6	0,00									
Adler Group S.A.	22.487	13	0,00									
Sunac Services Holdings Ltd.	2.723.136	653	0,00									
		<u>672</u>	<u>0,00</u>									
		<u>669.760</u>	<u>0,95</u>									
OPTIONSSCHEINE												
Constellation Oil Services Holding S.A. - Exp. 10.06.2071 (l)	4	0	0,00									
Guaranteed Rate, Inc. - Exp. 31. Dezember 2060	5.339	0	0,00									
Intelsat Emergence S.A. - Exp. 17. Februar 2027	160.093	411	0,00									
		<u>411</u>	<u>0,00</u>									
VORZUGSWERTPAPIERE												
Nationwide Building Society 10,250 %	£	859.974	142.838	0,20								
Voyager Aviation Holdings LLC 9,500 %	\$	12.927	0	0,00								
		<u>142.838</u>	<u>0,20</u>									
REAL ESTATE INVESTMENT TRUSTS												
CBL & Associates Properties, Inc.	95.496	2.332	0,00									
Uniti Group, Inc.	726.414	4.199	0,01									
VICI Properties, Inc.	5.793.243	184.688	0,26									
		<u>191.219</u>	<u>0,27</u>									
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE												
ARGENTINISCHE SCHATZWECHSEL												
(34,368) % fällig am 20.05.2024 (f)(g)		4.614.063	7.300	0,01								
(32,600) % fällig am 14.10.2024 (f)(g)	ARS	2.159.856	7.604	0,01								
		<u>14.904</u>	<u>0,02</u>									
UNGARISCHE SCHATZWECHSEL												
10,900 % fällig am 04.01.2024 (f)(g)	HUF	40.201.000	116.112	0,17								
JAPANISCHE SCHWATZWECHSEL												
(0,265) % fällig am 04.04.2024 (f)(g)	¥	13.910.000	98.718	0,14								
(0,257) % fällig am 04.04.2024 (f)(g)	¥	23.467.000	166.543	0,24								
(0,253) % fällig am 26.02.2024 (f)(g)		1.663.000	11.799	0,02								
(0,252) % fällig am 26.02.2024 (f)(g)		69.857.000	495.625	0,70								
(0,225) % fällig am 26.02.2024 (f)(g)		14.480.000	102.733	0,15								
(0,218) % fällig am 19.02.2024 (f)(g)		20.990.000	148.916	0,21								
(0,217) % fällig am 19.02.2024 (f)(g)		10.000.000	70.946	0,10								
(0,216) % fällig am 22.01.2024 (f)(g)		14.028.000	99.512	0,14								
(0,213) % fällig am 19.02.2024 (f)(g)		29.590.000	209.930	0,30								
(0,211) % fällig am 29.01.2024 (f)(g)		15.361.000	108.972	0,15								
(0,207) % fällig am 05.02.2024 (f)(g)		5.734.000	40.679	0,06								
(0,197) % fällig am 22.01.2024 (f)(g)		1.359.000	9.641	0,01								
(0,193) % fällig am 29.01.2024 (f)(g)		2.819.000	19.998	0,03								
(0,191) % fällig am 25.03.2024 (f)(g)		29.519.000	209.463	0,30								
(0,189) % fällig am 05.02.2024 (f)(g)		1.171.000	8.307	0,01								
(0,188) % fällig am 11.03.2024 (f)(g)		5.843.000	41.459	0,06								
(0,184) % fällig am 11.03.2024 (f)(g)		17.411.000	123.541	0,17								
(0,184) % fällig am 25.03.2024 (f)(g)		10.133.000	71.903	0,10								
(0,156) % fällig am 11.03.2024 (f)(g)		4.718.000	33.477	0,05								
(0,149) % fällig am 18.03.2024 (f)(g)		76.717.000	544.368	0,77								
		<u>2.616.530</u>	<u>3,71</u>									
Summe kurzfristige Instrumente		<u>2.747.546</u>	<u>3,90</u>									
Summe übertragbare Wertpapiere	\$	<u>96.949.829</u>	<u>137,44</u>									
AKTIEN												
INVESTMENTFONDS												
ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN												
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short- Term Floating NAV Fund (j)	152.110.411	1.515.725	2,15									
BÖRSENGEHANDELTE FONDS												
PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (j)	2.903.000	289.487	0,41									
Summe Investmentfonds	\$	<u>1.805.212</u>	<u>2,56</u>									

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende	% des Netto- vermögens
								Erlöse aus Pensions- geschäft ⁽¹⁾	
CEW	4,960 %	27.12.2023	03.01.2024	CAD 350.000	Province of Ontario 3,750 % fällig am 02.12.2053	\$ (147.735)	\$ 265.433	\$ 265.766	0,38
FICC	2,600	29.12.2023	02.01.2024	\$ 9.035	Province of Quebec 2,850 % fällig am 01.12.2053	(123.985)	9.035	9.037	0,01
					U.S. Treasury Notes 4,875 % fällig am 30.11.2025	(9.216)			
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (280.936)	\$ 274.468	\$ 274.803	0,39

(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	4.315	\$ (16.803)	(0,02)
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2025	1.188	4.418	0,01
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2026	1.289	2.933	0,00
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2024	1.498	7.892	0,01
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2025	1.206	3.143	0,00
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2024	1.990	12.145	0,02
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2025	1.087	3.348	0,00
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2026	1.206	2.686	0,00
3-Month SOFR September Futures	Short	12.2024	1.390	6.192	0,01
3-Month SOFR September Futures	Short	12.2025	986	2.314	0,00
Australia Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2024	230	(538)	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2024	3.713	(16.945)	(0,02)
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Long	03.2024	793	1.699	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2024	3.439	8.893	0,01
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2024	21.820	77.777	0,11
U.S. Treasury 10-Year Ultra March Futures	Long	03.2024	723	4.050	0,01
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Short	03.2024	6.124	(57.375)	(0,08)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2024	6.106	(72.131)	(0,10)
				\$ (26.302)	(0,04)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (26.302)	(0,04)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

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

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Airbus Finance BV	1,000 %	20.06.2028	€ 13.400	\$ 56	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2024	\$ 69.900	216	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2025	9.500	(44)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2026	9.400	(63)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2028	29.400	478	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2024	5.570	176	0,00
Boeing Co.	1,000	20.06.2025	11.800	283	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2025	11.700	336	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.12.2024	12.100	(632)	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.06.2026	3.300	(71)	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.12.2026	4.400	(96)	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.06.2027	3.300	46	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2024	18.900	(320)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.12.2024	44.900	(747)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2025	24.800	(437)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.12.2025	25.300	897	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2026	8.200	(147)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.12.2026	6.600	(51)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2027	11.500	84	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2024	7.600	195	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	53.500	424	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2026	6.700	47	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2025	€ 10.000	785	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2025	25.100	2.815	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2026	41.400	3.680	0,01
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2026	114.700	6.736	0,01
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2027	18.100	1.733	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2024	\$ 155.600	389	0,00

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Verizon Communications, Inc.	1,000 %	20.06.2026	\$ 6.700	\$ (81)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2026	32.300	(369)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2028	36.150	505	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2028	7.100	103	0,00
				\$ 16.926	0,02

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF⁽²⁾

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-35 5-Year Index	(1,000) %	20.12.2025	\$ 107.200	\$ 1.013	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-31 5-Year Index	1,000 %	20.06.2024	\$ 99.588	\$ 3.961	0,01
CDX.EM-32 5-Year Index	1,000	20.12.2024	71.910	3.553	0,01
CDX.EM-34 5-Year Index	1,000	20.12.2025	218.224	7.427	0,01
CDX.EM-35 5-Year Index	1,000	20.06.2026	1.380	40	0,00
CDX.EM-36 5-Year Index	1,000	20.12.2026	525.872	36.891	0,05
CDX.EM-37 5-Year Index	1,000	20.06.2027	6.958	477	0,00
CDX.EM-38 5-Year Index	1,000	20.12.2027	62.500	4.320	0,01
CDX.EM-39 5-Year Index	1,000	20.06.2028	31.300	1.514	0,00
CDX.EM-40 5-Year Index	1,000	20.12.2028	311.100	6.559	0,01
CDX.HY-34 5-Year Index	5,000	20.06.2025	4.984	(209)	0,00
CDX.HY-35 5-Year Index	5,000	20.12.2025	8.245	(237)	0,00
CDX.HY-36 5-Year Index	5,000	20.06.2026	413.317	14.081	0,02
CDX.HY-37 5-Year Index	5,000	20.12.2026	148.119	2.532	0,00
CDX.HY-38 5-Year Index	5,000	20.06.2027	26.869	1.993	0,00
CDX.HY-39 5-Year Index	5,000	20.12.2027	28.126	966	0,00
CDX.HY-40 5-Year Index	5,000	20.06.2028	19.701	1.246	0,00
CDX.HY-41 5-Year Index	5,000	20.12.2028	3.120.975	160.630	0,23
CDX.IG-37 5-Year Index	1,000	20.12.2026	1.400	(6)	0,00
CDX.IG-38 5-Year Index	1,000	20.06.2027	400	4	0,00
CDX.IG-39 5-Year Index	1,000	20.12.2027	200	1	0,00
CDX.IG-40 5-Year Index	1,000	20.06.2028	1.300	8	0,00
CDX.IG-41 5-Year Index	1,000	20.12.2028	1.658.600	9.687	0,01
				\$ 255.438	0,36

ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,500 %	16.09.2030	£ 254.700	\$ (6.731)	(0,01)
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	1,060	21.02.2052	14.400	(8.064)	(0,01)
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	1,096	14.02.2052	31.300	(17.288)	(0,02)
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	1,101	21.02.2052	14.400	(7.922)	(0,01)
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	1,175	28.02.2052	28.800	(15.294)	(0,02)
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,320	20.10.2033	20.700	2.308	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,500	20.03.2034	876.500	(88.839)	(0,13)
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	5,000	20.03.2029	1.488.000	698	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	20.09.2026	¥ 48.830.000	(3.235)	(0,01)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.03.2029	344.670.000	12.946	0,02
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,020	20.09.2028	395.820.000	51.710	0,07
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,176	27.04.2027	22.270.000	(422)	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	15.06.2032	31.750.700	3.128	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,500	15.03.2042	15.498.000	4.986	0,01
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,711	27.04.2042	5.408.000	1.870	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,500	16.06.2026	\$ 1.090.500	(62.923)	(0,09)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,500	16.06.2028	2.503.737	(205.176)	(0,29)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,550	15.01.2031	4.567.800	937.074	1,33
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,674	05.08.2030	62.900	12.158	0,02
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,678	29.07.2030	65.200	12.595	0,02
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,711	28.07.2030	69.000	13.193	0,02
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,715	27.07.2030	200.000	38.285	0,05
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,750	30.03.2031	963.600	176.905	0,25
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,750	16.06.2031	3.358.883	(341.865)	(0,49)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,800	15.01.2051	1.479.300	748.315	1,06
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,928	06.05.2026	150.100	12.299	0,02
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,975	17.06.2052	52.200	19.186	0,03
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,990	24.06.2052	75.000	27.214	0,04
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,000	26.01.2024	154.700	(1.342)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,000	15.06.2027	386.590	29.742	0,04
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,000	15.06.2029	495.770	48.594	0,07
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,000	16.12.2030	120.615	19.985	0,03

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,035 %	28.06.2052	\$ 25.900	\$ 9.106	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,144	04.11.2050	49.600	(20.801)	(0,03)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,150	30.03.2051	191.500	5.835	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,215	13.10.2050	83.500	(35.074)	(0,05)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,235	12.05.2028	75.400	8.492	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,250	15.12.2026	1.654.500	(152.064)	(0,22)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,250	15.06.2032	15.560	2.232	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,250	15.06.2032	635.270	(61.879)	(0,09)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,250	16.06.2051	1.456.600	337.622	0,48
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,280	24.03.2028	423.400	(40.647)	(0,06)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,306	02.11.2051	48.000	16.537	0,02
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,317	16.12.2050	33.800	(13.120)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,350	20.01.2027	109.100	8.952	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,360	15.02.2027	387.430	30.934	0,04
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,360	20.07.2031	91.400	15.025	0,02
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,370	19.07.2031	61.300	10.037	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,380	04.01.2027	212.800	(17.028)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,405	07.09.2031	154.300	24.763	0,03
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,418	20.01.2027	71.900	(5.623)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,420	24.02.2027	269.100	20.797	0,03
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,425	18.01.2027	146.000	(11.262)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,443	18.01.2027	157.300	(12.051)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,450	17.02.2027	361.600	27.764	0,04
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,450	16.07.2031	137.000	21.980	0,03
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,485	13.01.2051	78.100	(29.089)	(0,04)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,500	15.12.2028	473.684	(59.621)	(0,08)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,500	12.01.2029	85.443	9.467	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,500	05.10.2031	89.100	(13.779)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,518	20.01.2029	43.100	(4.622)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,535	15.10.2031	88.600	(13.462)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,535	22.10.2031	59.100	(8.921)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,545	26.10.2031	58.900	(8.843)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,550	20.01.2027	485.100	(34.929)	(0,05)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,570	11.01.2027	121.400	(8.888)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,570	12.01.2027	76.200	(5.580)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,573	28.02.2027	96.300	(8.969)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,580	16.02.2027	150.400	(10.500)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,595	13.01.2051	82.600	(29.048)	(0,04)
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,600	16.01.2026	943.900	31.553	0,04
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,600	15.02.2027	1.549.700	(106.180)	(0,15)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,618	09.02.2029	27.100	(3.211)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,620	18.04.2027	153.700	(13.441)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,630	20.01.2029	60.000	(6.096)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,630	26.01.2029	72.000	(7.253)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,650	24.02.2027	897.000	(59.317)	(0,08)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,650	08.02.2032	91.900	(14.329)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,655	24.01.2032	72.000	(10.482)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,700	06.03.2024	344.400	(1.672)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,700	17.02.2027	1.446.200	(93.731)	(0,13)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,700	12.01.2029	310.700	(30.113)	(0,04)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,730	24.02.2032	86.300	(12.845)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,735	12.01.2032	57.800	(8.126)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.06.2029	190.144	9.438	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.06.2032	209.290	11.637	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.06.2032	96.400	(7.798)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,765	16.03.2032	30.400	(4.382)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,770	14.02.2032	81.500	(11.930)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,783	22.04.2027	114.300	(9.211)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,785	12.08.2051	76.100	25.811	0,04
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,788	03.05.2027	114.800	(9.177)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,815	24.01.2052	14.400	(4.543)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,817	05.04.2032	318.600	(44.207)	(0,06)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,867	26.01.2052	14.400	(4.392)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,872	06.04.2032	160.000	(21.467)	(0,03)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,928	25.03.2027	159.500	(12.453)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,945	23.06.2051	127.800	38.797	0,05
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,988	09.02.2032	22.000	2.586	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	21.12.2027	193.480	(2.353)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	21.12.2029	910.590	9.116	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	18.02.2032	133.700	(15.287)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	21.12.2032	1.477.810	(4.515)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	15.12.2051	324.000	14.044	0,02
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,008	09.02.2032	36.700	4.302	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,185	21.04.2029	96.000	(8.013)	(0,01)
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,300	17.01.2026	678.900	22.155	0,03
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,350	17.01.2025	1.204.900	27.206	0,04
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,370	21.06.2027	159.400	(8.651)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,385	08.06.2032	26.800	2.276	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,430	30.09.2027	230.020	11.426	0,02
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,450	20.12.2024	2.408.100	56.184	0,08
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,450	04.10.2027	221.690	10.768	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,451	08.06.2032	90.600	7.325	0,01

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,468 %	27.07.2028	\$ 79.800	\$ (2.755)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,537	24.07.2053	20.300	(1.719)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,550	21.07.2053	20.300	(1.688)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,605	28.06.2027	158.600	(6.995)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,675	24.07.2028	81.100	(2.090)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,680	11.07.2032	27.300	(1.551)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,690	11.07.2032	27.300	(1.525)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,700	21.07.2028	79.700	(1.971)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,765	27.07.2024	377.400	(7.176)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,841	31.10.2024	77.400	(1.127)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,850	30.08.2027	137.400	(4.252)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,880	30.09.2027	657.200	(16.659)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,900	04.10.2027	633.400	(15.537)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,910	14.11.2024	78.600	(1.067)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,920	17.10.2024	96.700	(1.448)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,955	04.10.2027	141.800	(3.226)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,973	27.10.2024	77.700	(1.043)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,993	13.10.2024	82.900	(1.149)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,000	21.06.2030	2.179.420	57.883	0,08
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,000	21.06.2033	710.885	24.844	0,03
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,018	24.10.2024	77.900	(1.047)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,050	21.07.2024	377.000	(6.206)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,050	07.09.2027	69.900	(1.595)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,050	08.09.2029	69.900	(1.706)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,050	06.09.2032	104.600	(3.159)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,052	24.07.2024	376.700	(6.102)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,080	23.02.2053	29.400	(1.603)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,088	07.11.2024	77.800	(894)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,100	09.09.2029	70.000	(1.506)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,140	25.10.2024	77.500	(903)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,190	25.10.2024	77.500	(871)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,225	25.10.2024	77.500	(845)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,250	21.06.2028	2.045.860	49.091	0,07
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,300	06.03.2033	54.100	(1.397)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,340	23.02.2030	86.000	(1.824)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,350	14.12.2032	28.200	398	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,370	01.03.2033	52.300	(990)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,370	12.07.2053	40.100	260	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,400	23.02.2033	49.800	(829)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,405	01.03.2033	53.700	(860)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,420	24.05.2033	88.200	(1.017)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,425	01.03.2033	53.900	(794)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,430	27.02.2033	53.600	(762)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,450	07.03.2033	109.100	(1.381)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,470	22.02.2030	102.500	(1.324)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	21.06.2026	195.110	3.168	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	22.06.2030	175.800	(960)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2030	4.138.645	(51.623)	(0,07)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	22.05.2033	5.163.180	(4.422)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	21.06.2033	117.200	(326)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2033	290.730	8.838	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,525	02.03.2030	37.900	(374)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,610	12.12.2032	56.700	(308)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,650	22.11.2024	155.600	(1.423)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,650	05.12.2024	158.300	(1.427)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,650	10.07.2033	60.400	576	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,684	03.01.2034	26.000	(362)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,700	06.06.2033	3.050.720	(2.843)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,730	03.08.2033	30.800	553	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,735	07.08.2033	33.100	626	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	21.11.2024	155.600	(1.255)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	11.12.2024	159.200	(1.238)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	13.12.2027	141.600	(260)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.12.2028	1.360.714	(19.425)	(0,03)
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2029	1.477.600	(593)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	12.07.2033	57.200	1.057	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	02.01.2034	26.000	(511)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,760	23.08.2033	97.900	2.133	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,800	10.03.2028	104.800	(180)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,800	22.08.2030	24.500	393	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,800	30.08.2033	49.300	1.253	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,810	02.01.2034	26.000	(642)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,830	12.10.2053	15.600	1.536	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,842	26.12.2033	26.000	(700)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,854	29.12.2033	52.000	(1.460)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,870	17.10.2053	15.700	1.661	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,880	16.10.2053	15.700	1.690	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,900	30.08.2033	49.400	1.664	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,950	13.09.2033	146.600	5.669	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,950	19.12.2033	51.500	(1.841)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,030	04.10.2033	103.700	4.811	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,030	15.12.2033	51.700	(2.178)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,040 %	20.06.2024	\$ 364.200	\$ (2.825)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,060	20.06.2024	1.457.000	(11.009)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,140	22.06.2024	607.100	(4.077)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,150	12.10.2033	49.900	2.866	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,165	27.09.2033	115.400	6.707	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,170	03.10.2033	81.600	4.783	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,175	10.10.2033	50.000	2.955	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,200	18.10.2033	39.900	2.449	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,220	20.10.2033	50.300	3.180	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,230	23.10.2033	25.100	1.614	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	20.03.2029	208.940	(1.080)	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	20.03.2031	239.020	(1.564)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	22.11.2033	51.700	(3.068)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,255	23.10.2033	25.100	1.668	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,393	25.10.2033	23.500	1.834	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,435	01.11.2033	26.400	2.181	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,450	31.10.2033	29.800	2.485	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,450	01.11.2033	51.700	4.343	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,500	22.05.2025	11.396.340	(23.425)	(0,03)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,900	06.06.2025	6.663.690	13.983	0,02
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	5,100	22.05.2024	22.102.670	(23.332)	(0,03)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	5,400	06.06.2024	12.921.420	13.805	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,874	02.01.2026	BRL 453.700	(365)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,899	02.01.2026	229.400	(163)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,939	02.01.2026	366.700	(189)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,998	04.01.2027	669.600	(31)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,037	04.01.2027	163.900	27	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,041	04.01.2027	696.800	90	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,052	02.01.2026	857.800	(125)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,085	02.01.2026	851.400	(36)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,090	04.01.2027	1.313.900	436	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,105	02.01.2026	843.500	(9)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,138	04.01.2027	326.900	179	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,157	02.01.2025	26.500	(109)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,177	02.01.2025	17.600	(71)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,250	04.01.2027	32.000	64	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,275	04.01.2027	16.100	35	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,290	04.01.2027	16.200	37	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,367	02.01.2025	21.800	(68)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,731	04.01.2027	8.300	43	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,746	04.01.2027	35.900	191	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,901	04.01.2027	85.800	545	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,018	02.01.2025	59.500	(2)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,098	02.01.2025	98.900	33	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,158	02.01.2025	49.800	31	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,163	02.01.2025	48.800	31	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,178	02.01.2025	99.600	71	0,00
Erhalt	3-Month CAD-Bank Bill	1,000	16.06.2047	CAD 2.600	625	0,00
Erhalt	3-Month CAD-Bank Bill	1,300	16.06.2047	2.500	571	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	3,400	20.06.2029	6.300	(576)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,750	20.12.2025	1.042.300	15.716	0,02
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,360	07.08.2028	ZAR 550.900	481	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,380	04.08.2028	275.800	254	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,400	07.08.2028	550.900	529	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,410	31.07.2028	252.300	250	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,410	04.08.2028	664.400	655	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,410	07.08.2028	162.900	160	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,415	31.07.2028	201.400	202	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,415	04.08.2028	275.800	275	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,420	31.07.2028	753.500	763	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,421	04.08.2028	281.900	285	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,426	01.08.2028	304.400	311	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,428	31.07.2028	501.600	516	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,460	01.08.2028	513.900	563	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,460	02.08.2028	520.900	571	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,464	02.08.2028	522.200	577	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,543	04.08.2028	280.700	358	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,550	03.08.2028	554.000	716	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	2,750	17.06.2026	AUD 72.880	(1.217)	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	3,000	21.03.2027	1.179.040	(42.514)	(0,06)
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	3,250	17.12.2024	197.200	(7.414)	(0,01)
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	3,500	17.06.2025	361.600	(18.501)	(0,03)
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,250	17.12.2024	97.200	(8.276)	(0,01)
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,750	18.06.2024	124.400	(13.180)	(0,02)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,150	18.03.2030	€ 907.700	(20.954)	(0,03)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,150	17.06.2030	244.000	(8.980)	(0,01)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,294	30.06.2026	6.200	496	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,329	30.12.2025	13.200	888	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,363	30.06.2025	20.500	1.179	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,395	30.12.2024	10.800	453	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,425	28.06.2024	24.600	651	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	17.06.2050	126.900	55.316	0,08

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650 %	12.04.2027	€ 331.900	\$ (21.452)	(0,03)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,700	11.04.2027	113.000	(7.148)	(0,01)
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,830	09.12.2052	1.064.900	62.014	0,09
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027	243.100	(12.070)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	18.05.2027	116.300	(5.707)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,750	21.09.2027	355.500	(12.248)	(0,02)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,000	17.09.2024	149.000	21.306	0,03
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,000	21.09.2032	170.580	(12.647)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	11.04.2024	197.900	509	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	13.04.2024	407.800	1.153	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	17.05.2024	183.200	549	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	26.04.2024	200.100	1.099	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	28.04.2024	184.600	853	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	03.05.2024	184.500	849	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,547	09.03.2033	127.800	4.862	0,01
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	20.03.2054	300	34	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	2,760	03.01.2029	40.900	(610)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,880	19.12.2028	58.400	(1.185)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,890	22.12.2033	46.700	(1.589)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,910	29.12.2033	29.300	(1.076)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,920	13.12.2028	70.700	(1.544)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,950	29.12.2028	35.200	(866)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,970	15.12.2033	47.100	(1.951)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,990	08.12.2033	41.100	(1.772)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,063	06.12.2033	29.400	(1.476)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,128	04.12.2033	23.500	(1.312)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,148	20.11.2033	37.500	(2.144)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,179	29.11.2028	29.400	(997)	0,00
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,250	20.03.2029	439.600	(269)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,250	06.11.2033	38.300	(2.530)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,255	22.11.2028	29.400	(1.104)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,270	08.11.2028	62.400	(2.331)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	3,270	21.08.2033	35.300	2.640	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,280	22.11.2033	17.800	(1.246)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	3,300	03.10.2033	105.000	8.207	0,01
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,305	27.11.2033	36.600	(2.653)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	3,370	09.10.2028	62.900	2.873	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	3,450	20.10.2028	61.700	3.069	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,165	06.09.2032	MXN 266.600	(1.282)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,360	21.08.2037	285.500	(1.047)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,380	14.08.2037	111.200	164	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,480	18.06.2037	337.300	(1.656)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,495	14.01.2032	2.373.500	(7.852)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,498	15.01.2032	5.192.600	(17.104)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,498	19.06.2037	810.000	(3.930)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,103	04.01.2038	3.750.800	4.149	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,280	28.11.2036	690.000	(4.279)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,300	16.06.2028	665.100	(221)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,310	28.11.2036	1.066.400	(6.745)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,410	31.03.2027	1.182.400	1.240	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,444	25.07.2028	1.502.800	(688)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,471	26.07.2028	757.500	(296)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,512	24.07.2028	1.136.300	(354)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,550	27.07.2028	383.300	(80)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,556	27.07.2028	2.280.700	(443)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,600	31.07.2028	610.800	(42)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,620	28.07.2028	361.800	(16)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,636	28.07.2028	722.200	(6)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,640	28.07.2028	144.800	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,650	28.07.2028	365.300	8	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,660	04.04.2024	2.723.700	1.409	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,660	28.07.2028	361.100	16	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,675	03.04.2024	9.876.200	5.089	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,701	31.03.2032	905.900	(770)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,730	06.04.2027	787.600	369	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,732	30.03.2032	394.000	(376)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,750	05.04.2024	1.956.500	978	0,00
Zahlung	UKRPI	4,000	15.09.2031	£ 53.800	(8.082)	(0,01)
Zahlung	UKRPI	4,020	15.10.2031	69.900	(9.977)	(0,01)
Zahlung	UKRPI	4,055	15.09.2031	49.800	(7.339)	(0,01)
Zahlung	UKRPI	4,066	15.09.2031	96.800	(12.525)	(0,02)
Zahlung	UKRPI	4,140	15.10.2031	135.400	(17.102)	(0,02)
Zahlung	UKRPI	4,250	15.11.2031	135.600	(13.360)	(0,02)
Zahlung	UKRPI	4,400	15.10.2031	60.700	(6.089)	(0,01)
					\$ 912.928	1,30
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ 1.186.305	1,68

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

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

- (2) Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rücklerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (3) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.
- (4) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Netto- vermögens
FAR	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,243 %	05.08.2024	291.100	\$ 3.930	\$ 564	0,00
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,243	05.08.2024	291.100	3.930	7.138	0,01
GLM	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,110	26.07.2032	59.200	9.590	5.940	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,110	26.07.2032	85.900	13.916	19.128	0,03
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,620	22.07.2024	869.400	6.520	765	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,620	22.07.2024	869.400	6.520	10.931	0,01
	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,590	19.07.2024	616.200	8.473	1.606	0,00
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,590	19.07.2024	616.200	8.473	11.910	0,02
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,170	19.07.2032	68.100	10.801	6.977	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,170	19.07.2032	76.800	12.180	16.615	0,02
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,400	20.07.2027	68.100	8.986	4.442	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,400	20.07.2027	76.800	10.134	14.701	0,02
							\$ 103.453	\$ 100.717	0,14

VERKAUFSOPTIONEN

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BOA	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,288 %	19.01.2024	15.900	\$ (66)	(63)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,738	19.01.2024	15.900	(66)	(32)	0,00
BPS	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,494	08.01.2024	26.500	(122)	(197)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,545	16.01.2024	54.100	(243)	(679)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,994	08.01.2024	26.500	(122)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,995	16.01.2024	54.100	(243)	(14)	0,00
CBK	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,690	02.04.2024	41.500	(326)	(11)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,690	02.04.2024	41.500	(326)	(664)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,235	22.01.2024	53.200	(218)	(169)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,685	22.01.2024	53.200	(218)	(155)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,310	18.01.2024	22.900	(90)	(68)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,590	05.01.2024	35.700	(132)	(403)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,700	18.01.2024	22.900	(90)	(68)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,960	05.01.2024	35.700	(132)	(1)	0,00
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,697	02.04.2024	249.100	(1.954)	(68)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,697	02.04.2024	249.100	(1.954)	(3.972)	0,01
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,721	08.04.2024	80.600	(608)	(25)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,721	08.04.2024	80.600	(608)	(1.247)	0,01
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,215	22.01.2024	53.000	(215)	(151)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,285	19.01.2024	26.700	(111)	(104)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300	16.01.2024	51.700	(220)	(174)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,560	05.01.2024	53.500	(274)	(564)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,594	05.01.2024	53.500	(267)	(683)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,648	04.01.2024	52.100	(237)	(843)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,665	22.01.2024	53.000	(215)	(171)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,735	19.01.2024	26.700	(111)	(55)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	16.01.2024	51.700	(220)	(72)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,010	05.01.2024	53.500	(274)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,044	05.01.2024	53.500	(267)	0	0,00
GST	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,440	08.01.2024	59.100	(135)	(206)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,860	08.01.2024	59.100	(135)	(2)	0,00
JPM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,170	29.01.2024	26.100	(113)	(82)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,205	22.01.2024	26.500	(109)	(71)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	18.01.2024	26.700	(132)	(139)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,600	12.01.2024	25.500	(117)	(402)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,620	29.01.2024	26.100	(113)	(133)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,655	22.01.2024	26.500	(109)	(90)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	18.01.2024	26.700	(132)	(46)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,050	12.01.2024	25.500	(117)	(5)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,490	12.01.2024	35.600	(141)	(275)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,650	04.01.2024	46.900	(170)	(740)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,890	12.01.2024	35.600	(141)	(22)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,030	04.01.2024	46.900	(170)	0	0,00
MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,455	08.01.2024	53.200	(258)	(301)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,475	08.01.2024	26.500	(125)	(173)	0,00

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Netto- vermögens
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,600 %	12.01.2024	25.500	\$ (117)	\$ (402)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,670	04.01.2024	52.900	(249)	(949)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,955	08.01.2024	53.200	(258)	(2)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,975	08.01.2024	26.500	(125)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,050	12.01.2024	25.500	(117)	(5)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,120	04.01.2024	52.900	(249)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,330	15.01.2024	35.500	(150)	(93)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,740	15.01.2024	35.500	(150)	(64)	0,00
UAG	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,344	18.01.2024	26.700	(130)	(135)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,744	18.01.2024	26.700	(130)	(48)	0,00
							\$ (13.821)	\$ (15.040)	(0,02)

ZINSCAPS

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Netto- vermögens	
FAR	Call - OTC 2-Year Interest Rate Cap ⁽²⁾	2-Year USD-LIBOR	0,022 %	08.08.2026	291.100	\$ (5.021)	\$ (8.079)	(0,01)	
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Floor ⁽²⁾	2-Year USD-LIBOR	0,022	08.08.2026	291.100	(5.021)	(1.554)	0,00	
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Cap ⁽²⁾	1-Year USD-LIBOR	0,026	23.07.2025	869.400	(7.615)	(11.830)	(0,02)	
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Floor ⁽²⁾	1-Year USD-LIBOR	0,026	23.07.2025	869.400	(7.615)	(1.751)	0,00	
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Floor	1-Year USD-LIBOR	0,030	24.07.2024	1.738.800	(6.941)	(70)	0,00	
	Call - OTC 2-Year Interest Rate Cap ⁽²⁾	2-Year USD-LIBOR	0,026	23.07.2026	616.200	(10.898)	(14.505)	(0,02)	
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Floor ⁽²⁾	2-Year USD-LIBOR	0,026	23.07.2026	616.200	(10.897)	(4.104)	(0,01)	
							\$ (54.008)	\$ (41.893)	(0,06)

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Netto- vermögens		
BOA	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.01.2054	\$ 97,891	09.01.2024	57.000	\$ (223)	\$ (645)	0,00		
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 6,000 % fällig am 01.02.2054	101,094	06.02.2024	44.500	(177)	(360)	0,00		
JPM	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 6,000 % fällig am 01.02.2054	99,227	06.02.2024	28.500	(156)	(18)	0,00		
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 6,000 % fällig am 01.02.2054	101,227	06.02.2024	28.500	(107)	(206)	0,00		
MSC	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.01.2054	98,406	09.01.2024	29.500	(134)	(210)	0,00		
SAL	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.02.2054	95,813	06.02.2024	56.500	(311)	(252)	0,00		
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.02.2054	97,813	06.02.2024	56.500	(293)	(307)	0,00		
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.01.2054	98,469	09.01.2024	47.500	(219)	(316)	0,00		
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.01.2054	99,906	09.01.2024	27.000	(70)	(19)	0,00		
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.02.2054	96,813	06.02.2024	45.500	(121)	(86)	0,00		
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.02.2054	100,813	06.02.2024	45.500	(76)	(81)	0,00		
							\$ (1.887)	\$ (2.500)	0,00

(1) Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

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

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Netto- vermögens		
BOA	HSBC Holdings PLC	(1,000) %	20.06.2024	€ 1.300	\$ 22	\$ (28)	\$ (6)	0,00		
	UBS AG	(1,000)	20.06.2024	\$ 19.300	1.254	(1.312)	(58)	0,00		
BPS	UBS AG	(1,000)	20.06.2024	7.000	458	(479)	(21)	0,00		
							\$ 1.734	\$ (1.819)	\$ (85)	0,00

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Netto- vermögens
BOA	South Africa Government International Bond	1,000 %	20.12.2026	\$ 5.500	\$ (241)	\$ 206	\$ (35)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2024	10.800	(998)	1.039	41	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	23.000	(2.501)	2.600	99	0,00
BPS	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	14.700	(705)	715	10	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	2.900	(259)	244	(15)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	4.000	(287)	304	17	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2025	1.300	(223)	220	(3)	0,00
BRC	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2024	7.070	(658)	685	27	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	84.600	(11.485)	11.848	363	0,00
BYL	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	15.260	(1.322)	1.388	66	0,00
CBK	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2024	168.400	(2.908)	4.129	1.221	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2024	10.000	(102)	146	44	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2024	29.600	116	118	234	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2026	42.900	(1.989)	2.280	291	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	10.600	(381)	388	7	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	52.400	(847)	1.086	239	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2026	31.000	(203)	679	476	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2024	12.600	(1.154)	1.202	48	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens	
GST	Turkey Government International Bond	1,000 %	20.12.2024	4.700 \$	(490)	\$ 510	\$ 20	0,00	
	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2024	176.800	(2.751)	4.034	1.283	0,01	
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	17.600	(687)	699	12	0,00	
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	8.200	(731)	688	(43)	0,00	
	Equinix, Inc.	5,000	20.06.2027	9.000	1.258	(196)	1.062	0,00	
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.12.2028	20.200	0	273	273	0,00	
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	60.300	(502)	1.013	511	0,00	
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2027	2.400	(101)	132	31	0,00	
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2028	9.800	(103)	158	55	0,00	
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2025	10.200	(565)	605	40	0,00	
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2026	4.800	(215)	185	(30)	0,00	
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2024	37.500	(3.786)	3.929	143	0,00	
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	58.600	(6.583)	6.835	252	0,00	
	HUS	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2024	51.700	(1.513)	1.726	213	0,00
Colombia Government International Bond		1,000	20.06.2024	32.400	(93)	237	144	0,00	
JPM	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2026	2.200	(101)	116	15	0,00	
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	3.500	(135)	137	2	0,00	
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2026	33.200	(259)	769	510	0,00	
MBC	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	6.200	(676)	703	27	0,00	
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	21.700	(781)	796	15	0,00	
MYC	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	24.900	(2.220)	2.088	(132)	0,00	
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	47.400	(418)	819	401	0,00	
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2025	5.300	(73)	150	77	0,00	
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2026	56.100	(326)	1.187	861	0,00	
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2026	44.400	68	648	716	0,00	
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2027	40.600	(137)	727	590	0,00	
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2028	17.300	(335)	495	160	0,00	
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2028	74.600	(787)	1.204	417	0,00	
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2026	124.200	(5.441)	4.658	(783)	0,00	
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2024	17.500	(1.945)	2.012	67	0,00	
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	4.600	(518)	538	20	0,00	
					\$ (57.093)	\$ 67.152	\$ 10.059	0,01	

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽²⁾

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	ABX.HE.AA.6-1 Index	0,320 %	25.07.2045	\$ 661	\$ (228)	\$ 178	\$ (50)	0,00
	ABX.HE.AAA.6-2 Index	0,110	25.05.2046	30.130	(7.681)	6.490	(1.191)	0,00
	CMBX.NA.AS.6 Index	1,000	11.05.2063	83	0	0	0	0,00
BRC	ABX.HE.AAA.6-2 Index	0,110	25.05.2046	2.370	(602)	508	(94)	0,00
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	16.12.2072	100.000	(1.840)	1.169	(671)	0,00
	CMBX.NA.AS.6 Index	1,000	11.05.2063	570	(19)	19	0	0,00
	PRIMEX.ARM.2-AAA Index	4,580	25.12.2037	194	8	(5)	3	0,00
CBK	CDX.HY-33 5-Year Index 35-100 %	5,000	20.12.2024	57.942	9.647	(6.821)	2.826	0,00
DUB	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	233.645	(4.705)	4.686	(19)	0,00
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	512.161	(3.542)	2.673	(869)	0,00
FBF	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	162.200	(1.133)	503	(630)	0,00
	ABX.HE.AAA.6-2 Index	0,110	25.05.2046	778	(187)	156	(31)	0,00
GST	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	1.176.350	(15.149)	15.051	(98)	0,00
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	912.039	2.357	(3.905)	(1.548)	0,00
	CMBX.NA.AAA.13 Index	0,500	16.12.2072	86.300	(1.494)	915	(579)	0,00
	CMBX.NA.AAA.15 Index	0,500	18.11.2064	473.700	(13.688)	7.075	(6.613)	(0,01)
JPS	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	171.400	(2.957)	2.943	(14)	0,00
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	171.700	(1.351)	1.060	(291)	0,00
MEI	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	45.500	(336)	159	(177)	0,00
	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	66.700	(1.419)	1.413	(6)	0,00
MYC	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	364.800	(3.092)	2.473	(619)	0,00
	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	923.900	(14.119)	10.530	(3.589)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.13 Index	0,500	16.12.2072	379.100	507	(3.052)	(2.545)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.14 Index	0,500	16.12.2072	171.300	(4.147)	2.476	(1.671)	0,00
	CMBX.NA.AAA.15 Index	0,500	18.11.2064	74.400	(631)	(408)	(1.039)	0,00
	CMBX.NA.AS.6 Index	1,000	11.05.2063	50	(2)	2	0	0,00
	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	810.495	(7.907)	7.840	(67)	0,00
SAL	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	152.400	(785)	526	(259)	0,00
	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	1.386.500	(13.794)	8.409	(5.385)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.13 Index	0,500	16.12.2072	88.800	0	(596)	(596)	0,00
UAG	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	15.500	(445)	444	(1)	0,00
				\$ (88.734)	\$ 62.911	\$ (25.823)	(0,04)	

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

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

⁽³⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
MYC	Erhalt	iBoxx USD Liquid Investment Grade Index	k. A.	5,066 %	\$ 15.400	20.03.2024	\$ 5	\$ (33)	\$ (28)	0,00

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	01.2024	AUD 74.751	\$ 49.517	\$ 0	\$ (1.499)	\$ (1.499)	0,00
	03.2024	CNH 1.985.385	275.453	0	(4.971)	(4.971)	(0,01)
BOA	01.2024	£ 96.968	123.151	0	(467)	(467)	0,00
	01.2024	NZD 786	479	0	(19)	(19)	0,00
	01.2024	\$ 8.567	£ 6.774	69	0	69	0,00
	01.2024	6.428	MXN 109.352	0	0	0	0,00
	01.2024	38.096	ZAR 732.351	1.897	0	1.897	0,00
	03.2024	CNH 2.794.394	\$ 385.812	0	(8.880)	(8.880)	(0,01)
	03.2024	IDR 969.195.415	61.645	0	(1.204)	(1.204)	0,00
	03.2024	\$ 29.195	IDR 451.932.631	112	(1)	111	0,00
	03.2024	117.768	INR 9.854.502	245	0	245	0,00
	06.2024	KRW 53.331.055	\$ 40.994	0	(520)	(520)	0,00
BPS	01.2024	BRL 772.230	158.614	18	(378)	(360)	0,00
	01.2024	CNH 4	1	0	0	0	0,00
	01.2024	€ 176.386	192.278	1	(2.612)	(2.611)	0,00
	01.2024	£ 364.111	461.830	5	(2.358)	(2.353)	0,00
	01.2024	HUF 6.880.530	19.593	0	(289)	(289)	0,00
	01.2024	¥ 7.139.800	49.498	0	(1.178)	(1.178)	0,00
	01.2024	KRW 17.144.832	13.050	0	(197)	(197)	0,00
	01.2024	\$ 8.299	AUD 12.400	168	(4)	164	0,00
	01.2024	12.000	BRL 58.938	133	0	133	0,00
	01.2024	3.830	CAD 5.174	94	0	94	0,00
	01.2024	33.121	€ 30.035	95	(31)	64	0,00
	01.2024	25.271	£ 19.882	75	0	75	0,00
	01.2024	135	HKD 1.057	0	0	0	0,00
	01.2024	12	HUF 4.166	0	0	0	0,00
	01.2024	32.650	IDR 505.014.183	119	0	119	0,00
	01.2024	1.010.475	¥ 148.247.278	41.736	0	41.736	0,06
	01.2024	178	KRW 228.954	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	28.227	MXN 495.000	872	0	872	0,00
	01.2024	127.809	ZAR 2.369.536	1.590	0	1.590	0,00
	02.2024	TWD 18.064.770	\$ 566.155	0	(30.870)	(30.870)	(0,04)
	02.2024	\$ 161.272	BRL 801.455	3.450	0	3.450	0,00
	03.2024	CNH 1.856.000	\$ 257.894	1	(4.256)	(4.255)	(0,01)
	03.2024	IDR 9.738.717	619	0	(12)	(12)	0,00
	03.2024	TWD 10.466.903	335.909	0	(10.913)	(10.913)	(0,02)
	03.2024	\$ 3.054	CNH 22.103	68	0	68	0,00
	03.2024	121.150	IDR 1.860.716.263	0	(490)	(490)	0,00
	03.2024	124.321	INR 10.398.052	210	(10)	200	0,00
	04.2024	70.860	BRL 347.640	118	0	118	0,00
	06.2024	KRW 219.711.705	\$ 168.179	1	(2.852)	(2.851)	(0,01)
BRC	01.2024	HKD 19	2	0	0	0	0,00
	01.2024	IDR 1.042.945	68	0	0	0	0,00
	01.2024	KRW 38.575.155	29.850	59	0	59	0,00
	01.2024	\$ 1.428	AUD 2.171	54	0	54	0,00
	01.2024	1.033	CAD 1.378	12	0	12	0,00
	01.2024	1.080	CHF 942	40	0	40	0,00
	01.2024	2.037	£ 1.600	3	0	3	0,00
	01.2024	1.595	MXN 28.268	67	0	67	0,00
	01.2024	112.118	TRY 3.362.941	266	(156)	110	0,00
	01.2024	28.637	ZAR 533.323	488	0	488	0,00
	02.2024	¥ 146.580.000	\$ 987.006	0	(60.797)	(60.797)	(0,09)
	02.2024	TRY 5.561	184	2	0	2	0,00
	02.2024	TWD 6.133	194	0	(8)	(8)	0,00
	02.2024	\$ 80.820	TRY 2.464.183	164	(291)	(127)	0,00
	03.2024	HKD 67	\$ 9	0	0	0	0,00
	03.2024	¥ 116.369.000	825.041	0	(10.171)	(10.171)	(0,02)
	03.2024	SGD 83	63	0	0	0	0,00
	03.2024	\$ 20.557	IDR 319.578.330	166	0	166	0,00
	03.2024	63.833	INR 5.314.736	0	(186)	(186)	0,00
	03.2024	5.839	SGD 7.751	58	0	58	0,00
	03.2024	130.950	TRY 4.116.588	35	(1.111)	(1.076)	0,00
	04.2024	¥ 26.379.000	\$ 188.360	0	(1.404)	(1.404)	0,00
	04.2024	\$ 131.165	TRY 4.229.120	0	(1.850)	(1.850)	0,00
	06.2024	KRW 226.231.724	\$ 173.331	0	(2.773)	(2.773)	0,00
BSH	01.2024	\$ 793	MXN 14.614	66	0	66	0,00
CBK	01.2024	BRL 112.008	\$ 23.004	0	(54)	(54)	0,00
	01.2024	CHF 886	1.017	0	(36)	(36)	0,00
	01.2024	COP 20.000.000	4.886	0	(247)	(247)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	01.2024	€	17.076	\$	18.525	\$	0
	01.2024	£	31.782		40.238		0
	01.2024	HUF	1.005.951		2.870		0
	01.2024	IDR	442.799.031		28.767		0
	01.2024	MXN	3.996.271		226.820		0
	01.2024	TRY	336		11		0
	01.2024	\$	6.560	AUD	9.721		0
	01.2024		200.000	BRL	996.040	5.048	0
	01.2024		1.601	CAD	2.166		0
	01.2024		7.482	€	6.760		0
	01.2024		7.321	£	5.782		0
	01.2024		779	HKD	6.084		0
	01.2024		151.380	MXN	2.770.928	11.515	0
	01.2024		505	ZAR	9.490		0
	01.2024	ZAR	678.072	\$	35.931		0
	03.2024	IDR	4.228.779		273		0
	03.2024	ILS	125		34		0
	03.2024	PEN	167.562		44.491		0
	03.2024	\$	409.145	BRL	2.025.225	5.262	0
	03.2024		28.767	IDR	442.912.662		0
	03.2024		5.739	INR	479.767		0
	04.2024	¥	10.998.000	\$	78.521		0
	04.2024	\$	23.004	BRL	113.142		0
	06.2024	KRW	1.464.722	\$	1.132		0
	06.2024	\$	87	KRW	114.136		0
DUB	01.2024	CAD	354.335	\$	267.019		0
	01.2024	CLP	2.002.766		2.266		0
	01.2024	KRW	21.964.930		16.900		0
	01.2024	\$	68.405	MXN	1.199.589	2.116	0
	01.2024	ZAR	20.518	\$	1.077		0
	03.2024	CNH	1.663.633		230.874		0
	03.2024	IDR	1.204.850		77		0
	03.2024	SGD	2.461		1.859		0
	03.2024	\$	363.627	BRL	1.805.078	5.733	0
	03.2024		8.927	IDR	139.445.728		0
GLM	06.2024	KRW	244.568.282	\$	187.894		0
	01.2024	CAD	3.180.530		2.341.091		0
	01.2024	CHF	3.917		4.470		0
	01.2024	HKD	510		65		0
	01.2024	MXN	559.912		32.292		0
	01.2024	\$	268.848	BRL	1.350.260	9.121	0
	01.2024		3.488	£	2.738		0
	01.2024		301.474	MXN	5.284.472	9.186	0
	01.2024		83.840	TRY	2.559.882	932	0
	01.2024		4.120	ZAR	77.076	89	0
	01.2024	ZAR	333.771	\$	17.532		0
	02.2024	BRL	5.573		1.150		0
	02.2024	TRY	2.748		90		0
	02.2024	\$	396.473	BRL	2.006.591	15.940	0
	02.2024		22.703	TRY	692.389		0
	03.2024	CNH	864.771	\$	119.854		0
	03.2024	IDR	2.977.291		191		0
	03.2024	\$	118.324	IDR	1.820.084.667		0
JPM	03.2024		80.590	TRY	2.528.448		0
	01.2024	BRL	1.643.926	\$	337.272		0
	01.2024	HUF	27.457.834		78.227		0
	01.2024	\$	33.100	IDR	509.309.700		0
	01.2024		13.077	KRW	16.914.827		0
	01.2024		936	MXN	16.595	40	0
	01.2024		34.526	TRY	1.033.289		0
	02.2024	TWD	4.741.086	\$	148.016		0
	02.2024	\$	15.640	TRY	477.384		0
	03.2024	IDR	2.932.250.576	\$	189.140		0
	03.2024	SGD	7.660		5.777		0
	03.2024	TWD	11.027.800		354.831		0
	03.2024	\$	998.334	BRL	4.930.398	10.536	0
	03.2024		492	CNH	3.497		0
	03.2024		66.034	IDR	1.019.503.605	77	0
	03.2024		122.718	INR	10.259.438	144	0
	04.2024		142.978	BRL	703.310	617	0
MBC	06.2024	KRW	235.545.677	\$	181.754		0
	01.2024	AUD	30.412		20.165		0
	01.2024	€	4.362.649		4.769.886		0
	01.2024	£	16.589		20.923		0
	01.2024	HUF	1.617.168		4.595		0
	01.2024	¥	19.180.000		130.258		0
	01.2024	\$	1.216	CAD	1.645		0
	01.2024		3.053	£	2.398		0
	01.2024	ZAR	1.369.442	\$	71.655		0
	02.2024	TRY	93		3		0
	03.2024	CNH	22.002		3.035		0
	03.2024	\$	80.528	IDR	1.241.376.492		0

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermogens	
MYI	01.2024	AUD	377	\$ 258	\$ 1	\$ 0	0,00	
	01.2024	CHF	460	544	0	(3)	0,00	
	01.2024	€	23.067	25.619	138	0	0,00	
	01.2024	£	2.946	3.762	7	0	0,00	
	01.2024	HUF	3.101.593	8.815	0	(148)	0,00	
	01.2024	¥	8.944	63	0	(1)	0,00	
	01.2024	SGD	19.150	14.509	0	(9)	0,00	
	01.2024	TRY	10.701	364	2	0	0,00	
	01.2024	\$	5.959	€ 5.394	0	0	0,00	
	01.2024		15.906	£ 12.559	117	(12)	0,00	
	01.2024		546.555	¥ 80.574.363	25.336	0	0,03	
	01.2024		22	NOK 225	0	0	0,00	
	01.2024		50	SGD 65	0	0	0,00	
	01.2024		161.365	ZAR 3.020.699	3.610	0	0,01	
	01.2024	ZAR	469.270	\$ 24.641	0	(990)	0,00	
	02.2024	\$	364	TRY 11.032	0	(3)	0,00	
	03.2024	CNH	1.894.604	\$ 262.716	0	(4.886)	(0,01)	
	03.2024	¥	27.972.000	192.266	0	(8.202)	(0,01)	
	03.2024	\$	307.707	IDR 4.738.017.783	205	(669)	0,00	
	06.2024	KRW	142.969.767	\$ 109.922	0	(1.370)	0,00	
RBC	04.2024	\$	148.376	MXN 2.624.776	3.935	0	0,01	
RYL	01.2024	£	248	\$ 312	0	(4)	0,00	
SCX	01.2024		1.587.029	2.007.398	0	(15.812)	(0,02)	
	01.2024	SEK	15.620	1.504	0	(46)	0,00	
	01.2024	\$	44.101	¥ 6.356.300	1.014	0	0,00	
	01.2024	ZAR	1.738.202	\$ 91.635	0	(3.287)	(0,01)	
	03.2024	CNH	1.860.021	256.927	0	(5.790)	(0,01)	
	03.2024	IDR	488.402.194	31.125	0	(546)	0,00	
	03.2024	TWD	957.287	30.340	0	(1.380)	0,00	
	03.2024	\$	500	HKD 3.898	0	0	0,00	
	03.2024		92.164	IDR 1.431.202.706	907	(263)	0,00	
	03.2024		550.126	INR 46.020.167	988	0	0,00	
	06.2024	KRW	116.667.081	\$ 89.877	0	(940)	0,00	
SOG	01.2024	\$	25.254	BRL 123.097	87	0	0,00	
	01.2024		4.785	MXN 87.791	376	0	0,00	
	03.2024	SGD	28	\$ 21	0	0	0,00	
SSB	01.2024	£	13.121	16.511	0	(216)	0,00	
	01.2024	\$	107	HKD 836	0	0	0,00	
TOR	01.2024	¥	285.163	\$ 1.944	0	(80)	0,00	
	02.2024		6.905.000	46.663	0	(2.553)	0,00	
	03.2024	CNH	899.552	124.592	0	(2.464)	0,00	
	03.2024	IDR	422.877.945	26.789	0	(634)	0,00	
UAG	01.2024	AUD	24.803	16.456	0	(472)	0,00	
	01.2024	£	339.275	428.977	0	(3.545)	(0,01)	
	01.2024	¥	15.387.000	104.371	0	(5.063)	(0,01)	
	01.2024	MXN	882.866	49.871	0	(2.030)	0,00	
	01.2024	TRY	388.373	13.219	69	0	0,00	
	01.2024	\$	0	HKD 3	0	0	0,00	
	01.2024		57.704	¥ 8.453.617	2.296	0	0,00	
	01.2024		111.697	ZAR 2.132.174	4.739	0	0,01	
	02.2024		13.219	TRY 400.535	0	(108)	0,00	
					\$ 173.242	\$ (395.890)	\$ (222.648)	(0,31)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2023 standen fur die Anteilsklassen Institutional AUD (Hedged) thesaurierend, Institutional AUD (Hedged) ausschuttend, Investor AUD (Hedged) ausschuttend, Administrative AUD (Hedged) ausschuttend, Class E AUD (Hedged) ausschuttend und Class Z AUD (Hedged) ausschuttend II die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermogens
AZD	01.2024	\$ 296.836	AUD 448.210	\$ 9.060	\$ 0	\$ 9.060	0,01
BOA	01.2024	614.769	929.490	19.591	0	19.591	0,03
BPS	01.2024	AUD 13.370	\$ 9.002	0	(123)	(123)	0,00
	01.2024	\$ 3.886	AUD 5.732	31	(5)	26	0,00
BRC	01.2024	55.890	84.733	1.938	0	1.938	0,00
CBK	01.2024	AUD 59	\$ 39	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	\$ 3.729	AUD 5.543	55	(1)	54	0,00
GLM	01.2024	1.297	1.930	21	0	21	0,00
MBC	01.2024	345.290	520.738	10.105	0	10.105	0,01
RBC	01.2024	12.670	19.169	413	0	413	0,00
RYL	01.2024	780	1.160	12	0	12	0,00
UAG	01.2024	439.557	662.515	12.598	0	12.598	0,02
				\$ 53.824	\$ (130)	\$ 53.694	0,07

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

Zum 31. Dezember 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	01.2024	BRL 288.289	\$ 58.775	\$ 0	\$ (573)	\$ (573)	0,00
	01.2024	\$ 101.110	BRL 497.543	1.316	0	1.316	0,00
BPS	02.2024	58.775	289.494	725	0	725	0,00
	01.2024	BRL 253.927	\$ 52.050	0	(224)	(224)	0,00
CBK	01.2024	\$ 9.667	BRL 47.385	88	0	88	0,00
	02.2024	52.013	254.827	361	0	361	0,00
GLM	01.2024	BRL 569.872	\$ 115.383	0	(1.934)	(1.934)	0,00
	01.2024	\$ 110.380	BRL 542.063	1.211	0	1.211	0,00
JPM	02.2024	115.144	571.053	2.225	0	2.225	0,01
	01.2024	BRL 8.972	\$ 1.861	14	0	14	0,00
JPM	01.2024	\$ 13.647	BRL 67.484	245	0	245	0,00
	02.2024	1.854	8.972	0	(10)	(10)	0,00
JPM	01.2024	BRL 575.614	\$ 116.844	0	(1.653)	(1.653)	0,00
	01.2024	\$ 111.281	BRL 542.199	338	0	338	0,00
	02.2024	111.157	549.584	1.804	(5)	1.799	0,00
				\$ 8.327	\$ (4.399)	\$ 3.928	0,01

Zum 31. Dezember 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
BPS	01.2024	\$ 125	CAD 169	\$ 4	\$ 0	\$ 4	0,00
BRC	01.2024	46.175	62.792	1.450	0	1.450	0,00
CBK	01.2024	CAD 679	\$ 499	0	(16)	(16)	0,00
GLM	01.2024	2.066	1.559	0	(8)	(8)	0,00
	01.2024	\$ 51.736	CAD 70.307	1.589	0	1.589	0,01
JPM	01.2024	CAD 1.421	\$ 1.077	0	0	0	0,00
MBC	01.2024	\$ 7.304	CAD 9.884	193	0	193	0,00
MYI	01.2024	CAD 645	\$ 489	0	0	0	0,00
UAG	01.2024	\$ 4.899	CAD 6.460	0	0	0	0,00
	01.2024	52.096	70.665	1.501	0	1.501	0,00
				\$ 4.737	\$ (24)	\$ 4.713	0,01

Zum 31. Dezember 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	01.2024	CHF 351	\$ 408	\$ 0	\$ (10)	\$ (10)	0,00
	01.2024	\$ 1.626	CHF 1.392	29	0	29	0,00
BRC	01.2024	177.390	154.665	6.469	0	6.469	0,01
CBK	01.2024	CHF 1.026	\$ 1.177	0	(43)	(43)	0,00
	01.2024	\$ 159.108	CHF 138.563	5.610	0	5.610	0,01
GLM	01.2024	288.231	252.542	11.982	0	11.982	0,02
MYI	01.2024	254.045	221.758	9.572	0	9.572	0,01
SCX	01.2024	1.925	1.655	46	(3)	43	0,00
	01.2024	2.251	1.962	82	0	82	0,00
				\$ 33.790	\$ (56)	\$ 33.734	0,05

Zum 31. Dezember 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, Class E EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) ausschüttend, Class E EUR (Hedged) ausschüttend II, Class E EUR (Hedged) ausschüttend II Q, G Retail EUR (Hedged) ausschüttend, Class R EUR (Hedged) ausschüttend, Class T EUR (Hedged) thesaurierend, 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
BPS	01.2024	€ 14.302	\$ 15.571	\$ 28	\$ (259)	\$ (231)	0,00
	01.2024	\$ 5.757.466	€ 5.231.461	22.806	(10)	22.796	0,03
BRC	01.2024	5.562.108	5.057.473	25.914	0	25.914	0,04
CBK	01.2024	€ 124.578	\$ 137.870	233	(10)	223	0,00
	01.2024	\$ 96.511	€ 88.280	1.030	0	1.030	0,00
MBC	01.2024	€ 15.491	\$ 16.950	0	(166)	(166)	0,00
	01.2024	\$ 5.150.880	€ 4.710.943	54.259	0	54.259	0,08
SCX	01.2024	646.141	592.017	7.981	0	7.981	0,01
				\$ 112.251	\$ (445)	\$ 111.806	0,16

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend, Investor GBP (Hedged) ausschüttend, Administrative GBP (Hedged) ausschüttend, Class E GBP (Hedged) ausschüttend 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	01.2024	£ 139	\$ 176	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	01.2024	\$ 80.032	£ 63.158	485	0	485	0,00
BPS	01.2024	£ 49	\$ 62	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	\$ 410.161	£ 324.591	3.645	(4)	3.641	0,01
BRC	01.2024	£ 1.493	\$ 1.181	12	0	12	0,00
CBK	01.2024	£ 9.565	\$ 12.061	0	(133)	(133)	(0,01)
	01.2024	\$ 38.229	£ 30.201	272	0	272	0,00
GLM	01.2024	£ 2.592	\$ 2.035	2	0	2	0,00
MBC	01.2024	£ 7.190	\$ 9.154	0	(12)	(12)	0,00
	01.2024	\$ 45.061	£ 35.587	307	0	307	0,00
MYI	01.2024	£ 439	\$ 552	0	(7)	(7)	0,00
	01.2024	\$ 4.003	£ 3.134	0	(8)	(8)	0,00
SCX	01.2024	491.657	388.699	3.872	0	3.872	0,01
SSB	01.2024	403	320	5	0	5	0,00
UAG	01.2024	491.521	388.380	3.601	0	3.601	0,01
				\$ 12.201	\$ (166)	\$ 12.035	0,02

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilklassen Institutional JPY (Hedged) thesaurierend, Investor JPY (Hedged) thesaurierend, Class E JPY (Hedged) thesaurierend und Class E 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
BOA	01.2024	\$ 63.719	¥ 9.403.005	\$ 3.020	\$ 0	\$ 3.020	0,00
BRC	01.2024	20.468	2.984.854	718	0	718	(0,01)
CBK	01.2024	5.423	767.220	22	0	22	0,00
GLM	01.2024	120.673	17.714.671	5.060	0	5.060	0,01
MBC	01.2024	2.634	378.139	50	0	50	0,00
MYI	01.2024	81.101	11.951.385	3.726	0	3.726	0,01
SCX	01.2024	135.980	19.978.736	5.737	0	5.737	0,01
	02.2024	134.135	18.827.389	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 18.333	\$ (1)	\$ 18.332	0,02

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilklasse 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	01.2024	\$ 58.008	NOK 616.775	\$ 2.733	\$ 0	\$ 2.733	0,00
CBK	01.2024	79.908	854.976	4.292	0	4.292	0,01
GLM	01.2024	NOK 895	\$ 86	0	(2)	(2)	0,00
	01.2024	\$ 72.031	NOK 774.479	4.241	0	4.241	0,01
MBC	01.2024	143	1.556	11	0	11	0,00
MYI	01.2024	140	1.526	10	0	10	0,00
RYL	01.2024	NOK 1.427	\$ 134	1	(7)	(6)	0,00
	01.2024	\$ 962	NOK 10.251	47	0	47	(0,01)
SCX	01.2024	5.322	57.268	318	0	318	0,00
				\$ 11.653	\$ (9)	\$ 11.644	0,01

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilklassen Institutional RMB (Hedged) ausschüttend, 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
AZD	01.2024	\$ 286	CNH 2.054	\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,00
BPS	01.2024	95.287	678.301	64	(50)	14	0,00
BRC	01.2024	CNH 4.651	\$ 652	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	\$ 1.523	CNH 10.843	1	(1)	0	0,00
CBK	01.2024	46.501	331.813	118	0	118	0,00
DUB	01.2024	1.049	7.507	6	0	6	0,00
JPM	01.2024	CNH 15.830	\$ 2.214	0	(11)	(11)	0,00
MBC	01.2024	1.726	242	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 7.245	CNH 51.645	11	0	11	0,00
SCX	01.2024	CNH 12.471	\$ 1.752	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 1.867	CNH 13.307	3	0	3	0,00
				\$ 205	\$ (63)	\$ 142	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilklassen Institutional SGD (Hedged) thesaurierend, Institutional SGD (Hedged) ausschüttend, Investor SGD (Hedged) thesaurierend, Investor SGD (Hedged) ausschüttend, Administrative SGD (Hedged) ausschüttend und Class E SGD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	01.2024	\$ 26.348	SGD 35.136	\$ 296	\$ 0	\$ 296	0,00
BOA	01.2024	145.157	193.659	1.695	0	1.695	0,00
DUB	01.2024	1.670.530	2.220.652	13.403	0	13.403	0,02
GLM	01.2024	107.786	144.117	1.495	0	1.495	0,00
JPM	01.2024	420.476	560.877	4.840	0	4.840	0,01
MBC	01.2024	SGD 20.101	\$ 15.052	0	(191)	(191)	0,00
	01.2024	\$ 75.423	SGD 100.664	905	0	905	0,00
	02.2024	71.957	95.101	276	(30)	246	0,00
MYI	01.2024	1.553.612	2.072.418	17.914	0	17.914	0,03
	02.2024	SGD 31.130	\$ 23.618	0	(16)	(16)	0,00
TOR	01.2024	\$ 1.252.065	SGD 1.670.582	14.747	0	14.747	0,02
UAG	01.2024	SGD 23.234	\$ 17.470	0	(144)	(144)	0,00
				\$ 55.571	\$ (381)	\$ 55.190	0,08
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 107.977	0,15

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (00S)	MARKT-WERT (00S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Ginnie Mae, TBA			
2,500 % fällig am 01.01.2054	\$ 33.900	\$ (29.660)	(0,04)
5,500 % fällig am 01.01.2054	443.200	(446.456)	(0,63)
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
4,500 % fällig am 01.03.2054	476.000	(461.515)	(0,66)
Summe leerverkaufte Wertpapiere		\$ (937.631)	(1,33)
Summe Anlagen		\$ 99.359.858	140,85
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (28.816.741)	(40,85)
Nettovermögen		\$ 70.543.117	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
- ♣ der gesamte Betrag oder ein Teil davon stellt ungedeckte Darlehenszusagen dar. Der Zinssatz für den ungedeckten Anteil wird zum Zeitpunkt der Finanzierung festgelegt. Weitere Informationen zu ungedeckten Darlehenszusagen finden Sie in Erläuterung 4, Wertpapiere und andere Anlagen, in den Erläuterungen zum Abschluss.
- ^ Das Wertpapier ist in Verzug.
- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
- (b) Reines Kapitalwertpapier.
- (c) Wertpapier 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 Teilfonds verbunden.
- (k) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (l) Eingeschränkte Wertpapiere: (31. Dezember 2022: 0,97 %):

Emittentenbeschreibung	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
AMSURG Corp.	02.11.2023 - 06.11.2023	\$ 146.801	\$ 180.198	0,26
Chester A PLC 0,000 % fällig am 17.03.2046	18.04.2019	12.934	16.418	0,02
Chester A PLC 0,000 % fällig am 20.05.2046	18.04.2019	17.298	5.173	0,01
Chester A PLC 6,020 % fällig am 17.03.2046	18.04.2019	54.314	53.351	0,08
Chester A PLC 6,470 % fällig am 17.03.2046	18.04.2019	19.159	18.769	0,03
Chester A PLC 6,970 % fällig am 17.03.2046	18.04.2019	17.790	17.407	0,03
Chester A PLC 7,470 % fällig am 17.03.2046	18.04.2019	10.947	10.687	0,02
Chester A PLC 8,220 % fällig am 17.03.2046	18.04.2019	5.473	5.337	0,01
Citigroup, Inc. 2,572 % fällig am 03.06.2031	07.12.2023	4.191	4.274	0,01
Constellation Oil Services Holding S.A. - Exp. 10.06.2071	10.06.2022	0	0	0,00
Constellation Oil Services Holding S.A. ‚B‘	10.06.2022	353	353	0,00
Corestate Capital Holding S.A.	22.08.2023	0	0	0,00

Emittentenbeschreibung	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettvermögens
Deutsche Bank AG 2,129 % fällig am 24.11.2026	11.01.2023	\$ 22.257	\$ 22.792	0,03
Deutsche Bank AG 3,035 % fällig am 28.05.2032	25.05.2021 - 29.09.2021	46.067	38.388	0,05
Intelsat Emergence S.A.	19.06.2017 - 23.02.2022	440.150	132.746	0,19
Morgan Stanley 0,000 % fällig am 02.04.2032	11.02.2020	60.270	41.638	0,06
Neiman Marcus Group Ltd. LLC	25.09.2020	37.976	176.804	0,25
Oracle Corp. 4,100 % fällig am 25.03.2061	25.03.2021 - 05.10.2021	14.445	10.003	0,01
Serta Simmons Bedding LLC	29.06.2023	1.402	10	0,00
Sierra Hamilton Holder LLC	31.07.2017	560	0	0,00
Westmoreland Mining Holdings LLC	08.12.2014 - 19.12.2019	1.491	205	0,00
Westmoreland Mining LLC	03.07.2023	338	179	0,00
		\$ 914.216	\$ 734.732	1,06

(m) Wertpapier mit einem aggregierten beizulegenden Zeitwert von USD 502 (31. Dezember 2022: USD 19.079) und Barmittel in Höhe von USD 1.172 (31. Dezember 2022: USD null) waren zum 31. Dezember 2023 Wertpapiere als Sicherheiten gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäften verpfändet.

Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von USD null (31. Dezember 2022: USD 1) und Barmittel in Höhe von USD null (31. Dezember 2022: USD 273) waren zum 31. Dezember 2023 Wertpapiere als Sicherheiten gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäften eingegangen.

Barmittel in Höhe von USD 1.514.049 (31. Dezember 2022: USD 1.599.431) waren zum 31. Dezember 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 76.085 (31. Dezember 2022: USD 188.008) wurden zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten für Finanzderivate gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 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	\$ 257.726	\$ 95.849.535	\$ 842.568	\$ 96.949.829
Investmentfonds	1.515.725	289.487	0	1.805.212
Pensionsgeschäfte	0	274.468	0	274.468
Finanzderivate ⁽³⁾	(17.482)	1.286.825	(1.363)	1.267.980
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(937.631)	0	(937.631)
Summen	\$ 1.755.969	\$ 96.762.684	\$ 841.205	\$ 99.359.858

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 330.063	\$ 65.894.167	\$ 1.022.241	\$ 67.246.471
Investmentfonds	1.793.842	287.586	0	2.081.428
Pensionsgeschäfte	0	3.421.698	0	3.421.698
Finanzderivate ⁽³⁾	35.705	1.477.546	3	1.513.254
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(734.103)	0	(734.103)
Summen	\$ 2.159.610	\$ 70.346.894	\$ 1.022.244	\$ 73.528.748

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

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

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettvermögens
JML	2,250 %	14.11.2023	TBD ⁽¹⁾	€ (447)	\$ (495)	0,00
Summe umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (495)	0,00

(1) Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement ⁽¹⁾
AZD	\$ 2.888	\$ (3.940)	\$ (1.052)	\$ 2.601	\$ (920)	\$ 1.681
BOA	17.923	(17.500)	423	(36.145)	30.410	(5.735)
BOM	k. A.	k. A.	k. A.	(1.847)	2.130	283
BPS	17.770	(62.687)	(44.917)	37.581	(31.520)	6.061
BRC	(41.205)	12.970	(28.235)	(19.965)	16.765	(3.200)
BSH	66	0	66	(15)	0	(15)
BYL	66	0	66	(1.443)	0	(1.443)
CBK	27.413	(31.601)	(4.188)	63.317	(64.234)	(917)
CLY	k. A.	k. A.	k. A.	29	0	29
DUB	12.926	(16.750)	(3.824)	(21.446)	18.530	(2.916)
FAR	(1.931)	1.840	(91)	(2.129)	2.290	161
FBF	(1.499)	1.643	144	(4.557)	4.715	158
GLM	426	13.900	14.326	(618)	(8.230)	(8.848)
GST	(5.488)	(92.884)	(98.372)	(18.731)	8.496	(10.235)
HUS	357	(500)	(143)	1.179	(520)	659
JPM	(9.341)	10.510	1.169	9.738	(8.970)	768
JPS	(305)	220	(85)	(1.195)	1.120	(75)
MBC	4.940	(9.640)	(4.700)	112.677	(90.850)	21.827
MEI	(177)	286	109	(363)	294	(69)
MSC	(210)	0	(210)	k. A.	k. A.	k. A.
MYC	26.609	16.040	42.649	(9.537)	(29.220)	(38.757)
MYI	44.314	(60.260)	(15.946)	44.132	(35.730)	8.402
RBC	4.348	(3.900)	448	(1.592)	2.500	908
RYL	49	0	49	(10.431)	8.200	(2.231)
SAL	(7.368)	7.430	62	(15.988)	16.088	100
SCX	(7.202)	5.630	(1.572)	122.133	(112.350)	9.783
SOG	463	(420)	43	10	0	10
SSB	(211)	180	(31)	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	9.016	(8.540)	476	1.135	(920)	215
UAG	13.340	(12.670)	670	(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. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	53,15	68,71
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	83,76	45,07
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,53	2,21
Investmentfonds	2,56	3,59
Pensionsgeschäfte	0,39	5,90
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,04)	0,15
Zentral abgerechnete Finanzderivate	1,68	2,09
Freiverkehrsfinanzderivate	0,15	0,37
Leerverkaufte Wertpapiere	(1,33)	(1,27)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	0,00	(0,03)

* Gemäß der Liste der Märkte, die in Anhang 1 zum Prospekt aufgeführt sind und die Kriterien für gemäß OGAW-Vorschriften geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	1,83	3,66
Unternehmensanleihen und Wechsel	20,33	22,63
Wandelanleihen & Wechsel	0,03	0,03
Kommunalanleihen und Wechsel	0,12	0,15
US-Regierungsbehörden	62,99	35,26
US-Schatzobligationen	21,40	17,94
Non-Agency-MBS	10,79	12,73
Forderungsbesicherte Wertpapiere	9,14	8,72
Staatsemissionen	5,49	5,29
Stammaktien	0,95	0,93
Bezugsrechte	k. A.	0,01
Optionsscheine	0,00	0,07
Vorzugswertpapiere	0,20	0,23
Real Estate Investment Trusts	0,27	0,34
Kurzfristige Instrumente	3,90	8,00
Investmentfonds	2,56	3,59
Pensionsgeschäfte	0,39	5,90

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,04)	0,16
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	k. A.	(0,01)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,02	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,36	0,41
Zinsswaps	1,30	1,68
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,14	0,21
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	(0,02)	(0,17)
Zinscaps	(0,06)	(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	(0,04)	(0,06)
Total Return Swaps auf Indizes	0,00	0,00
Devisenterminkontrakte	(0,31)	(0,26)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,43	0,82
Leerverkaufte Wertpapiere	(1,33)	(1,27)
Sonstige Aktiva und Passiva	(40,85)	(26,82)
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund II (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt ⁽³⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,350 %	17.01.2025	\$ 900	\$ (1)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,450	20.12.2024	3.800	(3)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,750	21.06.2053	1.750	5	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,841	31.10.2024	100	0	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,910	14.11.2024	100	0	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,920	17.10.2024	200	(1)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,973	27.10.2024	100	0	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,000	21.06.2033	9.850	47	0,04
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,018	24.10.2024	100	0	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,088	07.11.2024	100	0	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,140	25.10.2024	100	0	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,190	25.10.2024	100	0	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,225	25.10.2024	100	0	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2030	1.900	(12)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2033	200	1	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,610	12.12.2032	100	(1)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,650	22.11.2024	100	0	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,650	05.12.2024	100	0	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	21.11.2024	100	0	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	11.12.2024	100	0	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.12.2028	17.600	101	0,08
Erhalt ⁽³⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2031	1.800	(4)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	20.12.2025	8.300	22	0,02
Erhalt ⁽³⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	20.03.2034	3.400	(27)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,512	04.01.2027	BRL 10.200	0	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	11.04.2024	€ 100	1	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	13.04.2024	200	2	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	17.05.2024	100	1	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	28.04.2024	100	1	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	03.05.2024	100	1	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,547	09.03.2033	100	1	0,00
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.03.2034	1.100	(5)	(0,01)
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,250	20.03.2029	400	(2)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	9,295	30.10.2028	MXN 19.400	1	0,00
					\$ 103	0,08
					\$ 78	0,06

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

- (1) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückzahlungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.
- (3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

VERKAUFSOPTIONEN

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
DUB	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,790 %	08.04.2024	100	\$ (1)	\$ 0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,790	08.04.2024	100	(1)	(1)	0,00
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,697	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)	(0,01)
							\$ (4)	\$ (3)	(0,01)

(1) Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

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

Kontrahent	Referenzinheit	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)	\$ 8	\$ (1)	0,00

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens						
BOA	01.2024	£	993	\$	1.257	\$	0	\$	(9)	(9)	(0,01)		
	01.2024	\$	941	¥	138.828	\$	45	\$	0	45	0,04		
	02.2024		29	CNY	204		0		0	0	0,00		
	03.2024	CNH	775	\$	107		0		(2)	(2)	0,00		
BPS	03.2024	IDR	82.763		5		0		0	0	0,00		
	01.2024	€	135		146		0		(3)	(3)	0,00		
	01.2024	HKD	2		0		0		0	0	0,00		
	01.2024	\$	937	¥	138.000		42		0	42	0,03		
	01.2024		99	TRY	2.928		0		0	0	0,00		
	01.2024	ZAR	31.398	\$	1.695		0		(19)	(19)	(0,01)		
	02.2024	TWD	594		19		0		(1)	(1)	0,00		
	02.2024	\$	51	CNY	364		0		0	0	0,00		
	03.2024	TWD	3.984	\$	127		0		(5)	(5)	0,00		
	03.2024	\$	8	IDR	127.761		0		0	0	0,00		
BRC	01.2024	HKD	3	\$	0		0		0	0	0,00		
	01.2024	\$	792	¥	115.000		24		0	24	0,02		
	01.2024		263	TRY	7.825		0		(1)	(1)	0,00		
	03.2024	HKD	77	\$	10		0		0	0	0,00		
CBK	04.2024	\$	860	TRY	27.647		0		(12)	(12)	(0,01)		
	01.2024	BRL	3.499	\$	719		0		(2)	(2)	0,00		
	01.2024	MXN	6.836		388		0		(14)	(14)	(0,01)		
	01.2024	\$	194	HKD	1.515		0		0	0	0,00		
GLM	01.2024	ZAR	5.868	\$	308		0		(12)	(12)	(0,01)		
	02.2024	\$	2.628	BRL	13.482		143		0	143	0,11		
	04.2024		719		3.534		3		0	3	0,00		
	01.2024	BRL	396	\$	80		0		(1)	(1)	0,00		
JPM	01.2024	MXN	977		56		0		(2)	(2)	0,00		
	02.2024	BRL	23		4		0		0	0	0,00		
	03.2024	\$	11	IDR	171.704		0		0	0	0,00		
	02.2024		82	BRL	401		1		0	1	0,00		
MBC	03.2024		541		2.674		6		0	6	0,01		
	03.2024		292	TWD	9.076		9		0	9	0,01		
	01.2024	€	6.197	\$	6.813		0		(34)	(34)	(0,03)		
	01.2024	£	72		91		0		(1)	(1)	0,00		
MYI	01.2024	¥	156.000		1.095		0		(13)	(13)	(0,01)		
	03.2024	TWD	4.635		147		0		(7)	(7)	(0,01)		
	03.2024	\$	208	HKD	1.617		0		0	0	0,00		
	01.2024	AUD	4.180	\$	2.853		0		0	0	0,00		
SCX	01.2024	£	30		38		0		0	0	0,00		
	02.2024	\$	30	CNY	213		0		0	0	0,00		
	03.2024	IDR	941.334	\$	61		0		0	0	0,00		
	03.2024	\$	37	IDR	570.536		0		0	0	0,00		
SSB	03.2024	HKD	2.183	\$	280		0		0	0	0,00		
	03.2024	\$	7	IDR	112.046		0		0	0	0,00		
UAG	01.2024	BRL	3.897	\$	805		3		0	3	0,00		
	01.2024	CLP	51.719		59		0		(1)	(1)	0,00		
UAG	01.2024	HKD	10		1		0		0	0	0,00		
	01.2024	\$	784	BRL	3.897		18		0	18	0,01		
	01.2024	£	8.989	\$	11.378		0		(82)	(82)	(0,07)		
							\$	294	\$	(221)	\$	73	0,06

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 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	01.2024	\$	3.292	AUD	4.965	\$	97	\$	0	97	0,09		
BOA	01.2024		221		334		7		0	7	0,01		
BPS	01.2024	AUD	354	\$	236		0		(6)	(6)	(0,01)		
CBK	01.2024		309		204		0		(8)	(8)	(0,01)		
	01.2024	\$	123	AUD	180		0		0	0	0,00		
MBC	01.2024		1.290		1.945		38		0	38	0,03		
UAG	01.2024		1.587		2.391		46		0	46	0,04		
							\$	188	\$	(14)	\$	174	0,15

Zum 31. Dezember 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						
BPS	01.2024	\$	267	€	245	\$	3	\$	0	3	0,00		
CBK	01.2024	€	26	\$	29		0		0	0	0,00		
MBC	01.2024		98		106		0		(1)	(1)	(0,01)		
	01.2024	\$	1.983	€	1.803		10		0	10	0,01		
MYI	01.2024		1.956		1.779		10		0	10	0,01		
UAG	01.2024		1.776		1.615		8		0	8	0,01		
							\$	31	\$	(1)	\$	30	0,02

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund II (Forts.)

Zum 31. Dezember 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	01.2024	£ 26	\$ 32	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2024	\$ 1.031	£ 814	7	0	7	0,01
BPS	01.2024	1.031	812	5	0	5	0,00
BRC	01.2024	17	13	0	0	0	0,00
CBK	01.2024	£ 137	\$ 173	0	(2)	(2)	0,00
	01.2024	\$ 151	£ 119	1	0	1	0,00
GLM	01.2024	£ 996	\$ 1.269	0	(1)	(1)	0,00
MBC	01.2024	58	74	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 25	£ 20	0	0	0	0,00
MYI	01.2024	£ 23	\$ 29	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 38	£ 30	0	0	0	0,00
SCX	01.2024	5.626	4.448	44	0	44	0,04
SSB	01.2024	£ 560	\$ 705	0	(9)	(9)	(0,01)
	01.2024	\$ 3.605	£ 2.857	37	0	37	0,03
UAG	01.2024	5.625	4.444	41	0	41	0,03
				\$ 135	\$ (12)	\$ 123	0,10

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilsklasse Class E 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
BOA	01.2024	\$ 42	¥ 6.219	\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,00
BRC	01.2024	10	1.535	1	0	1	0,00
GLM	01.2024	67	9.805	3	0	3	0,00
MYI	01.2024	52	7.726	2	0	2	0,00
UAG	01.2024	85	12.484	3	0	3	0,01
				\$ 11	\$ 0	\$ 11	0,01

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 407 0,33

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.01.2054	\$ 600	\$ (582)	(0,47)
Summe leerverkaufte Wertpapiere		\$ (582)	(0,47)
Summe Anlagen		\$ 135.966	108,63
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (10.806)	(8,63)
Nettovermögen		\$ 125.160	100,00

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(c) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

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

(e) Mit dem Teilfonds verbunden.

(f) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(g) Eingeschränkte Wertpapiere: (31. Dezember 2022: 0,04 %):

Emittentenbeschreibung	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Intelsat Emergence S.A.	24.02.2021	\$ 77	\$ 27	0,02

(h) Wertpapiere mit einem aggregierten beizulegenden Zeitwert von USD 3.529 (31. Dezember 2022: USD null) war zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte verpfändet oder geliefert.

Barmittel in Höhe von USD 1.462 (31. Dezember 2022: USD 961) waren zum 31. Dezember 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 31 (31. Dezember 2022: USD 61) wurden zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten für Finanzderivate gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 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	\$ 135.326	\$ 602	\$ 135.928
Investmentfonds	123	0	0	123
Finanzderivate ⁽³⁾	2	495	0	497
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(582)	0	(582)
Summen	\$ 125	\$ 135.239	\$ 602	\$ 135.966

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 56.688	\$ 282	\$ 56.970
Investmentfonds	1.740	0	0	1.740
Finanzderivate ⁽³⁾	(4)	316	0	312
Summen	\$ 1.736	\$ 57.004	\$ 282	\$ 59.022

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

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

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

Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Zahlbar für Rückkauf- Finanzierungs- geschäfte ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
MSC	5,600 %	19.12.2023	03.01.2024	\$ (2.181)	\$ (2.183)	(1,74)
	5,710	19.12.2023	04.01.2024	(1.389)	(1.389)	(1,11)
Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte					\$ (3.572)	(2,85)

(1) In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag sind USD 1 für einen aufgeschobenen Kursrückgang enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
AZD	\$ 97	\$ 0	\$ 97	\$ 3	\$ 0	\$ 3
BOA	50	0	50	(65)	0	(65)
BPS	16	0	16	(73)	0	(73)
BRC	12	0	12	(5)	0	(5)
CBK	109	0	109	24	0	24
DUB	(1)	0	(1)	(2)	0	(2)
GLM	(3)	0	(3)	(36)	30	(6)
JPM	16	0	16	k. A.	k. A.	k. A.
MBC	(8)	0	(8)	22	0	22
MYC	(1)	31	30	(8)	31	23
MYI	12	0	12	(10)	0	(10)
SCX	44	0	44	27	0	27
SSB	48	0	48	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	16	0	16	3	0	3

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

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	44,99	55,36
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	63,19	45,23
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,42	0,03
Investmentfonds	0,10	3,07
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,01	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,06	0,76
Freiverkehrsfinauzderivate	0,33	(0,21)
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,47)	k. A.
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(2,85)	k. A.

* Gemäß der Liste der Märkte, die die Kriterien für einen geregelten OGAW-Markt erfüllen, in Anlage 1 zum Verkaufsprospekt.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	0,96	1,71
Unternehmensanleihen und Wechsel	18,65	12,97
US-Regierungsbehörden	43,99	19,84
US-Schatzobligationen	19,70	35,05
Non-Agency-MBS	14,67	17,43
Forderungsbesicherte Wertpapiere	4,99	10,35
Staatsemissionen	5,62	3,23
Stammaktien	0,02	0,04
Bezugsrechte	k. A.	0,00
Investmentfonds	0,10	3,07
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,01	0,01
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	k. A.	(0,01)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	(0,02)	0,28
Zinsswaps	0,08	0,48
Freiverkehrsfinauzderivate		
Verkaufsoptionen		
Zinsswapoptionen	(0,01)	(0,08)
Optionen auf Wertpapiere	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	(0,01)
Devisenterminkontrakte	0,06	(0,27)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,28	0,15
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,47)	k. A.
Sonstige Aktiva und Passiva	(8,63)	(4,24)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
BANKEN UND FINANZEN			
Bank of America Corp.			
5,875 % fällig am 15.03.2028 (e)	\$ 60	\$ 58	0,02
Jyske Realkredit A/S			
1,000 % fällig am 01.10.2050 DKK	6.402	744	0,29
1,500 % fällig am 01.10.2053	4.939	580	0,23
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	2	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2053	13.356	1.540	0,61
2,000 % fällig am 01.10.2053	200	25	0,01
2,500 % fällig am 01.10.2047	0	0	0,00
Nykredit Realkredit A/S			
1,000 % fällig am 01.10.2050	6.708	778	0,31
1,000 % fällig am 01.10.2053	297	32	0,01
1,500 % fällig am 01.10.2053	8.066	972	0,38
2,000 % fällig am 01.10.2053	494	61	0,03
2,500 % fällig am 01.10.2047	3	0	0,00
3,500 % fällig am 01.10.2053	2.347	337	0,13
Realkredit Danmark A/S			
1,000 % fällig am 01.10.2050	3.107	360	0,14
1,000 % fällig am 01.10.2053	574	64	0,03
1,500 % fällig am 01.10.2050	1.301	153	0,06
1,500 % fällig am 01.10.2053	11.038	1.283	0,51
2,500 % fällig am 01.10.2047	2	0	0,00
	<u>6.989</u>	<u>2,76</u>	
VERSORGUNGSUNTERNEHMEN			
Petrobras Global Finance BV			
7,250 % fällig am 17.03.2044	\$ 157	164	0,07
Summe Unternehmensanleihen und Wechsel	<u>7.153</u>	<u>2,83</u>	
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Freddie Mac			
5,853 % fällig am 15.06.2047	657	638	0,25
Ginnie Mae			
6,138 % fällig am 20.08.2072	1.680	1.675	0,66
6,238 % fällig am 20.10.2072 - 20.01.2073	8.820	8.711	3,44
6,246 % fällig am 20.08.2068	91	89	0,03
6,438 % fällig am 20.05.2073	305	307	0,12
6,498 % fällig am 20.11.2072	1.897	1.915	0,76
Uniform Mortgage-Backed Security			
4,000 % fällig am 01.08.2052	2.961	2.802	1,11
4,500 % fällig am 01.07.2052	982	952	0,38
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
4,000 % fällig am 01.01.2054	11.900	11.261	4,45
4,500 % fällig am 01.02.2054	14.600	14.163	5,59
5,000 % fällig am 01.02.2054	5.800	5.741	2,27
5,500 % fällig am 01.02.2054	3.900	3.918	1,55
6,000 % fällig am 01.02.2054	11.800	11.982	4,73
6,500 % fällig am 01.02.2054	4.600	4.714	1,86
	<u>68.868</u>	<u>27,20</u>	
US-SCHATZ Obligationen			
U.S. Treasury Inflation Protected Securities (d)			
0,125 % fällig am 15.04.2025	2.144	2.068	0,82
0,125 % fällig am 15.04.2026	2.816	2.681	1,06
0,125 % fällig am 15.07.2026	193	183	0,07
0,125 % fällig am 15.10.2026 (g)	13.849	13.154	5,19
0,125 % fällig am 15.04.2027	763	717	0,28
0,125 % fällig am 15.01.2030	120	108	0,04
0,125 % fällig am 15.07.2030	480	434	0,17
0,125 % fällig am 15.07.2031 (h)	13.546	12.050	4,76
0,125 % fällig am 15.01.2032	8.879	7.804	3,08
0,125 % fällig am 15.02.2051	827	513	0,20
0,125 % fällig am 15.02.2052	663	407	0,16
0,250 % fällig am 15.02.2050	120	78	0,03
0,375 % fällig am 15.01.2027	1.898	1.804	0,71
0,375 % fällig am 15.07.2027	11.043	10.496	4,15
0,500 % fällig am 15.01.2028	2.245	2.125	0,84
0,625 % fällig am 15.01.2026	129	125	0,05
0,625 % fällig am 15.07.2032	6.248	5.712	2,26
0,625 % fällig am 15.02.2043	13	10	0,00
0,750 % fällig am 15.07.2028	1.728	1.655	0,65

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
0,750 % fällig am 15.02.2042 \$	681	\$ 552	0,22
0,750 % fällig am 15.02.2045	1.437	1.125	0,44
0,875 % fällig am 15.01.2029	1.413	1.353	0,54
0,875 % fällig am 15.02.2047	1.277	1.008	0,40
1,000 % fällig am 15.02.2046	3.077	2.520	1,00
1,000 % fällig am 15.02.2048	437	353	0,14
1,375 % fällig am 15.07.2033	1.418	1.376	0,54
1,375 % fällig am 15.02.2044	2.112	1.890	0,75
1,500 % fällig am 15.02.2053	828	752	0,30
1,625 % fällig am 15.10.2027 (g)	12.048	11.960	4,72
2,000 % fällig am 15.01.2026	33	32	0,01
2,125 % fällig am 15.02.2040	71	73	0,03
2,125 % fällig am 15.02.2041	843	867	0,34
	<u>85.985</u>	<u>33,95</u>	
NON-AGENCY-MBS			
1211 Avenue of the Americas Trust			
3,901 % fällig am 10.08.2035	1.900	1.821	0,72
Banc of America Alternative Loan Trust			
6,000 % fällig am 25.06.2046	171	145	0,06
Banc of America Funding Trust			
4,306 % fällig am 20.01.2047	193	163	0,06
6,000 % fällig am 25.03.2034	59	58	0,02
Bear Stearns Mortgage Funding Trust			
5,850 % fällig am 25.01.2037	2.699	2.453	0,97
Countrywide Alternative Loan Trust			
6,000 % fällig am 25.04.2037	94	79	0,03
HarborView Mortgage Loan Trust			
6,372 % fällig am 20.06.2035	47	42	0,02
New Residential Mortgage Loan Trust			
4,500 % fällig am 25.05.2058	133	128	0,05
One Market Plaza Trust			
3,614 % fällig am 10.02.2032	2.000	1.829	0,72
Polaris PLC			
5,995 % fällig am 23.10.2059 £	291	370	0,15
Sequoia Mortgage Trust			
5,872 % fällig am 20.07.2036 \$	120	105	0,04
Towd Point Mortgage Trust			
3,500 % fällig am 25.01.2058	2.230	2.093	0,83
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
5,907 % fällig am 25.09.2033	1	1	0,00
6,130 % fällig am 25.01.2045	169	160	0,06
6,490 % fällig am 25.08.2045	1.619	1.523	0,60
	<u>10.970</u>	<u>4,33</u>	
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates			
6,250 % fällig am 25.05.2034	33	33	0,01
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust			
6,100 % fällig am 25.02.2036	110	110	0,04
Citigroup Mortgage Loan Trust			
5,760 % fällig am 25.09.2036	89	85	0,03
Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates			
6,415 % fällig am 25.10.2034	131	126	0,05
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust			
5,650 % fällig am 25.06.2047	1.928	1.818	0,72
Encore Credit Receivables Trust			
6,370 % fällig am 25.01.2036	900	855	0,34
First Franklin Mortgage Loan Trust			
5,780 % fällig am 25.07.2036	143	137	0,05
6,250 % fällig am 25.09.2035	64	63	0,02
6,340 % fällig am 25.09.2035	138	136	0,05
Home Equity Asset Trust			
6,325 % fällig am 25.08.2034	118	116	0,05
HSI Asset Securitization Corp. Trust			
5,790 % fällig am 25.05.2037	12	12	0,00
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust			
5,950 % fällig am 25.07.2036	1.675	1.646	0,65
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust			
6,130 % fällig am 25.01.2035	99	96	0,04
Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates			
7,270 % fällig am 25.12.2034	619	603	0,24

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust			
5,780 % fällig am 25.06.2047 \$	1.842	\$ 1.699	0,67
Residential Asset Securities Corp. Trust			
5,750 % fällig am 25.09.2036	744	726	0,29
5,965 % fällig am 25.04.2036	29	28	0,01
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust			
5,730 % fällig am 25.12.2036	1.694	1.533	0,61
Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust			
7,195 % fällig am 25.11.2035	932	925	0,37
	<u>10.747</u>	<u>4,24</u>	
STAATSEMISSIONEN			
Australia Government International Bond			
0,250 % fällig am 21.11.2032 AUD	2.864	1.763	0,70
0,750 % fällig am 21.11.2027	733	494	0,19
3,000 % fällig am 20.09.2025	1.239	869	0,34
Canadian Government Real Return Bond			
0,500 % fällig am 01.12.2050 (d)	CAD 244	148	0,06
1,250 % fällig am 01.12.2047 (d)	2.251	1.620	0,64
France Government International Bond			
0,100 % fällig am 01.03.2028 (d)	€ 940	1.025	0,40
0,100 % fällig am 25.07.2031 (d)	2.011	2.191	0,86
0,100 % fällig am 25.07.2038 (d)	987	1.022	0,40
0,700 % fällig am 25.07.2030 (d)	1.616	1.840	0,73
1,800 % fällig am 25.07.2040 (d)	43	56	0,02
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro			
0,100 % fällig am 15.05.2033 (d)	6.336	5.993	2,37
0,400 % fällig am 15.05.2030 (d)	2.279	2.353	0,93
1,400 % fällig am 26.05.2025 (d)	10.295	11.193	4,42
2,350 % fällig am 15.09.2024 (d)	1.189	1.317	0,52
Japan Government International Bond			
0,100 % fällig am 10.03.2024 (d)	¥ 434.070	3.104	1,23
0,100 % fällig am 10.03.2028 (d)	975.291	7.271	2,87
0,100 % fällig am 10.03.2029 (d)	1.687.753	12.612	4,98
Spain Government International Bond			
0,650 % fällig am 30.11.2027 (d)	€ 10.993	12.117	4,78
0,700 % fällig am 30.11.2033 (d)	1.704	1.821	0,72
1,450 % fällig am 31.10.2027	300	319	0,13
United Kingdom Gilt			
0,125 % fällig am 10.08.2028 (d)	£ 325	419	0,17
0,125 % fällig am 22.11.2036 (d)	174	215	0,08
0,125 % fällig am 22.03.2039 (d)	382	449	0,18
0,125 % fällig am 10.08.2041 (d)	1.713	1.965	0,78
0,125 % fällig am 22.03.2044 (d)	623	685	0,27
0,125 % fällig am 22.03.2046 (d)	1.936	2.070	0,82
0,125 % fällig am 10.08.2048 (d)	1.856	1.943	0,77
0,125 % fällig am 22.03.2051 (d)	488	496	0,20
0,625 % fällig am 22.03.2040 (d)	262	331	0,13
0,625 % fällig am 22.11.2042 (d)	889	1.102	0,43
0,750 % fällig am 22.11.2047 (d)	2.273	2.773	1,09
1,250 % fällig am 22.11.2027 (d)	2.064	2.776	1,10
4,125 % fällig am 22.07.2030	556	894	0,35
	<u>85.246</u>	<u>33,66</u>	

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Dynamic Multi-Asset Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000\$)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000\$)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000\$)	MARKT-WERT (000\$)	% DES NETTO-VERMÖGENS
STAMMAKTIE LUXUSGÜTER								KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
Capri Holdings Ltd. (a)	800	\$ 40	0,02	AvalonBay Communities, Inc.	2.925	\$ 548	0,22	COMMERCIAL PAPER			
Hilton Worldwide Holdings, Inc.	550	100	0,04	Boston Properties, Inc.	1.575	111	0,04	Arrow Electronics, Inc.			
Marriott International, Inc. 'A'	380	86	0,03	Brixmor Property Group, Inc.	2.765	64	0,03	5,850 % fällig am			
		226	0,09	Camden Property Trust	2.502	249	0,10	10.01.2024 \$ 250 \$ 249 0,09			
BASISKONSUMGÜTER								5,900 % fällig am			
Sovos Brands, Inc. (a)	1.300	29	0,01	COPT Defense Properties	1.749	45	0,02	19.01.2024 250 249 0,10			
ENERGIE								AT+T, Inc.			
Hess Corp.	400	58	0,02	Crown Castle, Inc.	1.440	166	0,07	5,700 % fällig am			
Pioneer Natural Resources Co.	200	45	0,02	CubeSmart	3.325	154	0,06	19.03.2024 900 889 0,35			
		103	0,04	DiamondRock Hospitality Co.	9.304	87	0,03	CIGNA Group			
GESUNDHEITSWESEN								5,680 % fällig am			
Amedisys, Inc. (a)	400	38	0,01	Digital Realty Trust, Inc.	4.653	626	0,25	17.01.2024 250 249 0,10			
Cerevel Therapeutics Holdings, Inc. (a)	1.100	47	0,02	Equinix, Inc.	1.460	1.176	0,46	Fidelity National Information Services, Inc.			
ImmunoGen, Inc. (a)	1.300	38	0,02	Equity LifeStyle Properties, Inc.	5.644	398	0,16	5,650 % fällig am			
Karuna Therapeutics, Inc. (a)	100	32	0,01	Essex Property Trust, Inc.	6.450	395	0,16	05.01.2024 250 250 0,10			
RayzeBio, Inc. (a)	400	25	0,01	Extra Space Storage, Inc.	1.393	223	0,09	5,710 % fällig am			
		180	0,07	First Industrial Realty Trust, Inc.	6.668	351	0,14	16.01.2024 250 249 0,10			
INFORMATIONSTECHNOLOGIE								Intercontinental Exchange, Inc.			
Splunk, Inc. (a)	400	61	0,03	Gaming and Leisure Properties, Inc.	5.819	287	0,11	5,600 % fällig am			
BAUSTOFFE								03.01.2024 250 250 0,10			
United States Steel Corp.	1.100	53	0,02	Healthpeak Properties, Inc.	11.757	233	0,09	Kinder Morgan, Inc.			
IMMOBILIEN								5,700 % fällig am			
Howard Hughes Holdings, Inc. (a)	1.891	162	0,06	Host Hotels & Resorts, Inc.	11.538	225	0,09	22.01.2024 250 249 0,10			
		827	0,33	InvenTrust Properties Corp.	3.367	85	0,03	Marathon Oil Corp.			
VERSORGUNGSUNTERNEHMEN								6,050 % fällig am			
PNM Resources, Inc.	324	13	0,01	Invitation Homes, Inc.	16.974	579	0,23	03.01.2024 250 250 0,10			
		827	0,33	Kilroy Realty Corp.	3.195	127	0,05	Quanta Services, Inc.			
VORZUGSWERTPAPIERE								5,900 % fällig am			
Nationwide Building Society 10,250 %	813	135	0,05	Kimco Realty Corp.	5.012	107	0,04	08.01.2024 250 250 0,10			
REAL ESTATE INVESTMENT TRUSTS								Southern California Edison Co.			
Alexandria Real Estate Equities, Inc.	2.453	311	0,12	Mid-America Apartment Communities, Inc.	316	43	0,02	5,730 % fällig am			
American Assets Trust, Inc.	4.191	94	0,04	National Storage Affiliates Trust	2.487	103	0,04	16.01.2024 250 249 0,10			
American Homes 4 Rent 'A'	11.518	414	0,16	Park Hotels & Resorts, Inc.	11.538	177	0,07	5,730 % fällig am			
American Tower Corp.	1.336	288	0,11	Prologis, Inc.	12.258	1.634	0,65	17.01.2024 500 498 0,19			
Healthcare Realty Trust, Inc.	5.937	180	0,07	Public Storage	2.443	745	0,29	VW Credit, Inc.			
Apartment Income REIT Corp.	4.071	141	0,06	Realty Income Corp.	6.617	380	0,15	5,640 % fällig am			
		827	0,33	Regency Centers Corp.	1.453	97	0,04	03.01.2024 250 250 0,10			
PENSIONSGESCHÄFTE								4.131 1,63			
								UNGARISCHE SCHATZWECHSEL			
								10,900 % fällig am			
								04.01.2024 (b)(c) HUF 93.000 269 0,11			
								Summe kurzfristige Instrumente 4.400 1,74			
								Summe übertragbare Wertpapiere \$ 289.304 114,24			
								AKTIEN			
								INVESTMENTFONDS			
								ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
								PIMCO Select Funds			
								plc - PIMCO			
								US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)			
								187.197 1.865 0,74			
								BÖRSENGEHANDELTE FONDS			
								Invesco Physical Gold ETC			
								74.145 14.779 5,84			
								iShares Physical Gold ETC			
								288.780 11.612 4,58			
								26.391 10,42			
								Summe Investmentfonds \$ 28.256 11,16			

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 Netto- vermögens
SSB	2,600 %	29.12.2023	02.01.2024	\$ 364	U.S. Treasury Notes 0,250 % fällig am 31.07.2025	\$ (371)	\$ 364	\$ 364	0,14
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (371)	\$ 364	\$ 364	0,14

(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 March Futures	Short	03.2024	8	\$ (6)	0,00
Australia Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2024	1	(2)	0,00

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl March Futures	Short	03.2024	17	\$ (36)	(0,01)
Euro-BTP Italy Government Bond March Futures	Long	03.2024	40	191	0,07
Euro-BTP Italy Government Bond March Futures	Short	03.2024	51	(51)	(0,02)
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2024	57	(1)	0,00
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Short	03.2024	23	(291)	(0,12)
Euro-OAT France Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2024	63	259	0,10
Euro-Schatz March Futures	Short	03.2024	171	(128)	(0,05)
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Long	03.2024	44	101	0,04
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Short	03.2024	374	(903)	(0,36)
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2024	109	18	0,01
U.S. Treasury 10-Year Ultra March Futures	Short	03.2024	50	(256)	(0,10)
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Short	03.2024	78	(714)	(0,28)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2024	41	(530)	(0,21)
United Kingdom Long Gilt March Futures	Long	03.2024	55	244	0,10
				\$ (2.105)	(0,83)

VERKAUFSOPTIONEN**FUTURE-ÄHNLICHE OPTIONEN AUF BÖRSENGEHADELTE TERMINKONTRAKTE**

Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
Call - ICE Euribor April 2024 Futures	\$ 96,750	12.04.2024	185	\$ (125)	\$ (125)	(0,05)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$	(2.230)	(0,88)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,500 %	16.03.2042	£ 2.200	\$ 83	0,03
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	1,500	15.06.2052	6.500	(1.906)	(0,75)
Erhalt ⁽¹⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,250	20.03.2054	4.000	(666)	(0,26)
Zahlung ⁽¹⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	5,000	20.03.2029	3.500	284	0,11
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	16.06.2031	¥ 50.000	15	0,01
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,450	20.03.2029	154.390	47	0,02
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,500	15.12.2031	77.000	7	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,550	14.09.2028	1.950.000	(73)	(0,03)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,840	21.11.2028	\$ 3.100	286	0,11
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,888	21.11.2053	600	(193)	(0,08)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,237	21.11.2053	2.300	448	0,18
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,340	21.11.2028	11.200	(638)	(0,25)
Erhalt ⁽¹⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,865	13.02.2054	10.900	644	0,25
Zahlung ⁽¹⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,085	13.02.2034	24.600	(535)	(0,21)
Zahlung ⁽¹⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,900	22.03.2026	10.400	17	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	20.12.2025	66.900	(228)	(0,09)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,606	31.10.2025	29.600	340	0,13
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,611	31.10.2025	5.500	64	0,03
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,868	22.12.2025	10.400	(108)	(0,04)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,190	04.11.2052	€ 200	87	0,03
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,195	04.11.2052	200	100	0,04
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,197	08.11.2052	400	174	0,07
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	12.04.2027	600	(39)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	11.05.2027	300	(18)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,700	11.04.2027	300	(19)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027	600	(30)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	18.05.2027	200	(10)	0,00
Erhalt ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	20.03.2054	11.180	(1.594)	(0,63)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,879	15.08.2032	8.400	256	0,10
Zahlung ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.03.2034	35.010	2.523	1,00
Erhalt ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,500	20.03.2026	40.400	(713)	(0,28)
Zahlung	CPTFEMU	2,356	15.11.2033	1.800	44	0,02
Erhalt	CPTFEMU	2,359	15.08.2030	1.400	26	0,01
Zahlung	CPTFEMU	2,363	15.11.2033	1.100	26	0,01
Zahlung	CPTFEMU	2,390	15.11.2033	1.000	26	0,01
Erhalt	CPTFEMU	2,470	15.07.2032	1.100	19	0,01
Erhalt	CPTFEMU	2,548	15.11.2053	400	(13)	(0,01)
Zahlung	CPTFEMU	2,590	15.12.2052	500	17	0,01
Erhalt	CPTFEMU	2,600	15.05.2032	2.400	37	0,01
Erhalt	CPTFEMU	2,620	15.11.2053	200	(12)	0,00
Zahlung	CPTFEMU	2,680	15.04.2053	2.100	163	0,06
Zahlung	CPTFEMU	2,682	15.10.2053	300	24	0,01
Zahlung	CPTFEMU	2,700	15.04.2053	2.300	147	0,06
Erhalt	CPTFEMU	2,720	15.06.2032	4.200	(37)	(0,01)
Zahlung	CPTFEMU	2,736	15.10.2053	500	45	0,02
Zahlung	CPTFEMU	2,763	15.09.2053	1.100	117	0,05

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Dynamic Multi-Asset Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	CPTFEMU	2,965 %	15.05.2027	€ 10.700	\$ 224	0,09
Erhalt	CPTFEMU	2,980	15.06.2027	9.900	27	0,01
Erhalt	CPTFEMU	3,000	15.05.2027	1.900	35	0,01
Erhalt	CPTFEMU	3,130	15.05.2027	2.100	24	0,01
Zahlung	CPURNSA	1,280	19.05.2030	\$ 600	(39)	(0,02)
Erhalt	CPURNSA	1,794	24.08.2027	850	60	0,02
Erhalt	CPURNSA	1,798	25.08.2027	300	21	0,01
Erhalt	CPURNSA	1,890	27.08.2027	500	36	0,01
Zahlung	CPURNSA	1,954	03.06.2029	750	(55)	(0,02)
Zahlung	CPURNSA	2,165	16.04.2029	500	(38)	(0,02)
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	(36)	(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	(35)	(0,01)
Zahlung	FRCPXTOB	1,590	15.02.2028	180	(25)	(0,01)
Zahlung	UKRPI	3,480	15.01.2030	£ 800	(178)	(0,07)
Zahlung	UKRPI	3,566	15.03.2036	500	(90)	(0,04)
Zahlung	UKRPI	3,850	15.09.2024	400	(90)	(0,04)
Erhalt	UKRPI	4,143	15.10.2032	400	(1)	0,00
Erhalt	UKRPI	4,288	15.02.2032	2.500	165	0,07
Erhalt	UKRPI	4,595	15.08.2032	4.600	(247)	(0,10)
Erhalt	UKRPI	4,615	15.02.2027	4.900	229	0,09
Erhalt	UKRPI	4,735	15.12.2026	400	45	0,02
Erhalt	UKRPI	5,200	15.06.2024	1.300	67	0,03
Erhalt	UKRPI	5,330	15.06.2024	1.800	87	0,03
Erhalt	UKRPI	6,600	15.05.2024	800	43	0,02
					\$ (455)	(0,18)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ (455)	(0,18)

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

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

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

VERKAUFSOPTIONEN

INFLATION-CAPPED OPTIONS

Kontrahent	Beschreibung	Anfänglicher Index	Variabler Zinssatz	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens
GLM	Cap - OTC CPALEMU	\$ 100,151	Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 3,000 %] oder 0	22.06.2035	300	\$ (14)	\$ (11)	(0,01)

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BPS	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,700 %	13.02.2024	19.300	\$ (84)	\$ (286)	(0,11)
FAR	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,760	16.01.2024	15.800	(73)	(223)	(0,09)
GLM	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,900	20.03.2024	20.800	(100)	(116)	(0,05)
	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,900	29.08.2025	4.000	(52)	(87)	(0,03)
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,900	29.08.2025	4.000	(52)	(20)	(0,01)
GST	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,800	01.09.2025	22.800	(288)	(465)	(0,18)
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,800	01.09.2025	22.800	(288)	(126)	(0,05)
MYC	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,758	16.01.2024	3.200	(15)	(45)	(0,02)
							\$ (952)	\$ (1.368)	(0,54)

(1) Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Netto- vermögens
GST	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500 %	17.11.2059	\$ 200	(6)	\$ 6	\$ 0	0,00
MYC	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	800	(26)	26	0	0,00
SAL	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	200	0	(1)	(1)	0,00
UAG	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	400	(12)	12	0	0,00
					\$ (44)	\$ 43	\$ (1)	0,00

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
MYC	Erhalt	CPURNSA	1,800 %	20.07.2026	\$ 600	\$ 0	\$ (89)	\$ (89)	(0,04)
	Erhalt	CPURNSA	1,805	20.09.2026	50	0	(7)	(7)	0,00
	Erhalt	CPURNSA	1,810	19.07.2026	500	0	(73)	(73)	(0,03)
						\$ 0	\$ (169)	\$ (169)	(0,07)

TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variable Zinssatz	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
CBK	Erhalt	TRNGLU Index	2.377	1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 11.726	10.07.2024	\$ 0	\$ (32)	\$ (32)	(0,01)
JPM	Erhalt	JMABDEWU Index	1.627	0,053 %	263	15.02.2024	0	(1)	(1)	0,00
	Erhalt	JMABNIU5 Index	95.050	0,000	17.075	15.02.2024	0	(153)	(153)	(0,06)
MAC	Erhalt	PIMCOBDV Index	43.741	0,600	5.688	16.01.2024	0	30	30	0,01
	Erhalt	PIMCOBDU Index	213.477	0,150	33.758	15.03.2024	(4)	(204)	(208)	(0,08)
						\$ (4)	\$ (360)	\$ (364)	(0,14)	

TOTAL RETURN SWAPS AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variable Zinssatz	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Zahlung	Exxon Mobil Corp.	465	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 46	16.10.2024	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
MYI	Zahlung	Chevron Corp.	410	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	61	24.04.2024	0	0	0	0,00
						\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00	

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2024	£	10.278	\$ 13.011	\$ 0	\$ (92)	(0,04)
	02.2024	\$	1.238	CNY 8.749	0	(1)	0,00
	03.2024	CNH	29.439	\$ 4.095	0	(63)	(0,02)
	03.2024	\$	423	INR 35.363	1	0	0,00
BPS	06.2024		2.593	KRW 3.331.080	0	0	0,00
	01.2024	CAD	8.499	\$ 6.280	0	(166)	(0,07)
	01.2024	DKK	26.216	3.865	0	(21)	(0,01)
	01.2024	€	36.605	39.940	0	(505)	(0,20)
	01.2024	£	2.063	2.616	0	(13)	(0,01)
	01.2024	HUF	18.014	51	0	(1)	0,00
	01.2024	¥	174.300	1.185	0	(53)	(0,02)
	01.2024	KRW	65.689	50	0	(1)	0,00
	01.2024	PLN	560	133	0	(9)	0,00
	01.2024	\$	309	DKK 2.100	2	0	0,00
	01.2024		149	€ 135	0	0	0,00
	01.2024		1	HUF 351	0	0	0,00
	01.2024		50	IDR 773.309	0	0	0,00
	01.2024		1.891	ZAR 35.052	23	0	0,01
	02.2024	CNY	3.210	\$ 451	0	(2)	0,00
	02.2024	\$	995	CNY 7.065	3	0	0,00
	02.2024		867	TWD 27.561	44	0	0,02
	03.2024	IDR	2.443.193	\$ 153	0	(5)	0,00
	03.2024	TWD	3.717	118	0	(5)	0,00
	03.2024	\$	1.469	INR 122.832	2	0	0,00
BRC	01.2024	CHF	37	\$ 42	0	(2)	0,00
	01.2024	KRW	64.615	50	0	0	0,00
	01.2024	MXN	2.156	124	0	(3)	0,00
	01.2024	\$	1.068	MXN 18.744	33	0	0,01
	01.2024		2.486	PLN 10.872	278	0	0,11
	01.2024		2.008	TRY 61.127	32	0	0,01
	01.2024		50	ZAR 924	1	0	0,00
	03.2024	TRY	2.342	\$ 75	0	0	0,00
	03.2024	\$	1.149	IDR 17.869.073	9	0	0,00
	03.2024		1	THB 30	0	0	0,00
CBK	01.2024	BRL	8.875	\$ 1.823	0	(4)	0,00
	01.2024	COP	950.253	241	0	(4)	0,00
	01.2024	DKK	1.315	192	0	(3)	0,00
	01.2024	HUF	2.352	7	0	0	0,00
	01.2024	IDR	771.427	50	0	0	0,00
	01.2024	¥	58.000	408	0	(4)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Dynamic Multi-Asset Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
	01.2024	MXN	6.628	\$ 376	\$ 0	\$ (14)	(0,01)	
	01.2024	\$	190	CHF 166	7	0	0,00	
	01.2024		478	COP 1.904.395	13	0	0,01	
	01.2024		346	ZAR 6.580	13	0	0,01	
	01.2024	ZAR	855	\$ 45	0	(1)	0,00	
	02.2024	CNY	2.018	280	0	(5)	0,00	
	03.2024	\$	50	IDR 771.625	0	0	0,00	
	03.2024		644	ILS 2.346	9	0	0,00	
	03.2024		304	PEN 1.143	4	0	0,00	
	04.2024		1.823	BRL 8.965	8	0	0,00	
DUB	06.2024	KRW	1.326.248	\$ 1.016	0	(16)	(0,01)	
	01.2024		64.985	50	0	0	0,00	
	03.2024	\$	3.293	SGD 4.359	23	0	0,01	
FAR	06.2024		800	KRW 1.041.676	11	0	0,00	
GLM	02.2024	CNY	917	\$ 128	0	(2)	0,00	
	01.2024	CAD	66	50	0	0	0,00	
	01.2024	DKK	31.916	4.708	0	(23)	(0,01)	
	01.2024	HUF	49.512	133	0	(10)	0,00	
	01.2024	¥	411.943	2.802	0	(122)	(0,05)	
	01.2024	\$	1.885	BRL 9.494	70	0	0,03	
	01.2024		4.171	MXN 73.168	130	0	0,05	
	01.2024	ZAR	952	\$ 50	0	(2)	0,00	
	03.2024	IDR	46.381	3	0	0	0,00	
JPM	06.2024	KRW	1.330.993	1.024	0	(12)	0,00	
	01.2024	HUF	69.340	198	0	(3)	0,00	
	01.2024	\$	50	IDR 769.350	0	0	0,00	
	01.2024		50	KRW 64.807	0	0	0,00	
	02.2024		1.550	BRL 7.601	12	0	0,00	
	03.2024	IDR	71.066	\$ 5	0	0	0,00	
	03.2024	\$	440	INR 36.816	1	0	0,00	
	03.2024		2.279	TWD 70.862	69	0	0,03	
MBC	06.2024	KRW	64.252	\$ 50	0	0	0,00	
	01.2024	AUD	3.878	2.570	0	(77)	(0,03)	
	01.2024	£	215	272	0	(2)	0,00	
	01.2024	HUF	1	0	0	0	0,00	
	01.2024	\$	492	£ 388	3	0	0,00	
	01.2024		1.181	HUF 433.259	68	0	0,03	
	03.2024	TRY	6.062	\$ 194	0	0	0,00	
	03.2024	TWD	370	12	0	(1)	0,00	
	03.2024	\$	785	PHP 43.917	8	0	0,00	
MYI	01.2024	HUF	3.299	\$ 9	0	0	0,00	
	01.2024	PLN	519	130	0	(2)	0,00	
	01.2024	\$	1.674	DKK 11.400	15	0	0,01	
	01.2024		837	€ 757	1	(2)	0,00	
	01.2024		1.862	MYR 8.690	34	0	0,01	
	01.2024		20	SGD 26	0	0	0,00	
	01.2024	ZAR	2.525	\$ 135	0	(3)	0,00	
	02.2024	\$	2.494	CNY 17.662	3	0	0,00	
	03.2024		1.758	IDR 27.059.536	0	(3)	0,00	
RBC	06.2024		461	KRW 599.027	6	0	0,00	
SCX	04.2024		6	MXN 107	0	0	0,00	
	01.2024		399	¥ 58.100	14	0	0,01	
	01.2024		580	MXN 10.184	19	0	0,01	
	01.2024		282	SEK 2.929	9	0	0,00	
	01.2024		365	ZAR 6.920	13	0	0,01	
	03.2024	TWD	96.494	\$ 3.102	0	(95)	(0,04)	
	03.2024	\$	396	HKD 3.086	0	0	0,00	
	03.2024		3.000	INR 250.894	5	0	0,00	
SOG	03.2024		1.972	THB 68.156	38	0	0,01	
	02.2024		772	RON 3.542	14	0	0,01	
	03.2024	TWD	3.952	\$ 125	0	(6)	0,00	
SSB	01.2024	\$	629	CLP 556.000	7	0	0,00	
TOR	01.2024	¥	2.330.009	\$ 15.884	0	(653)	(0,26)	
UAG	01.2024	BRL	614	124	0	(2)	0,00	
	01.2024	\$	87	MXN 1.528	3	0	0,00	
	01.2024		145	ZAR 2.762	6	0	0,00	
	03.2024	THB	4.468	\$ 129	0	(3)	0,00	
	03.2024	\$	1.560	CZK 34.726	0	(9)	0,00	
					\$ 1.064	\$ (2.025)	\$ (961)	(0,38)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 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	01.2024	\$ 75	AUD 113	\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,00
BPS	01.2024	AUD 1	\$ 1	0	0	0	0,00
CBK	01.2024	\$ 0	KRW 87	0	0	0	0,00
MBC	01.2024	40	AUD 60	1	0	1	0,00
UAG	01.2024	57	85	2	0	2	0,00
				\$ 5	\$ 0	\$ 5	0,00

Zum 31. Dezember 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	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	01.2024	€ 1.660	\$ 1.814	\$ 1	\$ (21)	\$ (20)	(0,01)
	01.2024	\$ 1.704	€ 1.561	22	0	22	0,01
CBK	01.2024	€ 1.522	\$ 1.659	0	(24)	(24)	(0,01)
MBC	01.2024	863	935	0	(18)	(18)	(0,01)
	01.2024	\$ 37.845	€ 34.421	187	0	187	0,07
MYI	01.2024	37.729	34.327	199	0	199	0,08
UAG	01.2024	8.776	7.978	39	0	39	0,02
				\$ 448	\$ (63)	\$ 385	0,15

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Partially Hedged) thesaurierend und Class E GBP (Partially Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2024	\$ 146	£ 115	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
BPS	01.2024	237	187	1	0	1	0,00
CBK	01.2024	KRW 3.045	\$ 2	0	0	0	0,00
DUB	01.2024	£ 5	7	0	0	0	0,00
MBC	01.2024	\$ 4	£ 3	0	0	0	0,00
MYI	01.2024	£ 6	\$ 8	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 1	£ 1	0	0	0	0,00
NGF	01.2024	£ 7	\$ 9	0	0	0	0,00
RYL	01.2024	142	179	0	(2)	(2)	0,00
SCX	01.2024	\$ 1.425	£ 1.127	12	0	12	0,01
UAG	01.2024	£ 3	\$ 3	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 1.369	£ 1.082	10	0	10	0,00
				\$ 24	\$ (2)	\$ 22	0,01

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilsklassen Administrative SGD (Hedged) ausschüttend II und Class E SGD (Partially Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2024	\$ 234	SGD 312	\$ 3	\$ 0	\$ 3	0,00
GLM	01.2024	2	3	0	0	0	0,00
JPM	01.2024	187	249	2	0	2	0,00
MBC	01.2024	SGD 32	\$ 24	0	0	0	0,00
	02.2024	20	15	0	0	0	0,00
MYI	01.2024	\$ 1.219	SGD 1.626	14	0	14	0,01
	02.2024	SGD 23	\$ 17	0	0	0	0,00
TOR	01.2024	\$ 1.325	SGD 1.768	15	0	15	0,01
	02.2024	SGD 17	\$ 13	0	0	0	0,00
				\$ 34	\$ 0	\$ 34	0,02

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (2.428) (0,96)

Summe Anlagen

\$ 312.811 123,52

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (59.563) (23,52)

Nettovermögen

\$ 253.248 100,00

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

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

(a) 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 Teilfonds verbunden.

(g) Wertpapiere mit einem aggregierten beizulegenden Zeitwert von USD 15.168 (31. Dezember 2022: USD null) waren zum 31. Dezember 2023 Wertpapiere als Sicherheiten gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte verpfändet.

(h) Wertpapiere mit einem aggregierten beizulegenden Zeitwert von USD 1.225 (31. Dezember 2022: USD null) war zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte verpfändet oder geliefert.

Barmittel in Höhe von USD 4.010 (31. Dezember 2022: USD 5.919) waren zum 31. Dezember 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 2.460 (31. Dezember 2022: USD 2.260) wurden zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten für Finanzderivate gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. verpfändet.

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Dynamic Multi-Asset Fund (Forts.)

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 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	\$ 15.799	\$ 273.301	\$ 204	\$ 289.304
Investmentfonds	28.256	0	0	28.256
Pensionsgeschäfte	0	364	0	364
Finanzderivate ⁽³⁾	54	(5.167)	0	(5.113)
Summen	\$ 44.109	\$ 268.498	\$ 204	\$ 312.811

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 8.543	\$ 311.578	\$ 0	\$ 320.121
Investmentfonds	68.975	0	0	68.975
Pensionsgeschäfte	0	40.720	0	40.720
Finanzderivate ⁽³⁾	1.933	2.088	0	4.021
Summen	\$ 79.451	\$ 354.386	\$ 0	\$ 433.837

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

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

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Netto- vermögens
GRE	5,520 %	14.12.2023	04.01.2024	\$ (11.818)	\$ (11.850)	(4,68)
	5,520	18.12.2023	04.01.2024	(3.206)	(3.213)	(1,27)
Summe umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (15.063)	(5,95)

Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Zahlbar für Rückkauf- Finanzierungs- geschäfte	% des Netto- vermögens
TDM	5,530 %	19.12.2023	02.01.2024	\$ (1.226)	\$ (1.229)	(0,49)
Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte					\$ (1.229)	(0,49)

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
AZD	\$ 2	\$ 0	\$ 2	\$ 1	\$ 0	\$ 1
BOA	(151)	0	(151)	441	(240)	201
BPS	(990)	1.250	260	(230)	620	390
BRC	348	(370)	(22)	170	170	340
CBK	(53)	(1.080)	(1.133)	430	(240)	190
DUB	34	0	34	(119)	0	(119)
FAR	(225)	0	(225)	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	(203)	0	(203)	557	(550)	7
GST	(591)	560	(31)	(118)	260	142
JPM	(73)	0	(73)	40	400	440
MAC	(178)	0	(178)	192	0	192
MBC	169	(360)	(191)	375	(200)	175
MYC	(214)	260	46	(176)	260	84
MYI	262	(480)	(218)	(336)	550	214
RBC	k. A.	k. A.	k. A.	(21)	0	(21)
RYL	(2)	10	8	k. A.	k. A.	k. A.
SAL	(1)	0	(1)	(2)	0	(2)
SCX	15	0	15	2.207	(260)	1.947
SOG	8	0	8	66	0	66
SSB	7	0	7	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	(638)	380	(258)	1	0	1
UAG	46	0	46	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. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	79,26	53,86
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	34,78	24,35
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,20	1,21
Investmentfonds	11,16	17,11
Pensionsgeschäfte	0,14	10,10
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,88)	0,49
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,18)	(0,47)
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,96)	0,98
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(5,95)	k. A.
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(0,49)	k. A.

* Gemäß der Liste der Märkte, die die Kriterien für einen geregelten OGAW-Markt erfüllen, in Anlage 1 zum Verkaufsprospekt.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	2,83	3,02
US-Regierungsbehörden	27,20	10,47
US-Schatzobligationen	33,95	29,26
Non-Agency-MBS	4,33	4,06
Forderungsbesicherte Wertpapiere	4,24	3,00
Staatsemissionen	33,66	20,01
Stammaktien	0,33	0,37
Vorzugswertpapiere	0,05	0,14
Real Estate Investment Trusts	5,91	1,75
Kurzfristige Instrumente	1,74	7,34
Investmentfonds	11,16	17,11
Pensionsgeschäfte	0,14	10,10
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,83)	0,49
Verkaufsoptionen		
Future-ähnliche Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	(0,05)	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	k. A.	0,00
Zinsswaps	(0,18)	(0,47)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	k. A.	0,14
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Inflation-Capped Options	(0,01)	(0,01)
Zinsswapoptionen	(0,54)	(0,23)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,00	0,00
Zinsswaps	(0,07)	(0,04)
Total Return Swaps auf Indizes	(0,14)	(0,20)
Total Return Swaps auf Wertpapiere	0,00	k. A.
Devisenterminkontrakte	(0,38)	0,33
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,18	0,99
Sonstige Aktiva und Passiva	(23,52)	(7,63)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
6,000 % fällig am 01.04.2035 - 01.01.2041	\$ 848	\$ 886	0,11
6,500 % fällig am 01.12.2035 - 01.01.2036	6	7	0,00
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
4,000 % fällig am 01.01.2054	19.600	18.545	2,29
4,500 % fällig am 01.02.2054	42.600	41.324	5,10
5,000 % fällig am 01.01.2054	70.400	69.678	8,60
5,500 % fällig am 01.02.2054	6.300	6.329	0,78
		<u>276.596</u>	<u>34,15</u>

US-SCHATZ Obligationen

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
U.S. Treasury Notes			
0,250 % fällig am 31.05.2025	27.900	26.280	3,24
0,375 % fällig am 31.01.2026 (e)	139.800	129.181	15,95
2,875 % fällig am 15.05.2032	1.800	1.669	0,21
4,250 % fällig am 31.12.2024 (f)	65.300	64.955	8,02
4,250 % fällig am 31.05.2025 (f)	19.800	19.730	2,44
4,375 % fällig am 15.08.2026 (e)	26.200	26.381	3,26
4,375 % fällig am 30.11.2028	31.200	31.931	3,94
4,750 % fällig am 31.07.2025 (e)	39.300	39.484	4,88
4,875 % fällig am 30.11.2025	27.600	27.888	3,44
5,000 % fällig am 31.08.2025 (e)	47.600	48.045	5,93
5,000 % fällig am 30.09.2025 (e)	42.000	42.432	5,24
		<u>457.976</u>	<u>56,55</u>

NON-AGENCY-MBS

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Banc of America Mortgage Trust			
5,267 % fällig am 25.07.2034	11	9	0,00
5,274 % fällig am 25.08.2034	202	193	0,02
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust			
4,746 % fällig am 25.07.2034	114	105	0,01
5,125 % fällig am 25.01.2035	6	5	0,00
5,652 % fällig am 25.01.2034	6	6	0,00
Bear Stearns ALT-A Trust			
5,446 % fällig am 25.12.2033	25	24	0,00
5,790 % fällig am 25.02.2034	46	43	0,01
Benchmark Mortgage Trust			
3,965 % fällig am 10.04.2051	866	844	0,10
Citigroup Global Markets Mortgage Securities, Inc.			
7,000 % fällig am 25.12.2018	1	1	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust			
7,780 % fällig am 25.10.2035	13	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			
4,765 % fällig am 25.11.2034	28	25	0,00
5,003 % fällig am 20.02.2035	7	7	0,00
DBGS Mortgage Trust			
6,254 % fällig am 15.06.2033	2.800	2.573	0,32
Eurosail PLC			
6,289 % fällig am 13.06.2045	£ 3.458	4.381	0,54
Formentera Issuer PLC			
6,020 % fällig am 28.07.2047	2.266	2.885	0,36
Great Hall Mortgages PLC			
5,812 % fällig am 18.06.2039	\$ 267	265	0,03
GSR Mortgage Loan Trust			
4,836 % fällig am 25.09.2035	67	63	0,01
6,000 % fällig am 25.03.2032	0	0	0,00
IndyMac Mortgage Loan Trust			
5,950 % fällig am 25.04.2035	259	213	0,03
Morgan Stanley Capital Trust			
6,559 % fällig am 15.07.2035	4.260	4.225	0,52
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust			
5,332 % fällig am 25.10.2034	248	232	0,03
MortgageIT Trust			
6,110 % fällig am 25.02.2035	54	51	0,01
Opteum Mortgage Acceptance Corp. Asset-Backed Pass-Through Certificates			
6,030 % fällig am 25.12.2035	250	231	0,03
Prime Mortgage Trust			
5,870 % fällig am 25.02.2034	2	1	0,00
Primrose Residential DAC			
4,626 % fällig am 24.03.2061	€ 2.629	2.895	0,36

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Ripon Mortgages PLC			
5,920 % fällig am 28.08.2056	£ 3.966	\$ 5.041	0,62
Sequoia Mortgage Trust			
5,892 % fällig am 20.06.2036	\$ 197	182	0,02
6,272 % fällig am 20.10.2027	1	1	0,00
Stratton Mortgage Funding PLC			
6,121 % fällig am 20.07.2060	£ 2.470	3.149	0,39
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust			
4,351 % fällig am 25.01.2035	\$ 124	122	0,02
Structured Asset Mortgage Investments Trust			
5,970 % fällig am 19.07.2035	13	12	0,00
Thornburg Mortgage Securities Trust			
6,150 % fällig am 25.04.2043	0	0	0,00
Towd Point Mortgage Funding PLC			
6,365 % fällig am 20.10.2051	£ 1.853	2.365	0,29
6,570 % fällig am 20.05.2045	£ 4.545	5.803	0,72
6,571 % fällig am 20.07.2045	2.237	2.860	0,35
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
6,150 % fällig am 25.01.2045	\$ 397	374	0,05
6,412 % fällig am 25.06.2042	4	4	0,00
Warwick Finance Residential Mortgages PLC			
6,170 % fällig am 21.12.2049	£ 805	1.029	0,13
Wells Fargo-RBS Commercial Mortgage Trust			
3,995 % fällig am 15.05.2047	\$ 4.300	4.248	0,52
		<u>44.489</u>	<u>5,49</u>

FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates			
6,490 % fällig am 25.10.2034	780	771	0,10
Ares European CLO DAC			
4,843 % fällig am 20.04.2032	€ 3.100	3.370	0,42
Avoca CLO DAC			
4,785 % fällig am 15.10.2032	3.000	3.273	0,40
Barings Euro CLO DAC			
4,836 % fällig am 25.11.2029	432	477	0,06
Black Diamond CLO DAC			
4,982 % fällig am 15.05.2032	2.638	2.877	0,36
BlueMountain Fuji EUR CLO DAC			
4,685 % fällig am 15.01.2031	2.384	2.605	0,32
BNPP AM Euro CLO DAC			
4,822 % fällig am 22.07.2032	3.000	3.271	0,40
Bridgepoint CLO DAC			
5,175 % fällig am 15.01.2034	3.400	3.729	0,46
Carbone CLO Ltd.			
6,817 % fällig am 20.01.2031	\$ 3.155	3.157	0,39
Carlyle Euro CLO DAC			
4,665 % fällig am 15.01.2031	€ 2.182	2.386	0,29
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.			
4,752 % fällig am 15.11.2031	2.595	2.827	0,35
Catamaran CLO Ltd.			
6,774 % fällig am 22.04.2030	\$ 2.363	2.363	0,29
CBAM Ltd.			
6,684 % fällig am 17.04.2031	476	475	0,06
CIFC Funding Ltd.			
6,844 % fällig am 16.11.2030	2.000	2.002	0,25
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust			
6,520 % fällig am 25.11.2034	252	248	0,03
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.			
5,077 % fällig am 25.01.2032	6	6	0,00
Fortress Investment Group LLC			
7,187 % fällig am 23.02.2039	7.200	7.024	0,87
GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC			
4,893 % fällig am 20.01.2032	€ 2.500	2.734	0,34
GoldenTree Loan Opportunities Ltd.			
6,797 % fällig am 20.07.2031	\$ 2.650	2.652	0,33
Greystone Commercial Real Estate Notes Ltd.			
6,656 % fällig am 15.09.2037	509	508	0,06
Griffith Park CLO DAC			
4,704 % fällig am 21.11.2031	€ 2.987	3.248	0,40
Harvest CLO DAC			
4,566 % fällig am 26.06.2030	1.985	2.169	0,27

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Jubilee CLO DAC			
4,575 % fällig am 15.04.2030	€ 3.778	\$ 4.149	0,51
Madison Park Euro Funding DAC			
4,715 % fällig am 15.01.2032	2.700	2.939	0,36
Marble Point CLO Ltd.			
6,837 % fällig am 18.12.2030	\$ 3.053	3.054	0,38
Nassau Ltd.			
6,805 % fällig am 15.10.2029	517	517	0,06
OCP Euro CLO DAC			
5,873 % fällig am 20.01.2033	€ 2.000	2.209	0,27
Octagon Loan Funding Ltd.			
6,809 % fällig am 18.11.2031	\$ 3.400	3.405	0,42
Palmer Square European Loan Funding DAC			
4,685 % fällig am 15.10.2031	€ 2.346	2.551	0,31
4,695 % fällig am 15.07.2031	1.973	2.153	0,27
5,602 % fällig am 15.11.2032	3.138	3.466	0,43
Saranac CLO Ltd.			
7,233 % fällig am 22.06.2030	\$ 2.041	2.044	0,25
SLM Student Loan Trust			
5,746 % fällig am 25.10.2029	132	132	0,02
Tikehau CLO DAC			
4,844 % fällig am 04.08.2034	€ 2.300	2.511	0,31
Toro European CLO DAC			
4,812 % fällig am 15.02.2034	3.200	3.487	0,43
4,908 % fällig am 12.01.2032	2.500	2.740	0,34
Venture CLO Ltd.			
6,777 % fällig am 20.01.2029	\$ 1.574	1.574	0,19
		<u>89.103</u>	<u>11,00</u>

STAATSEMISSIONEN

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Brazil Letras do Tesouro Nacional			
0,000 % fällig am 01.01.2024 (b)	BRL 24.700	5.085	0,63
0,000 % fällig am 01.07.2024 (b)	71.800	14.066	1,74
		<u>19.151</u>	<u>2,37</u>

Summe übertragbare Wertpapiere \$ 1.099.774 135,80

AKTIEN

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
INVESTMENTFONDS ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - US Short-Term Fund (c)	3.382.522	34.231	4,23
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (c)	3.121	31	0,00
		<u>34.262</u>	<u>4,23</u>

BÖRSENGEHANDELTE FONDS

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (c)	484.660	48.331	5,97

Summe Investmentfonds \$82.593 10,20

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Average Duration Fund (Forts.)

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	2,600 %	29.12.2023	02.01.2024	\$ 1.044	U.S. Treasury Notes 4,875 % fällig am 30.11.2025	\$ (1.065)	\$ 1.044	\$ 1.044	0,13
	5,330	29.12.2023	02.01.2024	58.700	U.S. Treasury Notes 1,500 % fällig am 30.11.2028	(59.874)	58.700	58.700	7,25
JPS	5,490	02.01.2024	03.01.2024	100	U.S. Treasury Notes 4,125 % fällig am 31.01.2025	(102)	100	100	0,01
SAL	5,480	02.01.2024	03.01.2024	40.900	U.S. Treasury Notes 0,375 % fällig am 15.07.2024	(41.782)	40.900	40.906	5,05
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (102.823)	\$ 100.744	\$ 100.750	12,44

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl March Futures	Short	03.2024	91	\$ (192)	(0,02)
Japan Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2024	36	(308)	(0,04)
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Long	03.2024	833	1.389	0,17
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2024	258	604	0,08
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Short	03.2024	720	(2.570)	(0,32)
U.S. Treasury 10-Year Ultra March Futures	Short	03.2024	524	(2.368)	(0,29)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (3.445)	(0,42)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

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

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000 %	20.12.2024	\$ 1.000	\$ 2	0,00

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000 %	17.03.2024	¥ 5.680.000	\$ 13	0,00
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,380	18.06.2028	90.000	1	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,993	13.10.2024	\$ 53.500	(141)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,088	07.11.2024	26.600	(20)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,340	23.02.2030	2.900	3	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,470	22.02.2030	1.100	3	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,525	02.03.2030	1.200	4	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	21.11.2024	40.700	23	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	11.12.2024	14.800	(115)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,800	10.03.2028	1.800	0	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,233	13.09.2024	11.800	(22)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	14.09.2024	12.600	(22)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,715	13.09.2024	22.500	(15)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,750	14.09.2024	12.600	(7)	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	4,000	14.06.2024	NZD 279.100	83	0,01
Zahlung	3-Month NZD-BBR	4,500	13.09.2024	8.800	70	0,01
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ (142)	(0,02)
					\$ (140)	(0,02)

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

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

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

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	South Africa Government International Bond	1,000 %	20.12.2026	\$ 2.000	\$ (94)	\$ 81	\$ (13)	0,00
CBK	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2026	5.600	(270)	235	(35)	(0,01)
MYC	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	1.900	(108)	109	1	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	2.300	(205)	193	(12)	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2026	4.200	(195)	169	(26)	0,00
					\$ (872)	\$ 787	\$ (85)	(0,01)

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

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	01.2024	£	921	\$ 1.170	\$ 0	\$ (4)	0,00	
	01.2024	NZD	2.180	1.328	0	(52)	(0,01)	
	01.2024	\$	2.762	¥ 407.621	131	0	0,02	
BPS	01.2024	€	680	\$ 739	0	(13)	0,00	
	01.2024	£	3.512	4.454	0	(23)	0,00	
	01.2024	\$	473	ZAR 8.774	6	0	0,00	
	02.2024		2	CNY 14	0	0	0,00	
CBK	01.2024		13.520	BRL 65.831	32	0	0,00	
	01.2024		1.560	£ 1.228	5	0	0,00	
	03.2024		54	ILS 197	1	0	0,00	
	04.2024	BRL	66.497	\$ 13.520	0	(56)	(0,01)	
GLM	01.2024		93.000	18.356	0	(789)	(0,10)	
	01.2024	MXN	1.134	65	0	(2)	0,00	
	01.2024	\$	19.464	BRL 95.432	199	(18)	0,02	
	07.2024	BRL	71.800	\$ 14.496	0	(26)	0,00	
JPM	01.2024		68.032	14.094	89	0	0,01	
	03.2024	CNH	482	67	0	(1)	0,00	
	04.2024	\$	14.094	BRL 68.719	0	(64)	(0,01)	
MBC	01.2024	¥	65.200	\$ 457	0	(5)	0,00	
	01.2024	ZAR	104.098	5.447	0	(239)	(0,03)	
MYI	01.2024	\$	24	€ 21	0	0	0,00	
	01.2024		897	£ 712	12	0	0,00	
	01.2024		1.050	¥ 154.841	49	0	0,01	
	02.2024		1	CNY 10	0	0	0,00	
RYL	01.2024		919	NZD 1.479	17	0	0,00	
TOR	01.2024		1.736	¥ 254.637	71	0	0,01	
UAG	01.2024	€	84.476	\$ 92.921	0	(417)	(0,05)	
	01.2024	£	19.078	24.144	0	(178)	(0,02)	
	01.2024	\$	2.352	ZAR 44.892	100	0	0,01	
					\$ 712	\$ (1.887)	\$ (1.175)	(0,15)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens	
BPS	01.2024	€	913	\$ 999	\$ 0	\$ (9)	0,00	
	01.2024	\$	635	€ 582	8	8	0,00	
CBK	01.2024	€	96	\$ 105	0	(1)	0,00	
	01.2024	\$	8	€ 7	0	0	0,00	
MBC	01.2024	€	99	\$ 108	0	(1)	0,00	
	01.2024	\$	15.718	€ 14.296	78	78	0,01	
MYI	01.2024		15.642	14.232	82	0	0,01	
UAG	01.2024		15.546	14.133	70	0	0,01	
					\$ 238	\$ (11)	\$ 227	0,03

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Average Duration Fund (Forts.)

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
BOA	01.2024	\$ 829	£ 653	\$ 4	\$ 0	\$ 4	0,00
BPS	01.2024	2.087	1.643	8	(1)	7	0,00
BRC	01.2024	£ 5.888	\$ 7.500	0	(6)	(6)	0,00
	01.2024	\$ 32	£ 26	0	0	0	0,00
CBK	01.2024	£ 114	\$ 144	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	\$ 560	£ 445	8	0	8	0,00
DUB	01.2024	9.185	7.263	74	0	74	0,01
FAR	01.2024	£ 1.159	\$ 1.468	0	(9)	(9)	0,00
GLM	01.2024	\$ 249	£ 196	0	0	0	0,00
MBC	01.2024	£ 5.900	\$ 7.515	0	(7)	(7)	0,00
	01.2024	\$ 170	£ 134	1	0	1	0,00
MYI	01.2024	9.551	7.590	125	0	125	0,01
RYL	01.2024	£ 5.888	\$ 7.499	0	(7)	(7)	0,00
SCX	01.2024	\$ 9.710	£ 7.677	77	0	77	0,01
SSB	01.2024	7.028	5.570	72	0	72	0,01
UAG	01.2024	9.709	7.672	71	0	71	0,01
				\$ 440	\$ (31)	\$ 409	0,05

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (624) (0,08)

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000\$)	MARKT- WERT (000\$)	% DES NETTO- VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
3,000 % fällig am 01.02.2054	\$ 11.500	\$ (10.185)	(1,26)
3,000 % fällig am 01.03.2054	13.000	(11.528)	(1,42)
3,500 % fällig am 01.02.2054	31.000	(28.472)	(3,52)
Summe leerverkaufte Wertpapiere		\$ (50.185)	(6,20)
Summe Anlagen		\$ 1.228.717	151,72
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (418.872)	(51,72)
Nettovermögen		\$ 809.845	100,00

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

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

- (a) Reines Kapitalwertpapier.
 (b) Nullkuponwertpapier.
 (c) Mit dem Teilfonds verbunden.
 (d) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,26 %):

Emitentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits- datum	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Citigroup, Inc.	6,075 %	25.01.2026	18.01.2022	\$ 2.900	\$ 2.884	0,36

(e) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 271.704 (31. Dezember 2022: USD 143.852) waren zum 31. Dezember 2023 Wertpapiere als Sicherheiten gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte verpfändet.

(f) Wertpapiere mit einem aggregierten beizulegenden Zeitwert von USD 43.703 (31. Dezember 2022: USD 4.050) wurden zum 31. Dezember 2023 gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.

Barmittel in Höhe von USD 5.856 (31. Dezember 2022: USD 16.925) waren zum 31. Dezember 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 1.641 (31. Dezember 2022: USD 5.301) wurden zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten für Finanzderivate gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 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	\$ 1.099.282	\$ 492	\$ 1.099.774
Investmentfonds	34.262	48.331	0	82.593
Pensionsgeschäfte	0	100.744	0	100.744
Finanzderivate ⁽³⁾	(500)	(3.709)	0	(4.209)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(50.185)	0	(50.185)
Summen	\$ 33.762	\$ 1.194.463	\$ 492	\$ 1.228.717

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.234.805	\$ 801	\$ 1.235.606
Investmentfonds	37.618	48.013	0	85.631
Pensionsgeschäfte	0	956	0	956
Finanzderivate ⁽³⁾	1.960	(9.079)	0	(7.119)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(76.949)	0	(76.949)
Summen	\$ 39.578	\$ 1.197.746	\$ 801	\$ 1.238.125

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

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

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
STR	5,540 %	02.01.2024	03.01.2024	\$ (256.904)	\$ (256.904)	(31,72)
	5,660	29.12.2023	02.01.2024	(268.565)	(268.691)	(33,18)
Summe umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (525.595)	(64,90)

Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Zahlbar für Rückkauf- Finanzierungs- geschäfte ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
MSC	5,710 %	19.12.2023	04.01.2024	\$ (24.470)	\$ (24.482)	(3,02)
	5,740	19.12.2023	04.01.2024	(19.788)	(19.797)	(2,45)
Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte					\$ (44.279)	(5,47)

⁽¹⁾ In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag sind USD 21 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 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ 66	\$ 0	\$ 66	\$ (1.233)	\$ 1.360	\$ 127
BPS	(24)	0	(24)	(2.779)	2.650	(129)
BRC	(6)	0	(6)	8	0	8
CBK	(47)	0	(47)	903	(890)	13
CLY	k. A.	k. A.	k. A.	(22)	0	(22)
DUB	74	0	74	k. A.	k. A.	k. A.
FAR	(9)	0	(9)	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	(636)	501	(135)	(802)	751	(51)
JPM	24	0	24	97	(190)	(93)
MBC	(173)	30	(143)	1.204	(980)	224
MYC	(37)	260	223	(1.239)	510	(729)
MYI	268	(390)	(122)	(103)	30	(73)
RBC	k. A.	k. A.	k. A.	(1)	0	(1)
SAL	k. A.	k. A.	k. A.	(4)	0	(4)
RYL	10	0	10	k. A.	k. A.	k. A.
SCX	77	(110)	(33)	277	(230)	47
SSB	72	0	72	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	71	0	71	5	(10)	(5)
UAG	(354)	850	496	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. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	84,32	70,91
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	51,48	43,49
Sonstige übertragbare Wertpapiere	k. A.	0,78
Investmentfonds	10,20	7,98
Pensionsgeschäfte	12,44	0,09
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,42)	0,21
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,02)	(0,55)
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,08)	(0,32)
Leerverkaufte Wertpapiere	(6,20)	(7,17)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(64,90)	(13,50)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(5,47)	(0,38)

* Gemäß der Liste der Märkte, die die Kriterien für einen geregelten OGAW-Markt erfüllen, in Anlage 1 zum Verkaufsprospekt.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	26,24	28,04
US-Regierungsbehörden	34,15	22,99
US-Schatzobligationen	56,55	47,28
Non-Agency-MBS	5,49	6,37
Forderungsbesicherte Wertpapiere	11,00	9,23
Staatsemissionen	2,37	k. A.
Kurzfristige Instrumente	k. A.	1,27
Investmentfonds	10,20	7,98
Pensionsgeschäfte	12,44	0,09
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,42)	0,21
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	k. A.	(0,07)
Zinsswaps	(0,02)	(0,48)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	k. A.	0,03
Verkaufsoptionen		
Zinsswapoptionen	k. A.	(0,19)
Optionen auf Wertpapiere	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	(0,01)	(0,07)
Devisenterminkontrakte	(0,15)	(0,27)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,08	0,18
Leerverkaufte Wertpapiere	(6,20)	(7,17)
Sonstige Aktiva und Passiva	(51,72)	(15,42)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE											
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG											
Delos Aircraft DAC				Bank of America N.A.				Danske Bank A/S			
7,348 % fällig am 31.10.2027	\$	240	0,02	5,526 % fällig am 18.08.2026	\$	1.000	0,11	6,259 % fällig am 22.09.2026	\$	3.000	0,31
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL											
BANKEN UND FINANZEN											
Abanca Corp. Bancaria S.A.				Bank of Nova Scotia				Deutsche Bank AG			
0,500 % fällig am 08.09.2027	€	400	0,04	0,250 % fällig am 01.11.2028	€	400	0,04	1,375 % fällig am 03.09.2026	€	300	0,03
ABN AMRO Bank NV				Banque Federative du Credit Mutuel S.A.				1,447 % fällig am			
3,625 % fällig am 10.01.2026		700	0,08	4,875 % fällig am 25.09.2025	£	3.000	0,39	01.04.2025 (f)	\$	1.600	0,16
6,339 % fällig am 18.09.2027	\$	2.500	0,26	Barclays PLC				2,129 % fällig am			
Aegon Bank NV				2,885 % fällig am 31.01.2027	€	300	0,03	24.11.2026 (f)		500	0,05
0,625 % fällig am 21.06.2024	€	3.300	0,37	3,375 % fällig am 02.04.2025		400	0,05	6,720 % fällig am 18.01.2029		2.000	0,22
AerCap Ireland Capital DAC				7,285 % fällig am 13.09.2027	\$	6.500	0,67	6,819 % fällig am 20.11.2029		600	0,07
2,875 % fällig am 14.08.2024	\$	700	0,07	BGC Group, Inc.				Deutsche Börse AG			
AIB Group PLC				8,000 % fällig am 25.05.2028		400	0,04	3,875 % fällig am 28.09.2026	€	2.000	0,23
3,625 % fällig am 04.07.2026	€	300	0,03	Blackstone Private Credit Fund				Digital Euro Finco LLC			
Aircastle Ltd.				2,350 % fällig am 22.11.2024		900	0,09	2,500 % fällig am 16.01.2026		300	0,03
5,250 % fällig am 11.08.2025	\$	1.805	0,18	4,700 % fällig am 24.03.2025		700	0,07	EPR Properties			
6,500 % fällig am 18.07.2028		500	0,05	BNP Paribas S.A.				4,500 % fällig am 01.06.2027	\$	1.500	0,15
Ally Financial, Inc.				2,125 % fällig am 23.01.2027	€	300	0,03	EQT AB			
5,800 % fällig am 01.05.2025		2.000	0,21	2,219 % fällig am 09.06.2026	\$	1.500	0,15	2,375 % fällig am 06.04.2028	€	400	0,04
6,848 % fällig am 03.01.2030		500	0,05	3,375 % fällig am 09.01.2025		4.883	0,49	Equinix, Inc.			
AMCO - Asset Management Co. SpA				3,800 % fällig am 10.01.2024		500	0,05	0,250 % fällig am 15.03.2027		400	0,04
4,625 % fällig am 06.02.2027		1.400	0,16	BPCE S.A.				Equitable Financial Life Global Funding			
American Honda Finance Corp.				0,500 % fällig am 15.09.2027	€	400	0,04	5,500 % fällig am 02.12.2025	\$	3.200	0,33
5,000 % fällig am 23.05.2025	\$	1.800	0,19	1,652 % fällig am 06.10.2026	\$	300	0,03	Europäische Union			
American Tower Corp.				3,625 % fällig am 17.04.2026	€	600	0,07	2,000 % fällig am 04.10.2027	€	12.200	1,37
1,450 % fällig am 15.09.2026		4.000	0,38	5,975 % fällig am 18.01.2027	\$	2.800	0,29	Extra Space Storage LP			
2,400 % fällig am 15.03.2025		800	0,08	Brandywine Operating Partnership LP				5,700 % fällig am 01.04.2028	\$	400	0,04
3,650 % fällig am 15.03.2027		900	0,09	3,950 % fällig am 15.11.2027		600	0,06	F&G Global Funding			
5,250 % fällig am 15.07.2028		1.000	0,10	7,800 % fällig am 15.03.2028		300	0,03	2,300 % fällig am 11.04.2027		1.000	0,09
5,800 % fällig am 15.11.2028		4.800	0,51	CaixaBank S.A.				Fastighets AB Balder			
Ares Capital Corp.				4,625 % fällig am 16.05.2027	€	300	0,04	1,125 % fällig am 29.01.2027	€	1.500	0,15
2,875 % fällig am 15.06.2027		800	0,08	Cantor Fitzgerald LP				First American Financial Corp.			
7,000 % fällig am 15.01.2027		2.000	0,21	4,500 % fällig am 14.04.2027	\$	600	0,06	4,600 % fällig am 15.11.2024	\$	200	0,02
Ares Management Corp.				7,200 % fällig am 12.12.2028		500	0,05	Ford Motor Credit Co. LLC			
6,375 % fällig am 10.11.2028		2.400	0,26	Charles Schwab Corp.				1,744 % fällig am 19.07.2024	€	100	0,01
ASB Bank Ltd.				0,750 % fällig am 18.03.2024		2.600	0,27	2,386 % fällig am 17.02.2026		300	0,03
4,500 % fällig am 16.03.2027	€	300	0,04	5,916 % fällig am 13.05.2026		200	0,02	3,021 % fällig am 06.03.2024		800	0,09
Asian Development Bank				5,924 % fällig am 18.03.2024		1.500	0,15	3,250 % fällig am 15.09.2025		200	0,02
6,125 % fällig am 15.08.2025	£	4.000	0,54	Citigroup, Inc.				4,535 % fällig am 06.03.2025	£	600	0,08
Assured Guaranty U.S. Holdings, Inc.				2,014 % fällig am 25.01.2026 (f)		2.000	0,20	4,542 % fällig am 01.08.2026	\$	500	0,05
6,125 % fällig am 15.09.2028	\$	500	0,05	3,290 % fällig am 17.03.2026 (f)		3.200	0,32	4,675 % fällig am 01.12.2024	€	1.100	0,13
Athene Global Funding				Clydesdale Bank PLC				4,950 % fällig am 28.05.2027	\$	500	0,05
2,500 % fällig am 24.03.2028		2.053	0,19	5,820 % fällig am 22.09.2028	£	1.100	0,14	Freedom Mortgage Corp.			
6,108 % fällig am 24.05.2024		2.500	0,26	Commerzbank AG				12,000 % fällig am 01.10.2028		300	0,03
Aviation Capital Group LLC				4,625 % fällig am 21.03.2028	€	300	0,04	FS KKR Capital Corp.			
4,375 % fällig am 30.01.2024		800	0,08	5,250 % fällig am 25.03.2029		400	0,05	1,650 % fällig am 12.10.2024		800	0,08
5,500 % fällig am 15.12.2024		700	0,07	Commonwealth Bank of Australia				2,625 % fällig am 15.01.2027		400	0,04
Avolon Holdings Funding Ltd.				3,768 % fällig am 31.08.2027		2.000	0,23	7,875 % fällig am 15.01.2029		400	0,04
2,528 % fällig am 18.11.2027		1.600	0,15	5,071 % fällig am 14.09.2028	\$	1.350	0,14	GA Global Funding Trust			
3,950 % fällig am 01.07.2024		1.400	0,14	Consumers Securitization Funding LLC				1,000 % fällig am 08.04.2024		1.400	0,14
6,375 % fällig am 04.05.2028		500	0,05	5,550 % fällig am 01.03.2028		1.500	0,16	Gaci First Investment Co.			
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA				Cooperative Rabobank UA				4,750 % fällig am 14.02.2030		1.200	0,12
1,875 % fällig am 09.01.2026	€	900	0,10	2,625 % fällig am 22.07.2024		300	0,03	General Motors Financial Co., Inc.			
2,625 % fällig am 28.04.2025		500	0,06	Corebridge Financial, Inc.				0,600 % fällig am 20.05.2027	€	400	0,04
3,625 % fällig am 24.09.2024		4.100	0,46	3,650 % fällig am 05.04.2027		1.800	0,18	5,150 % fällig am 15.08.2026	£	1.400	0,18
Banco BPM SpA				CPI Property Group S.A.				Goldman Sachs Group, Inc.			
3,875 % fällig am 18.09.2026		2.600	0,30	2,750 % fällig am 12.05.2026	€	1.200	0,11	1,948 % fällig am 21.10.2027	\$	4.300	0,40
Banco BTG Pactual S.A.				Credit Acceptance Corp.				3,272 % fällig am 29.09.2025		2.700	0,27
4,500 % fällig am 10.01.2025	\$	500	0,05	9,250 % fällig am 15.12.2028	\$	500	0,06	3,850 % fällig am 08.07.2024		2.000	0,20
Banco de Sabadell S.A.				Credit Agricole S.A.				6,079 % fällig am 24.01.2025		1.600	0,16
5,125 % fällig am 10.11.2028	€	600	0,07	0,500 % fällig am 24.06.2024	€	2.300	0,26	6,484 % fällig am 24.10.2029		2.000	0,22
Banco Santander Chile				6,316 % fällig am 03.10.2029	\$	250	0,03	Golub Capital BDC, Inc.			
2,700 % fällig am 10.01.2025	\$	500	0,05	Credit Suisse AG				7,050 % fällig am 05.12.2028		400	0,04
Banco Santander S.A.				0,250 % fällig am 05.01.2026	€	300	0,03	Goodman U.S. Finance Three LLC			
6,527 % fällig am 07.11.2027		2.400	0,26	4,750 % fällig am 09.08.2024	\$	300	0,03	3,700 % fällig am 15.03.2028		3.200	0,31
6,607 % fällig am 07.11.2028		1.000	0,11	7,950 % fällig am 09.01.2025		3.000	0,32	Groupe Bruxelles Lambert NV			
Bank of America Corp.				Cromwell Ereit Lux Finco SARL				1,875 % fällig am 19.06.2025	€	1.700	0,19
2,015 % fällig am 13.02.2026		1.100	0,11	2,125 % fällig am 19.11.2025	€	1.600	0,17	Hamburg Commercial Bank AG			
2,375 % fällig am 19.06.2024	€	10.200	1,15	Crown Castle, Inc.				4,875 % fällig am 17.03.2025		1.700	0,19
5,080 % fällig am 20.01.2027	\$	2.300	0,24	3,650 % fällig am 01.09.2027	\$	200	0,02	6,250 % fällig am 18.11.2024		2.000	0,23
5,933 % fällig am 15.09.2027		1.500	0,16	3,700 % fällig am 15.06.2026		600	0,06	HSBC Holdings PLC			
				4,800 % fällig am 01.09.2028		2.163	0,22	2,099 % fällig am 04.06.2026	€	1.000	0,10
				CTP NV				3,019 % fällig am 15.06.2027	\$	1.300	0,15
				0,500 % fällig am 21.06.2025	€	100	0,01	4,583 % fällig am 19.06.2029	\$	3.000	0,30
				0,625 % fällig am 27.09.2026		400	0,04	Hudson Pacific Properties LP			
				0,750 % fällig am 18.02.2027		1.500	0,15	5,950 % fällig am 15.02.2028		900	0,08
				0,875 % fällig am 20.01.2026		2.100	0,22	ING Belgium S.A.			
				DAE Sukuk Dfc Ltd.				3,375 % fällig am 31.05.2027	€	2.300	0,27
				3,750 % fällig am 15.02.2026	\$	700	0,07	ING Groep NV			
								2,125 % fällig am 23.05.2026		300	0,03

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	
Arcadis NV		€ 2.400	\$ 2.750	0,28	Dell International LLC	\$ 500	\$ 501	0,05	John Lewis PLC	£ 200	\$ 254	0,03
4,875 % fällig am 28.02.2028					4,900 % fällig am 01.10.2026				6,125 % fällig am 21.01.2025			
Asahi Group Holdings Ltd.	1.200	1.310	0,13	Delta Air Lines, Inc.	2.100	2.046	0,21	Kenvue, Inc.	\$ 2.600	2.623	0,27	
0,010 % fällig am 19.04.2024				2,900 % fällig am 28.10.2024				5,500 % fällig am 22.03.2025				
0,155 % fällig am 23.10.2024	500	536	0,06	Devon Energy Corp.	600	604	0,06	Kering S.A.	£ 2.600	3.383	0,35	
Ashtead Capital, Inc.	\$ 400	363	0,04	5,250 % fällig am 15.10.2027				5,125 % fällig am 23.11.2026				
1,500 % fällig am 12.08.2026				eBay, Inc.	4.000	4.067	0,42	Kinder Morgan Energy Partners LP	\$ 600	595	0,06	
Assa Abloy AB	€ 1.600	1.801	0,19	5,900 % fällig am 22.11.2025				4,250 % fällig am 01.09.2024				
3,750 % fällig am 13.09.2026				Enbridge, Inc.	4.300	4.416	0,45	Kraft Heinz Foods Co.	€ 300	321	0,03	
Astrazeneca Finance LLC	\$ 600	612	0,06	5,900 % fällig am 15.11.2026				2,250 % fällig am 25.05.2028				
4,875 % fällig am 03.03.2028				Energy Transfer LP	4.000	4.083	0,42	L3Harris Technologies, Inc.	\$ 2.900	2.962	0,30	
Aurizon Network Pty. Ltd.	€ 600	657	0,07	5,550 % fällig am 15.02.2028				5,400 % fällig am 15.01.2027				
3,125 % fällig am 01.06.2026				6,050 % fällig am 01.12.2026	1.000	1.029	0,11	Las Vegas Sands Corp.	1.700	1.622	0,17	
BAE Systems Holdings, Inc.	\$ 1.100	1.077	0,11	Eni SpA	1.000	1.001	0,10	3,500 % fällig am 18.08.2026				
3,850 % fällig am 15.12.2025				4,750 % fällig am 12.09.2028				Lenovo Group Ltd.	600	603	0,06	
Baxter International, Inc.	2.389	2.384	0,25	Entergy Louisiana LLC	1.400	1.355	0,14	5,875 % fällig am 24.04.2025				
5,853 % fällig am 29.11.2024				0,950 % fällig am 01.10.2024				Marriott International, Inc.	5.500	5.676	0,58	
Bayer AG	€ 500	531	0,05	EQM Midstream Partners LP	75	74	0,01	5,550 % fällig am 15.10.2028				
0,050 % fällig am 12.01.2025				4,000 % fällig am 01.08.2024				Marvell Technology, Inc.	1.800	1.625	0,17	
Bayer U.S. Finance LLC	\$ 1.800	1.831	0,19	Equifax, Inc.	600	605	0,06	2,450 % fällig am 15.04.2028				
6,125 % fällig am 21.11.2026				5,100 % fällig am 01.06.2028				Mattel, Inc.	900	857	0,09	
Becton Dickinson Euro Finance SARL	€ 400	390	0,04	Expedia Group, Inc.	2.015	2.036	0,21	3,375 % fällig am 01.04.2026				
0,334 % fällig am 13.08.2028				6,250 % fällig am 01.05.2025				McDonald's Corp.	€ 1.000	1.129	0,12	
BHP Billiton Finance Ltd.	300	335	0,03	Flex Ltd.	1.700	1.757	0,18	3,625 % fällig am 28.11.2027				
3,250 % fällig am 24.09.2027				6,000 % fällig am 15.01.2028				Medtronic Global Holdings S.C.A.	400	393	0,04	
BMW Canada, Inc.	CAD 3.500	2.649	0,27	Gatwick Funding Ltd.	£ 600	783	0,08	0,375 % fällig am 15.10.2028				
4,760 % fällig am 10.02.2025 (f)				6,125 % fällig am 02.03.2028				Meta Platforms, Inc.	\$ 1.650	1.607	0,17	
BMW Finance NV	€ 400	462	0,05	GE HealthCare Technologies, Inc.	\$ 2.400	2.402	0,25	3,500 % fällig am 15.08.2027				
3,875 % fällig am 04.10.2028				5,550 % fällig am 15.11.2024				Motability Operations Group PLC	€ 400	390	0,04	
BMW U.S. Capital LLC	\$ 500	458	0,05	Glencore Funding LLC	1.500	1.458	0,15	0,125 % fällig am 20.07.2028				
1,250 % fällig am 12.08.2026				4,000 % fällig am 27.03.2027				Mundys SpA	1.300	1.397	0,14	
Booking Holdings, Inc.	€ 300	319	0,03	Global Payments, Inc.	2.000	2.004	0,21	1,625 % fällig am 03.02.2025				
0,100 % fällig am 08.03.2025				4,950 % fällig am 15.08.2027				National Fuel Gas Co.	\$ 1.000	1.002	0,10	
4,000 % fällig am 15.11.2026	800	909	0,09	GN Store Nord A/S	€ 1.500	1.588	0,16	5,500 % fällig am 01.10.2026				
Carrier Global Corp.	1.200	1.337	0,14	0,875 % fällig am 25.11.2024				NetApp, Inc.	200	197	0,02	
4,375 % fällig am 29.05.2025				Haleon Netherlands Capital BV	3.700	3.924	0,40	3,300 % fällig am 29.09.2024				
CDW LLC	\$ 1.800	1.686	0,17	1,250 % fällig am 29.03.2026				Netflix, Inc.	€ 300	336	0,03	
2,670 % fällig am 01.12.2026				Haleon U.S. Capital LLC	\$ 750	722	0,07	3,625 % fällig am 15.05.2027				
4,125 % fällig am 01.05.2025	1.149	1.127	0,12	3,375 % fällig am 24.03.2027				NextEra Energy Operating Partners LP	\$ 700	667	0,07	
Cellnex Finance Co. S.A.	€ 2.000	2.026	0,21	HCA, Inc.	2.000	2.048	0,21	3,875 % fällig am 15.10.2026				
1,000 % fällig am 15.09.2027				5,625 % fällig am 01.09.2028				4,250 % fällig am 15.07.2024	2.400	2.374	0,24	
Central Japan Railway Co.	\$ 3.300	3.223	0,33	HEICO Corp.	400	409	0,04	Nordson Corp.	1.000	1.038	0,11	
2,200 % fällig am 02.10.2024				5,250 % fällig am 01.08.2028				5,600 % fällig am 15.09.2028				
CGI, Inc.	2.700	2.450	0,25	Heineken NV	€ 1.300	1.460	0,15	NTT Finance Corp.	1.800	1.789	0,18	
1,450 % fällig am 14.09.2026				3,625 % fällig am 15.11.2026				4,142 % fällig am 26.07.2024	1.800	2.078	0,21	
Chanel Ceres PLC	€ 1.900	1.958	0,20	Holding d'Infrastructures de Transport SASU	400	391	0,04	4,239 % fällig am 25.07.2025	2.100	297	0,03	
0,500 % fällig am 31.07.2026				0,625 % fällig am 14.09.2028				4,372 % fällig am 27.07.2027	300			
Charter Communications Operating LLC	\$ 3.800	3.886	0,40	Home Depot, Inc.	\$ 600	574	0,06	Occidental Petroleum Corp.	1.600	1.683	0,17	
6,150 % fällig am 10.11.2026				2,875 % fällig am 15.04.2027				6,375 % fällig am 01.09.2028				
7,289 % fällig am 01.02.2024	250	250	0,03	HPHT Finance Ltd.	700	686	0,07	Open Text Corp.	3.200	3.329	0,34	
Cheniere Energy, Inc.	5.269	5.147	0,53	2,875 % fällig am 05.11.2024				6,900 % fällig am 01.12.2027				
4,625 % fällig am 15.10.2028				Huntington Ingalls Industries, Inc.	1.200	1.176	0,12	Oracle Corp.	1.900	1.773	0,18	
China Modern Dairy Holdings Ltd.	1.400	1.243	0,13	3,844 % fällig am 01.05.2025				1,650 % fällig am 25.03.2026 (f)				
2,125 % fällig am 14.07.2026				Hyatt Hotels Corp.	800	777	0,08	Ovintiv, Inc.	1.500	1.508	0,16	
CK Hutchison International Ltd.	1.800	1.804	0,19	1,800 % fällig am 01.10.2024				5,650 % fällig am 15.05.2025				
4,750 % fällig am 21.04.2028				4,850 % fällig am 15.03.2026	300	298	0,03	PepsiCo, Inc.	1.300	1.324	0,14	
CommonSpirit Health	100	98	0,01	Hyundai Capital America	1.600	1.564	0,16	4,450 % fällig am 15.05.2028				
2,760 % fällig am 01.10.2024				0,875 % fällig am 14.06.2024				Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd.	900	900	0,09	
Concentrix Corp.	1.200	1.231	0,13	1,500 % fällig am 15.06.2026				4,450 % fällig am 19.05.2028				
6,650 % fällig am 02.08.2026				2,750 % fällig am 27.09.2026	1.900	1.775	0,18	Philip Morris International, Inc.	€ 300	329	0,03	
Continental Resources, Inc.	500	460	0,05	5,800 % fällig am 26.06.2025				2,875 % fällig am 03.03.2026				
2,268 % fällig am 15.11.2026				6,000 % fällig am 11.07.2025	1.400	1.411	0,15	Pioneer Natural Resources Co.	\$ 1.000	1.008	0,10	
Cox Communications, Inc.	1.000	1.021	0,11	Illumina, Inc.	1.500	1.506	0,16	5,100 % fällig am 29.03.2026				
5,450 % fällig am 15.09.2028				5,800 % fällig am 12.12.2025				Qorvo, Inc.	2.550	2.448	0,25	
CPUK Finance Ltd.	£ 1.000	1.307	0,13	IMCD NV	€ 2.700	2.859	0,29	1,750 % fällig am 15.12.2024				
5,876 % fällig am 28.08.2027				2,125 % fällig am 31.03.2027				Regal Rexnord Corp.	500	506	0,05	
CSL Finance PLC	\$ 800	779	0,08	Imperial Brands Finance PLC	\$ 500	477	0,05	6,050 % fällig am 15.02.2026				
3,850 % fällig am 27.04.2027				3,500 % fällig am 26.07.2026				Renesas Electronics Corp.	4.100	3.947	0,41	
DAE Funding LLC	900	895	0,09	6,125 % fällig am 27.07.2027	1.595	1.639	0,17	1,543 % fällig am 26.11.2024				
1,625 % fällig am 15.02.2024				Informa PLC	€ 300	322	0,03	Republic Services, Inc.	300	288	0,03	
2,625 % fällig am 20.03.2025	300	288	0,03	2,125 % fällig am 06.10.2025				3,375 % fällig am 15.11.2027				
Daimler Truck Finance North America LLC	1.300	1.309	0,13	InterContinental Hotels Group PLC	800	869	0,09	Ritchie Bros Holdings, Inc.	€ 800	825	0,08	
5,125 % fällig am 19.01.2028				1,625 % fällig am 08.10.2024				6,750 % fällig am 15.03.2028				
5,200 % fällig am 17.01.2025	1.100	1.100	0,11	3,375 % fällig am 08.10.2028	£ 800	952	0,10	Robert Bosch GmbH	€ 400	452	0,05	
Danfoss Finance BV	€ 2.000	2.054	0,21	International Distributions Services PLC	€ 1.000	1.147	0,12	3,625 % fällig am 02.06.2027				
0,125 % fällig am 28.04.2026				5,250 % fällig am 14.09.2028								

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Sabine Pass Liquefaction LLC				Texas Instruments, Inc.				Brooklyn Union Gas Co.			
5,000 % fällig am 15.03.2027	\$ 568	\$ 571	0,06	4,600 % fällig am 15.02.2028	\$ 1.000	\$ 1.017	0,10	3,407 % fällig am 10.03.2026	617	589	0,06
5,750 % fällig am 15.05.2024	415	415	0,04	Thames Water Utilities Finance PLC				CenterPoint Energy Houston Electric LLC			
Safran S.A.				0,875 % fällig am 31.01.2028	€ 200	189	0,02	5,200 % fällig am 01.10.2028	4.200	4.337	0,45
0,125 % fällig am 16.03.2026	€ 300	311	0,03	4,000 % fällig am 18.04.2027	1.800	1.925	0,20	Columbia Pipelines Holding Co. LLC			
Sage Group PLC				TransDigm, Inc.				6,042 % fällig am 15.08.2028	2.000	2.066	0,21
3,820 % fällig am 15.02.2028	1.000	1.138	0,12	6,750 % fällig am 15.08.2028	\$ 1.300	1.332	0,14	6,055 % fällig am 15.08.2026	1.000	1.024	0,11
Sandoz Finance BV				Transurban Finance Co. Pty. Ltd.				Constellation Energy Generation LLC			
3,970 % fällig am 17.04.2027	800	902	0,09	4,125 % fällig am 02.02.2026	1.900	1.857	0,19	5,600 % fällig am 01.03.2028	700	721	0,07
Sands China Ltd.				Ubisoft Entertainment S.A.				Consumers Energy Co.			
2,550 % fällig am 08.03.2027	\$ 3.200	2.911	0,30	0,878 % fällig am 24.11.2027	€ 700	660	0,07	4,900 % fällig am 15.02.2029	1.900	1.935	0,20
4,300 % fällig am 08.01.2026	2.600	2.498	0,26	Union Pacific Corp.				DTE Electric Co.			
5,375 % fällig am 08.08.2025	900	888	0,09	4,750 % fällig am 21.02.2026	\$ 1.800	1.812	0,19	1,900 % fällig am 01.04.2028	1.000	900	0,09
5,650 % fällig am 08.08.2028	1.200	1.191	0,12	United Airlines Pass-Through Trust				Duke Energy Corp.			
Sartorius Finance BV				4,300 % fällig am 15.02.2027	498	483	0,05	3,100 % fällig am 15.06.2028	€ 300	327	0,03
4,250 % fällig am 14.09.2026	€ 2.000	2.261	0,23	5,875 % fällig am 15.04.2029	647	656	0,07	4,300 % fällig am 15.03.2028	\$ 1.000	987	0,10
Sealed Air Corp.				United Airlines, Inc.				5,000 % fällig am 08.12.2025	3.800	3.809	0,39
1,573 % fällig am 15.10.2026	\$ 1.900	1.712	0,18	4,375 % fällig am 15.04.2026	1.400	1.365	0,14	East Ohio Gas Co.			
SEB S.A.				Var Energi ASA				1,300 % fällig am 15.06.2025	1.800	1.703	0,18
1,375 % fällig am 16.06.2025	€ 500	532	0,05	7,500 % fällig am 15.01.2028	1.700	1.804	0,19	EDP - Energias de Portugal S.A.			
1,500 % fällig am 31.05.2024	200	218	0,02	Venture Global LNG, Inc.				2,875 % fällig am 01.06.2026	€ 300	329	0,03
Sherwin-Williams Co.				8,125 % fällig am 01.06.2028	2.300	2.325	0,24	Electricite de France S.A.			
4,250 % fällig am 08.08.2025	\$ 1.600	1.584	0,16	VMware LLC				3,750 % fällig am 05.06.2027	4.200	4.734	0,49
Siemens Energy Finance BV				4,500 % fällig am 15.05.2025	1.600	1.58	0,16	EnBW International Finance BV			
4,250 % fällig am 05.04.2029	€ 500	540	0,06	Volkswagen Group of America Finance LLC				2,500 % fällig am 04.06.2026	300	328	0,03
Sika Capital BV				4,350 % fällig am 08.06.2027	800	785	0,08	3,625 % fällig am 22.11.2026	2.000	2.251	0,23
3,750 % fällig am 03.11.2026	2.300	2.585	0,27	6,366 % fällig am 07.06.2024	3.000	3.004	0,31	Enel Finance America LLC			
Silfin NV				Walgreens Boots Alliance, Inc.				7,100 % fällig am 14.10.2027	\$ 200	214	0,02
2,875 % fällig am 11.04.2027	2.300	2.384	0,25	3,450 % fällig am 01.06.2026	300	285	0,03	Enel Finance International NV			
Sixt SE				Warnermedia Holdings, Inc.				0,000 % fällig am 17.06.2024	€ 800	868	0,09
1,750 % fällig am 09.12.2024	2.100	2.279	0,23	3,755 % fällig am 15.03.2027	1.200	1.150	0,12	(b)			
SK Hynix, Inc.				Weir Group PLC				1,375 % fällig am 12.07.2026	\$ 1.000	911	0,09
1,000 % fällig am 19.01.2024	\$ 1.300	1.297	0,13	2,200 % fällig am 13.05.2026	4.700	4.372	0,45	2,650 % fällig am 10.09.2024	4.200	4.103	0,42
Sky Ltd.				6,875 % fällig am 14.06.2028	€ 400	538	0,06	EP Infrastructure A/S			
2,500 % fällig am 15.09.2026	€ 300	327	0,03	Werfen S.A.				1,659 % fällig am 26.04.2024	€ 600	654	0,07
Smurfit Kappa Acquisitions ULC				4,625 % fällig am 06.06.2028	€ 900	1.015	0,10	1,698 % fällig am 30.07.2026	2.000	1.990	0,20
2,875 % fällig am 15.01.2026	300	327	0,03	West Fraser Timber Co. Ltd.				Evergy Missouri West, Inc.			
Societa per Azioni Esercizi Aeroportuali SEA SpA				4,350 % fällig am 15.10.2024	\$ 200	197	0,02	5,150 % fällig am 15.12.2027	\$ 2.000	2.014	0,21
3,500 % fällig am 09.10.2025	200	217	0,02	Western Midstream Operating LP				Eversource Energy			
Stryker Corp.				3,100 % fällig am 01.02.2025	2.600	2.532	0,26	5,450 % fällig am 01.03.2028	1.200	1.234	0,13
0,250 % fällig am 03.12.2024	1.000	1.070	0,11	Westinghouse Air Brake Technologies Corp.				Florida Power & Light Co.			
3,375 % fällig am 11.12.2028	900	1.009	0,10	3,200 % fällig am 15.06.2025	562	544	0,06	5,050 % fällig am 01.04.2028	700	716	0,07
Studio City Co. Ltd.				3,450 % fällig am 15.11.2026	450	431	0,04	Georgia Power Co.			
7,000 % fällig am 15.02.2027	\$ 2.800	2.757	0,28	Williams Cos., Inc.				6,135 % fällig am 08.05.2025	200	201	0,02
Studio City Finance Ltd.				5,400 % fällig am 02.03.2026	1.000	1.010	0,10	India Green Energy Holdings			
6,000 % fällig am 15.07.2025	600	588	0,06	Woodside Finance Ltd.				5,375 % fällig am 29.04.2024	250	248	0,03
Suez SACA				3,650 % fällig am 05.03.2025	600	587	0,06	Interstate Power & Light Co.			
1,875 % fällig am 24.05.2027	€ 300	317	0,03	Worldline S.A.				4,100 % fällig am 26.09.2028	900	874	0,09
Suntory Holdings Ltd.				4,125 % fällig am 12.09.2028	€ 400	439	0,05	Ipalco Enterprises, Inc.			
2,250 % fällig am 16.10.2024	\$ 1.100	1.071	0,11	Worley Financial Services Pty. Ltd.				3,700 % fällig am 01.09.2024	1.348	1.327	0,14
Swedish Match AB				5,950 % fällig am 13.10.2028	AUD 2.600	1.810	0,19	ITC Holdings Corp.			
0,875 % fällig am 23.09.2024	€ 500	539	0,06	Worley U.S. Finance Sub Ltd.				4,950 % fällig am 22.09.2027	850	855	0,09
Syngenta Finance NV				0,875 % fällig am 09.06.2026	€ 1.500	1.550	0,16	Jersey Central Power & Light Co.			
3,375 % fällig am 16.04.2026	300	330	0,03	Wynn Macau Ltd.				4,700 % fällig am 01.04.2024	1.083	1.079	0,11
T-Mobile USA, Inc.				4,875 % fällig am 01.10.2024	\$ 2.100	2.075	0,21	KeySpan Gas East Corp.			
2,250 % fällig am 15.02.2026	\$ 1.100	1.043	0,11	Zimmer Biomet Holdings, Inc.				2,742 % fällig am 15.08.2026	1.600	1.493	0,15
3,500 % fällig am 15.04.2025	450	441	0,05	5,350 % fällig am 01.12.2028	1.300	1.340	0,14	Lorca Telecom Bondco S.A.			
4,800 % fällig am 15.07.2028	1.800	1.816	0,19	Zoetis, Inc.				4,000 % fällig am 18.09.2027	€ 600	649	0,07
4,950 % fällig am 15.03.2028	500	507	0,05	5,400 % fällig am 14.11.2025	1.700	1.715	0,18	Midwest Connector Capital Co. LLC			
Take-Two Interactive Software, Inc.								3,900 % fällig am 01.04.2024	\$ 505	502	0,05
3,300 % fällig am 28.03.2024	35	35	0,00					Mississippi Power Co.			
Tapstry, Inc.								3,950 % fällig am 30.03.2028	2.495	2.427	0,25
7,000 % fällig am 27.11.2026	1.000	1.037	0,11					5,736 % fällig am 28.06.2024	3.090	3.088	0,32
Targa Resources Corp.								National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.			
5,200 % fällig am 01.07.2027	2.500	2.514	0,26					5,703 % fällig am 18.10.2024	975	976	0,10
TD SYNnex Corp.								NextEra Energy Capital Holdings, Inc.			
1,250 % fällig am 09.08.2024	2.000	1.950	0,20					2,200 % fällig am 02.12.2026	AUD		
1,750 % fällig am 09.08.2026	900	816	0,08					6,449 % fällig am 21.03.2024	\$ 500	500	0,05
TDF Infrastructure SASU								NGPL PipeCo LLC			
5,625 % fällig am 21.07.2028	€ 300	348	0,04					4,875 % fällig am 15.08.2027	3.170	3.115	0,32
Teleperformance SE								Niagara Mohawk Power Corp.			
5,250 % fällig am 22.11.2028	200	231	0,02					3,508 % fällig am 01.10.2024	1.000	983	0,10
Tennessee Gas Pipeline Co. LLC								ONEOK, Inc.			
7,000 % fällig am 15.10.2028	\$ 1.396	1.514	0,16					4,550 % fällig am 15.07.2028	1.600	1.581	0,16
TenneT Holding BV								5,650 % fällig am 01.11.2028	2.800	2.901	0,30
3,875 % fällig am 28.10.2028	€ 600	693	0,07								

VERSORGUNGSUNTERNEHMEN

AES Corp.							
1,375 % fällig am 15.01.2026	1.000	926	0,10				
5,450 % fällig am 01.06.2028	1.100	1.119	0,12				
Ameren Corp.							
5,700 % fällig am 01.12.2026	1.800	1.842	0,19				
Ameren Illinois Co.							
3,800 % fällig am 15.05.2028	1.000	974	0,10				
American Electric Power Co., Inc.							
5,200 % fällig am 15.01.2029	1.600	1.623	0,17				
Appalachian Power Co.							
3,300 % fällig am 01.06.2027	600	569	0,06				
Avangrid, Inc.							
3,150 % fällig am 01.12.2024	500	489	0,05				
Black Hills Corp.							
5,950 % fällig am 15.03.2028	\$ 2.000	\$ 2.073	0,21				

274.101 28,18

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Pacific Gas & Electric Co.			
3,150 % fällig am 01.01.2026	\$ 1.000	\$ 960	0,10
3,300 % fällig am 15.03.2027	300	281	0,03
3,300 % fällig am 01.12.2027	1.300	1.215	0,13
3,400 % fällig am 15.08.2024	100	98	0,01
3,450 % fällig am 01.07.2025	100	97	0,01
3,500 % fällig am 15.06.2025	1.700	1.648	0,17
4,950 % fällig am 08.06.2025	2.000	1.988	0,20
Pennsylvania Electric Co.			
4,150 % fällig am 15.04.2025	1.950	1.913	0,20
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara			
4,125 % fällig am 15.05.2027	1.200	1.168	0,12
Potomac Electric Power Co.			
3,600 % fällig am 15.03.2024	1.262	1.256	0,13
Public Service Enterprise Group, Inc.			
2,875 % fällig am 15.06.2024	2.900	2.864	0,29
5,875 % fällig am 15.10.2028	1.400	1.468	0,15
San Diego Gas & Electric Co.			
2,500 % fällig am 15.05.2026	226	216	0,02
Sempra			
3,300 % fällig am 01.04.2025	3.100	3.027	0,31
Southern California Edison Co.			
0,975 % fällig am 01.08.2024	800	779	0,08
4,200 % fällig am 01.06.2025	2.200	2.176	0,22
5,300 % fällig am 01.03.2028	1.500	1.541	0,16
5,850 % fällig am 01.11.2027	100	105	0,01
6,266 % fällig am 01.04.2024	557	557	0,06
Southern Power Co.			
0,900 % fällig am 15.01.2026	3.000	2.765	0,28
Sprint LLC			
7,125 % fällig am 15.06.2024	125	126	0,01
State Grid Overseas Investment BVI Ltd.			
0,797 % fällig am 05.08.2026	€ 500	516	0,05
Systems Energy Resources, Inc.			
2,140 % fällig am 09.12.2025	\$ 1.150	1.071	0,11
Tampa Electric Co.			
3,875 % fällig am 12.07.2024	800	793	0,08
TDC Net A/S			
5,056 % fällig am 31.05.2028	€ 2.000	2.300	0,24
Telecom Italia SpA			
7,875 % fällig am 31.07.2028	1.200	1.476	0,15
Teollisuuden Voima Oyj			
1,125 % fällig am 09.03.2026	300	313	0,03
Trans-Allegheny Interstate Line Co.			
3,850 % fällig am 01.06.2025	\$ 1.305	1.279	0,13
Verizon Communications, Inc.			
6,218 % fällig am 20.03.2026	447	447	0,05
Vistra Operations Co. LLC			
3,550 % fällig am 15.07.2024	3.325	3.279	0,34
WEC Energy Group, Inc.			
4,750 % fällig am 09.01.2026	1.500	1.495	0,15
		112.510	11,56
Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		812.914	83,56

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL			
State Board of Administration Finance Corp., Florida Revenue Notes, Series 2020			
1,258 % fällig am 01.07.2025	1.200	1.139	0,12
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Uniform Mortgage-Backed Security			
4,500 % fällig am 01.08.2052	\$ 5.165	\$ 5.011	0,52
5,000 % fällig am 01.02.2053	3.695	3.659	0,38
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
3,500 % fällig am 01.01.2054	6.800	6.243	0,64
4,000 % fällig am 01.01.2054	56.500	53.487	5,50
5,000 % fällig am 01.02.2054	600	594	0,06
6,000 % fällig am 01.02.2054	12.100	12.287	1,26
6,500 % fällig am 01.02.2054	2.100	2.152	0,22
		83.433	8,58
US-SCHATZOBIGATIONEN			
U.S. Treasury Inflation Protected Securities (c)			
0,250 % fällig am 15.01.2025	1.819	1.765	0,18
2,375 % fällig am 15.01.2025	1.632	1.620	0,17
U.S. Treasury Notes			
4,125 % fällig am 31.01.2025 (g)	13.700	13.617	1,40
4,375 % fällig am 31.10.2024 (h)	17.100	17.028	1,75
		34.030	3,50
NON-AGENCY-MBS			
GSR Mortgage Loan Trust			
4,836 % fällig am 25.09.2035	2	2	0,00
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust			
5,971 % fällig am 25.11.2034	2	2	0,00
6,289 % fällig am 25.09.2034	253	253	0,03
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
6,157 % fällig am 25.01.2033	4	3	0,00
6,262 % fällig am 25.01.2047	164	145	0,01
		405	0,04
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
Bumper NL BV			
4,529 % fällig am 22.03.2035	€ 4.000	4.426	0,45
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust			
6,090 % fällig am 25.12.2035	266	257	0,03
OCP Euro CLO DAC			
5,873 % fällig am 20.01.2033	€ 1.000	1.105	0,11
		5.788	0,59
STAATSEMISSIONEN			
Australia Government International Bond			
2,750 % fällig am 21.11.2028 AUD	41.600	27.271	2,80
Belgium Government International Bond			
0,800 % fällig am 22.06.2028	€ 2.500	2.598	0,27
Cassa Depositi e Prestiti SpA			
5,750 % fällig am 05.05.2026	\$ 2.000	1.999	0,21
CDP Financial, Inc.			
4,250 % fällig am 25.07.2028	2.000	\$ 1.997	0,20
CPPIB Capital, Inc.			
4,250 % fällig am 20.07.2028	1.050	1.053	0,11
France Government International Bond			
0,000 % fällig am 25.03.2025 (b)	€ 9.000	9.603	0,99

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Israel Government International Bond			
5,000 % fällig am 30.10.2026	800	904	0,09
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro			
0,000 % fällig am 01.04.2026 (b)	€ 2.700	\$ 2.801	0,29
Mexico Government International Bond			
3,000 % fällig am 03.12.2026 (c)	MXN 127.706	7.005	0,72
Bundesrepublik Deutschland			
2,500 % fällig am 13.03.2025	€ 6.700	7.373	0,76
South Africa Government International Bond			
10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR 139.500	7.986	0,82
Spain Government International Bond			
0,000 % fällig am 31.01.2028 (b)	€ 4.100	4.092	0,42
United Kingdom Gilt			
1,625 % fällig am 22.10.2028	£ 7.200	8.500	0,87
		83.182	8,55

AKTIEN			
STAMMAKTIE			
FINANZWERT			
Stearns Holdings LLC 'B' (a)	43.861	0	0,00

OPTIONSSCHEINE			
Guaranteed Rate, Inc. - Exp. 31. Dezember 2060	211	0	0,00

KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
KURZFRISTIGE SCHULDTITEL			
American Honda Finance Corp.			
5,967 % fällig am 07.06.2024	\$ 2.950	2.952	0,31
Yango Justice International Ltd.			
5,300 % fällig am 11.01.2022 ^	200	1	0,00
Summe kurzfristige Instrumente		2.953	0,31

Summe übertragbare Wertpapiere \$ 1.024.085 105,27

AKTIEN			
INVESTMENTFONDS			
ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short- Term Floating NAV Fund (d)	1.623.396	16.177	1,66
PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (d)	5.163	70	0,01
Summe Investmentfonds		\$ 16.247	1,67

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft ⁽¹⁾			% des Netto- vermögens
						Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Pensions- geschäft ⁽¹⁾	
FICC	2,600 %	29.12.2023	02.01.2024	\$ 678	U.S. Treasury Notes 4,875 % fällig am 30.11.2025	\$ (692)	\$ 678	\$ 678	0,07
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (692)	\$ 678	\$ 678	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

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2024	16	\$ 37	0,01
Euro-Bobl March Futures	Long	03.2024	45	96	0,01
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2024	19	36	0,00
U.S. Treasury 10-Year Ultra March Futures	Short	03.2024	222	(1.265)	(0,13)
				\$ (1.096)	(0,11)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (1.096)	(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-KOMMUNALEMISSIONEN – 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	\$ (13)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2025	200	(2)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2028	1.200	25	0,01
Boeing Co.	1,000	20.12.2024	1.500	47	0,01
Boeing Co.	1,000	20.12.2026	1.300	22	0,00
Boeing Co.	1,000	20.06.2027	1.200	87	0,01
British Telecommunications PLC	1,000	20.06.2028	€ 1.500	19	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	\$ 3.700	11	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2026	400	3	0,00
General Motors Co.	5,000	20.12.2026	80	(6)	0,00
General Motors Co.	5,000	20.06.2028	95	3	0,00
Glencore Finance Europe Ltd.	5,000	20.06.2028	€ 500	8	0,00
Glencore Finance Europe Ltd.	5,000	20.12.2028	400	14	0,00
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	1,000	20.06.2026	\$ 300	(4)	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2024	€ 2.200	26	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2025	500	15	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2027	\$ 200	5	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2028	1.800	25	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2028	500	7	0,00
Vodafone Group PLC	1,000	20.06.2024	€ 1.200	(16)	0,00
				\$ 276	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.IG-39 5-Year Index	1,000 %	20.12.2027	\$ 100	\$ 1	0,00
CDX.IG-40 5-Year Index	1,000	20.06.2028	600	4	0,00
CDX.IG-41 5-Year Index	1,000	20.12.2028	44.800	318	0,04
iTraxx Crossover 40 5-Year Index	5,000	20.12.2028	€ 500	25	0,00
iTraxx Europe Main 40 5-Year Index	1,000	20.12.2028	12.400	122	0,01
				\$ 470	0,05

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fest- 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	\$ 14	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		4,500	18.07.2024	\$ 19.000	15	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill		2,250	15.06.2024	CAD 3.000	13	0,00
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS		3,750	20.09.2025	34.300	414	0,04
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS		3,750	20.12.2025	57.100	689	0,07
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR		7,300	28.04.2027	ZAR 68.300	58	0,01
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		0,550	10.08.2024	€ 1.700	(56)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		0,650	11.05.2027	4.400	(265)	(0,03)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		1,000	13.05.2027	3.200	(159)	(0,02)
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR		3,250	20.03.2029	35.200	1.413	0,15
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR		3,500	20.03.2026	20.300	370	0,04
						\$ 2.506	0,25
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						\$ 3.252	0,33

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

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

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

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

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Brazil Government International Bond	1,000 %	20.06.2026	\$ 100	\$ (3)	\$ 4	\$ 1	0,00
GST	AT&T, Inc.	1,000	20.06.2028	800	(9)	17	8	0,00
JPM	Banco do Brasil S.A.	1,000	20.12.2024	700	(16)	16	0	0,00
					\$ (28)	\$ 37	\$ 9	0,00

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEWISENTERMIKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens		
BOA	01.2024	AUD	612	\$ 405	\$ 0	\$ (13)	0,00		
	01.2024	£	1.609	2.041	0	(9)	0,00		
	01.2024	\$	2.291	¥ 338.109	110	0	110	0,01	
	01.2024		193	NOK 2.049	9	0	9	0,00	
BPS	03.2024		302	INR 25.290	1	0	1	0,00	
	01.2024	AUD	1.342	\$ 887	0	(29)	(29)	0,00	
	01.2024	£	4.566	5.791	0	(29)	(29)	0,00	
	01.2024	HUF	145.098	393	0	(26)	(26)	0,00	
	01.2024	¥	9.100	62	0	(3)	(3)	0,00	
	01.2024	MXN	116.025	6.328	0	(493)	(493)	(0,05)	
	01.2024	\$	954	CAD 1.297	30	0	30	0,00	
	01.2024		5.025	€ 4.592	52	(4)	48	0,01	
	01.2024	ZAR	64.977	\$ 3.505	0	(43)	(43)	(0,01)	
	03.2024	\$	59	IDR 902.888	0	0	0	0,00	
BRC	03.2024		1.050	INR 87.845	2	0	2	0,00	
	01.2024	€	219.597	\$ 241.508	0	(1.126)	(1.126)	(0,12)	
	02.2024	\$	113	TRY 3.453	0	(1)	(1)	0,00	
	03.2024		1	THB 25	0	0	0	0,00	
CBK	03.2024		574	TRY 18.029	0	(7)	(7)	0,00	
	04.2024		615	19.804	0	(9)	(9)	0,00	
	01.2024	€	134	\$ 145	0	(3)	(3)	0,00	
	01.2024	MXN	36.706	2.108	0	(49)	(49)	(0,01)	
	01.2024	ZAR	66.482	3.495	0	(136)	(136)	(0,02)	
	02.2024	\$	916	BRL 4.507	10	0	10	0,00	
	GLM	01.2024	AUD	39.415	\$ 25.924	0	(977)	(977)	(0,10)
		01.2024	CAD	16.681	12.275	0	(377)	(377)	(0,04)
		01.2024	\$	2.177	CAD 2.954	64	0	64	0,01
		01.2024		1.829	MXN 32.066	56	0	56	0,01
JPM	01.2024	ZAR	19.010	\$ 1.001	0	(37)	(37)	(0,01)	
	03.2024	\$	249	IDR 3.827.126	0	0	0	0,00	
	03.2024		125	TRY 3.936	0	(1)	(1)	0,00	
	02.2024		921	BRL 4.516	7	0	7	0,00	
	03.2024		260	IDR 4.008.196	0	0	0	0,00	
	03.2024		315	INR 26.330	0	0	0	0,00	
	MBC	01.2024	€	5.154	\$ 5.598	0	(97)	(97)	(0,01)
		03.2024	\$	317	IDR 4.882.050	0	0	0	0,00
	MYI	01.2024	CAD	1.419	\$ 1.076	0	0	0	0,00
		01.2024	€	209	233	1	0	1	0,00
01.2024		£	23	29	0	0	0	0,00	
01.2024		\$	340	€ 307	0	(2)	(2)	0,00	
SCX	01.2024		44	£ 34	0	0	0	0,00	
	01.2024		871	¥ 128.436	40	0	40	0,00	
	01.2024		400	ZAR 7.349	1	0	1	0,00	
	03.2024		1.357	IDR 20.883.468	0	(3)	(3)	0,00	
	01.2024	ZAR	3.118	\$ 164	0	(6)	(6)	0,00	
	03.2024	\$	52	IDR 790.390	0	0	0	0,00	
	03.2024		685	INR 57.323	1	0	1	0,00	
	03.2024		1.678	THB 58.007	33	0	33	0,00	
	01.2024		1.440	¥ 211.214	59	0	59	0,01	
	01.2024	£	24.806	\$ 31.393	0	(231)	(231)	(0,02)	
UAG	01.2024	\$	1.068	NOK 11.396	54	0	54	0,01	
				\$ 831	\$ (3.711)	\$ (3.181)	(0,33)		

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	01.2024	€ 1.719	\$ 1.890	\$ 4	\$ (13)	\$ (9)	0,00
	01.2024	\$ 213.053	€ 193.680	944	0	944	0,10
BRC	01.2024	206.095	187.396	961	0	961	0,10
	01.2024	€ 1.359	\$ 1.489	1	(15)	(14)	0,00
MBC	01.2024	\$ 327	€ 301	6	0	6	0,00
	01.2024	€ 357	\$ 385	0	(9)	(9)	0,00
UAG	01.2024	\$ 772	€ 706	8	0	8	0,00
	01.2024	206.129	187.396	926	0	926	0,09
				\$ 2.850	\$ (37)	\$ 2.813	0,29

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2024	£ 32	\$ 40	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2024	\$ 975	£ 769	5	0	5	0,00
BPS	01.2024	£ 1	\$ 1	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 1.493	£ 1.177	7	0	7	0,00
BRC	01.2024	28	22	0	0	0	0,00
	01.2024	£ 162	\$ 205	0	(2)	(2)	(0,01)
GLM	01.2024	\$ 14	£ 11	0	0	0	0,00
	01.2024	£ 11	\$ 14	0	0	0	0,00
MBC	01.2024	74	94	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 4	£ 3	0	0	0	0,00
MYI	01.2024	£ 30	\$ 38	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 8.605	£ 6.803	68	0	68	0,01
SCX	01.2024	6.003	4.758	62	0	62	0,01
	01.2024	£ 10	\$ 12	0	0	0	0,00
UAG	01.2024	\$ 8.604	£ 6.798	63	0	63	0,01
					\$ 205	\$ (2)	\$ 203

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional NOK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2024	\$ 774	NOK 8.230	\$ 36	\$ 0	\$ 36	0,00
	01.2024	999	10.684	53	0	53	0,01
GLM	01.2024	960	10.324	57	0	57	0,01
	01.2024	NOK 1.946	\$ 184	0	(7)	(7)	0,00
SCX	01.2024	\$ 136	NOK 1.468	8	0	8	0,00
					\$ 154	\$ (7)	\$ 147

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CBK	01.2024	\$ 9.952	SEK 103.152	\$ 286	\$ 0	\$ 286	0,03
	01.2024	9.952	103.152	286	0	286	0,03
GLM	01.2024	1	12	0	0	0	0,00
	01.2024	9.750	101.257	301	0	301	0,03
				\$ 873	\$ 0	\$ 873	0,09

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 864 0,09

Summe Anlagen

\$ 1.044.030 107,32

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (71.187) (7,32)

Nettovermögen

\$ 972.843 100,00

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(b) Nullkuponwertpapier.

(c) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(d) Mit dem Teilfonds verbunden.

(e) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(f) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 1,31 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
BMW Canada, Inc.	4,760 %	10.02.2025	07.02.2023	\$ 2.601	\$ 2.649	0,27
Citigroup, Inc.	2,014	25.01.2026	18.01.2022	2.000	1.923	0,20
Citigroup, Inc.	3,290	17.03.2026	10.03.2022	3.200	3.117	0,32
Deutsche Bank AG	1,447	01.04.2025	30.03.2021	1.600	1.581	0,16
Deutsche Bank AG	2,129	24.11.2026	17.11.2020	500	469	0,05
Oracle Corp.	1,650	25.03.2026	22.03.2021	1.900	1.773	0,18
				\$ 11.801	\$ 11.512	1,18

(g) Ein Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von USD 6.858 (31. Dezember 2022: USD 12.682) war zum 31. Dezember 2023 Wertpapiere als Sicherheiten gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte verpfändet.

(h) Wertpapiere mit einem aggregierten beizulegenden Zeitwert von USD 4.780 (31. Dezember 2022: USD 1.396) wurden zum 31. Dezember 2023 gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.

Barmittel in Höhe von USD 9.560 (31. Dezember 2022: USD 9.433) waren zum 31. Dezember 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 1.630 (31. Dezember 2022: USD 426) wurden zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten für Finanzderivate gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 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	\$ 1.023.969	\$ 116	\$ 1.024.085
Investmentfonds	16.247	0	0	16.247
Pensionsgeschäfte	0	678	0	678
Finanzderivate ⁽³⁾	96	2.924	0	3.020
Summen	\$ 16.343	\$ 1.027.571	\$ 116	\$ 1.044.030

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 691.422	\$ 0	\$ 691.422
Investmentfonds	643	0	0	643
Pensionsgeschäfte	0	1.604	0	1.604
Finanzderivate ⁽³⁾	(614)	2.737	0	2.123
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(14.029)	0	(14.029)
Summen	\$ 29	\$ 681.734	\$ 0	\$ 681.763

⁽¹⁾ Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.⁽²⁾ Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.⁽³⁾ Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.**Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2023:**

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
BOS	5,750 %	28.12.2023	04.01.2024	\$ (6.969)	\$ (6.973)	(0,72)
Summe umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (6.973)	(0,72)

Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
BRC	5,730 %	28.12.2023	02.01.2024	\$ (4.814)	\$ (4.817)	(0,50)
Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte					\$ (4.817)	(0,50)

⁽¹⁾ In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag sind USD 1 für einen aufgeschobenen Kursrückgang enthalten.

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (Forts.) 31. Dezember 2023

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ 140	\$ 0	\$ 140	\$ (35)	\$ 0	\$ (35)
BPS	399	(1.610)	(1.211)	(202)	140	(62)
BRC	(182)	370	188	146	(120)	26
CBK	151	(260)	(109)	4.468	(4.360)	108
DUB	286	(260)	26	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	(1.215)	1.260	45	(12)	16	4
GST	8	0	8	k. A.	k. A.	k. A.
JPM	7	0	7	84	0	84
MBC	(98)	0	(98)	170	(290)	(120)
MYI	37	(10)	27	(74)	0	(74)
RBC	k. A.	k. A.	k. A.	13	0	13
RYL	(7)	0	(7)	k. A.	k. A.	k. A.
SCX	405	(590)	(185)	4.065	(3.850)	215
SSB	62	0	62	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	59	0	59	6	(20)	(14)
UAG	812	(1.850)	(1.038)	(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. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	75,46	73,17
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	29,48	32,43
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,33	k. A.
Investmentfonds	1,67	0,10
Pensionsgeschäfte	0,07	0,24
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,11)	0,05
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,33	(1,02)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,09	1,30
Leerverkaufte Wertpapiere	k. A.	(2,14)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,72)	(1,95)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(0,50)	(0,22)

* Gemäß der Liste der Märkte, die die Kriterien für einen geregelten OGAW-Markt erfüllen, in Anlage 1 zum Verkaufsprospekt.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	0,02	0,55
Unternehmensanleihen und Wechsel	83,56	83,16
Kommunalanleihen und Wechsel	0,12	0,17
US-Regierungsbehörden	8,58	6,33
US-Schatzobligationen	3,50	10,55
Non-Agency-MBS	0,04	0,07
Forderungsbesicherte Wertpapiere	0,59	0,22
Staatsemissionen	8,55	3,40
Stammaktien	0,00	0,00
Optionsscheine	0,00	0,00
Kurzfristige Instrumente	0,31	1,15
Investmentfonds	1,67	0,10
Pensionsgeschäfte	0,07	0,24
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,11)	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	0,03	(0,03)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,05	0,01
Zinsswaps	0,25	(1,00)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,01
Devisenterminkontrakte	(0,33)	(0,48)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,42	1,77
Leerverkaufte Wertpapiere	k. A.	(2,14)
Sonstige Aktiva und Passiva	(7,32)	(4,13)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Jupiter Mortgage PLC				Verus Securitization Trust				Harvest SBA Loan Trust			
6,621 % fällig am 20.07.2060 £	14.595	18.603	0,92	1,977 % fällig am 25.03.2060 \$	35	35	0,00	7,707 % fällig am 25.08.2044	133	132	0,01
Kinbane DAC				3,035 % fällig am 25.03.2060	100	97	0,00	Hayfin Emerald CLO DAC			
4,685 % fällig am 25.09.2062 €	15.728	17.220	0,85	3,889 % fällig am 25.03.2060	200	194	0,01	0,000 % fällig am			
Lanebrook Mortgage Transaction PLC				WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				25.01.2037 (b)	€ 7.700	8.506	0,42
7,070 % fällig am 12.06.2057 £	4.282	5.474	0,27	3,698 % fällig am 25.02.2037	672	602	0,03	Holland Park CLO DAC			
8,470 % fällig am 12.06.2057	1.000	1.274	0,06	6,230 % fällig am 25.01.2045	75	73	0,00	4,912 % fällig am 14.11.2032	7.650	8.358	0,41
Lehman Mortgage Trust				Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust				Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust			
6,000 % fällig am 25.07.2036 \$	127	65	0,00	6,000 % fällig am 25.04.2037	4.294	3.422	0,17	5,630 % fällig am 25.07.2037 \$	370	200	0,01
Lehman XS Trust				Wells Fargo Alternative Loan Trust				5,670 % fällig am 25.07.2037	4.959	2.681	0,13
5,870 % fällig am 25.08.2046	6.931	6.331	0,31	6,500 % fällig am 25.07.2037	3.202	2.791	0,14	HSI Asset Securitization Corp. Trust			
Luminent Mortgage Trust						458.207	22,57	5,610 % fällig am 25.12.2036	8.345	7.029	0,35
3,827 % fällig am 25.04.2036	3.366	2.290	0,11					5,660 % fällig am 25.01.2037	2.806	1.953	0,10
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				Invesco Euro CLO DAC			
6,160 % fällig am 25.08.2036	2.202	2.156	0,11	ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust				4,615 % fällig am 15.07.2031 €	8.660	9.416	0,46
Morgan Stanley Capital Trust				5,750 % fällig am 25.02.2037	5.511	2.331	0,11	IXIS Real Estate Capital Trust			
7,309 % fällig am 15.07.2035	7.056	6.939	0,34	5,910 % fällig am 25.05.2037	12.454	2.127	0,10	5,930 % fällig am 25.01.2037 \$	3.423	1.224	0,06
7,609 % fällig am 15.07.2035	3.014	2.949	0,15	Aegis Asset-Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Certificates				JPMorgan Mortgage Acquisition Trust			
Mortgage Funding PLC				7,420 % fällig am 25.06.2034	1.784	1.677	0,08	5,730 % fällig am 25.06.2037	154	154	0,01
6,439 % fällig am 13.03.2046 £	4.025	5.133	0,25	Amortizing Residential Collateral Trust				Lehman XS Trust			
MortgageIT Trust				6,170 % fällig am 25.10.2031	164	159	0,01	5,990 % fällig am 25.05.2046	1.340	1.171	0,06
5,990 % fällig am 25.12.2035 \$	14	14	0,00	Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				6,500 % fällig am 25.06.2046	49	41	0,00
Mortimer BTL PLC				6,235 % fällig am 25.10.2035	100	89	0,00	7,770 % fällig am 25.12.2037	1.203	1.149	0,06
0,000 % fällig am 22.12.2056 £	6.700	8.563	0,42	Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust				Lockwood Grove CLO Ltd.			
6,670 % fällig am 23.06.2053	1.000	1.243	0,06	3,118 % fällig am 25.07.2036	4.140	3.969	0,20	7,310 % fällig am 25.01.2030	2.700	2.705	0,13
Natixis Commercial Mortgage Securities Trust				3,972 % fällig am 25.05.2036	5.957	5.166	0,25	Long Beach Mortgage Loan Trust			
3,790 % fällig am 15.11.2032 \$	7.453	5.546	0,27	Auto ABS Spanish Loans				5,750 % fällig am 25.06.2036	450	414	0,02
Newgate Funding PLC				6,365 % fällig am 28.02.2032 €	2.148	2.341	0,12	6,070 % fällig am 25.01.2036	2.923	2.726	0,13
5,500 % fällig am 15.12.2050 £	6.692	8.199	0,40	Avoca Static CLO DAC				Madison Park Euro Funding DAC			
PHH Alternative Mortgage Trust				5,690 % fällig am 15.10.2030	6.600	7.287	0,36	4,765 % fällig am 15.07.2032 €	1.900	2.070	0,10
6,000 % fällig am 25.02.2037 \$	3.505	2.807	0,14	Bayview Financial Acquisition Trust				Man GLG Euro CLO DAC			
Precise Mortgage Funding PLC				5,996 % fällig am 28.05.2037 \$	1.876	1.651	0,08	4,705 % fällig am 15.10.2030	2.592	2.843	0,14
6,126 % fällig am 16.10.2056 £	596	760	0,04	Bayview Financial Asset Trust				5,779 % fällig am 15.10.2036	7.600	8.415	0,41
Primrose Residential DAC				6,970 % fällig am 25.03.2037	412	421	0,02	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust			
4,876 % fällig am 24.10.2061 €	3.175	3.487	0,17	Bosphorus CLO DAC				5,750 % fällig am 25.05.2037 \$	4.286	2.185	0,11
Residential Accredited Loans, Inc. Trust				4,960 % fällig am 12.12.2032 €	694	758	0,04	5,770 % fällig am 25.08.2037	268	250	0,01
5,830 % fällig am 25.07.2036 \$	1.217	1.138	0,06	Cairn CLO DAC				Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust			
5,970 % fällig am 25.08.2037	371	338	0,02	4,666 % fällig am 25.04.2032	8.602	9.417	0,46	3,938 % fällig am 25.01.2035	1.330	1.025	0,05
Residential Asset Securitization Trust				Carrington Mortgage Loan Trust				5,670 % fällig am 25.05.2037	908	523	0,03
6,609 % fällig am 25.02.2037	10.592	2.521	0,12	6,460 % fällig am 25.06.2035 \$	3.208	3.146	0,15	5,770 % fällig am 25.06.2036	1.791	1.481	0,07
Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust				CIFC Funding Ltd.				6,385 % fällig am 25.03.2035	367	366	0,02
6,250 % fällig am 25.08.2036	1.023	829	0,04	6,640 % fällig am 24.04.2031	4.482	4.482	0,22	Nassau Ltd.			
RESIMAC Bastille Trust				College Avenue Student Loans LLC				6,805 % fällig am 15.07.2031	10.261	10.262	0,51
6,390 % fällig am 05.09.2057	23	23	0,00	4,130 % fällig am 26.12.2047	18	18	0,00	6,905 % fällig am 15.01.2030	6.337	6.346	0,31
RMAC PLC				6,670 % fällig am 26.12.2047	18	18	0,00	Navient Private Education Loan Trust			
0,000 % fällig am 15.02.2047 £	12.300	15.731	0,78	Countrywide Asset-Backed Certificates				4,100 % fällig am 16.12.2058	600	578	0,03
RMAC Securities PLC				6,670 % fällig am 25.10.2035	802	790	0,04	Nelnet Student Loan Trust			
5,827 % fällig am 12.06.2044 \$	3.341	3.221	0,16	Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				5,910 % fällig am 27.09.2066	9.957	9.922	0,49
Shamrock Residential DAC				5,610 % fällig am 25.06.2047	1.796	1.644	0,08	New Century Home Equity Loan Trust			
4,726 % fällig am 24.01.2061 €	20.578	22.654	1,12	5,680 % fällig am 25.05.2047	6.194	5.476	0,27	6,190 % fällig am 25.10.2035	7.174	6.897	0,34
4,876 % fällig am 24.06.2071	12.991	14.283	0,70	5,750 % fällig am 25.12.2046	937	876	0,04	NovaStar Mortgage Funding Trust			
5,126 % fällig am 24.02.2071	11.047	12.185	0,60	5,995 % fällig am 25.08.2036	467	451	0,02	5,630 % fällig am 25.09.2037	151	149	0,01
Southern Pacific Securities PLC				6,670 % fällig am 25.11.2035	5.000	4.548	0,22	5,670 % fällig am 25.01.2037	209	74	0,00
4,499 % fällig am 10.03.2044	2.064	2.242	0,11	Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust				7,045 % fällig am 25.12.2034	3.190	3.039	0,15
Stratton BTL Mortgage Funding PLC				3,201 % fällig am 25.01.2037	14.072	4.379	0,22	Oak Hill European Credit Partners DAC			
6,221 % fällig am 20.01.2054 £	3.000	3.740	0,18	Denali Capital CLO Ltd.				4,723 % fällig am 20.01.2032 €	2.552	2.792	0,14
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				6,705 % fällig am 15.04.2031	1.549	1.548	0,08	OHA Loan Funding Ltd.			
5,736 % fällig am 25.09.2034 \$	165	156	0,01	Edsouth Indenture LLC				6,764 % fällig am 23.07.2031 \$	2.989	2.988	0,15
TBW Mortgage-Backed Trust				6,182 % fällig am 25.04.2039	2.837	2.826	0,14	Option One Mortgage Loan Trust			
5,965 % fällig am 25.07.2037	111	34	0,00	Elevation CLO Ltd.				5,720 % fällig am 25.03.2037	4.852	2.365	0,12
Temple Quay PLC				7,505 % fällig am 15.07.2029	4.400	4.409	0,22	6,235 % fällig am 25.08.2035	1.750	1.673	0,08
6,720 % fällig am 24.07.2085 £	11.358	14.494	0,71	First Franklin Mortgage Loan Trust				6,895 % fällig am 25.11.2034	795	801	0,04
Thornburg Mortgage Securities Trust				5,875 % fällig am 25.04.2036	1.000	754	0,04	Palmer Square European Loan Funding DAC			
5,876 % fällig am 25.12.2042 \$	76	70	0,00	Fremont Home Loan Trust				0,000 % fällig am 15.05.2033 €	7.500	8.265	0,41
Towd Point Mortgage Funding PLC				5,620 % fällig am 25.10.2036	1.253	506	0,02	4,685 % fällig am 15.10.2031	3.433	3.731	0,18
6,365 % fällig am 20.10.2051 £	2.238	2.856	0,14	Generate Ltd.				Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates			
6,571 % fällig am 20.07.2045	1.041	1.330	0,07	7,427 % fällig am 20.10.2029	0	0	0,00	7,045 % fällig am 25.02.2035 \$	7.755	7.433	0,37
6,690 % fällig am 20.02.2045	1.232	1.567	0,08	Golden Bar Securitisation SRL				People's Choice Home Loan Securities Trust			
Tower Bridge Funding PLC				6,816 % fällig am 22.09.2043 €	2.000	2.239	0,11	7,495 % fällig am 25.10.2034	477	389	0,02
0,000 % fällig am				7,516 % fällig am 22.09.2043	1.000	1.116	0,05	Pretium Mortgage Credit Partners LLC			
20.01.2066 (b)	16.000	20.432	1,01	GSA Home Equity Trust				2,487 % fällig am 25.07.2051	1.516	1.497	0,07
Trinity Square PLC				5,850 % fällig am 25.03.2036 \$	2.337	827	0,04	Renaissance Home Equity Loan Trust			
7,970 % fällig am 15.07.2059	1.000	1.266	0,06	5,970 % fällig am 25.08.2036	11.082	4.241	0,21	5,580 % fällig am 25.11.2036	1.235	431	0,02
Twin Bridges PLC				GSAMP Trust				Residential Asset Mortgage Products Trust			
6,170 % fällig am 14.06.2055	8.455	10.766	0,53	6,190 % fällig am 25.11.2035 \$	3.000	2.433	0,12	6,550 % fällig am 25.03.2035	2.000	1.944	0,10
6,432 % fällig am 15.05.2056	10.900	13.925	0,69								

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Duration Income Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS			
Saxon Asset Securities Trust 5,640 % fällig am 25.10.2046	\$	4.231	\$ 4.105	0,20	Provincia de Buenos Aires 129,126 % fällig am 12.04.2025 (a)	ARS	6.240	\$ 5	0,00	OPTIONSSCHEINE Intelsat Emergence S.A. - Exp. 17.02.2027	661	\$ 2	0,00	
Sculptor European CLO DAC 4,755 % fällig am 14.01.2032	€	3.000	3.267	0,16	Romania Government International Bond 2,000 % fällig am 14.04.2033	€	1.700	1.410	0,07	REAL ESTATE INVESTMENT TRUSTS CBL & Associates Properties, Inc.	174	4	0,00	
SLM Student Loan Trust 6,252 % fällig am 25.03.2026	\$	14.677	14.530	0,72	3,750 % fällig am 07.02.2034		1.200	1.144	0,06	Uniti Group, Inc.	247	2	0,00	
SMB Private Education Loan Trust 3,500 % fällig am 16.12.2041		550	510	0,03	5,500 % fällig am 18.09.2028		3.800	4.323	0,21			6	0,00	
Sound Point CLO Ltd. 6,655 % fällig am 15.04.2031		4.665	4.657	0,23	Russia Government International Bond 4,250 % fällig am 23.06.2027 ^	\$	5.600	3.612	0,18					
Soundview Home Loan Trust 5,710 % fällig am 25.11.2036		10.977	3.318	0,16	4,750 % fällig am 27.05.2026 ^		200	141	0,01					
Specialty Underwriting & Residential Finance Trust 5,670 % fällig am 25.11.2037		1.498	820	0,04	5,250 % fällig am 23.06.2047 ^		600	213	0,01					
Starwood Commercial Mortgage Trust 6,556 % fällig am 15.07.2038		3.665	3.627	0,18	7,150 % fällig am 12.11.2025 ^	RUB	19.414	89	0,00					
Structured Asset Investment Loan Trust 6,190 % fällig am 25.01.2036		428	408	0,02	7,950 % fällig am 07.10.2026 ^		13.158	54	0,00	KURZFRISTIGE INSTRUMENTE ARGENTINISCHE SCHATZWECHSEL (34,368) % fällig am 20.05.2024 (e)(f)	ARS	20.607	33	0,00
6,470 % fällig am 25.09.2034		1.849	1.799	0,09	South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	193.200	11.060	0,54	UNGARISCHE SCHATZWECHSEL 10,900 % fällig am 04.01.2024 (e)(f)	HUF	951.000	2.747	0,13
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust 5,670 % fällig am 25.06.2037		8.074	5.249	0,26	Turkey Government International Bond 4,250 % fällig am 13.03.2025	\$	1.200	1.180	0,06	JAPANISCHE SCHATZWECHSEL (0,257) % fällig am 04.04.2024 (e)(f)	¥	691.000	4.904	0,24
5,700 % fällig am 25.05.2047		180	172	0,01	5,250 % fällig am 13.03.2030		1.000	920	0,04	(0,252) % fällig am 26.02.2024 (e)(f)		1.024.000	7.265	0,36
6,445 % fällig am 25.05.2035		2.900	2.777	0,14	5,750 % fällig am 11.05.2047		741	583	0,03	(0,231) % fällig am 26.02.2024 (e)(f)		276.000	1.958	0,10
Terwin Mortgage Trust 6,850 % fällig am 25.03.2035		406	389	0,02	Venezuela Government International Bond 8,250 % fällig am 13.10.2034 ^		2.000	314	0,02	(0,217) % fällig am 19.02.2024 (e)(f)		920.000	6.527	0,32
TIAA CLO Ltd. 6,805 % fällig am 16.01.2031		1.952	1.953	0,10	9,000 % fällig am 07.05.2049 ^		1.600	253	0,01	(0,216) % fällig am 22.01.2024 (e)(f)		285.000	2.022	0,10
Tralee CLO Ltd. 7,577 % fällig am 20.07.2029		4.100	4.109	0,20				59.803	2,94	(0,207) % fällig am 05.02.2024 (e)(f)		120.000	851	0,04
Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust 6,220 % fällig am 25.12.2035		701	690	0,03	AKTIEN STAMMAKTIEN KOMMUNIKATIONSDIENSTE Clear Channel Outdoor Holdings, Inc. (d)		173.174	315	0,02	(0,191) % fällig am 25.03.2024 (e)(f)		750.000	5.322	0,26
7,195 % fällig am 25.11.2035		4.705	4.671	0,23	iHeartMedia, Inc. 'A' (d)		41.444	111	0,01	(0,177) % fällig am 11.03.2024 (e)(f)		510.000	3.619	0,18
Wind River CLO Ltd. 6,707 % fällig am 18.07.2031		2.082	2.081	0,10	iHeartMedia, Inc. 'B' (d)		32.182	77	0,00	(0,149) % fällig am 18.03.2024 (e)(f)		1.863.000	13.218	0,65
			281.845	13,88	Intelsat Emergence S.A. (d)(k)		45.580	1.299	0,06			45.686	2,25	
					Windstream Holdings, Inc. (d)		361	11	0,00			48.466	2,38	
								1.813	0,09	Summe kurzfristige Instrumente				
					BASISKONSUMGÜTER Neiman Marcus Group Ltd. LLC (d)(k)		5.145	771	0,04	Summe übertragbare Wertpapiere	\$	2.692.081	132,59	
					GESUNDHEITSWESEN AMSURG Corp. (d)(k)		45.588	2.338	0,11	AKTIEN INVESTMENTFONDS ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short- Term Floating NAV Fund (i)		19.970.687	199.001	9,80
					INDUSTRIEWERTE Westmoreland Mining Holdings LLC (d)(k)		149	0	0,00	Summe Investmentfonds	\$	199.001	9,80	
					Westmoreland Mining LLC (d)(k)		149	1	0,00					
					IMMOBILIEN Adler Group S.A. (d)		64.865	35	0,00					
					Adler Group S.A.		143.630	84	0,01					
								119	0,01					
								5.042	0,25					

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft ⁽¹⁾	% des Netto- vermögens
BOS	5,100 %	29.12.2023	02.01.2024	\$ 6.700	U.S. Treasury Notes 3,500 % fällig am 30.04.2030	\$ (6.850)	\$ 6.700	\$ 6.704	0,33
BRC	5,480	02.01.2024	03.01.2024	65.000	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2024	(66.267)	65.000	65.010	3,20
CEW	4,960	27.12.2023	03.01.2024	CAD 150.000	Republic of Alberta 2,050 % fällig am 01.06.2030	(105.423)	113.757	113.900	5,60
					Province of Quebec 3,500 % fällig am 01.12.2048	(11.225)			
		28.12.2023	04.01.2024	70.000	Province of Ontario 2,050 % - 2,600 % fällig 02.06.2027 - 02.06.2030	(54.325)	53.087	53.153	2,62
		11.12.2023	03.01.2024	50.000	Province of Quebec 3,250 % fällig am 01.09.2032	(39.751)	37.919	38.076	1,87

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensionsgeschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
FICC	2,600 %	29.12.2023	02.01.2024	\$ 221	U.S. Treasury Notes 4,875 % fällig am 30.11.2025	\$ (225)	\$ 221	\$ 221	0,01
	5,330	29.12.2023	02.01.2024	68.800	U.S. Treasury Notes 1,500 % fällig am 30.11.2028	(70.176)	68.800	68.800	3,39
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (354.242)	\$ 345.484	\$ 345.864	17,02

⁽¹⁾ Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablaufmonat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month SOFR December Futures	Long	03.2024	126	\$ (503)	(0,02)
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2025	22	82	0,01
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2026	23	52	0,00
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2024	29	153	0,01
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2025	22	57	0,00
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2024	35	213	0,01
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2025	20	62	0,00
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2026	21	47	0,00
3-Month SOFR September Futures	Short	12.2024	26	116	0,01
3-Month SOFR September Futures	Short	12.2025	17	40	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2024	55	(252)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Short	03.2024	1.578	(5.860)	(0,29)
U.S. Treasury 10-Year Ultra March Futures	Short	03.2024	141	(112)	(0,01)
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Short	03.2024	16	(148)	(0,01)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2024	82	(929)	(0,04)
				\$ (6.982)	(0,34)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (6.982)	(0,34)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

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

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Airbus Finance BV	1,000 %	20.12.2025	€ 7.600	\$ 208	0,01
Airbus Finance BV	1,000	20.06.2026	3.100	(26)	0,00
Airbus Finance BV	1,000	20.06.2028	200	1	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2025	\$ 700	23	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2025	2.500	(12)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2026	1.500	(8)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2028	600	10	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.12.2024	2.600	(129)	(0,01)
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2025	100	2	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	12	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	4.700	46	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2025	€ 2.400	294	0,02
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2027	1.100	109	0,01
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2024	\$ 2.200	5	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2026	3.000	(36)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2026	400	(5)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2028	3.400	48	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2028	900	13	0,00
				\$ 560	0,03

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-31 5-Year Index	1,000 %	20.06.2024	\$ 688	\$ 27	0,00
CDX.EM-32 5-Year Index	1,000	20.12.2024	510	25	0,00
CDX.EM-34 5-Year Index	1,000	20.12.2025	1.196	23	0,00
CDX.EM-36 5-Year Index	1,000	20.12.2026	9.752	373	0,02
CDX.EM-38 5-Year Index	1,000	20.12.2027	800	56	0,00
CDX.EM-39 5-Year Index	1,000	20.06.2028	500	24	0,00
CDX.EM-40 5-Year Index	1,000	20.12.2028	4.700	99	0,01

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Duration Income Fund (Forts.)

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
CDX.HY-36 5-Year Index	5,000 %	20.06.2026	\$ 5.723	\$ (143)	(0,01)
CDX.HY-37 5-Year Index	5,000	20.12.2026	2.231	37	0,00
CDX.HY-39 5-Year Index	5,000	20.12.2027	490	23	0,00
CDX.HY-40 5-Year Index	5,000	20.06.2028	297	18	0,00
CDX.HY-41 5-Year Index	5,000	20.12.2028	48.312	2.566	0,13
CDX.IG-41 5-Year Index	1,000	20.12.2028	2.200	14	0,00
				\$ 3.142	0,15

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	1,060 %	21.02.2052	£ 300	\$ (168)	(0,01)
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	1,096	14.02.2052	600	(331)	(0,02)
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	1,101	21.02.2052	300	(165)	(0,01)
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	1,175	28.02.2052	600	(319)	(0,02)
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,250	20.03.2054	1.700	(283)	(0,01)
Zahlung ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	5,000	20.03.2029	4.500	2	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.03.2029	¥ 8.473.000	980	0,05
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,176	27.04.2027	550.000	(13)	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	15.06.2032	1.467.200	270	0,01
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,500	15.03.2042	702.000	378	0,02
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,711	27.04.2042	130.000	79	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,500	16.06.2026	\$ 88.900	5.788	0,28
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,500	16.06.2028	10.869	(951)	(0,05)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,928	06.05.2026	2.200	180	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,940	08.06.2026	2.900	226	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,000	15.06.2027	3.600	254	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,000	15.06.2029	4.070	365	0,02
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,000	16.12.2030	20.713	4.081	0,20
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,030	17.06.2026	3.600	271	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,235	12.05.2028	1.100	124	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,250	17.06.2030	4.400	418	0,02
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,250	15.06.2032	22.690	(2.362)	(0,12)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,250	16.12.2050	12.600	4.059	0,20
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,250	16.06.2051	8.700	2.250	0,11
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,317	16.12.2050	400	(155)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,360	15.02.2027	6.700	535	0,03
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,360	20.07.2031	1.400	230	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,370	19.07.2031	900	147	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,380	04.01.2027	3.600	(288)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,418	20.01.2027	1.300	(102)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,425	18.01.2027	2.500	(193)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,438	22.01.2051	9.000	(3.383)	(0,17)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,450	17.02.2027	6.300	484	0,02
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,450	16.07.2031	2.000	321	0,02
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,500	15.12.2028	7.919	(1.011)	(0,05)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,500	18.12.2029	1.200	110	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,500	17.06.2050	7.700	3.955	0,19
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,518	20.01.2029	800	(86)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,570	12.01.2027	1.400	(103)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,580	16.02.2027	2.800	(195)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,580	13.01.2051	9.300	(3.328)	(0,16)
Erhalt ⁽³⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,600	16.01.2026	17.200	575	0,03
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,600	15.02.2027	26.800	(1.836)	(0,09)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,625	06.01.2030	300	41	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,630	26.01.2029	1.300	(131)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,700	06.03.2024	6.400	(31)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,700	17.02.2027	25.000	(1.620)	(0,08)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,730	24.02.2032	1.600	(238)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.06.2025	38.000	1.123	0,05
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.06.2029	3.538	157	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.01.2030	4.600	575	0,03
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.06.2032	1.608	75	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.06.2052	28.100	5.008	0,25
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,765	16.03.2032	600	(86)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,783	22.04.2027	2.100	(169)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,785	12.08.2051	1.100	373	0,02
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,788	03.05.2027	2.300	(184)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,815	24.01.2052	300	(95)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,867	26.01.2052	300	(91)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,910	17.10.2049	400	130	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,988	09.02.2032	1.100	129	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	21.12.2027	2.100	(26)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	10.12.2029	21.000	2.266	0,11
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	21.12.2029	11.170	(222)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	12.02.2030	2.500	286	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	10.03.2030	1.200	115	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	21.12.2032	17.930	22	0,00

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,008 %	09.02.2032	\$ 1.900	\$ 223	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,250	12.03.2050	15.700	3.781	0,19
Erhalt ⁽³⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,300	17.01.2026	12.300	401	0,02
Erhalt ⁽³⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,350	17.01.2025	21.900	494	0,02
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,385	08.06.2032	1.400	119	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,436	08.06.2032	6.800	557	0,03
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,450	20.12.2024	43.700	1.020	0,05
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,450	04.10.2027	5.430	264	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,451	08.06.2032	8.700	703	0,03
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,468	27.07.2028	1.500	(52)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,537	24.07.2053	400	(34)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,543	05.02.2024	1.000	2	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,550	05.02.2024	1.000	2	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,550	21.07.2053	400	(33)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,559	05.02.2024	1.000	2	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,571	05.02.2024	500	1	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,580	05.02.2024	1.500	3	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,605	05.02.2024	1.500	3	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,607	05.02.2024	500	1	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,675	24.07.2028	1.500	(39)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,700	21.07.2028	1.500	(37)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,765	27.07.2024	6.900	(131)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,841	31.10.2024	3.800	(55)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,900	04.10.2027	15.500	(380)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,910	14.11.2024	3.700	(50)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,920	17.10.2024	9.600	(144)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,973	27.10.2024	3.900	(52)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,993	13.10.2024	4.400	(61)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,000	19.06.2024	24.000	1.062	0,05
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,000	19.06.2026	12.700	839	0,04
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,000	21.06.2030	85.750	3.199	0,16
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,000	21.06.2033	7.110	281	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,000	21.06.2033	270	(8)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,018	24.10.2024	3.900	(52)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,050	21.07.2024	6.900	(114)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,050	07.09.2027	1.400	(32)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,050	06.09.2032	2.000	(60)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,052	24.07.2024	6.900	(112)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,080	23.02.2053	1.200	(65)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,088	07.11.2024	3.800	(44)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,140	25.10.2024	3.900	(45)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,190	25.10.2024	3.900	(44)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,225	25.10.2024	3.900	(43)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,250	21.06.2028	43.820	1.043	0,05
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,300	06.03.2033	2.000	(52)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,350	14.12.2032	500	7	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,370	01.03.2033	2.000	(38)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,370	12.07.2053	2.800	18	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,400	23.02.2033	3.200	(53)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,405	01.03.2033	2.100	(34)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,420	24.05.2033	7.600	(88)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,430	27.02.2033	2.100	(30)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,450	07.03.2033	3.900	(49)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	21.06.2026	6.720	144	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2030	45.820	(539)	(0,03)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	22.05.2033	29.710	(388)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	21.06.2033	8.100	(23)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2033	1.900	(58)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2033	600	42	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,610	12.12.2032	1.100	(6)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,650	22.11.2024	7.200	(66)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,650	05.12.2024	6.000	(54)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,650	10.07.2033	4.600	44	0,00
Erhalt ⁽³⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,684	03.01.2034	1.300	(18)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,700	06.06.2033	66.350	(62)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,730	03.08.2033	1.400	25	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,735	07.08.2033	1.600	30	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	21.11.2024	7.200	(58)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	11.12.2024	6.100	(47)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.12.2028	51.850	(507)	(0,03)
Erhalt ⁽³⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2029	15.400	(8)	0,00
Erhalt ⁽³⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2031	85.900	14	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	12.07.2033	4.000	74	0,00
Erhalt ⁽³⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	02.01.2034	1.300	(26)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,800	10.03.2028	2.000	(3)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,800	22.08.2030	1.200	19	0,00
Erhalt ⁽³⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,810	02.01.2034	1.300	(32)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,854	29.12.2033	2.600	(73)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,900	30.08.2033	2.400	81	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,950	19.12.2033	2.900	(104)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,030	04.10.2033	4.900	227	0,01

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Duration Income Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Erhalt	1-Day USD-SOFR	Compounded-OIS	4,030 %	15.12.2033	\$ 2.600	\$ (109)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR	Compounded-OIS	4,040	20.06.2024	7.900	(61)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR	Compounded-OIS	4,060	20.06.2024	31.700	(240)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR	Compounded-OIS	4,140	22.06.2024	13.200	(89)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR	Compounded-OIS	4,150	12.10.2033	2.400	138	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR	Compounded-OIS	4,175	10.10.2033	2.400	142	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR	Compounded-OIS	4,200	18.10.2033	2.000	123	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR	Compounded-OIS	4,220	20.10.2033	2.400	152	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR	Compounded-OIS	4,230	23.10.2033	1.300	84	0,00
Erhalt ⁽³⁾	1-Day USD-SOFR	Compounded-OIS	4,250	20.03.2029	2.100	(9)	0,00
Erhalt ⁽³⁾	1-Day USD-SOFR	Compounded-OIS	4,250	20.03.2031	4.210	(24)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR	Compounded-OIS	4,250	22.11.2033	2.600	(154)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR	Compounded-OIS	4,255	23.10.2033	1.300	86	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR	Compounded-OIS	4,393	25.10.2033	1.200	94	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR	Compounded-OIS	4,435	01.11.2033	1.300	107	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR	Compounded-OIS	4,450	01.11.2033	2.600	218	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR	Compounded-OIS	4,500	22.05.2025	65.120	145	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR	Compounded-OIS	4,900	06.06.2025	144.940	304	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR	Compounded-OIS	5,100	22.05.2024	125.980	57	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR	Compounded-OIS	5,400	06.06.2024	281.160	300	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI		9,874	02.01.2026	BRL 8.000	(6)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		9,899	02.01.2026	4.000	(3)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		9,939	02.01.2026	6.300	(3)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		9,998	04.01.2027	12.000	(1)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		10,037	04.01.2027	2.800	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		10,041	04.01.2027	11.300	1	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		10,052	02.01.2026	13.900	(2)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		10,085	02.01.2026	13.700	(1)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		10,090	04.01.2027	21.200	7	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		10,105	02.01.2026	13.600	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		10,138	04.01.2027	5.300	3	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		11,157	02.01.2025	100	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		11,177	02.01.2025	100	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		11,250	04.01.2027	200	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		11,275	04.01.2027	100	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		11,290	04.01.2027	100	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		11,367	02.01.2025	100	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		11,746	04.01.2027	200	1	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		11,901	04.01.2027	500	3	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		12,018	02.01.2025	300	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		12,047	04.01.2027	57.400	419	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI		12,098	02.01.2025	500	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		12,158	02.01.2025	300	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		12,163	02.01.2025	300	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		12,178	02.01.2025	500	0	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR		8,360	07.08.2028	ZAR 37.400	33	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR		8,380	04.08.2028	35.400	33	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR		8,410	31.07.2028	24.200	24	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR		8,410	07.08.2028	5.500	5	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR		8,415	31.07.2028	6.500	7	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR		8,415	04.08.2028	9.000	9	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR		8,420	31.07.2028	24.200	24	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR		8,421	04.08.2028	12.400	13	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR		8,426	01.08.2028	9.800	10	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR		8,460	01.08.2028	16.500	18	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR		8,460	02.08.2028	16.700	18	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR		8,543	04.08.2028	9.100	12	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR		8,550	03.08.2028	19.800	26	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW		3,000	21.03.2027	AUD 12.400	(526)	(0,03)
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW		4,500	20.09.2033	6.500	130	0,01
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		0,250	18.03.2050	€ 2.500	1.030	0,05
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		0,294	30.06.2026	100	8	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		0,329	30.12.2025	200	13	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		0,363	30.06.2025	300	17	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		0,395	30.12.2024	200	8	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		0,425	28.06.2024	300	8	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		0,500	17.06.2050	600	262	0,01
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		0,550	10.08.2024	2.400	(80)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		0,650	11.05.2027	14.200	(857)	(0,04)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		0,700	11.04.2027	4.800	(304)	(0,02)
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR		0,830	09.12.2052	27.100	1.437	0,07
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		1,000	13.05.2027	9.800	(488)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		1,000	18.05.2027	4.700	(231)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		1,750	21.09.2027	3.500	(121)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		2,100	11.04.2024	9.900	25	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		2,100	13.04.2024	15.000	41	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		2,100	17.05.2024	8.600	26	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		2,250	26.04.2024	9.900	54	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		2,250	28.04.2024	9.200	43	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		2,250	03.05.2024	9.600	44	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		2,547	09.03.2033	4.900	186	0,01

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
Erhalt ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR		2,760 %	03.01.2029	€ 2.100	\$ (31)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		2,880	19.12.2028	3.000	(61)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		2,890	22.12.2033	2.400	(82)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		2,910	29.12.2033	1.600	(59)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		2,920	13.12.2028	3.700	(81)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		2,990	08.12.2033	2.100	(91)	0,00
Erhalt ⁽²⁾	6-Month EUR-EURIBOR		3,000	20.03.2034	11.800	(742)	(0,04)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		3,063	06.12.2033	1.600	(80)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		3,128	04.12.2033	1.200	(67)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		3,148	20.11.2033	1.900	(109)	(0,01)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		3,179	29.11.2028	1.600	(54)	0,00
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR		3,250	20.03.2029	16.100	(10)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		3,250	06.11.2033	1.900	(125)	(0,01)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		3,255	22.11.2028	1.500	(56)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		3,270	08.11.2028	3.100	(116)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		3,270	21.08.2033	1.600	120	0,01
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		3,280	22.11.2033	1.000	(70)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		3,305	27.11.2033	2.000	(145)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		3,450	20.10.2028	2.900	144	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		8,300	16.06.2028	MXN 23.100	(8)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		8,444	25.07.2028	53.000	(24)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		8,471	26.07.2028	26.700	(10)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		8,512	24.07.2028	40.100	(12)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		8,550	27.07.2028	13.500	(3)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		8,556	27.07.2028	80.500	(16)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		8,600	31.07.2028	24.400	(1)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		8,620	28.07.2028	14.500	(1)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		8,636	28.07.2028	29.000	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		8,640	28.07.2028	5.800	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		8,650	28.07.2028	14.700	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		8,660	28.07.2028	14.500	1	0,00
Zahlung	UKRPI		4,000	15.09.2031	£ 900	(135)	(0,01)
Zahlung	UKRPI		4,020	15.10.2031	1.200	(171)	(0,01)
Zahlung	UKRPI		4,055	15.09.2031	800	(118)	(0,01)
Zahlung	UKRPI		4,066	15.09.2031	1.700	(220)	(0,01)
Zahlung	UKRPI		4,140	15.10.2031	2.300	(289)	(0,01)
						\$ 28.756	1,42
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						\$ 32.458	1,60

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

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

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

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

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variable 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	\$ 110	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,110	26.07.2032	1.600	259	356	0,02
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,620	22.07.2024	15.900	119	14	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,620	22.07.2024	15.900	119	200	0,01
	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,590	19.07.2024	11.300	156	30	0,00
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,590	19.07.2024	11.300	156	218	0,01
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,170	19.07.2032	1.200	190	123	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,170	19.07.2032	1.400	222	303	0,01
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,400	20.07.2027	1.200	158	78	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,400	20.07.2027	1.400	185	268	0,01
							\$ 1.742	\$ 1.700	0,08

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Duration Income Fund (Forts.)

VERKAUFSOPTIONEN

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BOA	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,288 %	19.01.2024	800	\$ (3)	\$ (3)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,738	19.01.2024	800	(3)	(2)	0,00
BPS	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,494	08.01.2024	1.500	(7)	(11)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,545	16.01.2024	2.800	(13)	(35)	0,00
CBK	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,994	08.01.2024	1.500	(7)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,995	16.01.2024	2.800	(13)	(1)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,690	02.04.2024	2.100	(17)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,690	02.04.2024	2.100	(17)	(34)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,235	22.01.2024	2.600	(11)	(8)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,685	22.01.2024	2.600	(11)	(8)	0,00
DUB	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,310	18.01.2024	1.100	(4)	(3)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,590	05.01.2024	1.900	(7)	(21)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,700	18.01.2024	1.100	(4)	(3)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,960	05.01.2024	1.900	(7)	0	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,790	08.04.2024	3.300	(25)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,790	08.04.2024	3.300	(25)	(49)	(0,01)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,697	02.04.2024	12.300	(96)	(3)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,697	02.04.2024	12.300	(96)	(196)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,721	08.04.2024	4.100	(31)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,721	08.04.2024	4.100	(31)	(63)	(0,01)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,215	22.01.2024	2.600	(11)	(7)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,285	19.01.2024	1.300	(5)	(5)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300	16.01.2024	2.600	(11)	(9)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,560	05.01.2024	2.800	(14)	(30)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,594	05.01.2024	2.800	(14)	(36)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,648	04.01.2024	2.700	(12)	(44)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,665	22.01.2024	2.600	(11)	(8)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,735	19.01.2024	1.300	(5)	(3)	0,00
GST	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	16.01.2024	2.600	(11)	(4)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,010	05.01.2024	2.800	(14)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,044	05.01.2024	2.800	(14)	0	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,440	08.01.2024	3.000	(7)	(11)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,860	08.01.2024	3.000	(7)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,455	08.01.2024	2.900	(14)	(16)	0,00
MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,475	08.01.2024	1.500	(7)	(10)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,600	12.01.2024	1.400	(6)	(22)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,670	04.01.2024	2.900	(14)	(52)	(0,01)
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,955	08.01.2024	2.900	(14)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,975	08.01.2024	1.500	(7)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,050	12.01.2024	1.400	(6)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,120	04.01.2024	2.900	(14)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,330	15.01.2024	1.800	(8)	(5)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,740	15.01.2024	1.800	(8)	(3)	0,00
	UAG	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,344	18.01.2024	1.400	(7)	(7)
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,744	18.01.2024	1.400	(7)	(3)	0,00
							\$ (676)	\$ (718)	(0,04)

ZINSCAPS

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Cap ⁽²⁾	1-Year USD-LIBOR	0,026 %	23.07.2025	15.900	\$ (139)	\$ (217)	(0,01)
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Floor ⁽²⁾	1-Year USD-LIBOR	0,030	24.07.2024	31.800	(127)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Floor ⁽²⁾	1-Year USD-LIBOR	0,026	23.07.2025	15.900	(139)	(32)	0,00
	Call - OTC 2-Year Interest Rate Cap ⁽²⁾	2-Year USD-LIBOR	0,026	23.07.2026	11.300	(200)	(266)	(0,01)
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Floor ⁽²⁾	2-Year USD-LIBOR	0,026	23.07.2026	11.300	(200)	(75)	(0,01)
						\$ (805)	\$ (591)	(0,03)

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

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

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.01.2054	\$ 97,891	09.01.2024	6.000	\$ (24)	\$ (68)	(0,01)
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 6,000 % fällig am 01.02.2054	101,094	06.02.2024	4.500	(18)	(36)	0,00
SAL	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.02.2054	95,813	06.02.2024	6.500	(36)	(29)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.02.2054	97,813	06.02.2024	6.500	(34)	(35)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.01.2054	98,469	09.01.2024	5.500	(25)	(37)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.01.2054	99,906	09.01.2024	3.000	(8)	(2)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.02.2054	96,813	06.02.2024	5.000	(13)	(9)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.02.2054	100,813	06.02.2024	5.000	(8)	(9)	0,00
					\$ (166)	\$ (225)	(0,01)

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

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

Kontrahent	Referenzzeit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Turkey Government International Bond	1,000 %	20.12.2024	\$ 100	\$ (12)	\$ 12	\$ 0	0,00
BPS	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	500	(45)	42	(3)	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)	46	5	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	640	(82)	85	3	0,00
CBK	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	400	(14)	14	0	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)	3	(1)	0,00
GST	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	500	(18)	18	0	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	300	(27)	25	(2)	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2025	200	(11)	12	1	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	700	(79)	82	3	0,00
MYC	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	700	(27)	28	1	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	800	(71)	67	(4)	0,00
	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)	54	(8)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2024	100	(16)	16	0	0,00
					\$ (518)	\$ 521	\$ 3	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
GST	CMBX.NA.AAA.13 Index	0,500 %	16.12.2072	\$ 62.300	\$ 92	\$ (510)	\$ (418)	(0,02)
MEI	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	15.300	(74)	14	(60)	0,00
MYC	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	25.375	(78)	76	(2)	0,00
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	25.375	(193)	150	(43)	0,00
	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	300	(2)	1	(1)	0,00
	CMBX.NA.AAA.13 Index	0,500	16.12.2072	25.500	86	(257)	(171)	(0,01)
					\$ (169)	\$ (526)	\$ (695)	(0,03)

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

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	01.2024	AUD	1.037	\$ 686	\$ 0	\$ (21)	0,00
	03.2024	CNH	18.809	2.610	0	(47)	0,00
BOA	01.2024	AUD	550	364	0	(12)	0,00
	01.2024	£	7.695	9.766	0	(43)	0,00
	01.2024	\$	8.279	¥ 1.221.692	393	0	0,02
	01.2024		102	MXN 1.738	0	0	0,00
	01.2024		148	ZAR 2.759	3	0	0,00
	01.2024	ZAR	2.262	\$ 118	0	(6)	0,00
	02.2024	CNY	6.029	834	0	(18)	0,00
	03.2024	CNH	30.126	4.162	0	(94)	(0,01)
	03.2024	IDR	21.414.380	1.375	0	(13)	0,00
	03.2024	TWD	83.855	2.721	0	(57)	0,00
	03.2024	\$	113	IDR 1.757.648	1	0	0,00
	03.2024		1.431	INR 119.737	3	0	0,00
	06.2024	KRW	583.207	\$ 448	0	(6)	0,00
BPS	01.2024	BRL	32.340	6.700	42	0	0,00
	01.2024	CAD	50.157	37.013	0	(1.026)	(0,05)
	01.2024	€	1.804	1.962	0	(31)	0,00
	01.2024	£	24.604	31.209	0	(158)	(0,01)
	01.2024	HUF	474.002	1.349	0	(21)	0,00
	01.2024	KRW	457.205	350	0	(3)	0,00
	01.2024	TWD	18.785	600	0	(15)	0,00
	01.2024	\$	100	BRL 491	1	0	0,00
	01.2024		4.683	€ 4.215	0	(26)	0,00
	01.2024		1.230	£ 968	4	0	0,00
	01.2024		1	HUF 432	0	0	0,00
	01.2024		350	IDR 5.413.713	1	0	0,00
	01.2024		6.970	¥ 1.007.700	182	0	0,01
	01.2024		152	KRW 196.166	0	(1)	0,00
	01.2024		2.326	ZAR 43.014	23	0	0,00
	02.2024	TWD	98.857	\$ 3.106	0	(161)	(0,01)
	03.2024	CNH	18.321	2.546	0	(42)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Duration Income Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	03.2024	SGD 225	\$ 169	\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	0,00
	03.2024	TWD 304.000	9.745	0	(328)	(328)	(0,02)
	03.2024	\$ 51	CNH 367	1	0	1	0,00
	03.2024	1.415	IDR 21.699.020	0	(8)	(8)	0,00
	03.2024	4.972	INR 415.903	8	0	8	0,00
	04.2024	6.700	BRL 32.666	0	(30)	(30)	0,00
BRC	06.2024	KRW 3.742.792	\$ 2.868	1	(46)	(45)	0,00
	01.2024	CAD 1.037	775	0	(12)	(12)	0,00
	01.2024	€ 241.771	265.895	0	(1.239)	(1.239)	(0,06)
	01.2024	\$ 5.973	BRL 29.189	36	0	36	0,00
	01.2024	593	CLP 513.365	0	(6)	(6)	0,00
	01.2024	1.597	MXN 27.248	5	0	5	0,00
	01.2024	1.408	TRY 42.231	3	(2)	1	0,00
	01.2024	609	TWD 18.685	3	0	3	0,00
	01.2024	347	ZAR 6.470	6	0	6	0,00
	02.2024	¥ 2.220.000	\$ 14.948	0	(921)	(921)	(0,05)
	02.2024	TRY 70	2	0	0	0	0,00
	02.2024	TWD 9.810	311	0	(13)	(13)	0,00
	02.2024	\$ 1.443	TRY 44.001	2	(7)	(5)	0,00
	03.2024	¥ 2.613.000	\$ 18.516	0	(238)	(238)	(0,01)
	03.2024	TWD 18.476	609	0	(4)	(4)	0,00
	03.2024	\$ 251	IDR 3.896.602	2	0	2	0,00
	03.2024	2.861	TRY 90.172	0	(29)	(29)	0,00
	04.2024	¥ 391.000	\$ 2.792	0	(21)	(21)	0,00
	04.2024	\$ 6.146	TRY 198.090	0	(88)	(88)	(0,01)
CBK	06.2024	KRW 4.402.849	\$ 3.397	0	(30)	(30)	0,00
	01.2024	BRL 4.918	994	0	(18)	(18)	0,00
	01.2024	HUF 280.160	800	0	(10)	(10)	0,00
	01.2024	IDR 4.628.561	301	0	0	0	0,00
	01.2024	KRW 452.449	350	1	0	1	0,00
	01.2024	MXN 165.156	9.242	0	(467)	(467)	(0,02)
	01.2024	TRY 85	3	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 2.442	£ 1.929	17	0	17	0,00
	01.2024	400	IDR 6.151.800	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	527	MXN 9.236	16	0	16	0,00
	01.2024	119	ZAR 2.184	1	0	1	0,00
	01.2024	ZAR 42.252	\$ 2.221	0	(87)	(87)	(0,01)
	03.2024	PEN 2.138	568	0	(8)	(8)	0,00
	03.2024	\$ 301	IDR 4.629.749	0	0	0	0,00
	04.2024	¥ 300.000	\$ 2.142	0	(16)	(16)	0,00
DUB	01.2024	CAD 220.209	166.249	0	(756)	(756)	(0,04)
	01.2024	\$ 2.209	TRY 65.703	0	(14)	(14)	0,00
	02.2024	3.754	BRL 18.413	30	0	30	0,00
	03.2024	CNH 21.091	\$ 2.927	0	(52)	(52)	0,00
	03.2024	\$ 798	IDR 12.305.576	1	(1)	0	0,00
GLM	06.2024	KRW 2.397.176	\$ 1.842	0	(24)	(24)	0,00
	01.2024	CAD 41.118	30.369	0	(818)	(818)	(0,04)
	01.2024	¥ 102.200	717	0	(8)	(8)	0,00
	01.2024	\$ 1.530	BRL 7.687	52	0	52	0,00
	01.2024	3.985	¥ 585.977	174	0	174	0,01
	01.2024	8.490	MXN 148.897	263	0	263	0,01
	01.2024	1.058	TRY 32.294	12	0	12	0,00
	02.2024	TRY 118	\$ 4	0	0	0	0,00
	02.2024	\$ 27.995	BRL 142.984	1.394	0	1.394	0,07
	03.2024	CNH 8.192	\$ 1.135	0	(22)	(22)	0,00
	03.2024	IDR 3.133.789	196	0	(7)	(7)	0,00
	03.2024	\$ 619	IDR 9.529.922	0	(1)	(1)	0,00
	03.2024	713	TRY 22.399	0	(8)	(8)	0,00
MBC	01.2024	AUD 486	\$ 322	0	(9)	(9)	0,00
	01.2024	€ 9.441	10.293	0	(139)	(139)	(0,01)
	01.2024	£ 5.136	6.469	0	(78)	(78)	(0,01)
	01.2024	HUF 52.688	150	0	(2)	(2)	0,00
	01.2024	\$ 885	TRY 26.325	0	0	0	0,00
	01.2024	150	ZAR 2.869	7	0	7	0,00
	01.2024	ZAR 6.562	\$ 346	0	(12)	(12)	0,00
	02.2024	¥ 120.000	811	0	(44)	(44)	0,00
	03.2024	CNH 12.823	1.794	0	(17)	(17)	0,00
	03.2024	CNY 26.417	3.734	0	(9)	(9)	0,00
	03.2024	\$ 601	IDR 9.270.880	0	0	0	0,00
MYI	01.2024	CAD 379	\$ 283	0	(4)	(4)	0,00
	01.2024	€ 807	895	3	0	3	0,00
	01.2024	HUF 141.197	401	0	(7)	(7)	0,00
	01.2024	SGD 802	609	1	0	1	0,00
	01.2024	TRY 135	5	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 307	€ 276	0	(2)	(2)	0,00
	01.2024	2.402	£ 1.910	34	(1)	33	0,00
	01.2024	4.366	¥ 643.482	202	0	202	0,01
	01.2024	1.619	ZAR 29.838	10	0	10	0,00
	01.2024	ZAR 3.734	\$ 196	0	(8)	(8)	0,00
	02.2024	\$ 5	TRY 139	0	0	0	0,00
	03.2024	CNH 17.949	\$ 2.489	0	(46)	(46)	0,00
	03.2024	¥ 510.000	3.505	0	(149)	(149)	(0,01)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	03.2024	\$ 4.248	IDR 65.422.444	\$ 3	\$ (8)	\$ (5)	0,00
	03.2024	2.823	TRY 88.122	0	(34)	(34)	0,00
RBC	06.2024	KRW 1.403.919	\$ 1.079	0	(13)	(13)	0,00
SCX	04.2024	\$ 12	MXN 209	0	0	0	0,00
	01.2024	ZAR 9.687	\$ 511	0	(18)	(18)	0,00
	03.2024	CNH 17.621	2.434	0	(55)	(55)	0,00
	03.2024	IDR 25.426.647	1.639	0	(9)	(9)	0,00
	03.2024	TWD 41.735	1.322	0	(61)	(61)	0,00
	03.2024	\$ 596	IDR 9.330.941	10	(1)	9	0,00
	03.2024	2.633	INR 220.157	4	0	4	0,00
SSB	06.2024	KRW 1.886.067	\$ 1.453	0	(15)	(15)	0,00
	03.2024	\$ 1.004	IDR 15.504.391	2	0	2	0,00
	03.2024	1.579	INR 131.759	0	(1)	(1)	0,00
UAG	01.2024	£ 133.600	\$ 169.075	0	(1.243)	(1.243)	(0,06)
	01.2024	¥ 285.000	1.933	0	(94)	(94)	(0,01)
	01.2024	MXN 9.766	552	0	(22)	(22)	0,00
	01.2024	TRY 4.891	166	1	0	1	0,00
	01.2024	ZAR 24.719	1.295	0	(55)	(55)	0,00
	02.2024	\$ 166	TRY 5.044	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 2.958	\$ (9.300)	\$ (6.342)	(0,31)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 31. Dezember 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
BRC	01.2024	\$ 23.237	CHF 20.258	\$ 845	\$ 0	\$ 845	0,04
CBK	01.2024	23.128	20.150	825	0	825	0,04
MYI	01.2024	23.016	20.091	868	0	868	0,04
				\$ 2.538	\$ 0	\$ 2.538	0,12

Zum 31. Dezember 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
BPS	01.2024	€ 1.710	\$ 1.890	\$ 1	\$ (1)	\$ 0	0,00
	01.2024	\$ 302.253	€ 274.773	1.349	(3)	1.346	0,07
BRC	01.2024	290.486	264.131	1.353	0	1.353	0,07
CBK	01.2024	€ 544	\$ 586	0	(14)	(14)	0,00
	01.2024	\$ 447	€ 406	1	0	1	0,00
MBC	01.2024	€ 1.391	\$ 1.520	0	(17)	(17)	0,00
	01.2024	\$ 301	€ 276	5	0	5	0,00
MYI	01.2024	€ 380	\$ 411	0	(9)	(9)	0,00
UAG	01.2024	\$ 290.534	€ 264.131	1.305	0	1.305	0,06
				\$ 4.014	\$ (44)	\$ 3.970	0,20

Zum 31. Dezember 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	01.2024	\$ 19.122	£ 15.084	\$ 108	\$ 0	\$ 108	0,01
BPS	01.2024	27.271	21.500	138	0	138	0,01
BRC	01.2024	507	401	4	0	4	0,00
CBK	01.2024	£ 2.142	\$ 2.712	0	(19)	(19)	0,00
	01.2024	\$ 13	£ 10	0	0	0	0,00
MBC	01.2024	£ 470	\$ 598	0	(1)	(1)	0,00
MYI	01.2024	2.200	2.810	5	0	5	0,00
	01.2024	\$ 3	£ 3	0	0	0	0,00
NGF	01.2024	£ 38.860	\$ 49.200	0	(341)	(341)	(0,02)
SCX	01.2024	\$ 156.157	£ 123.456	1.230	0	1.230	0,06
SSB	01.2024	109.836	87.043	1.130	0	1.130	0,05
UAG	01.2024	156.132	123.369	1.145	0	1.145	0,06
				\$ 3.760	\$ (361)	\$ 3.399	0,17

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Duration Income Fund (Forts.)

Zum 31. Dezember 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	
BOA	01.2024	\$	SGD	49	0	49	0,01	
DUB	01.2024			35	0	35	0,00	
GLM	01.2024	SGD	\$	111	(1)	(1)	0,00	
	01.2024	\$	SGD	492	0	5	0,00	
MBC	01.2024	SGD	\$	71	(1)	(1)	0,00	
	01.2024	\$	SGD	583	0	5	0,00	
	02.2024			105	0	0	0,00	
MYI	01.2024			5.281	0	46	0,00	
	02.2024			576	0	0	0,00	
UAG	01.2024			4	0	4	0,00	
				144	(2)	142	0,01	
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$	3.181	0,16

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000\$)	MARKT- WERT (000\$)	% DES NETTO- VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.03.2054	\$ 5.800	\$ (5.624)	(0,28)
Summe leerverkaufte Wertpapiere		\$ (5.624)	(0,28)
Summe Anlagen		\$ 3.259.599	160,55
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (1.229.294)	(60,55)
Nettovermögen		\$ 2.030.305	100,00

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
- (b) Wertpapier per Emissionstermin.
- (c) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.
- (d) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.
- (e) Nullkuponwertpapier.
- (f) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (g) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (h) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (i) Mit dem Teilfonds verbunden.
- (j) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (k) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,77 %):

Emittentenbeschreibung	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
AMSURG Corp.	02.11.2023 - 06.11.2023	\$ 1.905	\$ 2.338	0,11
Intelsat Emergence S.A.	05.09.2018 - 23.02.2022	3.227	1.299	0,06
Neiman Marcus Group Ltd. LLC	25.09.2020	166	771	0,04
Westmoreland Mining Holdings LLC	26.03.2019	0	0	0,00
Westmoreland Mining LLC	07.03.2023	1	1	0,00
		\$ 5.299	\$ 4.409	0,21

Barmittel in Höhe von USD 1.587 (31. Dezember 2022: USD null) war zum 31. Dezember 2023 Wertpapiere als Sicherheiten gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 42.633 (31. Dezember 2022: USD 24.066) waren zum 31. Dezember 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 2.797 (31. Dezember 2022: USD 9.984) wurden zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten für Finanzderivate gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 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	\$ 516	\$ 2.665.094	\$ 26.471	\$ 2.692.081
Investmentfonds	199.001	0	0	199.001
Pensionsgeschäfte	0	345.484	0	345.484
Finanzderivate ⁽³⁾	(252)	28.909	0	28.657
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(5.624)	0	(5.624)
Summen	\$ 199.265	\$ 3.033.863	\$ 26.471	\$ 3.259.599

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 1.018	\$ 1.197.881	\$ 14.709	\$ 1.213.608
Investmentfonds	106.140	0	0	106.140
Pensionsgeschäfte	0	98.831	0	98.831
Finanzderivate ⁽³⁾	579	14.698	0	15.277
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(5.209)	0	(5.209)
Summen	\$ 107.737	\$ 1.306.201	\$ 14.709	\$ 1.428.647

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

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

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

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
AZD	\$ (68)	\$ 0	\$ (68)	\$ (35)	\$ 0	\$ (35)
BOA	199	0	199	(2.834)	2.820	(14)
BPS	(200)	(1.560)	(1.760)	(1.952)	1.730	(222)
BRC	(343)	90	(253)	(307)	301	(6)
CBK	144	(290)	(146)	6.696	(6.666)	30
DUB	(832)	530	(302)	(582)	370	(212)
GLM	1.092	(760)	332	(2.097)	2.036	(61)
GST	(427)	554	127	(885)	904	19
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	1	0	1
MBC	(312)	260	(52)	4.371	(3.930)	441
MEI	(60)	280	220	(56)	260	204
MYC	313	583	896	(562)	813	251
MYI	891	(810)	81	(223)	270	47
NGF	(341)	500	159	k. A.	k. A.	k. A.
RBC	k. A.	k. A.	k. A.	(39)	0	(39)
SAL	(121)	0	(121)	(49)	0	(49)
SCX	1.085	(1.600)	(515)	6.363	(5.950)	413
SSB	1.131	(980)	151	16	0	16
UAG	1.030	(2.580)	(1.550)	(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. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	44,20	35,07
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	87,13	75,51
Sonstige übertragbare Wertpapiere	1,26	1,33
Investmentfonds	9,80	9,79
Pensionsgeschäfte	17,02	9,11
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,34)	0,19
Zentral abgerechnete Finanzderivate	1,60	0,57
Freiverkehrsfinanzderivate	0,16	0,66
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,28)	(0,48)

* Gemäß der Liste der Märkte, die die Kriterien für einen geregelten OGAW-Markt erfüllen, in Anlage 1 zum Verkaufsprospekt.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	1,67	6,41
Unternehmensanleihen und Wechsel	20,46	26,11
Wandelanleihen & Wechsel	0,03	0,05
US-Regierungsbehörden	59,41	33,41
US-Schatzobligationen	9,00	9,02
Non-Agency-MBS	22,57	19,47
Forderungsbesicherte Wertpapiere	13,88	8,93
Staatsemissionen	2,94	3,00
Stammaktien	0,25	0,29
Bezugsrechte	k. A.	0,01
Optionsscheine	0,00	0,00
Real Estate Investment Trusts	0,00	0,00
Kurzfristige Instrumente	2,38	5,21
Investmentfonds	9,80	9,79
Pensionsgeschäfte	17,02	9,11
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,34)	0,20
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	k. A.	(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	0,15	0,00
Zinsswaps	1,42	0,57
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,08	0,19
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	(0,04)	(0,32)
Zinscaps	(0,03)	(0,08)
Optionen auf Wertpapiere	(0,01)	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	(0,04)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	(0,03)	(0,13)
Total Return Swaps auf Indizes	k. A.	0,00
Devisenterminkontrakte	(0,31)	(0,55)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,50	1,60
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,28)	(0,48)
Sonstige Aktiva und Passiva	(60,55)	(31,75)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS			
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE														
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG														
American Airlines, Inc. 10,427 % fällig am 20.04.2028	\$	990	1,018	0,13	DVI Deutsche Vermoegens- & Immobilienverwaltungs GmbH 2,500 % fällig am 25.01.2027	€	2.100	1.998	0,25	3,629 % fällig am 06.04.2026	€	2.600	2.897	0,37
IRB Holding Corp. 8,456 % fällig am 15.12.2027	\$	4.815	4.829	0,61	Fairfax Financial Holdings Ltd. 4,625 % fällig am 29.04.2030	\$	700	673	0,09	Sun Communities Operating LP 4,200 % fällig am 15.04.2032	\$	2.500	2.283	0,29
LifePoint Health, Inc. 11,168 % fällig am 16.11.2028	\$	1.139	1.138	0,15	Federation des Caisses Desjardins du Quebec 5,860 % fällig am 30.11.2026	€	1.000	1.275	0,16	TP ICAP Finance PLC 2,625 % fällig am 18.11.2028	€	1.000	1.068	0,14
MPH Acquisition Holdings LLC 9,900 % fällig am 01.09.2028	\$	3.812	3.686	0,47	Ford Motor Credit Co. LLC 1,744 % fällig am 19.07.2024	€	2.900	3.159	0,40	5,250 % fällig am 29.05.2026	€	1.400	1.731	0,22
			10,671	1,36	3,021 % fällig am 06.03.2024	\$	100	110	0,01	UBS AG 5,125 % fällig am 15.05.2024 (h)	\$	100	99	0,01
					3,375 % fällig am 13.11.2025	\$	600	574	0,07	UBS Group AG 1,000 % fällig am 24.06.2027	€	500	519	0,07
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSELBANKEN UND FINANZEN														
Acef Holding S.C.A. 1,250 % fällig am 26.04.2030	€	1.000	889	0,11	Goldman Sachs Group, Inc. 3,691 % fällig am 05.06.2028	\$	100	96	0,01	3,750 % fällig am 26.03.2025	\$	150	147	0,02
AGFC Capital Trust 7,405 % fällig am 15.01.2067	\$	500	254	0,03	4,223 % fällig am 01.05.2029	\$	2.500	2.420	0,31	4,194 % fällig am 01.04.2031	\$	800	746	0,09
Aircastle Ltd. 2,850 % fällig am 26.01.2028	\$	1.500	1.340	0,17	HSBC Holdings PLC 5,750 % fällig am 20.12.2027	€	100	133	0,02	4,550 % fällig am 17.04.2026	\$	700	691	0,09
AMCO - Asset Management Co. SpA 2,250 % fällig am 17.07.2027	€	2.900	3.045	0,39	6,000 % fällig am 29.03.2040	€	200	257	0,03	VICI Properties LP 4,375 % fällig am 15.05.2025	\$	1.300	1.278	0,16
American Assets Trust LP 3,375 % fällig am 01.02.2031	\$	2.050	1.673	0,21	Intesa Sanpaolo SpA 7,750 % fällig am 11.01.2027 (f)(h)	€	1.700	1.930	0,25	Volkswagen Financial Services NV 1,625 % fällig am 10.02.2024	€	1.100	1.396	0,18
American Tower Corp. 4,400 % fällig am 15.02.2026	\$	850	840	0,11	JPMorgan Chase & Co. 1,963 % fällig am 23.03.2030	\$	1.000	1.030	0,13	1,875 % fällig am 03.12.2024	€	2.000	2.465	0,31
5,250 % fällig am 15.07.2028	\$	2.000	2.033	0,26	Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd. 3,250 % fällig am 12.11.2025	\$	2.900	2.912	0,37	Wells Fargo & Co. 4,808 % fällig am 25.07.2028	\$	2.000	1.986	0,25
Aroundtown S.A. 5,375 % fällig am 21.03.2029	\$	3.100	2.555	0,32	LeasePlan Corp. NV 2,875 % fällig am 24.10.2024	\$	1.200	1.173	0,15				135,399	17,19
Avolon Holdings Funding Ltd. 2,528 % fällig am 18.11.2027	\$	1.806	1.602	0,20	Legal & General Group PLC 5,625 % fällig am 24.03.2031 (f)(h)	€	600	651	0,08	INDUSTRIEWERTE				
Balder Finland Oyj 1,000 % fällig am 18.01.2027	€	1.900	1.781	0,23	Lloyds Banking Group PLC 2,250 % fällig am 16.10.2024	\$	900	1.118	0,14	Aeroporti di Roma SpA 1,750 % fällig am 30.07.2031	€	600	573	0,07
1,000 % fällig am 20.01.2029	\$	500	422	0,05	3,750 % fällig am 18.03.2028	\$	1.000	958	0,12	Air Canada 3,875 % fällig am 15.08.2026	\$	1.200	1.147	0,15
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 7,708 % fällig am 18.01.2028	€	3.800	4.208	0,53	4,375 % fällig am 22.03.2028	\$	400	391	0,05	Alaska Airlines Pass-Through Trust 4,800 % fällig am 15.02.2029	\$	1.606	1.563	0,20
Banco de Credito del Peru S.A. 4,650 % fällig am 17.09.2024	PEN	7.000	1.836	0,23	4,716 % fällig am 11.08.2026	\$	500	494	0,06	Altice France S.A. 4,250 % fällig am 15.10.2029	€	2.000	1.765	0,22
Bank of America Corp. 4,376 % fällig am 27.04.2028	\$	1.000	978	0,12	Logicor Financing SARL 0,625 % fällig am 17.11.2025	€	1.300	1.341	0,17	5,500 % fällig am 15.10.2029	\$	2.100	1.649	0,21
Banque Federative du Credit Mutuel S.A. 1,250 % fällig am 05.12.2025	€	1.200	1.434	0,18	1,500 % fällig am 13.07.2026	\$	1.000	1.036	0,13	AMC Networks, Inc. 4,750 % fällig am 01.08.2025	\$	100	97	0,01
Barclays PLC 3,125 % fällig am 17.01.2024	\$	100	127	0,02	3,250 % fällig am 13.11.2028	\$	700	737	0,09	American Airlines Pass-Through Trust 3,150 % fällig am 15.08.2033	\$	567	497	0,06
4,972 % fällig am 16.05.2029	\$	800	786	0,10	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 0,339 % fällig am 19.07.2024	\$	1.600	1.734	0,22	3,250 % fällig am 15.04.2030	\$	17	15	0,00
5,746 % fällig am 09.08.2033	\$	100	101	0,01	5,242 % fällig am 19.04.2029	\$	600	609	0,08	3,375 % fällig am 01.11.2028	\$	978	897	0,11
7,125 % fällig am 15.06.2025 (f)(h)	€	1.000	1.243	0,16	Mizuho Financial Group, Inc. 3,477 % fällig am 12.04.2026	\$	3.050	2.949	0,37	3,650 % fällig am 15.08.2030	\$	686	636	0,08
BNP Paribas S.A. 1,904 % fällig am 30.09.2028	\$	1.300	1.156	0,15	NatWest Group PLC 2,000 % fällig am 04.03.2025	€	2.300	2.531	0,32	3,700 % fällig am 01.04.2028	\$	211	197	0,03
BPCE S.A. 1,500 % fällig am 13.01.2042 (h)	€	1.800	1.808	0,23	4,892 % fällig am 18.05.2029	\$	700	688	0,09	American Medical Systems Europe BV 1,375 % fällig am 08.03.2028	€	2.000	2.071	0,26
4,625 % fällig am 12.09.2028	\$	2.500	2.451	0,31	8,000 % fällig am 10.08.2025 (f)(h)	\$	300	301	0,04	Boeing Co. 2,750 % fällig am 01.02.2026	\$	2.100	2.011	0,26
Canadian Imperial Bank of Commerce 3,250 % fällig am 31.03.2027	€	3.200	3.568	0,45	NE Property BV 2,000 % fällig am 20.01.2030	€	3.100	2.756	0,35	British Airways Pass-Through Trust 3,300 % fällig am 15.06.2034	\$	84	75	0,01
CapitaLand Ascendas REIT 0,750 % fällig am 23.06.2028	\$	1.100	1.042	0,13	Nissan Motor Acceptance Co. LLC 2,450 % fällig am 15.09.2028	€	800	686	0,09	4,250 % fällig am 15.05.2034	\$	300	280	0,04
CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund 0,500 % fällig am 27.01.2028	\$	1.600	1.565	0,20	Nova Kreditna Banka Maribor d.d. 1,875 % fällig am 27.01.2025	€	2.200	2.419	0,31	Broadcom, Inc. 3,469 % fällig am 15.04.2034	\$	200	174	0,02
0,900 % fällig am 12.10.2029	\$	1.600	1.472	0,19	Nova Ljubljanska Banka d.d. 3,400 % fällig am 05.02.2030	\$	2.400	2.301	0,29	Chanel Ceres PLC 0,500 % fällig am 31.07.2026	€	1.300	1.339	0,17
Cooperatieve Rabobank UA 3,100 % fällig am 29.06.2028 (f)(h)	\$	1.000	913	0,12	3,650 % fällig am 19.11.2029	\$	1.400	1.362	0,17	1,000 % fällig am 31.07.2031	\$	2.100	1.957	0,25
CPI Property Group S.A. 1,750 % fällig am 14.01.2030	\$	2.700	1.705	0,22	Peugeot Invest 1,875 % fällig am 30.10.2026	\$	3.800	4.014	0,51	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 5,875 % fällig am 31.03.2025	\$	20	20	0,00
Credit Suisse AG 0,250 % fällig am 01.09.2028	\$	2.300	2.212	0,28	Protective Life Global Funding 3,104 % fällig am 15.04.2024	\$	5.000	4.967	0,63	Constellation Oil Services Holding S.A. (3,000 % bar oder 4,000 % PIK) 3,000 % fällig am 31.12.2026 (a)	\$	567	413	0,05
Credit Suisse AG AT1 Claim \$	7.900	948	0,12	Rexford Industrial Realty LP 2,150 % fällig am 01.09.2031	\$	21	17	0,00	DAE Funding LLC 1,625 % fällig am 15.02.2024	\$	700	696	0,09	
Cromwell Ereit Lux Finco SARL 2,125 % fällig am 19.11.2025	€	2.000	2.086	0,27	Sagax AB 1,125 % fällig am 30.01.2027	€	1.700	1.693	0,22	3,375 % fällig am 20.03.2028	\$	3.300	3.046	0,39
CTP NV 0,625 % fällig am 27.09.2026	\$	2.700	2.686	0,34	Sagax Euro MTN NL BV 0,750 % fällig am 26.01.2028 (j)	\$	600	567	0,07	Delta Air Lines, Inc. 7,000 % fällig am 01.05.2025	\$	800	815	0,10
1,500 % fällig am 27.09.2031	\$	2.500	2.157	0,27	1,000 % fällig am 17.05.2029	\$	1.000	905	0,12	Discovery Communications LLC 2,500 % fällig am 20.09.2024	€	100	125	0,02
Deutsche Bank AG 2,625 % fällig am 16.12.2024	€	3.000	3.708	0,47	Santander Holdings USA, Inc. 3,244 % fällig am 05.10.2026	\$	100	94	0,01	Enbridge, Inc. 5,700 % fällig am 08.03.2033	\$	2.000	2.080	0,26
					Santander UK Group Holdings PLC 3,625 % fällig am 14.01.2026	€	300	370	0,05	Exela Intermediate LLC 11,500 % fällig am 15.04.2026	\$	184	33	0,01
					3,823 % fällig am 03.11.2028	\$	300	282	0,04	GE Capital UK Funding Unlimited Co. 5,875 % fällig am 18.01.2033	€	300	412	0,05
					Sirius Real Estate Ltd. 1,125 % fällig am 22.06.2026	€	1.100	1.099	0,14	Greene King Finance PLC 5,318 % fällig am 15.09.2031	\$	319	399	0,05
					Sofina S.A. 1,000 % fällig am 23.09.2028	\$	2.500	2.332	0,30	7,139 % fällig am 15.12.2034	\$	100	101	0,01
					Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 2,550 % fällig am 10.03.2025	\$	2.400	2.327	0,30	Haleon U.S. Capital LLC 3,375 % fällig am 24.03.2027	\$	1.000	963	0,12

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
IndyMac Mortgage Loan Trust				ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust				CVC Cordatus Loan Fund DAC			
5,890 % fällig am 25.07.2036 \$	1.742	\$ 1.691	0,22	5,750 % fällig am 25.07.2036 \$	95	\$ 71	0,01	4,652 % fällig am 21.07.2030 €	3.818	\$ 4.170	0,53
JPMorgan Alternative Loan Trust				5,770 % fällig am 25.07.2036	1.030	340	0,04	4,725 % fällig am 15.04.2032	3.304	3.618	0,46
5,830 % fällig am 25.06.2037	3.990	2.090	0,27	6,085 % fällig am 25.12.2035	2.593	2.393	0,30	4,782 % fällig am 15.08.2032	5.455	5.970	0,76
Jubilee Place BV				Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				Dryden Euro CLO DAC			
4,985 % fällig am 17.10.2057 €	1.445	1.601	0,20	5,940 % fällig am 25.11.2035	896	872	0,11	4,625 % fällig am 15.04.2033	4.477	4.873	0,62
Landmark Mortgage Securities PLC				6,340 % fällig am 25.01.2036	3.400	3.213	0,41	4,815 % fällig am 15.07.2031	470	516	0,07
5,620 % fällig am 17.04.2044 £	136	169	0,02	6,490 % fällig am 25.09.2034	950	934	0,12	Elevation CLO Ltd.			
Lehman XS Trust				Apidos CLO				6,885 % fällig am 15.10.2029 \$	645	646	0,08
5,870 % fällig am 25.08.2046 \$	169	154	0,02	6,687 % fällig am 20.04.2031	946	946	0,12	Ellington Loan Acquisition Trust			
5,920 % fällig am 25.08.2046	339	325	0,04	Ares European CLO DAC				6,570 % fällig am 25.05.2037	2.982	2.875	0,36
Ludgate Funding PLC				4,843 % fällig am 20.04.2032 €	2.500	2.718	0,34	Euro-Galaxy CLO DAC			
4,155 % fällig am 01.12.2060 €	18	19	0,00	Argent Securities Trust				4,693 % fällig am 11.04.2031 €	1.036	1.134	0,14
5,339 % fällig am 01.12.2060 £	123	151	0,02	5,690 % fällig am 25.05.2036 \$	163	40	0,01	Fieldstone Mortgage Investment Trust			
Mansard Mortgages PLC				5,770 % fällig am 25.07.2036	100	87	0,01	6,137 % fällig am 25.04.2047 \$	1.908	1.338	0,17
5,520 % fällig am 15.04.2047	34	42	0,01	Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				Fremont Home Loan Trust			
5,989 % fällig am 15.12.2049	112	141	0,02	5,950 % fällig am 25.05.2035	71	60	0,01	5,605 % fällig am 25.10.2036	142	125	0,02
MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust				6,745 % fällig am 15.01.2031	2.257	2.260	0,29	5,670 % fällig am 25.08.2036	207	67	0,01
7,720 % fällig am 25.11.2034 \$	648	628	0,08	Atlas Senior Loan Fund Ltd.				6,340 % fällig am 25.05.2034	1.275	1.202	0,15
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				5,102 % fällig am 24.01.2033 €	2.000	2.192	0,28	GE-WMC Mortgage Securities Trust			
4,118 % fällig am 25.12.2037	998	682	0,09	BBVA Consumer Auto				5,770 % fällig am 25.08.2036	5.077	2.111	0,27
6,354 % fällig am 25.08.2036	10.498	2.003	0,25	0,270 % fällig am 20.07.2031	281	303	0,04	Greenwood Park CLO Ltd.			
Mortgage Equity Conversion Asset Trust				Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				6,685 % fällig am 15.04.2031	1.232	1.232	0,16
5,340 % fällig am 25.05.2042	271	260	0,03	5,700 % fällig am 25.02.2037 \$	3.000	2.805	0,36	Greystone Commercial Real Estate Notes Ltd.			
NAAC Reperforming Loan REMIC Trust Certificates				6,100 % fällig am 25.02.2036	1.104	1.101	0,14	6,656 % fällig am 15.09.2037	848	847	0,11
6,500 % fällig am 25.02.2035	461	387	0,05	6,325 % fällig am 25.07.2034	1.254	1.214	0,15	GSA Home Equity Trust			
New Century Alternative Mortgage Loan Trust				6,490 % fällig am 25.10.2035	283	278	0,04	5,772 % fällig am 25.11.2036	463	138	0,02
4,688 % fällig am 25.10.2036	500	98	0,01	6,520 % fällig am 25.08.2037	783	681	0,09	5,985 % fällig am 25.06.2036	1.329	353	0,04
Newgate Funding PLC				Black Diamond CLO DAC				GSAMP Trust			
4,525 % fällig am 15.12.2050 €	72	78	0,01	4,982 % fällig am 15.05.2032 €	4.494	4.902	0,62	5,610 % fällig am 25.11.2036	1.870	901	0,11
5,500 % fällig am 15.12.2050 £	201	246	0,03	Blackrock European CLO DAC				5,990 % fällig am 25.02.2046	522	485	0,06
NovaStar Mortgage Funding Trust				4,585 % fällig am 15.10.2031	5.303	5.766	0,73	HSI Asset Securitization Corp. Trust			
0,523 % fällig am 25.09.2046 \$	2.090	733	0,09	Cairn CLO DAC				6,250 % fällig am 25.01.2036	2.200	1.816	0,23
OBX Trust				4,618 % fällig am 31.01.2030	591	647	0,08	ICG U.S. CLO Ltd.			
6,120 % fällig am 25.06.2057	127	122	0,02	Carlyle Euro CLO DAC				6,754 % fällig am 22.07.2031	4.822	4.824	0,61
Paragon Mortgages PLC				4,632 % fällig am 15.08.2030	2.323	2.543	0,32	Lehman XS Trust			
6,270 % fällig am 15.05.2045 £	182	232	0,03	Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd.				6,299 % fällig am 25.03.2037	1.738	1.705	0,22
Residential Accredit Loans, Inc. Trust				6,755 % fällig am 15.10.2030 \$	1.378	1.378	0,17	LoanCore Issuer Ltd.			
5,750 % fällig am 25.06.2036 \$	19	14	0,00	4,752 % fällig am 15.11.2031 €	799	870	0,11	6,888 % fällig am 17.01.2037	500	490	0,06
6,000 % fällig am 25.04.2036	924	730	0,09	CBAM Ltd.				Long Beach Mortgage Loan Trust			
6,000 % fällig am 25.06.2036	131	101	0,01	6,927 % fällig am 20.07.2030 \$	1.736	1.737	0,22	5,910 % fällig am 25.02.2036	294	286	0,04
Residential Asset Securitization Trust				Cedar Funding CLO Ltd.				6,385 % fällig am 25.08.2035	4.270	3.775	0,48
6,500 % fällig am 25.06.2037	2.921	668	0,09	6,657 % fällig am 20.04.2031	1.082	1.082	0,14	Man GLG Euro CLO DAC			
RMAC Securities PLC				6,677 % fällig am 20.01.2031	4.762	4.758	0,60	4,645 % fällig am 15.10.2030 €	1.532	1.682	0,21
5,489 % fällig am 12.06.2044 £	40	49	0,01	CIFC Funding Ltd.				4,702 % fällig am 15.05.2031	378	414	0,05
Shamrock Residential DAC				6,657 % fällig am 18.04.2031	687	686	0,09	4,835 % fällig am 15.01.2030	262	290	0,04
4,726 % fällig am 24.01.2061 €	3.032	3.338	0,42	CIT Mortgage Loan Trust				Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust			
Stratton BTL Mortgage Funding PLC				6,970 % fällig am 25.10.2037	5.460	5.403	0,69	5,540 % fällig am 25.10.2036 \$	1.390	600	0,08
5,951 % fällig am 20.01.2054 £	8.003	10.173	1,29	Citigroup Mortgage Loan Trust				5,600 % fällig am 25.11.2036	1.609	723	0,09
Stratton Mortgage Funding PLC				5,530 % fällig am 25.07.2045	373	256	0,03	5,610 % fällig am 25.05.2037	1.316	1.117	0,14
6,069 % fällig am 25.09.2051	7.425	9.463	1,20	5,640 % fällig am 25.07.2045	6.949	4.791	0,61	5,700 % fällig am 25.10.2036	1.133	594	0,08
6,121 % fällig am 20.07.2060	3.168	4.038	0,51	5,770 % fällig am 25.12.2036	97	39	0,00	5,700 % fällig am 25.11.2036	5.033	2.869	0,36
Structured Asset Mortgage Investments Trust				7,250 % fällig am 25.05.2036	814	423	0,05	5,720 % fällig am 25.07.2036	412	362	0,05
5,910 % fällig am 25.09.2047 \$	643	553	0,07	Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates				5,770 % fällig am 25.09.2036	14.972	5.308	0,67
Towd Point Mortgage Funding PLC				6,415 % fällig am 25.10.2034	44	42	0,01	5,970 % fällig am 25.04.2036	95	89	0,01
6,365 % fällig am 20.10.2051 £	2.908	3.711	0,47	Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				6,010 % fällig am 25.12.2034	1.362	1.227	0,16
6,571 % fällig am 20.07.2045	1.093	1.397	0,18	5,730 % fällig am 25.03.2037	2.829	2.443	0,31	Morgan Stanley Home Equity Loan Trust			
6,690 % fällig am 20.02.2045	194	246	0,03	Contego CLO BV				5,980 % fällig am 25.02.2036	1.800	1.638	0,21
Twin Bridges PLC				4,735 % fällig am 15.10.2030 €	1.596	1.748	0,22	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust			
6,070 % fällig am 12.03.2055	6.846	8.695	1,10	Contego CLO DAC				6,226 % fällig am 25.10.2036	266	78	0,01
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				4,642 % fällig am 23.01.2030	3.986	4.341	0,55	Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust			
3,787 % fällig am 25.02.2037 \$	67	61	0,01	Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				6,270 % fällig am 25.02.2037	3.126	917	0,12
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust				4,877 % fällig am 25.05.2036 \$	2.138	2.108	0,27	NovaStar Mortgage Funding Trust			
6,000 % fällig am 25.07.2036	97	57	0,01	5,610 % fällig am 25.06.2035	3.206	2.806	0,36	5,630 % fällig am 25.09.2037	13	12	0,00
Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust				5,650 % fällig am 25.11.2047	559	622	0,08	5,790 % fällig am 25.05.2036	39	38	0,00
5,615 % fällig am 25.07.2034	8	0,00		5,670 % fällig am 25.06.2047	2.724	2.437	0,31	Oak Hill European Credit Partners DAC			
		82.175	10,43	5,680 % fällig am 25.05.2047	70	62	0,01	4,723 % fällig am 20.01.2032 €	611	670	0,08
				5,690 % fällig am 25.09.2037	328	334	0,04	Option One Mortgage Loan Trust			
				6,130 % fällig am 25.08.2035	275	267	0,03	5,610 % fällig am 25.01.2037 \$	49	28	0,00
				Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC				5,610 % fällig am 25.02.2037	600	389	0,05
				3,072 % fällig am 25.12.2036	154	127	0,02	5,610 % fällig am 25.03.2037	682	602	0,08
				6,385 % fällig am 25.01.2034	449	457	0,06	5,690 % fällig am 25.04.2037	559	391	0,05
								5,690 % fällig am 25.05.2037	619	366	0,05
								OZLM Ltd.			
								6,675 % fällig am 15.04.2031	2.215	2.214	0,28
								6,744 % fällig am 17.04.2031	914	914	0,12
								6,827 % fällig am 20.01.2031	1.444	1.446	0,18

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Duration Opportunities Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
OZLME DAC				STAATSEMISSIONEN				KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
4,758 % fällig am 27.07.2032	€ 2.186	\$ 2.392	0,30	Argentina Government International Bond				ARGENTINISCHE SCHATZWECHSEL			
Palmer Square European Loan Funding DAC				0,750 % fällig am 09.07.2030	\$ 1.422	570	0,07	(34,368) % fällig am			
5,938 % fällig am 12.04.2032	4.613	5.112	0,65	1,000 % fällig am 09.07.2029	150	60	0,01	20.05.2024 (c)(d)	ARS 15.316	\$ 24	0,00
Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust				3,625 % fällig am 09.07.2035	2.504	854	0,11	UNGARISCHE SCHATZWECHSEL			
5,965 % fällig am 25.07.2036	\$ 605	564	0,07	Brazil Letras do Tesouro Nacional				10,900 % fällig am			
RAAC Trust				0,000 % fällig am 01.01.2024				04.01.2024 (c)(d)	HUF 3.335.000	9.633	1,22
6,230 % fällig am 25.10.2046	86	83	0,01	(c)	BRL 22.000	4.529	0,58	Summe kurzfristige Instrumente		9.657	1,22
Residential Asset Securities Corp. Trust				0,000 % fällig am 01.07.2024							
5,810 % fällig am 25.11.2036	41	39	0,00	(c)	64.100	12.557	1,59				
6,055 % fällig am 25.03.2036	822	810	0,10	Israel Government International Bond				Summe übertragbare Wertpapiere	\$ 1.047.330	132,97	
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust				5,000 % fällig am 30.10.2026	€ 3.300	3.731	0,47	AKTIEN			
5,790 % fällig am 25.10.2036	9.599	3.233	0,41	Japan Finance Organization for Municipalities				INVESTMENTFONDS			
6,130 % fällig am 25.08.2035	54	43	0,01	0,050 % fällig am 12.02.2027	1.500	1.523	0,19	ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
Segovia European CLO DAC				Mexico Government International Bond				PIMCO Funds: Global			
4,873 % fällig am 20.07.2032	€ 6.900	7.525	0,96	5,400 % fällig am 09.02.2028	\$ 1.700	1.744	0,22	Investors Series plc -			
SG Mortgage Securities Trust				Peru Government International Bond				PIMCO Asia High			
5,680 % fällig am 25.10.2036	\$ 3.600	2.564	0,33	5,940 % fällig am 12.02.2029	PEN 2.300	621	0,08	Yield Bond Fund (g)	385.356	3.561	0,45
Sierra Madre Funding Ltd.				Romania Government International Bond				PIMCO Funds: Global			
5,854 % fällig am 07.09.2039	1.987	1.399	0,18	1,750 % fällig am 13.07.2030	€ 1.500	1.344	0,17	Investors Series plc -			
Sound Point CLO Ltd.				Russia Government International Bond				Asia Strategic Interest			
6,741 % fällig am 26.07.2031	993	992	0,13	5,250 % fällig am 23.06.2047 ^	\$ 200	71	0,01	Bond Fund (g)	1.197.507	11.077	1,41
6,807 % fällig am 18.04.2031	7.400	7.394	0,94	South Africa Government International Bond				PIMCO Select Funds plc -			
Soundview Home Loan Trust				4,850 % fällig am 30.09.2029	2.000	1.880	0,24	PIMCO US Dollar			
5,670 % fällig am 25.06.2037	2.163	1.524	0,19	Turkey Government International Bond				Short-Term Floating			
5,730 % fällig am 25.02.2037	982	278	0,04	5,750 % fällig am 22.03.2024	1.000	1.001	0,13	NAV Fund (g)	197.937	1.972	0,25
5,970 % fällig am 25.10.2036	1.294	1.213	0,15	6,350 % fällig am 10.08.2024	2.500	2.516	0,32			16.610	2,11
Structured Asset Investment Loan Trust						33.001	4,19	BÖRSENGEHANDELTE FONDS			
6,445 % fällig am 25.01.2035	1.685	1.523	0,19	AKTIEN				PIMCO ETFs plc - PIMCO			
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				STAMMAKTIEN				US Dollar Short			
5,625 % fällig am 25.09.2036	4.588	2.848	0,36	ENERGIE				Maturity UCITS			
6,957 % fällig am 25.04.2035	25	25	0,00	Constellation Oil Services				ETF (g)	543.400	54.188	6,88
Toro European CLO DAC				Holding S.A. 'B' (b)(f)	617.385	67	0,01	Summe Investmentfonds		\$ 70.798	8,99
4,885 % fällig am 15.07.2030	€ 82	91	0,01	VORZUGSWERTPAPIERE							
WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust				Nationwide Building Society							
5,695 % fällig am 25.05.2037	\$ 443	411	0,05	10,250 %	521	87	0,01				
Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust											
6,070 % fällig am 25.04.2037	4.701	3.201	0,41								
7,195 % fällig am 25.11.2035	93	93	0,01								
		193.005	24,51								

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft ⁽¹⁾	% des Netto- vermögens
FICC	2,600 %	29.12.2023	02.01.2024	\$2.805	U.S. Treasury Notes 4,875 % fällig am 30.11.2025	\$(2.861)	\$2.805	\$2.806	0,36
Summe Pensionsgeschäfte						\$(2.861)	\$2.805	\$2.806	0,36

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
3-Month SOFR December Futures	Long	03.2024	133	\$ (618)	(0,08)
Euro-Bobl March Futures	Short	03.2024	242	(527)	(0,07)
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2024	131	(600)	(0,07)
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Long	03.2024	12	152	0,02
Euro-Schatz March Futures	Short	03.2024	441	(328)	(0,04)
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Long	03.2024	305	655	0,08
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Short	03.2024	963	(2.361)	(0,30)
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Short	03.2024	1.529	(5.025)	(0,64)
U.S. Treasury 10-Year Ultra March Futures	Short	03.2024	812	(2.172)	(0,27)
				\$ (10.824)	(1,37)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (10.824)	(1,37)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

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

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2024	\$ 3.200	\$ 11	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2026	1.700	(15)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2028	200	3	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2027	500	31	0,01
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	1.700	17	0,00
				\$ 47	0,01

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHÜTZKAUF⁽²⁾

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-34 5-Year Index	(5,000) %	20.06.2025	\$ 20.470	\$ (2.125)	(0,27)
CDX.HY-39 5-Year Index	(5,000)	20.12.2027	7.450	(569)	(0,08)
				\$ (2.694)	(0,35)

ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	5,000 %	20.03.2029	£ 10.100	\$ (736)	(0,09)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,500	16.06.2026	\$ 16.480	(1.024)	(0,13)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,250	17.06.2030	5.000	595	0,08
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,700	19.09.2028	53.900	1.138	0,14
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,725	19.09.2028	39.400	839	0,11
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	21.12.2052	29.700	2.072	0,26
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,827	03.07.2028	13.300	(1.046)	(0,13)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,842	19.09.2053	1.300	(59)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,853	18.05.2032	37.780	(4.918)	(0,62)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,874	19.09.2053	10.400	(511)	(0,06)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,999	03.07.2053	11.500	2.394	0,30
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	27.10.2028	31.000	(2.330)	(0,30)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	12.02.2030	9.900	1.131	0,14
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	10.03.2030	4.900	468	0,06
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,060	27.10.2053	6.200	1.456	0,18
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,841	31.10.2024	4.700	(68)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,973	27.10.2024	4.600	(62)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,000	21.06.2033	13.000	76	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,018	24.10.2024	4.600	(62)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,140	25.10.2024	4.600	(54)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,190	25.10.2024	4.600	(52)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,225	25.10.2024	4.600	(50)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,370	01.03.2033	1.200	(23)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,400	23.02.2033	2.800	(47)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,430	27.02.2033	1.900	(27)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,650	22.11.2024	36.100	(330)	(0,04)
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,684	03.01.2034	1.200	(17)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	21.11.2024	24.600	(198)	(0,03)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	11.12.2024	13.300	(103)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,854	29.12.2033	700	(20)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,950	19.12.2033	1.400	(50)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,175	10.10.2033	3.300	195	0,02
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	22.11.2033	1.000	(59)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,628	02.01.2026	BRL 138.600	(4)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,083	04.01.2027	18.600	22	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,115	04.01.2027	92.700	104	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,126	04.01.2027	29.800	36	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,755	02.01.2025	24.800	(14)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,900	04.01.2027	14.300	91	0,01
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	4,000	21.06.2025	CAD 93.700	128	0,02
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,750	20.12.2033	AUD 97.900	1.777	0,23
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	28.04.2024	€ 11.000	51	0,01
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	03.05.2024	11.300	52	0,01
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.03.2034	12.400	785	0,10
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,250	20.03.2029	18.400	(743)	(0,09)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,985	11.10.2027	PLN 29.300	(664)	(0,08)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	7,015	11.10.2027	53.100	(1.219)	(0,15)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	7,156	13.10.2027	54.000	(572)	(0,07)
					\$ (1.652)	(0,21)
					\$ (4.299)	(0,55)

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Duration Opportunities Fund (Forts.)

- (1) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (2) Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (3) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.
- (4) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

VERKAUFSOPTIONEN

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Netto-vermögens
BOA	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,288 %	19.01.2024	700	\$ (3)	\$ (3)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,738	19.01.2024	700	(3)	(1)	0,00
BPS	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,494	08.01.2024	800	(3)	(6)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,545	16.01.2024	2.000	(9)	(25)	(0,01)
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,994	08.01.2024	800	(4)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,995	16.01.2024	2.000	(9)	(1)	0,00
CBK	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,235	22.01.2024	700	(3)	(2)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,685	22.01.2024	700	(3)	(2)	0,00
FAR	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,489	08.01.2024	800	(4)	(6)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,550	16.01.2024	1.200	(5)	(15)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,989	08.01.2024	800	(4)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,000	16.01.2024	1.200	(5)	0	0,00
GLM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,285	19.01.2024	1.000	(4)	(4)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300	16.01.2024	300	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,560	05.01.2024	1.000	(5)	(11)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,594	05.01.2024	1.000	(5)	(13)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,735	19.01.2024	1.000	(4)	(2)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	16.01.2024	300	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,010	05.01.2024	1.000	(5)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,044	05.01.2024	1.000	(5)	0	0,00
MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,455	08.01.2024	1.400	(7)	(8)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,475	08.01.2024	800	(4)	(5)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,600	12.01.2024	1.900	(9)	(30)	(0,01)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,670	04.01.2024	1.400	(6)	(25)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,955	08.01.2024	1.400	(7)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,975	08.01.2024	800	(4)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,050	12.01.2024	1.900	(9)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,120	04.01.2024	1.400	(6)	0	0,00
							\$ (137)	\$ (161)	(0,02)

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Netto-vermögens
BOA	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.01.2054	\$ 97,891	09.01.2024	2.000	\$ (8)	\$ (23)	(0,01)
SAL	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.02.2054	95,813	06.02.2024	1.500	(8)	(7)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.02.2054	97,813	06.02.2024	1.500	(8)	(8)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.01.2054	98,469	09.01.2024	1.600	(7)	(11)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.02.2054	96,813	06.02.2024	1.300	(4)	(2)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.02.2054	100,813	06.02.2024	1.300	(2)	(2)	0,00
					\$ (37)	\$ (53)	(0,01)

(1) Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Netto-vermögens
BRC	Turkey Government International Bond	1,000 %	20.06.2024	\$ 200	\$ (26)	\$ 27	\$ 1	0,00
GST	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2024	200	(3)	4	1	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2024	2.300	(102)	110	8	0,00
					\$ (131)	\$ 141	\$ 10	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
GST	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500 %	17.11.2059	\$ 2.200	\$ (9)	\$ 9	\$ 0	0,00
MYC	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	100	(4)	4	0	0,00
SAL	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	1.500	(3)	3	0	0,00
UAG	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	300	(10)	10	0	0,00
					\$ (26)	\$ 26	\$ 0	0,00

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

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	01.2024	\$ 1.989	AUD 3.003	\$ 61	\$ 0	\$ 61	0,01
BOA	01.2024	COP 8.659.799	\$ 2.264	31	0	31	0,00
	01.2024	£ 2.138	2.716	0	(10)	(10)	0,00
	01.2024	HUF 692.534	1.907	0	(89)	(89)	(0,01)
	01.2024	PLN 2.080	492	0	(37)	(37)	0,00
	01.2024	\$ 2.153	COP 8.659.799	80	0	80	0,01
	01.2024	611	HUF 213.993	6	0	6	0,00
	01.2024	6.285	¥ 927.499	298	0	298	0,04
	01.2024	353	PLN 1.490	26	0	26	0,00
	02.2024	CNY 117	\$ 17	0	0	0	0,00
	03.2024	\$ 30	CNH 215	1	0	1	0,00
	03.2024	2.231	COP 8.659.799	0	(30)	(30)	0,00
BPS	01.2024	BRL 60.747	\$ 12.585	79	0	79	0,01
	01.2024	€ 885	970	3	(11)	(8)	0,00
	01.2024	£ 8.151	10.339	0	(52)	(52)	(0,01)
	01.2024	HUF 148.985	424	0	(6)	(6)	0,00
	01.2024	\$ 751	AUD 1.137	25	0	25	0,00
	01.2024	443	€ 405	4	0	4	0,00
	01.2024	4	HUF 1.430	0	0	0	0,00
	01.2024	1.996	ZAR 36.998	25	0	25	0,00
	02.2024	CNY 159	\$ 22	0	0	0	0,00
	02.2024	TWD 319	10	0	(1)	(1)	0,00
	03.2024	820	26	0	(1)	(1)	0,00
	04.2024	\$ 12.585	BRL 61.360	0	(57)	(57)	(0,01)
BRC	01.2024	€ 181.122	\$ 199.194	0	(928)	(928)	(0,12)
	01.2024	HUF 771.327	2.167	0	(56)	(56)	(0,01)
	01.2024	PLN 61.183	13.993	0	(1.562)	(1.562)	(0,20)
	01.2024	\$ 1.103	£ 866	1	0	1	0,00
	01.2024	625	PLN 2.694	60	0	60	0,01
	01.2024	553	TRY 16.487	1	(1)	0	0,00
	02.2024	218	6.642	0	(1)	(1)	0,00
	03.2024	2.303	72.352	0	(27)	(27)	0,00
	04.2024	1.446	46.615	0	(21)	(21)	0,00
BSH	01.2024	BRL 83.000	\$ 16.653	0	(434)	(434)	(0,05)
CBK	01.2024	HUF 84.048	240	0	(3)	(3)	0,00
	01.2024	MXN 164	9	0	0	0	0,00
	01.2024	PLN 2.237	561	0	(8)	(8)	0,00
	01.2024	\$ 1.036	AUD 1.541	15	0	15	0,00
	01.2024	17.037	BRL 82.952	40	0	40	0,01
	01.2024	467	HUF 163.860	5	0	5	0,00
	01.2024	2.751	PLN 11.547	185	0	185	0,02
	02.2024	7.357	BRL 37.739	398	0	398	0,05
	03.2024	BRL 5.422	\$ 1.098	0	(12)	(12)	0,00
	03.2024	PEN 12.741	3.384	0	(48)	(48)	(0,01)
	04.2024	BRL 83.792	17.037	0	(71)	(71)	(0,01)
GLM	01.2024	MXN 485	28	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	PLN 1.068	252	0	(20)	(20)	0,00
	01.2024	\$ 12.574	BRL 61.000	0	(16)	(16)	0,00
	02.2024	BRL 64	\$ 13	0	(1)	(1)	0,00
	03.2024	\$ 374	TRY 11.739	0	(4)	(4)	0,00
	07.2024	BRL 64.100	\$ 12.941	0	(23)	(23)	0,00
MBC	01.2024	€ 873	955	0	(9)	(9)	0,00
	01.2024	HUF 619.639	1.691	0	(95)	(95)	(0,01)
	01.2024	\$ 934	AUD 1.409	27	0	27	0,00
	01.2024	1.193	HUF 446.935	95	0	95	0,01
	01.2024	888	TRY 26.398	0	0	0	0,00
	03.2024	TWD 1.602	\$ 51	0	(2)	(2)	0,00
MYI	01.2024	€ 25	28	0	0	0	0,00
	01.2024	HUF 43.981	125	0	(2)	(2)	0,00
	01.2024	MYR 27	6	0	0	0	0,00
	01.2024	PLN 3.937	984	0	(17)	(17)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Duration Opportunities Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	01.2024	\$ 497	£ 390	\$ 1	\$ (1)	\$ 0	0,00
	01.2024	2.088	HUF 769.066	128	0	128	0,02
	01.2024	2.390	¥ 352.325	111	0	111	0,01
	01.2024	258	PLN 1.073	15	0	15	0,00
	02.2024	CNY 122	\$ 17	0	0	0	0,00
SCX	03.2024	THB 22.627	655	0	(13)	(13)	0,00
SSB	01.2024	£ 1.295	1.630	0	(21)	(21)	0,00
	01.2024	\$ 1.084	CLP 958.527	13	0	13	0,00
TOR	01.2024	3.950	¥ 579.402	163	0	163	0,02
UAG	01.2024	£ 44.286	\$ 56.044	0	(413)	(413)	(0,05)
	01.2024	\$ 756	AUD 1.139	22	0	22	0,00
	01.2024	559	HUF 205.634	33	0	33	0,00
	01.2024	1.440	MXN 25.492	59	0	59	0,01
	01.2024	119	PLN 464	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	ZAR 34.181	\$ 1.791	0	(76)	(76)	(0,01)
				\$ 2.011	\$ (4.181)	\$ (2.170)	(0,27)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 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
BPS	01.2024	€ 15	\$ 16	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2024	\$ 885	€ 806	5	0	5	0,00
CBK	01.2024	€ 54	\$ 59	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 38	€ 35	0	0	0	0,00
MBC	01.2024	€ 827	\$ 904	0	(9)	(9)	(0,01)
	01.2024	\$ 10.127	€ 9.211	50	0	50	0,01
MYI	01.2024	10.133	9.219	53	0	53	0,01
RYL	01.2024	€ 4.993	\$ 5.483	0	(35)	(35)	(0,01)
UAG	01.2024	\$ 9.957	€ 9.052	45	0	45	0,01
				\$ 153	\$ (44)	\$ 109	0,01

Zum 31. Dezember 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 Netto- vermögens
BOA	01.2024	£ 365	\$ 462	\$ 0	\$ (4)	\$ (4)	0,00
	01.2024	\$ 11.030	£ 8.684	41	0	41	0,01
BPS	01.2024	34.680	27.341	175	0	175	0,02
BRC	01.2024	568	450	5	0	5	0,00
CBK	01.2024	£ 20	\$ 25	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 5.599	£ 4.445	67	0	67	0,01
GLM	01.2024	9	7	0	0	0	0,00
MBC	01.2024	£ 249	\$ 317	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 4.636	£ 3.642	7	0	7	0,00
MYI	01.2024	£ 57	\$ 72	0	(1)	(1)	0,00
RYL	01.2024	\$ 35.342	£ 27.921	254	0	254	0,03
SCX	01.2024	212.181	167.748	1.672	0	1.672	0,21
SSB	01.2024	123.103	97.557	1.266	0	1.266	0,16
UAG	01.2024	£ 37	\$ 47	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	\$ 212.161	£ 167.639	1.553	0	1.553	0,20
				\$ 5.040	\$ (6)	\$ 5.034	0,64
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 2.769	0,35

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.02.2054	\$ 50.800	\$ (41.577)	(5,28)
Summe leerverkaufte Wertpapiere		\$ (41.577)	(5,28)
Summe Anlagen		\$ 1.067.002	135,47
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (279.378)	(35,47)
Nettovermögen		\$ 787.624	100,00

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(b) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(c) Nullkuponwertpapier.

(d) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(e) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

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

(g) Mit dem Teilfonds 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

(j) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 15.094 (31. Dezember 2022: USD null) waren zum 31. Dezember 2023 Wertpapiere als Sicherheiten gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 23.168 (31. Dezember 2022: USD 29.843) waren zum 31. Dezember 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 4.454 (31. Dezember 2022: USD 27.963) wurden zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten für Finanzderivate gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 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	\$ 1.047.125	\$ 205	\$ 1.047.330
Investmentfonds	16.610	54.188	0	70.798
Pensionsgeschäfte	0	2.805	0	2.805
Finanzderivate ⁽³⁾	(1.303)	(11.051)	0	(12.354)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(41.577)	0	(41.577)
Summen	\$ 15.307	\$ 1.051.490	\$ 205	\$ 1.067.002

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.216.185	\$ 561	\$ 1.216.746
Investmentfonds	72.181	60.875	0	133.056
Pensionsgeschäfte	0	118.800	0	118.800
Finanzderivate ⁽³⁾	79	(54.248)	0	(54.169)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(94.108)	0	(94.108)
Summen	\$ 72.260	\$ 1.247.504	\$ 561	\$ 1.320.325

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

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

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BPS	3,200 %	28.09.2023	TBD ⁽¹⁾	€ (241)	\$ (268)	(0,04)
SCX	5,750	28.12.2023	04.01.2024	\$ (14.807)	(14.817)	(1,88)
Summe umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (15.085)	(1,92)

⁽¹⁾ Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Duration Opportunities Fund (Forts.)

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement ⁽¹⁾
AZD	\$ 61	\$ 0	\$ 61	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ k. A.
BOA	286	(290)	(4)	(3.452)	3.430	(22)
BPS	156	0	156	(3.383)	3.100	(283)
BRC	(2.528)	3.690	1.162	(105)	30	(75)
BSH	(434)	410	(24)	k. A.	k. A.	k. A.
CBK	564	(670)	(106)	287	(540)	(253)
CLY	k. A.	k. A.	k. A.	(20)	0	(20)
FAR	(21)	0	(21)	(1.707)	1.460	(247)
GLM	(97)	250	153	(15.394)	15.157	(237)
GST	9	0	9	(12)	22	10
MBC	64	0	64	(1.943)	1.280	(663)
MYC	(68)	10	(58)	(1.783)	1.490	(293)
MYI	287	(260)	27	510	(320)	190
RBC	k. A.	k. A.	k. A.	(28)	0	(28)
RYL	219	(310)	(91)	(25)	0	(25)
SAL	(30)	94	64	(102)	94	(8)
SCX	1.659	(2.030)	(371)	354	(460)	(106)
SSB	1.258	(1.080)	178	(2.629)	1.900	(729)
TOR	163	0	163	191	(750)	(559)
UAG	1.221	(1.140)	81	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. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	62,81	44,59
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	70,04	43,14
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,12	2,68
Investmentfonds	8,99	9,89
Pensionsgeschäfte	0,36	8,83
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(1,37)	0,66
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,55)	(2,52)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,35	(2,17)
Leerverkaufte Wertpapiere	(5,28)	(6,99)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(1,92)	k. A.

* Gemäß der Liste der Märkte, die die Kriterien für einen geregelten OGAW-Markt erfüllen, in Anlage 1 zum Verkaufsprospekt.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	1,36	2,57
Unternehmensanleihen und Wechsel	27,83	23,54
Kommunalanleihen und Wechsel	0,99	0,56
US-Regierungsbehörden	48,04	14,02
US-Schatzobligationen	14,38	14,38
Non-Agency-MBS	10,43	7,79
Forderungsbesicherte Wertpapiere	24,51	17,36
Staatsemissionen	4,19	2,15
Stammaktien	0,01	0,01
Vorzugswertpapiere	0,01	0,03
Kurzfristige Instrumente	1,22	8,00
Investmentfonds	8,99	9,89
Pensionsgeschäfte	0,36	8,83
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(1,37)	0,69
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	k. A.	(0,03)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,01	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,35)	(0,15)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	k. A.	0,00
Zinsswaps	(0,21)	(2,37)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	k. A.	0,75
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	(0,02)	(2,34)
Optionen auf Wertpapiere	(0,01)	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzkauf	k. A.	0,00

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
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	(0,27)	(0,77)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,65	0,12
Leerverkaufte Wertpapiere	(5,28)	(6,99)
Sonstige Aktiva und Passiva	(35,47)	1,89
Nettovermögen	100,00	100,00

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	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	4,000 %	21.06.2025	CAD 500	\$ 1	0,02
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,750	20.12.2033	AUD 600	11	0,21
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.03.2034	€ 100	6	0,12
					\$ 18	0,35
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ 18	0,35

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

DEVISETERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2024	\$ 40	¥ 5.961	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,02
BRC	01.2024	€ 5	\$ 5	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 5	AUD 8	0	0	0	0,00
	01.2024	41	¥ 6.000	2	0	2	0,04
CBK	03.2024	46	BRL 228	1	0	1	0,02
GLM	01.2024	17	AUD 26	1	0	1	0,02
MBC	01.2024	€ 608	\$ 668	0	(3)	(3)	(0,06)
UAG	01.2024	£ 22	28	0	(1)	(1)	(0,02)
				\$ 5	\$ (4)	\$ 1	0,02

ABGESICHERTE DEVISETERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 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
BRC	01.2024	\$ 1	€ 1	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
CBK	01.2024	2	2	0	0	0	0,00
MBC	01.2024	87	79	1	0	1	0,02
MYI	01.2024	86	79	1	0	1	0,02
SCX	01.2024	2	2	0	0	0	0,00
UAG	01.2024	86	78	0	0	0	0,00
				\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,04

Zum 31. Dezember 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	01.2024	\$ 7	£ 5	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BRC	01.2024	1	1	0	0	0	0,00
CBK	01.2024	3	2	0	0	0	0,00
MBC	01.2024	2	1	0	0	0	0,00
SCX	01.2024	88	70	0	0	0	0,00
SSB	01.2024	79	63	1	0	1	0,02
UAG	01.2024	88	70	1	0	1	0,02
				\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,04
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 5	0,10

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2054	\$ 100	\$ (100)	(1,92)
Summe leerverkaufte Wertpapiere		\$ (100)	(1,92)
Summe Anlagen		\$ 5.069	97,09
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ 152	2,91
Nettovermögen		\$ 5.221	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Duration Opportunities ESG Fund (Forts.)

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

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

- (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: 0,99 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Citigroup, Inc.	6,075 %	25.01.2026	27.07.2022	\$ 49	\$ 50	0,96

Barmittel in Höhe von USD 69 (31. Dezember 2022: USD 31) waren zum 31. Dezember 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 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	\$ 5.199	\$ 0	\$ 5.199
Finanzderivate ⁽³⁾	(8)	(22)	0	(30)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(100)	0	(100)
Summen	\$ (8)	\$ 5.077	\$ 0	\$ 5.069

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 5.070	\$ 0	\$ 5.070
Finanzderivate ⁽³⁾	(4)	(41)	0	(45)
Summen	\$ (4)	\$ 5.029	\$ 0	\$ 5.025

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

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

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

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	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	2	0	2	(8)	0	(8)
CBK	1	0	1	(8)	0	(8)
GLM	1	0	1	2	0	2
MBC	(2)	0	(2)	k. A.	k. A.	k. A.
MYI	1	0	1	(11)	0	(11)
SCX	0	0	0	(16)	0	(16)
SSB	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. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	52,20	32,23
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	47,38	70,65
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(1,02)	(0,18)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,35	0,02
Freiverkehrsfinanzderivate	0,10	(0,75)
Leerverkaufte Wertpapiere	(1,92)	k. A.

* Gemäß der Liste der Märkte, die die Kriterien für einen geregelten OGAW-Markt erfüllen, in Anlage 1 zum Verkaufsprospekt.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	0,38	1,53
Unternehmensanleihen und Wechsel	39,09	34,48
US-Regierungsbehörden	37,13	5,49
US-Schatzobligationen	13,35	k. A.
Forderungsbesicherte Wertpapiere	2,08	2,12
Kurzfristige Instrumente	7,55	59,26
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(1,02)	(0,18)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Zinsswaps	0,35	0,02
Freiverkehrsfinanzderivate		
Devisenterminkontrakte	0,02	(0,87)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,08	0,12
Leerverkaufte Wertpapiere	(1,92)	k. A.
Sonstige Aktiva und Passiva	2,91	(1,97)
Nettovermögen	100,00	100,00

DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2024	\$ 113	£ 89	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
MBC	01.2024	CAD 678	\$ 501	0	(13)	(13)	(0,01)
MYI	01.2024	\$ 67	€ 61	0	0	0	0,00
				\$ 1	\$ (13)	\$ (12)	(0,01)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend und Investor EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	01.2024	€ 1.556	\$ 1.700	\$ 0	\$ (18)	\$ (18)	(0,02)
	01.2024	\$ 2.165	€ 1.980	23	0	23	0,02
CBK	01.2024	€ 562	\$ 609	1	(12)	(11)	(0,01)
	01.2024	\$ 41	€ 38	1	0	1	0,00
MBC	01.2024	€ 78	\$ 85	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	\$ 15.852	€ 14.424	85	0	85	0,09
MYI	01.2024	14.742	13.413	77	0	77	0,08
UAG	01.2024	13.557	12.325	61	0	61	0,06
				\$ 248	\$ (31)	\$ 217	0,22

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2024	\$ 94	£ 74	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
BPS	01.2024	105	83	1	0	1	0,00
BRC	01.2024	2	1	0	0	0	0,00
CBK	01.2024	£ 26	\$ 33	0	(1)	(1)	0,00
MBC	01.2024	\$ 34	£ 26	0	0	0	0,00
SCX	01.2024	608	481	5	0	5	0,01
SSB	01.2024	398	316	4	0	4	0,00
UAG	01.2024	£ 4	\$ 5	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 608	£ 480	4	0	4	0,00
				\$ 15	\$ (1)	\$ 14	0,01

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (32) (0,03)

Summe Anlagen

\$ 98.312 99,82

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ 181 0,18

Nettovermögen

\$ 98.493 100,00

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

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

- Wertpapier per Emissionstermin.
- Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.
- Nullkuponwertpapier.
- Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- Mit dem Teilfonds verbunden.

Wertpapiere mit einem aggregierten beizulegenden Zeitwert von USD 475 (31. Dezember 2022: USD null) und Barmittel in Höhe von USD 970 (31. Dezember 2022: USD 2.870) wurden zum 31. Dezember 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 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	\$ 42.027	\$ 46.018	\$ 0	\$ 88.045
Investmentfonds	9.668	0	0	9.668
Pensionsgeschäfte	0	631	0	631
Finanzderivate ⁽³⁾	0	(32)	0	(32)
Summen	\$ 51.695	\$ 46.617	\$ 0	\$ 98.312

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 64.970	\$ 41.989	\$ 0	\$ 106.959
Investmentfonds	11.833	0	0	11.833
Pensionsgeschäfte	0	811	0	811
Finanzderivate ⁽³⁾	0	1.210	0	1.210
Summen	\$ 76.803	\$ 44.010	\$ 0	\$ 120.813

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

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

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

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ (111)	\$ 475	\$ 364	\$ (129)	\$ 1.610	\$ 1.481
BPS	6	0	6	k. A.	k. A.	k. A.
CBK	(24)	0	(24)	488	(370)	118
FAR	(3)	0	(3)	(18)	550	532
JPM	(69)	410	341	18	0	18
MBC	71	0	71	305	(310)	(5)
MYI	24	560	584	17	710	727
SCX	5	0	5	k. A.	k. A.	k. A.
SOG	k. A.	k. A.	k. A.	466	(270)	196
SSB	4	0	4	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	65	0	65	k. A.	k. A.	k. A.
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. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	74,81	54,07
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	14,58	34,95
Investmentfonds	9,82	9,85
Pensionsgeschäfte	0,64	0,68
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,03)	1,01

* Gemäß der Liste der Märkte, die die Kriterien für einen geregelten OGAW-Markt erfüllen, in Anlage 1 zum Verkaufsprospekt.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Kanada	k. A.	9,07
USA	42,67	45,00
Kurzfristige Instrumente	46,72	34,95
Investmentfonds	9,82	9,85
Pensionsgeschäfte	0,64	0,68
Freiverkehrsfinanzderivate		
Total Return Swaps auf Indizes	(0,07)	(0,01)
Total Return Swaps auf Wertpapiere	(0,18)	(0,10)
Devisenterminkontrakte	(0,01)	0,08
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,23	1,04
Sonstige Aktiva und Passiva	0,18	(0,56)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS			
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE														
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL														
BANKEN UND FINANZEN														
SLM Student Loan Trust														
4,475 % fällig am 15.12.2033	€	594 \$	609	0,06										
INDUSTRIEWERTE														
Times Square Hotel Trust														
8,528 % fällig am 01.08.2026	\$	79	79	0,01										
Summe Unternehmensanleihen und Wechsel				688				0,07						
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN														
Fannie Mae														
0,000 % fällig am 25.03.2033 - 25.03.2047	3.271	2.309	0,25	5,500 % fällig am 25.06.2035 - 25.02.2040 (a)	\$	1.793 \$	356	0,04	0,628 % fällig am 20.01.2035 - 20.08.2049 (a)	\$	8.698 \$	700	0,08	
0,000 % fällig am 25.05.2033 - 25.05.2048 (b)(d)	3.866	2.970	0,32	5,620 % fällig am 01.06.2041	461	481	0,05	0,728 % fällig am 20.03.2035 - 20.09.2048 (a)	1.949	233	0,03			
0,000 % fällig am 25.06.2043 - 25.02.2062 (a)	240.084	6.095	0,66	5,750 % fällig am 25.07.2035	516	530	0,06	0,778 % fällig am 20.07.2044 (a)	2.278	380	0,04			
0,200 % fällig am 25.02.2043 (a)	2.257	15	0,00	6,000 % fällig am 25.04.2032 - 25.03.2033 (a)	268	38	0,00	0,927 % fällig am 16.01.2038 (a)	12	0	0,00			
0,206 % fällig am 25.08.2033	241	221	0,02	6,000 % fällig am 25.05.2035	690	703	0,08	0,977 % fällig am 16.02.2040 (a)	1.577	112	0,01			
0,273 % fällig am 25.08.2033	73	66	0,01	6,500 % fällig am 25.12.2034 (a)	1.240	177	0,02	1,228 % fällig am 20.05.2041 (a)	1.202	83	0,01			
0,498 % fällig am 25.04.2044 (a)	1.416	164	0,02	Freddie Mac					2,500 % fällig am 20.09.2027 (a)	2.541	82	0,01		
0,548 % fällig am 25.05.2046 - 25.01.2050 (a)	18.884	2.508	0,27	0,000 % fällig am 15.10.2032 - 15.12.2043	4.165	3.021	0,33	3,000 % fällig am 20.12.2047 - 20.10.2051	7.061	6.455	0,70			
0,598 % fällig am 25.10.2042 - 25.07.2059 (a)	11.314	1.538	0,17	0,000 % fällig am 01.02.2035 - 15.08.2057 (b)(d)	3.339	2.419	0,26	3,000 % fällig am 20.12.2049 - 20.01.2052 (a)	18.760	2.643	0,29			
0,648 % fällig am 25.06.2037 - 25.07.2050 (a)	17.897	2.222	0,24	0,000 % fällig am 15.01.2038 - 15.08.2047 (a)	19.181	1.284	0,14	3,250 % fällig am 20.01.2047	435	389	0,04			
0,698 % fällig am 25.02.2046 - 25.09.2048 (a)	8.050	1.070	0,12	0,397 % fällig am 15.02.2041 (a)	253	19	0,00	3,500 % fällig am 20.09.2029 - 20.09.2046 (a)	1.266	184	0,02			
0,748 % fällig am 25.11.2047 - 25.06.2048 (a)	27.945	3.581	0,39	0,437 % fällig am 15.09.2043 (a)	711	68	0,01	3,500 % fällig am 20.03.2042 - 20.01.2052	9.405	8.593	0,93			
0,798 % fällig am 25.04.2043 (a)	1.778	120	0,01	0,460 % fällig am 25.08.2024 (a)	48.930	119	0,01	4,000 % fällig am 15.04.2047 - 15.08.2048	2.305	2.250	0,24			
0,848 % fällig am 25.05.2030 (a)	1.264	65	0,01	0,497 % fällig am 15.07.2041 (a)	2.435	200	0,02	4,500 % fällig am 20.07.2040 - 20.02.2049	2.474	2.434	0,26			
1,078 % fällig am 25.01.2041 (a)	505	69	0,01	0,547 % fällig am 15.10.2041 - 15.05.2046 (a)	27.727	3.236	0,35	4,500 % fällig am 20.05.2043 - 20.09.2047 (a)	2.603	508	0,05			
1,148 % fällig am 25.09.2040 - 25.09.2042 (a)	2.853	270	0,03	0,597 % fällig am 15.08.2041 - 15.09.2044 (a)	7.013	737	0,08	5,000 % fällig am 20.06.2040 - 20.11.2048	2.798	2.834	0,31			
1,198 % fällig am 25.05.2034 (a)	184	1	0,00	0,647 % fällig am 15.02.2044 (a)	116	7	0,00	5,000 % fällig am 20.09.2040 (a)	402	0	0,00			
1,348 % fällig am 25.12.2032 (a)	430	43	0,00	0,648 % fällig am 25.06.2050 (a)	16.076	2.079	0,22	5,638 % fällig am 20.09.2073	978	968	0,10			
1,500 % fällig am 25.08.2037 (a)	53.320	2.930	0,32	0,697 % fällig am 15.08.2025 - 15.10.2048 (a)	11.772	1.316	0,14	6,000 % fällig am 20.02.2047	14	15	0,00			
1,648 % fällig am 25.11.2033 - 25.10.2034 (a)	616	36	0,00	0,698 % fällig am 25.05.2050 (a)	2.799	387	0,04	6,087 % fällig am 20.02.2070	480	479	0,05			
1,748 % fällig am 25.10.2042 (a)	402	56	0,01	0,747 % fällig am 15.03.2048 (a)	3.071	397	0,04	6,238 % fällig am 20.07.2073	90.075	89.651	9,69			
2,000 % fällig am 25.07.2037 - 25.04.2052 (a)	14.229	1.406	0,15	0,797 % fällig am 15.09.2042 (a)	844	71	0,01	6,288 % fällig am 20.09.2073	4.455	4.447	0,48			
2,148 % fällig am 25.11.2033 (a)	40	3	0,00	0,847 % fällig am 15.10.2036 (a)	939	76	0,01	6,298 % fällig am 20.08.2073	9.674	9.665	1,04			
2,500 % fällig am 25.12.2027 - 25.10.2052 (a)	193.376	26.900	2,91	1,017 % fällig am 15.11.2037 (a)	203	16	0,00	6,343 % fällig am 20.03.2058	80	80	0,01			
3,000 % fällig am 25.11.2027 - 25.10.2052 (a)	198.785	31.545	3,41	1,037 % fällig am 15.01.2042 (a)	5.515	633	0,07	6,438 % fällig am 20.06.2073	611	616	0,07			
3,000 % fällig am 01.02.2057 - 01.04.2059	12.878	11.351	1,23	1,147 % fällig am 15.11.2041 (a)	118	6	0,00	6,458 % fällig am 20.08.2073	4.569	4.603	0,50			
3,000 % fällig am 01.07.2060 (h)	9.964	8.552	0,92	1,197 % fällig am 15.07.2026 (a)	320	5	0,00	Ginnie Mae, TBA						
3,500 % fällig am 25.02.2028 - 25.04.2053 (a)	25.643	4.054	0,44	1,247 % fällig am 15.09.2026 - 15.12.2042 (a)	1.536	188	0,02	3,000 % fällig am 01.02.2054	32.700	29.632	3,20			
3,510 % fällig am 01.03.2029	1.096	1.056	0,11	1,277 % fällig am 15.09.2039 (a)	2.356	246	0,03	4,000 % fällig am 01.02.2054	11.200	10.705	1,16			
3,870 % fällig am 01.07.2027	1.600	1.543	0,17	1,397 % fällig am 15.03.2038 (a)	398	33	0,00	4,500 % fällig am 01.02.2054	6.120	5.979	0,65			
3,956 % fällig am 01.08.2049	447	452	0,05	2,000 % fällig am 25.11.2050 - 15.06.2052 (a)	21.986	2.592	0,28	5,000 % fällig am 01.01.2054	5.000	4.966	0,54			
4,000 % fällig am 25.04.2032 (a)	382	37	0,00	2,065 % fällig am 15.09.2032	239	232	0,03	Uniform Mortgage-Backed Security						
4,000 % fällig am 25.10.2040 - 25.06.2050 (a)	24.856	4.141	0,45	2,447 % fällig am 15.12.2031 (a)	46	5	0,00	2,500 % fällig am 01.01.2033 - 01.09.2051	8.575	7.438	0,80			
4,000 % fällig am 25.05.2050	2.039	1.867	0,20	2,500 % fällig am 15.11.2027 - 15.10.2052 (a)	91.608	12.351	1,33	3,000 % fällig am 01.09.2051 (h)	8.794	7.561	0,82			
4,037 % fällig am 25.05.2051 (a)	2.722	426	0,05	2,920 % fällig am 01.09.2036	1.315	1.095	0,12	3,000 % fällig am 01.01.2038 - 01.07.2052	37.929	34.002	3,67			
4,140 % fällig am 01.04.2028	677	672	0,07	3,000 % fällig am 15.03.2027 - 25.12.2051 (a)	117.960	17.853	1,93	3,000 % fällig am 01.02.2040 - 01.03.2050 (h)	20.231	18.571	2,01			
4,374 % fällig am 01.02.2028	2.000	1.975	0,21	3,000 % fällig am 15.12.2046 - 15.04.2049 (a)	908	130	0,01	3,500 % fällig am 01.02.2030 - 01.06.2052	32.432	30.644	3,31			
4,385 % fällig am 01.04.2033	718	714	0,08	3,231 % fällig am 25.12.2036	6.841	5.614	0,61	3,500 % fällig am 01.11.2049 (h)	9.371	8.801	0,95			
4,440 % fällig am 01.06.2033	1.573	1.570	0,17	3,314 % fällig am 15.12.2027 (a)	389	17	0,00	4,000 % fällig am 01.02.2037 - 01.08.2049	16.407	15.904	1,72			
4,490 % fällig am 01.04.2033	300	301	0,03	3,439 % fällig am 25.09.2024	6.100	5.758	0,62	4,000 % fällig am 01.05.2048 (h)	6.786	6.547	0,71			
4,500 % fällig am 25.06.2029 - 25.09.2046 (a)	3.980	551	0,06	3,500 % fällig am 15.03.2029 - 15.10.2052 (a)	67.081	11.822	1,28	4,500 % fällig am 01.12.2038 - 01.07.2052	7.850	7.681	0,83			
4,500 % fällig am 01.11.2032 - 01.04.2059	6.126	6.029	0,65	3,500 % fällig am 01.01.2038 - 01.12.2046	873	824	0,09	4,500 % fällig am 01.07.2053 (h)	9.267	8.988	0,97			
4,580 % fällig am 01.08.2033	1.000	1.009	0,11	4,000 % fällig am 15.10.2041 - 25.08.2050 (a)	23.850	5.173	0,56	5,000 % fällig am 01.06.2048 - 01.09.2053	1.271	1.273	0,14			
4,700 % fällig am 01.04.2033	1.410	1.423	0,15	4,000 % fällig am 01.03.2046 - 01.04.2048	9.743	9.429	1,02	5,500 % fällig am 01.05.2053	1.476	1.494	0,16			
4,990 % fällig am 01.03.2031	499	513	0,06	4,190 % fällig am 01.05.2030	2.500	2.441	0,26	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA						
5,000 % fällig am 25.04.2034 - 25.12.2035 (a)	675	114	0,01	4,500 % fällig am 15.02.2037 - 25.10.2051 (a)	6.491	1.341	0,14	3,000 % fällig am 01.02.2054	58.000	51.369	5,55			
5,000 % fällig am 25.09.2035 (a)	189	30	0,00	4,500 % fällig am 15.11.2040 - 01.02.2048	1.151	1.134	0,12	4,500 % fällig am 01.02.2039 - 01.02.2054	191.450	186.425	20,15			
5,478 % fällig am 25.07.2046	119	118	0,01	4,660 % fällig am 25.01.2031	2.200	2.197	0,24	5,000 % fällig am 01.01.2039 - 01.02.2054	224.100	221.863	23,98			
5,481 % fällig am 01.12.2048	411	419	0,05	5,000 % fällig am 15.05.2025 - 25.05.2048 (a)	1.690	277	0,03	5,500 % fällig am 01.02.2054	162.800	163.538	17,67			
				5,000 % fällig am 01.03.2049	2.485	2.515	0,27	6,500 % fällig am 01.02.2054	221.000	226.466	24,48			
				Ginnie Mae					7,000 % fällig am 01.01.2054	58.600	60.410	6,53		
				0,000 % fällig am 20.08.2033 - 20.01.2044 (b)(d)	1.545	1.387	0,15							
				0,000 % fällig am 20.05.2040 - 20.08.2047 (a)	53.491	1.975	0,21							
				0,000 % fällig am 20.11.2045	534	427	0,05							
				0,078 % fällig am 20.09.2043 (a)	960	22	0,00							
				0,248 % fällig am 20.09.2045 (a)	1.880	164	0,02							
				0,577 % fällig am 16.04.2040 - 16.08.2042 (a)	2.589	252	0,03							
								1.492.796	161,34					

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Mortgage Opportunities Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
US-SCHATZobligationen											
U.S. Treasury Inflation Protected Securities (e)				6,500 % fällig am 25.11.2037	\$ 2.231	\$ 804	0,09	Stratton BTL Mortgage Funding PLC	£ 3.000	\$ 3.607	0,39
0,125 % fällig am 15.07.2024	\$ 130	\$ 128	0,01	6,500 % fällig am 25.12.2037	5.240	2.252	0,24	Stratton Mortgage Funding PLC			
0,125 % fällig am 15.10.2024 (i)	3.118	3.050	0,33	Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust				6,919 % fällig am 25.09.2051	5.000	6.374	0,69
0,250 % fällig am 15.01.2025	2.858	2.774	0,30	5,500 % fällig am 25.10.2021	15	13	0,00	7,221 % fällig am 20.07.2060	2.200	2.802	0,30
0,500 % fällig am 15.04.2024	1.135	1.120	0,12	DBGS Mortgage Trust				7,721 % fällig am 20.07.2060	2.500	3.185	0,34
2,375 % fällig am 15.01.2025	326	324	0,04	6,959 % fällig am 15.06.2033	2.422	1.880	0,20	8,220 % fällig am 12.03.2052	1.400	1.788	0,19
		7.396	0,80	Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust				8,221 % fällig am 20.07.2060	3.600	4.586	0,50
				5,660 % fällig am 19.10.2036	4.470	3.692	0,40	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust			
NON-AGENCY-MBS				Eurosail PLC				5,033 % fällig am 25.07.2035	\$ 1.534	703	0,08
1166 Avenue of the Americas Commercial Mortgage Trust				4,198 % fällig am 13.03.2045	€ 515	560	0,06	5,132 % fällig am 25.05.2035	954	760	0,08
5,690 % fällig am 13.10.2037	2.000	1.570	0,17	4,419 % fällig am 10.09.2044	800	857	0,09	5,770 % fällig am 25.02.2037	451	432	0,05
225 Liberty Street Trust				5,889 % fällig am 13.06.2045	€ 1.673	1.826	0,20	5,910 % fällig am 25.06.2037	283	229	0,02
4,649 % fällig am 10.02.2036	5.000	3.898	0,42	6,339 % fällig am 13.06.2045	309	365	0,04	5,975 % fällig am 25.12.2034	1.622	1.476	0,16
American Home Mortgage Assets Trust				First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust				6,478 % fällig am 25.02.2034	7	7	0,00
5,595 % fällig am 25.03.2047	1.977	1.744	0,19	6,475 % fällig am 25.07.2035	\$ 162	147	0,02	Structured Asset Mortgage Investments Trust			
American Home Mortgage Investment Trust				Grifonas Finance PLC				5,910 % fällig am 25.09.2047	3.046	2.624	0,28
5,883 % fällig am 25.09.2035	560	304	0,03	4,212 % fällig am 28.08.2039	€ 813	877	0,09	6,010 % fällig am 25.08.2035	474	417	0,05
6,050 % fällig am 25.11.2045	1.752	1.521	0,16	GS Mortgage Securities Corp. Trust				6,595 % fällig am 19.12.2033	346	326	0,04
6,500 % fällig am 25.03.2047	1.153	819	0,09	4,579 % fällig am 10.10.2032	\$ 5.821	5.412	0,58	Structured Asset Securities Corp.			
Angel Oak Mortgage Trust				6,859 % fällig am 15.07.2031	600	436	0,05	5,720 % fällig am 25.07.2035	1.268	1.156	0,12
2,336 % fällig am 25.04.2066	3.638	2.555	0,28	7,109 % fällig am 15.07.2031	2.000	1.250	0,14	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust			
Ashford Hospitality Trust				GS Mortgage Securities Trust				5,720 % fällig am 25.05.2036	1.918	1.556	0,17
8,284 % fällig am 15.06.2035	6.900	6.666	0,72	3,805 % fällig am 10.10.2035	3.700	3.060	0,33	Tower Bridge Funding PLC			
Atlas Funding PLC				GSMPMS Mortgage Loan Trust				0,000 % fällig am 20.01.2066 (c)£	4.100	5.236	0,57
6,920 % fällig am 25.07.2058	£ 1.150	1.466	0,16	5,870 % fällig am 25.04.2036	327	269	0,03	Trinity Square PLC			
7,470 % fällig am 25.07.2058	950	1.212	0,13	7,060 % fällig am 20.10.2032	1.094	977	0,11	6,920 % fällig am 15.07.2059	3.200	4.067	0,44
Avon Finance PLC				GSMSC Resecuritization Trust				7,220 % fällig am 15.07.2059	2.400	3.039	0,33
0,000 % fällig am 28.12.2049	2.000	2.544	0,27	2,167 % fällig am 26.04.2037	7.355	1.939	0,21	7,970 % fällig am 15.07.2059	1.600	2.025	0,22
Banc of America Funding Trust				Hops Hill PLC				Tudor Rose Mortgages			
6,263 % fällig am 25.10.2036	\$ 1.587	1.360	0,15	7,048 % fällig am 27.05.2054	£ 3.000	3.822	0,41	6,370 % fällig am 25.06.2048	5.105	6.325	0,68
Barley Hill PLC				7,548 % fällig am 27.05.2054	1.100	1.400	0,15	6,720 % fällig am 20.06.2048	9.746	11.982	1,29
6,898 % fällig am 27.08.2058	£ 2.953	3.670	0,40	HSI Asset Securitization Corp. Trust				Twin Bridges PLC			
BCAP LLC Trust				6,430 % fällig am 25.07.2035	\$ 988	948	0,10	6,920 % fällig am 01.12.2055	3.007	3.609	0,39
5,750 % fällig am 25.04.2037	\$ 1.440	1.311	0,14	IndyMac Mortgage Loan Trust				Uropa Securities PLC			
Bear Stearns ALT-A Trust				3,860 % fällig am 25.12.2035	3.002	1.716	0,19	5,590 % fällig am 10.10.2040	64	79	0,01
6,595 % fällig am 25.01.2035	1.321	1.224	0,13	4,265 % fällig am 25.12.2035	318	240	0,03	5,690 % fällig am 10.10.2040	32	37	0,00
Cascade Funding Mortgage Trust				5,870 % fällig am 25.10.2036	3.099	2.769	0,30	Verus Securitization Trust			
4,000 % fällig am 25.10.2068	719	720	0,08	JPMorgan Alternative Loan Trust				2,338 % fällig am 25.10.2063	\$ 1.250	1.078	0,12
Chase Mortgage Finance Trust				5,790 % fällig am 25.11.2036	4.031	3.383	0,37	3,195 % fällig am 25.10.2063	1.000	805	0,09
4,114 % fällig am 25.03.2037	47	44	0,00	JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust				4,199 % fällig am 25.10.2063	1.000	773	0,08
ChaseFlex Trust				5,350 % fällig am 05.07.2033	1.950	1.426	0,15	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
6,150 % fällig am 25.05.2037	1.420	1.353	0,15	6,039 % fällig am 12.02.2051	52	434	0,05	3,814 % fällig am 25.06.2037	2.974	2.547	0,28
Citigroup Mortgage Loan Trust				JPMorgan Resecuritization Trust				4,272 % fällig am 25.12.2036	2.153	1.878	0,20
6,000 % fällig am 25.12.2035	1.111	1.066	0,12	4,500 % fällig am 26.04.2037	931	439	0,05	5,782 % fällig am 25.04.2047	58	47	0,01
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				5,559 % fällig am 26.09.2037	1.247	919	0,10	5,972 % fällig am 25.09.2046	901	716	0,08
5,891 % fällig am 25.08.2035	13	12	0,00	Lehman Mortgage Trust				6,262 % fällig am 25.01.2047	656	580	0,06
CitiMortgage Alternative Loan Trust				6,000 % fällig am 25.12.2036	1.411	1.151	0,12	6,512 % fällig am 25.11.2046	295	260	0,03
6,000 % fällig am 25.11.2036	818	739	0,08	Lehman XS Trust				Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
6,000 % fällig am 25.01.2037	1.412	1.149	0,12	5,950 % fällig am 25.06.2047	5.266	4.669	0,50	6,002 % fällig am 25.06.2046	1.941	1.515	0,16
Countrywide Alternative Loan Trust				MASTR Asset Securitization Trust				Worldwide Plaza Trust			
5,500 % fällig am 25.06.2035	134	101	0,01	6,000 % fällig am 25.10.2036	651	532	0,06	3,596 % fällig am 10.11.2036	3.950	844	0,09
5,500 % fällig am 25.07.2035	1.990	1.402	0,15	MASTR Reperforming Loan Trust							
5,500 % fällig am 25.10.2035	1.105	809	0,09	7,000 % fällig am 25.07.2035	1.190	825	0,09				
5,500 % fällig am 25.11.2035	1.643	928	0,10	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust							
5,500 % fällig am 25.12.2035	232	163	0,02	6,250 % fällig am 25.08.2036	4.079	1.697	0,18	Accredited Mortgage Loan Trust			
5,790 % fällig am 25.02.2047	269	250	0,03	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				6,490 % fällig am 25.07.2035	2.150	1.979	0,21
5,790 % fällig am 25.09.2047	7	7	0,00	5,500 % fällig am 25.11.2035	965	624	0,07	ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust			
5,892 % fällig am 20.03.2046	470	382	0,04	6,000 % fällig am 25.10.2037	6.307	3.287	0,36	6,445 % fällig am 25.11.2033	644	628	0,07
5,892 % fällig am 20.05.2046	1.749	1.475	0,16	Mortgage Equity Conversion Asset Trust				Aegis Asset-Backed Securities Trust			
5,952 % fällig am 25.06.2046	1.983	1.612	0,17	5,290 % fällig am 25.02.2042	449	439	0,05	6,470 % fällig am 25.03.2035	50	46	0,00
6,000 % fällig am 25.05.2036	3.384	1.938	0,21	Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust				Aegis Asset-Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Certificates			
6,000 % fällig am 25.02.2037	1.381	577	0,06	4,389 % fällig am 25.10.2035	906	498	0,05	7,300 % fällig am 25.12.2034	991	867	0,09
6,012 % fällig am 25.12.2035	1.200	1.056	0,11	6,017 % fällig am 25.06.2037	1.216	1.018	0,11	Ameriquet Mortgage Securities Trust			
6,110 % fällig am 25.11.2035	3.651	2.915	0,31	Nomura Resecuritization Trust				6,040 % fällig am 25.04.2036	6.350	5.562	0,60
6,170 % fällig am 25.09.2035	1.697	1.516	0,16	6,417 % fällig am 26.11.2036	1.941	1.653	0,18	Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates			
6,250 % fällig am 25.05.2036	265	146	0,02	Residential Accredit Loans, Inc. Trust				5,950 % fällig am 25.05.2035	2.590	2.184	0,24
6,250 % fällig am 25.09.2037	509	343	0,04	5,770 % fällig am 25.08.2036	797	592	0,06	Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust			
Countrywide Asset-Backed Certificates				5,929 % fällig am 25.12.2035	1.146	521	0,06	3,646 % fällig am 25.03.2036	1.593	1.367	0,15
5,970 % fällig am 25.03.2036	372	366	0,04	6,000 % fällig am 25.01.2037	163	126	0,01	6,700 % fällig am 25.02.2035	946	864	0,09
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				6,250 % fällig am 25.01.2037	917	744	0,08	Attentus CDO Ltd.			
3,695 % fällig am 25.04.2035	201	139	0,01	Residential Asset Securitization Trust				6,118 % fällig am 11.10.2042	9.984	8.711	0,94
4,042 % fällig am 20.04.2036	39	35	0,00	6,000 % fällig am 25.12.2036	2.991	908	0,10	Avoca Static CLO DAC			
4,441 % fällig am 20.11.2035	3.131	2.828	0,31	RMAC Securities PLC				5,690 % fällig am 15.10.2030	€ 500	552	0,06
4,524 % fällig am 20.04.2036	541	473	0,05	5,509 % fällig am 12.06.2044	£ 349	429	0,05				
5,750 % fällig am 25.07.2037	693	339	0,04	Sestante Finance SRL							
				4,222 % fällig am 23.07.2046	€ 792	804	0,09				

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				Home Equity Asset Trust				5,746 % fällig am 25.05.2036	\$ 1.361	\$ 665	0,07
5,543 % fällig am 25.12.2035	\$ 1.678	\$ 1.497	0,16	5,790 % fällig am 25.08.2036	\$ 450	\$ 447	0,05	Residential Asset Mortgage Products Trust			
5,653 % fällig am 25.04.2036	1.458	1.450	0,16	5,950 % fällig am 25.08.2037	695	689	0,07	6,010 % fällig am 25.02.2036	196	187	0,02
5,950 % fällig am 25.07.2036	238	237	0,03	6,145 % fällig am 25.02.2036	1.414	1.366	0,15	Residential Asset Securities Corp. Trust			
6,520 % fällig am 25.08.2037	7.854	6.835	0,74	6,760 % fällig am 25.08.2033	271	257	0,03	5,712 % fällig am 25.06.2034	654	642	0,07
6,670 % fällig am 25.01.2045	25	25	0,00	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust				5,905 % fällig am 25.06.2036	1.292	1.252	0,14
7,345 % fällig am 25.07.2034	135	114	0,01	5,710 % fällig am 25.04.2037	6.415	4.149	0,45	6,505 % fällig am 25.08.2035	2.131	2.027	0,22
Cardiff Auto Receivables Securitisation PLC				JPMorgan Mortgage Acquisition Trust				Sapphire Aviation Finance Ltd.			
7,147 % fällig am 21.10.2028	£ 3.200	4.086	0,44	4,433 % fällig am 25.11.2036	186	168	0,02	4,250 % fällig am 15.03.2040	3.160	2.817	0,30
8,097 % fällig am 21.10.2028	8.775	11.132	1,20	5,590 % fällig am 25.12.2036	5.797	3.096	0,33	Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust			
Castlelake Aircraft Securitization Trust				Jubilee CLO DAC				5,590 % fällig am 25.09.2036	2.131	1.429	0,15
4,125 % fällig am 15.06.2043	\$ 1.875	1.712	0,19	4,615 % fällig am 15.04.2031	€ 400	432	0,05	Signal Peak CLO Ltd.			
Centerline Logistics Corp.				Laurelin DAC				6,750 % fällig am 25.04.2031	851	852	0,09
9,250 % fällig am 15.12.2027	564	565	0,06	1,800 % fällig am 20.10.2031	3.500	3.539	0,38	SoFi Professional Loan Program LLC			
9,750 % fällig am 15.12.2027	703	704	0,08	Lehman XS Trust				2,650 % fällig am 25.09.2040	35	34	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust				5,890 % fällig am 25.06.2046	\$ 3.026	2.736	0,30	Soundview Home Loan Trust			
5,790 % fällig am 25.12.2036	3.214	1.796	0,19	Long Beach Mortgage Loan Trust				5,640 % fällig am 25.07.2037	5.508	4.707	0,51
Conseco Finance Corp.				6,070 % fällig am 25.02.2036	140	112	0,01	6,370 % fällig am 25.10.2037	6.560	5.153	0,56
6,920 % fällig am 15.12.2030	1.606	1.608	0,17	6,490 % fällig am 25.08.2033	70	68	0,01	6,460 % fällig am 25.06.2035	605	565	0,06
Countrywide Asset-Backed Certificates				Man GLG Euro CLO DAC				6,770 % fällig am 25.10.2037	5.206	3.812	0,41
5,910 % fällig am 25.07.2034	2.421	2.364	0,26	1,680 % fällig am 15.12.2031	€ 4.700	4.696	0,51	Structured Asset Investment Loan Trust			
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				1,700 % fällig am 15.10.2030	5.000	5.133	0,55	6,070 % fällig am 25.04.2036	10.906	5.777	0,62
5,633 % fällig am 25.06.2035	92	78	0,01	MAPS Ltd.				Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust			
5,690 % fällig am 25.09.2037	1.886	1.922	0,21	4,212 % fällig am 15.05.2043	\$ 1.520	1.365	0,15	5,730 % fällig am 25.05.2036	287	276	0,03
5,859 % fällig am 25.10.2046	5	6	0,00	MASTR Asset-Backed Securities Trust				6,595 % fällig am 25.04.2035	56	55	0,01
5,910 % fällig am 25.09.2047	878	846	0,09	6,050 % fällig am 25.12.2035	63	62	0,01	Taberna Preferred Funding Ltd.			
6,170 % fällig am 25.03.2036	1.742	1.519	0,16	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				5,994 % fällig am 05.05.2038	2.312	2.197	0,24
6,445 % fällig am 25.01.2036	441	429	0,05	6,550 % fällig am 25.10.2035	539	535	0,06	6,146 % fällig am 05.07.2035	223	203	0,02
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.				Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				Terwin Mortgage Trust			
6,445 % fällig am 25.10.2034	70	69	0,01	3,938 % fällig am 25.01.2035	740	657	0,07	6,415 % fällig am 25.06.2036	200	195	0,02
Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC				5,610 % fällig am 25.10.2036	996	430	0,05	Thunderbolt Aircraft Lease Ltd.			
3,114 % fällig am 25.05.2036	2.053	1.313	0,14	5,720 % fällig am 25.07.2036	9.434	8.283	0,90	4,147 % fällig am 15.09.2038	6.624	5.747	0,62
3,580 % fällig am 25.03.2034	252	258	0,03	5,770 % fällig am 25.07.2036	3.401	1.271	0,14	TIAA CLO Ltd.			
Credit-Based Asset Servicing & Securitization Mortgage Loan Trust				5,970 % fällig am 25.07.2036	3.401	1.282	0,14	6,805 % fällig am 16.01.2031	1.952	1.953	0,21
3,541 % fällig am 25.02.2037	2.870	1.776	0,19	Morgan Stanley Capital, Inc. Trust				Tralee CLO Ltd.			
Cumulus Static CLO DAC				6,050 % fällig am 25.01.2036	1.729	1.658	0,18	7,577 % fällig am 20.07.2029	4.100	4.109	0,44
5,499 % fällig am 25.04.2033	€ 3.100	3.422	0,37	Morgan Stanley Home Equity Loan Trust				TruPS Financials Note Securitization Ltd.			
Elevation CLO Ltd.				5,570 % fällig am 25.07.2036	3.532	1.423	0,15	7,202 % fällig am 20.09.2039	2.207	2.157	0,23
7,505 % fällig am 15.07.2029	\$ 4.300	4.308	0,47	Nassau Ltd.				Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust			
First Franklin Mortgage Loan Trust				6,905 % fällig am 15.01.2030	8.872	8.884	0,96	5,890 % fällig am 25.03.2037	1.039	1.021	0,11
6,130 % fällig am 25.01.2036	311	308	0,03	National Collegiate Student Loan Trust							
Fremont Home Loan Trust				5,780 % fällig am 25.05.2032	1.788	1.726	0,19				
5,750 % fällig am 25.02.2037	5.655	4.330	0,47	Option One Mortgage Loan Trust							
5,950 % fällig am 25.08.2036	4.010	1.290	0,14	5,610 % fällig am 25.03.2037	4.624	4.085	0,44				
6,400 % fällig am 25.07.2035	4.000	3.073	0,33	Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates							
Goodgreen Trust				7,045 % fällig am 25.02.2035	298	286	0,03				
3,930 % fällig am 15.10.2053	1.830	1.619	0,18	Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust							
GSAA Home Equity Trust				5,965 % fällig am 25.07.2036	2.285	2.129	0,23				
5,930 % fällig am 25.04.2047	3.673	1.754	0,19	6,010 % fällig am 25.05.2036	344	323	0,03				
6,190 % fällig am 25.10.2035	1.950	1.780	0,19	Renaissance Home Equity Loan Trust							
GSAMP Trust				5,608 % fällig am 25.05.2036	5.981	2.854	0,31				
5,740 % fällig am 25.03.2047	694	617	0,07								
Harvest CLO DAC											
1,040 % fällig am 15.07.2031	€ 800	837	0,09								

Summe übertragbare Wertpapiere \$ 1.902.209 205,59

AKTIEN

INVESTMENTFONDS

ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN

PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)	425	4	0,00
Summe Investmentfonds	\$ 4		0,00

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensionsgeschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
BPS	5,470 %	02.01.2024	03.01.2024	\$ 31.800	U.S. Treasury Notes 1,250 % fällig am 15.08.2031	\$ (32.494)	\$ 31.800	\$ 31.805	3,44
	5,510	02.01.2024	03.01.2024	100	U.S. Treasury Notes 2,125 % fällig am 15.05.2025	(102)	100	100	0,01
FICC	2,600	29.12.2023	02.01.2024	1.668	U.S. Treasury Notes 4,875 % fällig am 30.11.2025	(1.702)	1.668	1.668	0,18
	5,330	29.12.2023	02.01.2024	35.400	U.S. Treasury Notes 1,500 % fällig am 30.11.2028	(36.108)	35.400	35.400	3,82
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (70.406)	\$ 68.968	\$ 68.973	7,45

⁽¹⁾ Umfasst aufgelaufene Zinsen.

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Mortgage Opportunities Fund (Forts.)

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablaufmonat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month SOFR December Futures	Long	03.2024	62	\$ (41)	0,00
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2025	18	(28)	0,00
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2024	62	(11)	0,00
3-Month SOFR March Futures	Long	06.2024	98	14	0,00
3-Month SOFR September Futures	Short	12.2024	62	(127)	(0,01)
3-Month SOFR September Futures	Long	12.2025	9	16	0,00
30-Day Federal Fund February Futures	Short	02.2024	45	135	0,01
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Short	03.2024	815	(1.615)	(0,17)
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Short	03.2024	233	(612)	(0,07)
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2024	69	13	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Short	03.2024	174	(615)	(0,07)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2024	27	(349)	(0,04)
				\$ (3.220)	(0,35)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (3.220)	(0,35)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt ⁽¹⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,250 %	20.03.2054	£ 400	\$ (67)	(0,01)
Zahlung ⁽¹⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	5,000	20.03.2029	2.300	1	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,827	03.07.2028	\$ 85.485	(6.725)	(0,73)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,000	21.06.2033	3.100	(129)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,043	07.08.2028	14.800	(277)	(0,03)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2030	17.500	998	0,11
Erhalt ⁽¹⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.06.2054	8.700	40	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,510	08.03.2033	100	0	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,740	10.07.2030	1.500	15	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.12.2028	52.800	1.230	0,13
Erhalt ⁽¹⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2029	16.300	(10)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,012	08.11.2030	14.100	527	0,06
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,180	08.11.2030	16.000	758	0,08
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,192	08.11.2030	4.500	217	0,02
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	20.12.2025	2.400	(26)	0,00
Erhalt ⁽¹⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	20.03.2029	19.900	(102)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,320	10.10.2030	800	41	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,500	21.06.2024	200.400	955	0,10
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,250	18.03.2050	€ 2.400	988	0,11
Erhalt ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.03.2034	13.300	(836)	(0,09)
Zahlung ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,250	20.03.2029	21.500	(13)	0,00
					\$ (2.415)	(0,26)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ (2.415)	(0,26)

⁽¹⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BOA	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,000 %	28.05.2024	36.000	\$ 43	\$ 13	0,00
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,310	08.01.2024	6.700	49	0	0,00
	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	5,500	13.01.2025	28.000	189	72	0,01
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,000	22.04.2025	8.000	73	217	0,02
BRC	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,500	05.02.2024	76.000	509	737	0,08
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,250	21.02.2024	30.500	31	1	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500	21.02.2024	77.700	61	1	0,00
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,250	17.03.2025	8.000	44	73	0,01
CBK	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500	27.12.2024	28.400	119	68	0,01
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,400	19.05.2027	13.900	79	102	0,01
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,509	06.02.2024	7.200	35	87	0,01

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Netto- vermögens	
DUB	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,500 %	09.02.2024	24.700	\$ 179	\$ 259	0,03	
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,500	20.02.2024	61.000	530	703	0,08	
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,100	01.02.2024	30.000	68	157	0,02	
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500	16.12.2024	39.000	46	11	0,00	
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,500	21.02.2025	4.800	44	57	0,01	
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,500	19.08.2024	5.100	104	148	0,02	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,500	25.03.2025	16.300	329	620	0,07	
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,045	08.01.2024	18.300	63	0	0,00	
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,200	19.08.2024	5.100	104	29	0,00	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,016	23.01.2024	2.000	3	0	0,00	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,953	21.02.2024	2.300	7	0	0,00	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,995	16.01.2024	10.400	101	0	0,00	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,040	11.01.2024	11.100	106	0	0,00	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,875	03.01.2024	1.400	37	0	0,00	
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,500	07.02.2024	77.500	554	784	0,08	
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,500	28.02.2024	35.500	288	444	0,05	
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,500	04.03.2024	35.500	259	459	0,05	
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,625	03.01.2024	1.400	38	0	0,00	
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,250	29.11.2024	31.200	745	323	0,04	
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500	03.01.2025	22.000	130	54	0,01	
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500	28.01.2025	1.400	8	4	0,00	
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500	26.04.2024	87.800	47	5	0,00	
	FAR GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,400	19.05.2027	20.000	107	147	0,02
		Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,250	19.08.2024	32.800	66	9	0,00
Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap		3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,300	13.03.2025	17.000	31	8	0,00	
Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap		3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500	18.03.2024	140.000	147	3	0,00	
Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap		3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,790	03.05.2024	14.800	322	70	0,01	
Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap		3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,790	03.05.2024	14.800	322	455	0,05	
Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap		3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,365	19.08.2024	5.500	102	135	0,01	
Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap		3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,265	19.08.2024	5.500	102	28	0,00	
Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap		3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,250	03.03.2025	44.000	70	22	0,00	
Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap		3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,500	28.02.2025	2.700	27	33	0,00	
Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap		3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,705	08.01.2024	1.200	5	19	0,00	
Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap		3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,000	16.04.2025	13.300	151	359	0,04	
MYC	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500	16.12.2024	14.600	61	33	0,00	
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500	13.01.2025	21.500	116	55	0,01	
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,000	28.05.2024	43.100	49	15	0,00	
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,000	14.06.2024	33.500	52	13	0,00	
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,000	16.12.2024	16.800	28	10	0,00	
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500	14.05.2024	35.400	18	3	0,00	
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500	21.01.2025	49.500	54	15	0,00	
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,750	21.03.2025	16.500	152	282	0,03	
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,285	04.03.2024	8.500	160	78	0,01	
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,548	06.02.2024	4.600	37	62	0,01	
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,560	06.02.2024	7.700	37	107	0,01	
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,905	06.02.2024	8.700	31	14	0,00	
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,985	04.03.2024	8.500	160	20	0,00	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,433	27.02.2024	2.300	17	1	0,00	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,500	22.08.2025	17.000	211	287	0,03	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,000	16.04.2025	5.800	59	156	0,02	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,000	22.04.2025	6.600	66	179	0,02	
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500	03.01.2025	9.600	45	24	0,00	
Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500	30.01.2025	14.000	66	39	0,00		
							\$ 7.897	\$ 8.109	0,88	

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Netto- vermögens
JPM	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.01.2054	\$ 66,000	09.01.2024	37.000	\$ 1	\$ 0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 5,000 % fällig am 01.01.2054	75,000	09.01.2024	140.000	5	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 5,000 % fällig am 01.03.2054	75,000	06.03.2024	75.000	3	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 5,500 % fällig am 01.03.2054	76,000	06.03.2024	20.000	1	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 6,500 % fällig am 01.02.2054	74,000	06.02.2024	100.000	4	0	0,00
SAL	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 6,500 % fällig am 01.03.2054	79,000	06.03.2024	38.400	1	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.02.2054	70,000	06.02.2024	100.000	4	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 7,000 % fällig am 01.02.2054	80,000	06.02.2024	41.600	2	0	0,00
					\$ 21	\$ 0	0,00

VERKAUFSOPTIONEN

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BOA	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,000 %	13.01.2025	14.000	\$ (105)	\$ (71)	(0,01)
DUB	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,600	01.02.2024	30.000	(33)	(40)	0,00
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	25.03.2025	16.300	(185)	(371)	(0,04)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	5,750	18.03.2024	140.000	(68)	(1)	0,00
							\$ (391)	\$ (483)	(0,05)

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Mortgage Opportunities Fund (Forts.)

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfallsdatum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BOA	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 5,000 % fällig am 01.01.2054	\$ 97,891	09.01.2024	2.000	\$ (8)	\$ (23)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 5,000 % fällig am 01.01.2054	98,813	09.01.2024	3.000	(16)	(9)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 6,000 % fällig am 01.02.2054	101,094	06.02.2024	2.000	(8)	(16)	0,00
JPM	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 5,000 % fällig am 01.01.2054	96,828	09.01.2024	3.500	(19)	(75)	(0,01)
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 6,000 % fällig am 01.02.2054	99,227	06.02.2024	1.000	(5)	(1)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 6,000 % fällig am 01.02.2054	101,227	06.02.2024	1.000	(4)	(7)	0,00
MSC	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 5,000 % fällig am 01.01.2054	98,406	09.01.2024	1.000	(5)	(7)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 5,000 % fällig am 01.02.2054	96,391	06.02.2024	10.000	(30)	(14)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 5,500 % fällig am 01.02.2054	100,258	06.02.2024	7.000	(38)	(49)	(0,01)
SAL	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.02.2054	95,813	06.02.2024	2.000	(11)	(9)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.02.2054	97,813	06.02.2024	2.000	(10)	(11)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 5,000 % fällig am 01.01.2054	97,078	09.01.2024	9.000	(65)	(171)	(0,02)
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 5,000 % fällig am 01.01.2054	97,945	09.01.2024	5.000	(16)	(4)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 5,000 % fällig am 01.01.2054	98,469	09.01.2024	2.000	(9)	(13)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 5,000 % fällig am 01.01.2054	98,813	09.01.2024	2.000	(9)	(6)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 5,000 % fällig am 01.01.2054	99,195	09.01.2024	14.300	(53)	(36)	(0,01)
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 5,000 % fällig am 01.01.2054	99,656	09.01.2024	9.000	(21)	(10)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 5,000 % fällig am 01.01.2054	99,906	09.01.2024	1.000	(3)	(1)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 5,000 % fällig am 01.02.2054	96,813	06.02.2024	2.000	(5)	(4)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 5,000 % fällig am 01.02.2054	98,313	06.02.2024	9.000	(35)	(107)	(0,01)
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 5,000 % fällig am 01.02.2054	98,391	06.02.2024	9.000	(37)	(103)	(0,01)
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 5,000 % fällig am 01.02.2054	100,813	06.02.2024	2.000	(3)	(4)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 6,500 % fällig am 01.02.2054	101,375	06.02.2024	8.000	(16)	(11)	0,00
					\$ (426)	\$ (691)	(0,07)

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
BOA	01.2024	£ 599	\$ 758	\$ 0	\$ (6)	\$ (6)	0,00
BPS	01.2024	€ 21.042	\$ 22.955	0	(294)	(294)	(0,03)
	01.2024	\$ 417	€ 386	10	0	10	0,00
BRC	01.2024	£ 67.456	\$ 85.371	0	(625)	(625)	(0,07)
CBK	01.2024	\$ 504	£ 398	3	0	3	0,00
MYI	01.2024	€ 102	\$ 113	1	0	1	0,00
	01.2024	\$ 48	£ 37	0	0	0	0,00
				\$ 14	\$ (925)	\$ (911)	(0,10)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional CAD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
BRC	01.2024	\$ 9.850	CAD 13.395	\$ 309	\$ 0	\$ 309	0,04
CBK	01.2024	456	619	14	0	14	0,00
GLM	01.2024	10.175	13.822	309	0	309	0,03
MYI	01.2024	56	74	0	0	0	0,00
UAG	01.2024	9.970	13.524	287	0	287	0,03
				\$ 919	\$ 0	\$ 919	0,10

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
BPS	01.2024	CHF 207	\$ 243	\$ 0	\$ (3)	\$ (3)	0,00
	01.2024	\$ 24	CHF 20	0	0	0	0,00
BRC	01.2024	10	9	0	0	0	0,00
CBK	01.2024	497	430	14	0	14	0,00
GLM	01.2024	925	810	39	0	39	0,01
MYI	01.2024	911	795	34	0	34	0,00
UAG	01.2024	900	785	34	0	34	0,00
				\$ 121	\$ (3)	\$ 118	0,01

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	01.2024	€ 1.446	\$ 1.583	\$ 0	\$ (14)	\$ (14)	0,00
	01.2024	\$ 8.356	€ 7.667	118	(2)	116	0,01
BRC	01.2024	95.743	87.056	446	0	446	0,05
CBK	01.2024	€ 1.678	\$ 1.828	2	(28)	(26)	0,00
	01.2024	\$ 4.522	€ 4.120	30	0	30	0,00
MBC	01.2024	€ 235	\$ 256	0	(4)	(4)	0,00
	01.2024	\$ 1.852	€ 1.693	18	0	18	0,00
MYI	01.2024	95.685	87.056	504	0	504	0,05
UAG	01.2024	95.759	87.056	430	0	430	0,04
				\$ 1.548	\$ (48)	\$ 1.500	0,15

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2024	\$ 653	£ 515	\$ 4	\$ 0	\$ 4	0,00
BPS	01.2024	1.117	881	6	0	6	0,00
BRC	01.2024	22	17	0	0	0	0,00
CBK	01.2024	£ 20	\$ 25	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 379	£ 298	1	0	1	0,00
GLM	01.2024	£ 3	\$ 4	0	0	0	0,00
MBC	01.2024	125	157	0	(1)	(1)	(0,01)
	01.2024	\$ 229	£ 181	1	0	1	0,00
MYI	01.2024	£ 10	\$ 13	0	0	0	0,00
SCX	01.2024	\$ 6.412	£ 5.070	50	0	50	0,01
SSB	01.2024	4.759	3.772	49	0	49	0,01
UAG	01.2024	£ 3	\$ 4	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 6.412	£ 5.067	47	0	47	0,01
				\$ 158	\$ (1)	\$ 157	0,02
Summe Freiverkehrsfinauzderivate						\$ 8.718	0,94

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Fannie Mae, TBA			
4,000 % fällig am 01.01.2039	\$ 7.800	\$ (7.654)	(0,83)
Ginnie Mae, TBA			
2,000 % fällig am 01.01.2054	4.300	(3.642)	(0,39)
2,500 % fällig am 01.01.2054	26.200	(22.923)	(2,48)
3,500 % fällig am 01.01.2054	2.250	(2.096)	(0,23)
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,000 % fällig am 01.01.2039	22.800	(20.445)	(2,21)
2,000 % fällig am 01.01.2054	33.750	(27.591)	(2,98)
2,000 % fällig am 01.02.2054	102.600	(83.972)	(9,08)
2,500 % fällig am 01.01.2054	9.000	(7.658)	(0,83)
2,500 % fällig am 01.02.2054	96.500	(82.213)	(8,88)
3,000 % fällig am 01.01.2039	500	(471)	(0,05)
3,000 % fällig am 01.02.2054 (g)	34.250	(30.334)	(3,28)
3,000 % fällig am 01.03.2054	38.000	(33.697)	(3,64)
3,500 % fällig am 01.02.2054	37.600	(34.533)	(3,73)
4,000 % fällig am 01.01.2054	1.200	(1.135)	(0,12)
4,000 % fällig am 01.02.2054	56.000	(53.018)	(5,73)
6,000 % fällig am 01.02.2054	20.600	(20.918)	(2,26)
Summe leerverkaufte Wertpapiere		\$ (432.300)	(46,72)
Summe Anlagen		\$ 1.541.964	166,65
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (616.708)	(66,65)
Nettovermögen		\$ 925.256	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
- Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
 - Reines Kapitalwertpapier.
 - Wertpapier per Emissionstermin.

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Mortgage Opportunities Fund (Forts.)

(d) Nullkuponwertpapier.

(e) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(f) Mit dem Teilfonds verbunden.

(g) Ein zum 31. Dezember 2023 leerverkauftes Wertpapier ist durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.

(h) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 59.020 (31. Dezember 2022: USD 324.164) waren zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte verpfändet.

(i) Ein Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von USD 821 (31. Dezember 2022: USD null) war zum 31. Dezember 2023 als Sicherheit für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte verpfändet oder geliefert.

Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 1.837 (31. Dezember 2022: USD null) und Barmittel in Höhe von USD null (31. Dezember 2022: USD 4.656) waren zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte erhalten worden.

Barmittel in Höhe von USD 6.307 (31. Dezember 2022: USD 4.327) waren zum 31. Dezember 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 460 (31. Dezember 2022: USD 4.020) waren zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten für Finanzderivate gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 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)	Markt- wert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.894.376	\$ 7.833	\$ 1.902.209
Investmentfonds	4	0	0	4
Pensionsgeschäfte	0	68.968	0	68.968
Finanzderivate ⁽³⁾	0	3.083	0	3.083
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(432.300)	0	(432.300)
Summen	\$ 4	\$ 1.534.127	\$ 7.833	\$ 1.541.964

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)	Markt- wert
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⁾ Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus Pensions- geschäften	% des Netto- vermögens
BOS	5,560 %	13.12.2023	16.01.2024	\$ (55.692)	\$ (55.855)	(6,04)
Summe umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (55.855)	(6,04)

Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kreditbetrag	Zahlbar für Rückkauf- Finanzierungs- geschäfte	% des Netto- vermögens
BPG	5,710 %	28.12.2023	04.01.2024	\$ (822)	\$ (823)	(0,09)
Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte					\$ (823)	(0,09)

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement ⁽¹⁾
BOA	\$ (36)	\$ 0	\$ (36)	\$ (3.187)	\$ 2.810	\$ (377)
BPS	775	(600)	175	3.438	(3.310)	128
BRC	273	(370)	(97)	500	(480)	20
CBK	1.187	(1.300)	(113)	11.235	(10.950)	285
CLY	k. A.	k. A.	k. A.	11	0	11
DUB	2.679	(2.490)	189	6.229	(5.990)	239
FAR	5	0	5	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	1.202	(1.050)	152	1.201	(1.080)	121
JPM	438	(340)	98	(743)	730	(13)
MBC	14	0	14	2.699	(2.490)	209
MSC	(70)	0	(70)	(94)	0	(94)
MYC	1.305	(1.250)	55	2.285	(2.410)	(125)
MYI	539	(1.070)	(531)	(6)	0	(6)
SAL	(490)	460	(30)	(418)	480	62
SCX	50	0	50	1.971	(1.850)	121
SSB	49	0	49	4	0	4
UAG	798	(1.320)	(522)	k. A.	k. A.	k. A.

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

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	12,84	25,41
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	192,75	174,84
Sonstige übertragbare Wertpapiere	k. A.	2,90
Investmentfonds	0,00	0,00
Pensionsgeschäfte	7,45	2,04
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,35)	0,54
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,26)	(0,35)
Freiverkehrsfinaanzderivate	0,94	2,96
Leerverkaufte Wertpapiere	(46,72)	(61,03)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(6,04)	(37,27)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(0,09)	k. A.

* Gemäß der Liste der Märkte, die die Kriterien für einen geregelten OGAW-Markt erfüllen, in Anlage 1 zum Verkaufsprospekt.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	0,07	0,10
US-Regierungsbehörden	161,34	121,51
US-Schatzobligationen	0,80	0,51
Non-Agency-MBS	21,71	37,20
Forderungsbesicherte Wertpapiere	21,67	35,71
Kurzfristige Instrumente	k. A.	8,12
Investmentfonds	0,00	0,00
Pensionsgeschäfte	7,45	2,04
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,35)	0,54
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Zinsswaps	(0,26)	(0,35)
Freiverkehrsfinaanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswaptionen	0,88	3,42
Optionen auf Wertpapiere	0,00	0,00
Verkaufsoptionen		
Zinsswaptionen	(0,05)	(1,08)
Optionen auf Wertpapiere	(0,07)	(0,20)
Devisenterminkontrakte	(0,10)	0,14
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,28	0,68
Leerverkaufte Wertpapiere	(46,72)	(61,03)
Sonstige Aktiva und Passiva	(66,65)	(47,31)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS		
Bear Stearns ALT-A Trust				JPMorgan Mortgage Trust				6,630 % fällig am 25.11.2045	\$	892	\$	815	0,04
4,170 % fällig am 25.08.2036	\$	563	\$	4,319 % fällig am 25.04.2036	\$	606	\$	536				0,03	
4,228 % fällig am 25.11.2036		3.186		Jupiter Mortgage PLC				Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust					
4,730 % fällig am 25.09.2035		6		6,021 % fällig am 20.07.2060	£	10.339	13.180	4,792 % fällig am 25.04.2036		1.430	1.354	0,07	
4,964 % fällig am 25.01.2036		28		Lehman XS Trust									
5,215 % fällig am 25.07.2035		780		5,830 % fällig am 25.11.2035	\$	2.980	2.868						
7,045 % fällig am 25.01.2035		1.481		5,830 % fällig am 25.07.2037		8.948	8.199						
Bear Stearns Mortgage Funding Trust				6,010 % fällig am 25.12.2035		4.310	3.997						
5,810 % fällig am 25.06.2047		323		London Wall Mortgage Capital PLC									
5,830 % fällig am 25.10.2036		1.309		5,970 % fällig am 15.05.2051	£	6.380	8.084						
Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust				6,020 % fällig am 15.05.2052		4.740	6.015						
3,993 % fällig am 26.12.2046		443		Luminent Mortgage Trust									
4,805 % fällig am 26.01.2036		1.536		5,870 % fällig am 25.10.2046	\$	143	125						
Braemar Hotels & Resorts Trust				MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust									
6,354 % fällig am 15.06.2035		116		5,812 % fällig am 25.12.2046		9.191	6.783						
Brants Bridge PLC				Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust									
6,120 % fällig am 14.06.2066	£	931	1.184	5,956 % fällig am 15.06.2030		4	4						
BX Trust				Merrill Lynch Mortgage Investors Trust									
6,679 % fällig am 15.05.2035	\$	7.010	6.901	4,757 % fällig am 25.12.2034		4	4						
Canada Square Funding PLC				5,890 % fällig am 25.02.2036		6	5						
6,000 % fällig am 17.06.2058	£	2.157	2.738	5,930 % fällig am 25.04.2029		100	93						
Canterbury Finance PLC				5,970 % fällig am 25.11.2035		3	2						
6,046 % fällig am 16.05.2058		1.852	2.356	6,465 % fällig am 25.12.2029		79	72						
Citigroup Commercial Mortgage Trust				Mortimer BTL PLC									
6,556 % fällig am 15.12.2036	\$	1.000	991	0,000 % fällig am 22.12.2056	£	1.000	1.278						
Citigroup Mortgage Loan Trust				5,920 % fällig am 23.06.2053		416	528						
5,322 % fällig am 25.08.2035		52	44	Pierpont BTL PLC									
6,980 % fällig am 25.05.2035		1	1	6,020 % fällig am 22.12.2053		9.840	12.473						
7,110 % fällig am 25.10.2035		29	27	Polaris PLC									
Countrywide Alternative Loan Trust				5,985 % fällig am 23.12.2058		981	1.248						
5,667 % fällig am 20.12.2046		52	45	Prime Mortgage Trust									
5,670 % fällig am 25.04.2047		1.438	1.349	5,870 % fällig am 25.02.2034	\$	17	16						
5,680 % fällig am 25.04.2047		1.266	1.028	Primrose Residential DAC									
5,750 % fällig am 25.04.2037		572	475	4,626 % fällig am 24.03.2061	€	17.243	18.989						
5,770 % fällig am 25.06.2035		873	588	Residential Accredit Loans, Inc. Trust									
5,790 % fällig am 25.02.2047		65	60	6,500 % fällig am 25.08.2036		898	702						
5,830 % fällig am 25.05.2047		239	204	Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust									
5,890 % fällig am 25.07.2046		3.512	3.067	5,091 % fällig am 25.09.2035		434	290						
6,012 % fällig am 25.12.2035		613	508	RMAC PLC									
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				0,000 % fällig am 15.02.2047	£	2.000	2.558						
5,930 % fällig am 25.05.2035		2.971	2.379	Sequoia Mortgage Trust									
6,250 % fällig am 25.02.2035		3.146	2.677	6,072 % fällig am 20.12.2034	\$	211	189						
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.				Shamrock Residential DAC									
0,098 % fällig am 25.06.2032		0	0	4,726 % fällig am 24.01.2061	€	17.963	19.775						
6,050 % fällig am 25.03.2032		1	1	Stratton Mortgage Funding PLC									
Credit Suisse Mortgage Capital Certificates				5,920 % fällig am 12.12.2043	£	4.594	5.816						
3,950 % fällig am 27.12.2037		4.357	3.697	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust									
Credit Suisse Mortgage Capital Trust				5,790 % fällig am 25.10.2035	\$	1.903	1.737						
3,850 % fällig am 25.09.2057		8.038	7.807	6,412 % fällig am 25.01.2035		19	16						
6,194 % fällig am 15.07.2032		385	368	6,478 % fällig am 25.02.2034		9	8						
CSAIL Commercial Mortgage Trust				Structured Asset Mortgage Investments Trust									
3,504 % fällig am 15.06.2057		4.030	3.900	5,830 % fällig am 25.09.2047		587	526						
Dilosk RMBS DAC				5,970 % fällig am 19.07.2035		13	12						
4,956 % fällig am 20.10.2062	€	1.223	1.357	6,030 % fällig am 25.02.2036		8	6						
Dutch Property Finance BV				6,412 % fällig am 25.12.2035		50	40						
4,602 % fällig am 28.07.2058		2.760	3.042	Thornburg Mortgage Securities Trust									
4,652 % fällig am 28.04.2059		10.155	11.182	6,110 % fällig am 25.09.2043		304	286						
5,702 % fällig am 28.04.2050		9.579	10.384	Towd Point Mortgage Trust									
GSR Mortgage Loan Trust				3,750 % fällig am 25.10.2056		8.100	7.793						
5,820 % fällig am 25.01.2034	\$	0	0	Tower Bridge Funding PLC									
HarborView Mortgage Loan Trust				0,000 % fällig am 20.01.2066									
4,725 % fällig am 19.08.2036		9	8	(b)	£	1.000	1.277						
5,910 % fällig am 19.05.2035		20	18	6,120 % fällig am 21.07.2064		6.393	8.158						
Hilton Orlando Trust				Twin Bridges PLC									
6,709 % fällig am 15.12.2034		9.170	9.093	5,990 % fällig am 01.12.2055		7.149	9.046						
Hops Hill PLC				6,170 % fällig am 14.06.2055		846	1.077						
6,197 % fällig am 21.12.2055	£	3.353	4.261	6,432 % fällig am 15.05.2056		1.000	1.278						
Impac CMB Trust				Verus Securitization Trust									
6,010 % fällig am 25.05.2035	\$	3.149	2.885	1,829 % fällig am 25.10.2066	\$	5.833	5.090						
6,230 % fällig am 25.10.2033		0	0	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust									
Independence Plaza Trust				4,407 % fällig am 25.08.2046		25	22						
3,911 % fällig am 10.07.2035		4.300	4.059	4,615 % fällig am 25.10.2035		219	196						
JPMorgan Alternative Loan Trust				5,712 % fällig am 25.03.2047		1.945	1.611						
6,500 % fällig am 25.03.2036		1.410	817	6,010 % fällig am 25.12.2045		5	5						
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust				6,050 % fällig am 25.10.2045		3	2						
6,826 % fällig am 15.02.2035		6.201	6.127	6,390 % fällig am 25.10.2044		408	386						
				6,450 % fällig am 25.10.2045		1.689	1.574						

FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE

Aames Mortgage Investment Trust				AREIT LLC								
6,385 % fällig am 25.10.2035		2.900	2.733	7,470 % fällig am 17.08.2041		500	501					
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust				Ares European CLO DAC								
5,790 % fällig am 25.10.2036		3.924	1.452	4,625 % fällig am 15.10.2030	€	1.139	1.249					0,06
Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				4,745 % fällig am 15.10.2031		987	1.080					0,06
6,050 % fällig am 25.11.2035		3.026	2.756	Asset-Backed European Securitisation Transaction Twenty-One BV								
6,385 % fällig am 25.09.2035		6.000	5.565	4,553 % fällig am 21.09.2031		784	869					0,04
6,430 % fällig am 25.10.2035		1.700	1.557	Asset-Backed Funding Certificates Trust								
				5,790 % fällig am 25.11.2036	\$	6.039	2.394					0,12
AREIT LLC				Auto ABS French Leases FCT								
7,470 % fällig am 17.08.2041		500	501	4,615 % fällig am 28.10.2035	€	5.000	5.543					0,28
Ares European CLO DAC				AutoFlorence SRL								
4,625 % fällig am 15.10.2030	€	1.139	1.249	4,826 % fällig am 25.12.2046		1.500	1.666					0,09
4,745 % fällig am 15.10.2031		987	1.080	Autonoría Spain								
Asset-Backed European Securitisation Transaction Twenty-One BV				4,576 % fällig am 30.09.2041		2.100	2.327					0,12
4,553 % fällig am 21.09.2031		784	869	Avoca CLO DAC								
Asset-Backed Funding Certificates Trust				4,785 % fällig am 15.10.2032		4.200	4.582					0,23
5,790 % fällig am 25.11.2036	\$	6.039	2.394	Avoca Static CLO DAC								
Auto ABS French Leases FCT				5,690 % fällig am 15.10.2030		600	662					0,03
4,615 % fällig am 28.10.2035	€	5.000	5.543	Bain Capital Euro CLO DAC								
AutoFlorence SRL				4,733 % fällig am 20.01.2032		689	751					0,04
4,826 % fällig am 25.12.2046		1.500	1.666	Bavarian Sky S.A.								
Autonoría Spain				4,269 % fällig am 20.03.2030		662	731					0,04
4,576 % fällig am 30.09.2041		2.100	2.327	4,309 % fällig am 20.11.2031		1.100	1.216					0,06

Aufstellung der Wertpapieranlagend des StocksPLUS™ Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.	€ 799	\$ 870	0,04	5,770 % fällig am 25.09.2036	\$ 2.744	\$ 978	0,05	5,938 % fällig am 12.04.2032	€ 12.639	\$ 14.006	0,71
Carlyle U.S. CLO Ltd.				5,950 % fällig am 25.03.2046	503	487	0,02	Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates			
6,697 % fällig am 20.04.2031	\$ 3.757	3.756	0,19	6,370 % fällig am 25.11.2035	1.550	1.465	0,07	6,790 % fällig am 25.01.2036	\$ 1.000	930	0,05
Carrington Mortgage Loan Trust				Harvest CLO DAC				Pony S.A. Compartment German Auto Loans			
6,460 % fällig am 25.06.2035	385	377	0,02	4,566 % fällig am 26.06.2030	€ 265	289	0,01	4,502 % fällig am 14.11.2032	€ 8.600	9.528	0,49
Cars Alliance Auto Leases France				4,695 % fällig am 15.10.2030	2.999	3.281	0,17	Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust			
4,503 % fällig am 21.10.2038	€ 7.200	7.978	0,41	4,725 % fällig am 15.07.2031	900	980	0,05	6,340 % fällig am 25.02.2036	\$ 1.700	1.556	0,08
Cedar Funding CLO Ltd.				Hayfin Emerald CLO DAC				RAAC Trust			
6,677 % fällig am 20.01.2031	\$ 943	942	0,05	0,000 % fällig am 25.01.2037 (b)	1.000	1.105	0,06	6,970 % fällig am 25.09.2047	3.105	2.976	0,15
Chase Funding Trust				Hill FL BV				Red & Black Auto Germany			
6,210 % fällig am 25.10.2032	2	2	0,00	4,544 % fällig am 18.05.2030	6.192	6.861	0,35	4,283 % fällig am 15.09.2032	€ 8.749	9.683	0,49
CIFC Funding Ltd.				4,604 % fällig am 18.05.2031	12.500	13.854	0,71	Red & Black Auto Italy SRL			
6,640 % fällig am 24.04.2031	988	988	0,05	Home Equity Asset Trust				4,865 % fällig am 28.07.2034	1.694	1.879	0,10
6,710 % fällig am 24.04.2030	957	955	0,05	4,787 % fällig am 25.10.2035	\$ 2.900	2.793	0,14	Red & Black Auto Lease France			
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				6,175 % fällig am 25.01.2036	956	895	0,05	4,556 % fällig am 27.06.2035	2.600	2.877	0,15
7,120 % fällig am 25.07.2037	198	193	0,01	HSI Asset Securitization Corp. Trust				Residential Asset Mortgage Products Trust			
Citizen Irish Auto Receivables Trust DAC				6,250 % fällig am 25.01.2036	1.200	991	0,05	6,010 % fällig am 25.02.2036	\$ 1.177	1.123	0,06
4,623 % fällig am 15.12.2032	€ 1.884	2.090	0,11	JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.				6,535 % fällig am 25.05.2035	2.000	1.889	0,10
4,653 % fällig am 15.12.2029	718	794	0,04	6,400 % fällig am 25.12.2035	1.339	1.293	0,07	Residential Asset Securities Corp. Trust			
Compartment VCL				JPMorgan Mortgage Acquisition Trust				5,750 % fällig am 25.07.2036	1.200	1.148	0,06
4,273 % fällig am 21.04.2029	718	793	0,04	5,730 % fällig am 25.06.2037	77	77	0,00	Retail Automotive CP Germany UG			
4,273 % fällig am 21.08.2029	2.422	2.678	0,14	5,750 % fällig am 25.03.2047	610	564	0,03	4,553 % fällig am 21.07.2034	€ 5.298	5.863	0,30
4,283 % fällig am 21.01.2029	2.072	2.291	0,12	5,905 % fällig am 25.05.2036	493	463	0,02	Revocar UG			
Countrywide Asset-Backed Certificates				Jubilee CLO DAC				4,473 % fällig am 21.09.2036	5.799	6.423	0,33
5,870 % fällig am 25.08.2034	\$ 112	107	0,01	4,565 % fällig am 15.04.2030	€ 367	402	0,02	4,513 % fällig am 21.04.2036	932	1.033	0,05
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				4,575 % fällig am 15.04.2030	945	1.037	0,05	Saxon Asset Securities Trust			
4,626 % fällig am 25.01.2037	89	88	0,00	4,615 % fällig am 15.04.2031	1.200	1.304	0,07	6,370 % fällig am 26.12.2034	\$ 210	200	0,01
5,610 % fällig am 25.08.2037	86	86	0,00	KKR CLO Ltd.				SC Germany S.A. Compartment Consumer			
5,750 % fällig am 25.02.2037	889	834	0,04	6,655 % fällig am 15.04.2031	\$ 951	950	0,05	4,578 % fällig am 15.09.2037	€ 8.100	8.985	0,46
5,750 % fällig am 25.03.2037	953	912	0,05	Koromo Italy SRL				SCF Rahoituspalvelut DAC			
6,010 % fällig am 25.03.2036	543	474	0,02	4,676 % fällig am 26.02.2035	€ 840	930	0,05	4,435 % fällig am 25.06.2032	1.135	1.255	0,06
6,475 % fällig am 25.10.2035	108	106	0,01	Laurelin DAC				4,535 % fällig am 25.06.2033	6.000	6.650	0,34
6,565 % fällig am 25.07.2035	51	51	0,00	4,713 % fällig am 20.10.2031	1.045	1.143	0,06	Silver Arrow Athlon NL BV			
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.				LCM LP				4,576 % fällig am 26.04.2031	8.753	9.683	0,49
5,077 % fällig am 25.01.2032	2	2	0,00	6,785 % fällig am 15.10.2031	\$ 7.015	7.008	0,36	Silver Arrow S.A.			
Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC				Long Beach Mortgage Loan Trust				4,273 % fällig am 15.02.2030	5.647	6.243	0,32
7,045 % fällig am 25.03.2046	1.500	1.429	0,07	5,910 % fällig am 25.02.2036	918	891	0,05	Specialty Underwriting & Residential Finance Trust			
Cumulus Static CLO DAC				6,030 % fällig am 25.10.2034	5	4	0,00	5,590 % fällig am 25.03.2037	\$ 4.626	2.514	0,13
5,499 % fällig am 25.04.2033	€ 1.000	1.104	0,06	6,070 % fällig am 25.01.2036	336	314	0,02	5,970 % fällig am 25.06.2037	5.803	3.362	0,17
CVC Cordatus Loan Fund DAC				LT Autorahoitus DAC				6,445 % fällig am 25.12.2035	95	93	0,00
4,555 % fällig am 15.09.2031	896	975	0,05	4,534 % fällig am 18.07.2033	€ 11.810	13.087	0,67	Steele Creek CLO Ltd.			
Driver UK Multi-Compartment S.A.				4,744 % fällig am 18.12.2032	9.040	10.036	0,51	6,744 % fällig am 21.04.2031	971	972	0,05
5,847 % fällig am 25.04.2031	£ 9.400	12.004	0,61	Madison Park Funding Ltd.				Structured Asset Investment Loan Trust			
Dryden Euro CLO DAC				6,405 % fällig am 15.04.2029	\$ 2.047	2.039	0,10	5,650 % fällig am 25.09.2036	6.581	4.070	0,21
4,862 % fällig am 15.05.2034	€ 998	1.086	0,06	Man GLG Euro CLO DAC				6,090 % fällig am 25.01.2036	1.180	1.086	0,06
E-Carat PLC				4,615 % fällig am 15.12.2031	€ 923	1.008	0,05	6,235 % fällig am 25.08.2035	1.433	1.375	0,07
5,567 % fällig am 18.08.2029	£ 514	656	0,03	4,645 % fällig am 15.10.2030	357	392	0,02	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust			
Ellington Loan Acquisition Trust				4,835 % fällig am 15.01.2030	262	290	0,01	5,740 % fällig am 25.03.2036	1.405	1.300	0,07
6,520 % fällig am 25.05.2037	\$ 1.714	1.666	0,08	5,779 % fällig am 15.10.2036	600	664	0,03	5,780 % fällig am 25.08.2046	3.164	2.758	0,14
EquiFirst Mortgage Loan Trust				MidOcean Credit CLO				5,790 % fällig am 25.10.2036	1.560	1.085	0,06
7,195 % fällig am 25.12.2034	449	426	0,02	6,794 % fällig am 21.04.2031	\$ 12.444	12.444	0,63	5,890 % fällig am 25.02.2037	1.145	1.104	0,06
FACT Master S.A.				Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				Toro European CLO DAC			
4,539 % fällig am 20.07.2028	€ 1.286	1.425	0,07	5,600 % fällig am 25.10.2036	702	611	0,03	4,812 % fällig am 15.02.2034	€ 5.100	5.557	0,28
FCT CA Leasing				5,970 % fällig am 25.04.2036	1.658	1.555	0,08	Trinitas CLO Ltd.			
4,736 % fällig am 26.02.2042	1.151	1.276	0,07	6,325 % fällig am 25.03.2034	908	906	0,05	6,777 % fällig am 20.07.2031	\$ 1.535	1.536	0,08
First Franklin Mortgage Loan Trust				6,385 % fällig am 25.07.2034	901	907	0,05	Venture CLO Ltd.			
5,950 % fällig am 25.05.2036	\$ 6.681	5.609	0,29	6,385 % fällig am 25.09.2034	1.460	1.436	0,07	6,535 % fällig am 15.04.2027	2.628	2.628	0,13
Fremont Home Loan Trust				Morgan Stanley Home Equity Loan Trust				6,915 % fällig am 15.01.2032	1.000	998	0,05
5,810 % fällig am 25.02.2037	3.862	1.297	0,07	5,790 % fällig am 25.04.2036	194	139	0,01	Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust			
FTA Santander Consumo				Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				5,780 % fällig am 25.08.2036	819	776	0,04
4,773 % fällig am 21.03.2036	€ 864	956	0,05	5,650 % fällig am 25.12.2036	1.834	650	0,03	Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust			
GE-WMC Asset-Backed Pass-Through Certificates				Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust				5,965 % fällig am 25.05.2036	258	257	0,01
6,110 % fällig am 25.12.2035	\$ 3.139	2.989	0,15	6,100 % fällig am 25.02.2036	1.417	1.272	0,06				
Ginkgo Personal Loans				Northwoods Capital Ltd.							
4,666 % fällig am 23.09.2044	€ 1.500	1.662	0,08	7,246 % fällig am 15.06.2031	976	978	0,05				
Ginkgo Sales Finance				Octagon Investment Partners Ltd.							
4,576 % fällig am 25.11.2049	2.872	3.183	0,16	6,867 % fällig am 20.01.2031	2.246	2.249	0,11				
Greystone Commercial Real Estate Notes Ltd.				Option One Mortgage Loan Trust							
6,656 % fällig am 15.09.2037	\$ 356	356	0,02	5,690 % fällig am 25.04.2037	1.963	1.372	0,07				
Griffith Park CLO DAC				Option One Mortgage Loan Trust Asset-Backed Certificates							
4,704 % fällig am 21.11.2031	€ 5.975	6.496	0,33	6,205 % fällig am 25.11.2035	274	223	0,01				
GSAA Home Equity Trust				OZLME DAC							
5,970 % fällig am 25.01.2036	\$ 969	331	0,02	5,288 % fällig am 27.07.2032	€ 1.440	1.553	0,08				
GSAMP Trust				Palmer Square European Loan Funding DAC							
5,610 % fällig am 25.12.2036	994	523	0,03	0,000 % fällig am 15.05.2033	1.000	1.102	0,06				
				5,602 % fällig am 15.11.2032	579	640	0,03				

STAATSEMISSIONEN

Korea Housing Finance Corp.			
0,010 % fällig am 05.02.2025	€ 5.000	5.308	0,27
0,010 % fällig am 07.07.2025	5.000	5.249	0,27
0,723 % fällig am 22.03.2025	1.260	1.344	0,07
		11.901	0,61

KURZFRISTIGE INSTRUMENTE COMMERCIAL PAPER

Bank of Nova Scotia			
5,272 % fällig am 01.02.2024 CAD	7.400	5.584	0,28
5,298 % fällig am 16.01.2024	3.400	2.572	0,13

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Canadian Imperial Bank of Commerce 5,229 % fällig am 02.01.2024	CAD	2.000 \$	1,516	0,08	(0,252) % fällig am 26.02.2024 (c)(d)	¥ 3.113.000	\$ 22.086	1,13	INVESTMENTFONDS		
5,271 % fällig am 07.02.2024		2.700	2,036	0,10	(0,231) % fällig am 26.02.2024 (c)(d)	837.000	5.938	0,30	ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN		
Royal Bank of Canada 5,342 % fällig am 01.02.2024		3.043	2,296	0,12	(0,206) % fällig am 13.02.2024 (c)(d)	1.666.000	11.820	0,60	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short- Term Floating NAV Fund (f)	17.975.383 \$	179.118 9,12
			14.004	0,71	(0,202) % fällig am 13.02.2024 (c)(d)	3.654.000	25.923	1,32			
							86.905	4,43	Summe Investmentfonds	\$ 179.118	9,12
					Summe kurzfristige Instrumente		100.909	5,14			
					Summe übertragbare Wertpapiere	\$ 1.318.561	67,18				

JAPANISCHE SCHWATZWECHSEL

(0,280) % fällig am 09.01.2024 (c)(d)	¥ 2.913.000	20.663	1,06
(0,269) % fällig am 09.01.2024 (c)(d)	33.000	234	0,01
(0,260) % fällig am 09.01.2024 (c)(d)	34.000	241	0,01

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft ⁽¹⁾	% des Netto- vermögens
BOS	5,420 %	29.12.2023	02.01.2024	\$ 130.000	U.S. Treasury Notes 3,625 % fällig am 31.03.2030	\$ (132.961)	\$ 130.000	\$ 130.078	6,62
BPS	5,460	29.12.2023	02.01.2024	80.000	Ginnie Mae 5,500 % fällig am 20.10.2052	(82.373)	80.000	80.049	4,08
	5,600	29.12.2023	02.01.2024	19.700	U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 15.02.2032	(20.093)	19.700	19.712	1,00
BRC	5,420	02.01.2024	03.01.2024	38.800	Freddie Mac 7,000 % fällig am 01.01.2054	(40.217)	38.800	38.806	1,98
DEU	5,480	02.01.2024	03.01.2024	11.000	U.S. Treasury Bonds 2,750 % fällig am 15.08.2042	(11.260)	11.000	11.002	0,56
FICC	2,600	29.12.2023	02.01.2024	1.388	U.S. Treasury Notes 4,875 % fällig am 30.11.2025	(1.416)	1.388	1.388	0,07
GSC	5,450	29.12.2023	02.01.2024	50.000	Ginnie Mae 4,500 % fällig am 20.07.2052	(52.981)	50.000	50.030	2,55
SAL	5,390	29.12.2023	02.01.2024	25.000	U.S. Treasury Notes 0,750 % fällig am 31.03.2026	(25.551)	25.000	25.015	1,27
	5,450	29.12.2023	02.01.2024	130.000	U.S. Treasury Notes 0,875 % fällig am 30.09.2026	(132.893)	130.000	130.079	6,62
TDM	5,450	29.12.2023	02.01.2024	58.700	U.S. Treasury Bonds 2,375 % fällig am 15.02.2042	(60.377)	58.700	58.736	2,99
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (560.122)	\$ 544.588	\$ 544.895	27,74

(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	Ablaufmonat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
E-mini S&P 500 Index March Futures	Long	03.2024	2.287	\$ 19.145	0,97
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2024	73	(334)	(0,02)
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Short	03.2024	505	(80)	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2024	131	307	0,02
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Short	03.2024	238	(845)	(0,04)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2024	11	(128)	(0,01)
United Kingdom Long Gilt March Futures	Short	03.2024	6	(53)	0,00
				\$ 18.012	0,92
Summe der an einem regelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 18.012	0,92

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

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

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2026	\$ 2.500	\$ (19)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2026	1.100	(6)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2028	700	11	0,00
Exelon Generation Co. LLC	1,000	20.12.2024	800	(2)	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	1.700	15	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2026	3.700	31	0,00
				\$ 30	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagend des StocksPLUS™ Fund (Forts.)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
CDX.IG-41 5-Year Index	1,000 %	20.12.2028	\$ 198.700	\$ 1.575	0,08

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750 %	15.06.2024	\$ 237.900	\$ 893	0,04
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.06.2027	22.900	(128)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.06.2032	28.900	374	0,02
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,875	07.02.2050	300	140	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	15.01.2050	900	433	0,02
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	20.03.2050	1.900	904	0,05
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,750	21.06.2053	3.200	209	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,000	21.06.2030	7.100	183	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,000	21.06.2033	7.200	37	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,250	21.06.2028	12.300	176	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2030	37.700	(270)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	21.06.2025	70.400	(788)	(0,04)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.12.2028	50.900	(401)	(0,02)
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,500	20.03.2026	€ 23.800	(420)	(0,02)
Erhalt	CPURNSA	2,418	11.07.2052	\$ 5.700	81	0,00
					\$ 1.423	0,07
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ 3.028	0,15

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

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

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

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

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

TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variable Zinssatz	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Netto- vermögens
CBK	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	677	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 6.992	10.01.2024	\$ 0	\$ (29)	\$ (29)	0,00
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	4.143	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	42.788	17.01.2024	0	(185)	(185)	(0,01)
FAR	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	3.736	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	38.585	05.06.2024	0	(164)	(164)	(0,01)
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	21.307	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	220.055	26.06.2024	0	(940)	(940)	(0,05)
JPM	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	9.621	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	99.364	06.03.2024	0	(416)	(416)	(0,02)
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	5.404	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	55.812	20.03.2024	0	(233)	(233)	(0,01)
RBC	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	14.061	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	145.220	10.04.2024	0	(623)	(623)	(0,03)
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	340	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	3.511	17.01.2024	0	(15)	(15)	0,00
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	5.593	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	57.764	24.01.2024	0	(243)	(243)	(0,01)
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	13.035	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	134.623	21.02.2024	0	(561)	(561)	(0,03)
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	24.072	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	248.612	15.05.2024	0	(1.041)	(1.041)	(0,05)
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	12.647	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	130.616	17.07.2024	0	(563)	(563)	(0,03)
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	1.157	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	11.949	24.07.2024	0	(52)	(52)	0,00
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	1.365	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	14.097	07.08.2024	0	(62)	(62)	(0,01)
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	5.226	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	53.973	16.10.2024	0	(231)	(231)	(0,01)
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	1.366	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	14.108	06.11.2024	0	(60)	(60)	0,00
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	10.727	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	110.787	13.11.2024	0	(474)	(474)	(0,02)

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Netto- vermögens
TOR	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	167	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 1.725	21.02.2024	\$ 0	\$ (8)	\$ (8)	0,00
UAG	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	1.532	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	15.822	21.08.2024	0	(69)	(69)	(0,01)
							\$ 0	\$ (5.969)	\$ (5.969)	(0,30)

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens	
BOA	01.2024	£	3.763	\$ 4.780	\$ 0	\$ (18)	0,00	
	02.2024	CAD	2.700	1.964	0	(84)	0,00	
BPS	01.2024	DKK	18.025	2.659	0	(13)	0,00	
	01.2024	€	684	744	0	(12)	0,00	
	01.2024	£	14.347	18.198	0	(92)	(0,01)	
	01.2024	\$	4.591	€ 4.156	16	(15)	0,00	
BRC	01.2024	€	355.202	\$ 390.644	0	(1.820)	(0,10)	
	01.2024	¥	2.980.000	20.284	0	(867)	(0,04)	
	02.2024		3.950.000	26.640	0	(1.607)	(0,08)	
CBK	01.2024	CAD	3.400	2.462	0	(118)	(0,01)	
	01.2024	NZD	190	117	0	(3)	0,00	
DUB	01.2024	\$	1.123	€ 1.018	2	0	0,00	
GLM	01.2024	DKK	23.880	\$ 3.523	0	(17)	0,00	
	01.2024	\$	13	MXN 225	0	0	0,00	
JPM	01.2024	CAD	2.000	\$ 1.464	0	(53)	0,00	
	02.2024		7.400	5.419	0	(196)	(0,01)	
MBC	01.2024	€	3.041	\$ 3.309	0	(51)	0,00	
	01.2024	£	640	812	0	(4)	0,00	
	01.2024	\$	1.048	£ 823	2	0	0,00	
	02.2024	¥	5.320.000	\$ 35.963	0	(2.004)	(0,10)	
MYI	01.2024	€	37	41	0	0	0,00	
	01.2024	\$	1.381	€ 1.261	12	0	0,00	
	01.2024		1.154	£ 922	22	0	0,00	
SCX	01.2024		121	ZAR 2.302	4	0	0,00	
SSB	01.2024		11	£ 9	0	0	0,00	
	02.2024	CAD	3.043	\$ 2.216	0	(92)	(0,01)	
UAG	01.2024	£	77.864	98.539	0	(725)	(0,04)	
					\$ 58	\$ (7.791)	\$ (7.733)	(0,40)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 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 Netto- vermögens	
BPS	01.2024	€	229	\$ 250	\$ 1	\$ (4)	0,00	
	01.2024	\$	9.042	€ 8.286	114	0	0,01	
BRC	01.2024		68.696	62.463	320	0	0,01	
CBK	01.2024	€	916	\$ 1.008	1	(4)	0,00	
	01.2024	\$	306	€ 282	5	0	0,00	
MBC	01.2024	€	1.930	\$ 2.117	0	(15)	0,00	
	01.2024	\$	75	€ 69	1	0	0,00	
MYI	01.2024		77.487	70.499	407	0	0,02	
RYL	01.2024		19.345	17.677	187	0	0,01	
UAG	01.2024		77.547	70.499	347	0	0,02	
					\$ 1.383	\$ (23)	\$ 1.360	0,07

Zum 31. Dezember 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 Netto- vermögens	
BOA	01.2024	\$	0	£ 0	\$ 0	\$ 0	0,00	
BRC	01.2024		1	£ 1	0	0	0,00	
MBC	01.2024		0	0	0	0	0,00	
SCX	01.2024	£	21	\$ 26	0	0	0,00	
	01.2024	\$	9	£ 7	0	0	0,00	
SSB	01.2024		7	£ 5	0	0	0,00	
UAG	01.2024		9	£ 7	0	0	0,00	
					\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagend des StocksPLUS™ Fund (Forts.)

Zum 31. Dezember 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 Netto- vermögens
BOA	01.2024	\$ 119	SGD 159	\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,00
BRC	01.2024	SGD 8	\$ 6	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 79	SGD 105	1	0	1	0,00
CBK	01.2024	118	158	1	0	1	0,00
IND	02.2024	SGD 118	\$ 89	0	(1)	(1)	0,00
MBC	01.2024	81	61	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	\$ 75	SGD 101	1	0	1	0,00
	02.2024	SGD 118	\$ 89	0	(1)	(1)	0,00
SCX	02.2024	118	89	0	(1)	(1)	0,00
	02.2024	\$ 269	SGD 355	1	0	1	0,00
SSB	01.2024	SGD 434	\$ 328	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 6	\$ (5)	\$ 1	0,00
Summe Freiverkehrsinanzderivate						\$ (12.341)	(0,63)
Summe Anlagen						\$ 2.050.966	104,48
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ (87.978)	(4,48)
Nettovermögen						\$ 1.962.988	100,00

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

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

- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
- (b) Wertpapier per Emissionstermin.
- (c) Nullkuponwertpapier.
- (d) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (e) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (f) Mit dem Teilfonds verbunden.

Barmittel in Höhe von USD 49.516 (31. Dezember 2022: USD 45.395) waren zum 31. Dezember 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 7.390 (31. Dezember 2022: USD 40.550) waren zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten für Finanzderivate gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 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	\$ 1.317.011	\$ 1.550	\$ 1.318.561
Investmentfonds	179.118	0	0	179.118
Pensionsgeschäfte	0	544.588	0	544.588
Finanzderivate ⁽³⁾	18.758	(10.059)	0	8.699
Summen	\$ 197.876	\$ 1.851.540	\$ 1.550	\$ 2.050.966

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 711.694	\$ 0	\$ 711.694
Investmentfonds	92.742	0	0	92.742
Pensionsgeschäfte	0	156.445	0	156.445
Finanzderivate ⁽³⁾	(14.139)	(3.519)	0	(17.658)
Summen	\$ 78.603	\$ 864.620	\$ 0	\$ 943.223

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

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

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

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	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.	\$ (653)	\$ 580	\$ (73)
BOA	(100)	0	(100)	(428)	290	(138)
BPS	(5)	0	(5)	4	0	4
BRC	(3.973)	5.190	1.217	9	0	9
CBK	(332)	(1.910)	(2.242)	2.647	(2.506)	141
CLY	k. A.	k. A.	k. A.	(53)	0	(53)
DUB	2	0	2	k. A.	k. A.	k. A.
FAR	(1.104)	(10.880)	(11.984)	(1.148)	18.390	17.242
GLM	(17)	0	(17)	(184)	0	(184)
IND	(1)	0	(1)	k. A.	k. A.	k. A.
JPM	(1.521)	(12.380)	(13.901)	753	(700)	53
MBC	(2.072)	2.200	128	(1.953)	3.760	1.807
MYI	441	(890)	(449)	(224)	0	(224)
RBC	(3.302)	(33.130)	(36.432)	(1.063)	16.910	15.847
RYL	187	(300)	(113)	k. A.	k. A.	k. A.
SCX	4	0	4	2.420	(2.270)	150
SSB	(93)	0	(93)	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	(8)	0	(8)	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	(447)	(370)	(817)	2	620	622
UBS	k. A.	k. A.	k. A.	(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. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	41,60	33,61
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	25,43	35,70
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,15	1,24
Investmentfonds	9,12	9,19
Pensionsgeschäfte	27,74	15,52
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,92	(1,39)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,15	(0,37)
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,63)	0,01

* Gemäß der Liste der Märkte, die die Kriterien für einen geregelten OGAW-Markt erfüllen, in Anlage 1 zum Verkaufsprospekt.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	12,17	6,99
US-Regierungsbehörden	6,81	0,59
US-Schatzobligationen	5,87	k. A.
Non-Agency-MBS	14,75	25,04
Forderungsbesicherte Wertpapiere	21,83	22,85
Staatsemissionen	0,61	k. A.
Kurzfristige Instrumente	5,14	15,08
Investmentfonds	9,12	9,19
Pensionsgeschäfte	27,74	15,52
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,92	(1,39)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,00	(0,10)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	k. A.	(0,30)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,08	0,00
Zinsswaps	0,07	0,03
Freiverkehrsfinanzderivate		
Total Return Swaps auf Indizes	(0,30)	(0,24)
Devisenterminkontrakte	(0,40)	(0,30)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,07	0,55
Sonstige Aktiva und Passiva	(4,48)	6,49
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO StocksPLUS™ AR Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE								PRETIUM MORTGAGE CREDIT PARTNERS LLC				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL								2,240 % fällig am 27.09.2060 \$ 92 \$ 92 0,82				
BANKEN UND FINANZEN								1.685 15,08				
Avolon Holdings Funding Ltd.								STAATSEMISSIONEN				
2,528 % fällig am 18.11.2027	\$	43	38	0,34	Mexico Government International Bond							
Bank of America N.A.								2,750 % fällig am 27.11.2031 (c) MXN 160 8 0,07				
5,650 % fällig am 18.08.2025	100	101	0,91	KURZFRISTIGE INSTRUMENTE								
Goldman Sachs Group, Inc.								COMMERCIAL PAPER				
7,273 % fällig am 15.03.2028	100	101	0,90	Bank of Nova Scotia				5,272 % fällig am 01.02.2024 CAD 100 76 0,68				
Nissan Motor Acceptance Co. LLC								Royal Bank of Canada				
2,750 % fällig am 09.03.2028	50	44	0,39	5,250 % fällig am 09.02.2024				100 75 0,67				
Nykredit Realkredit A/S								151 1,35				
1,500 % fällig am 01.10.2053	DKK	690	83	0,74	UNGARISCHE SCHATZWECHSEL							
Wells Fargo & Co.								10,900 % fällig am 04.01.2024 (a)(b) HUF 7.000 20 0,18				
1,338 % fällig am 04.05.2025	€	100	110	0,99	JAPANISCHE SCHWATZWECHSEL							
					(0,305) % fällig am 09.01.2024 (a)(b) ¥ 10.000 71 0,63							
					(0,260) % fällig am 09.01.2024 (a)(b)				10.000 71 0,63			
					(0,245) % fällig am 04.03.2024 (a)(b)				10.000 71 0,64			
					(0,217) % fällig am 19.02.2024 (a)(b)				15.000 106 0,95			
					(0,213) % fällig am 19.02.2024 (a)(b)				15.000 106 0,95			
					(0,207) % fällig am 05.02.2024 (a)(b)				30.000 213 1,91			
					(0,202) % fällig am 13.02.2024 (a)(b)				30.000 213 1,91			
									851 7,62			
					U.S. TREASURY BILLS							
					5,363 % fällig am 11.01.2024 (a)(b) \$ 1.000 999 8,94							
					5,373 % fällig am 16.01.2024 (a)(b)				1.000 998 8,93			
					5,400 % fällig am 02.01.2024 (a)(b)				1.000 1.000 8,94			
									2.997 26,81			
					Summe kurzfristige Instrumente				4.019 35,96			
					Summe übertragbare Wertpapiere				\$9.254 82,81			
INDUSTRIEWERTE								AKTIEN				
Expedia Group, Inc.								INVESTMENTFONDS				
6,250 % fällig am 01.05.2025	\$	44	44	0,40	ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN							
VERSORGUNGSUNTERNEHMEN								PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (d)				
Pacific Gas & Electric Co.								66.550 663 5,93				
4,550 % fällig am 01.07.2030	5	5	0,04	BÖRSENGEHANDELTE FONDS								
Summe Unternehmensanleihen und Wechsel								PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (d)				
					3.800 379 3,39							
					Summe Investmentfonds				\$ 1.042 9,32			
					US-SCHATZOBIGATIONEN							
Freddie Mac								US. Treasury Inflation Protected Securities (c)				
6,212 % fällig am 25.02.2045	41	38	0,34	0,125 % fällig am 15.10.2024				120 117 1,05				
Uniform Mortgage-Backed Security								0,250 % fällig am 15.01.2025				
4,000 % fällig am 01.09.2053	300	284	2,54	0,625 % fällig am 15.07.2032				212 194 1,74				
4,500 % fällig am 01.09.2052	199	193	1,73					689 6,17				
5,000 % fällig am 01.07.2053	305	304	2,72	NON-AGENCY-MBS								
5,500 % fällig am 01.08.2053	95	96	0,86	American Home Mortgage Assets Trust								
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA								5,932 % fällig am 25.11.2046				
5,500 % fällig am 01.02.2054	300	301	2,69	6,000 % fällig am 25.03.2021				9 6 0,05				
6,000 % fällig am 01.02.2054	100	102	0,91	Banc of America Alternative Loan Trust								
6,500 % fällig am 01.02.2054	300	307	2,75	5,177 % fällig am 25.06.2034				4 4 0,04				
					Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust							
					4,543 % fällig am 25.05.2037				10 9 0,08			
					Chase Mortgage Finance Trust							
					4,523 % fällig am 25.07.2037				2 1 0,01			
					Countrywide Alternative Loan Trust							
					5,500 % fällig am 25.11.2035				13 9 0,08			
					5,915 % fällig am 25.11.2035				33 17 0,15			
					6,012 % fällig am 25.12.2035				22 19 0,17			
					Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust							
					5,930 % fällig am 25.05.2035				77 62 0,56			
					FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE							
					Ares European CLO DAC							
					4,625 % fällig am 15.10.2030				€ 95 104 0,93			
					Armada Euro CLO DAC							
					4,685 % fällig am 15.07.2031				99 109 0,98			
					Avoca CLO DAC							
					4,655 % fällig am 15.07.2030				49 54 0,48			
					Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust							
					5,790 % fällig am 25.08.2036				\$ 74 70 0,63			
					6,720 % fällig am 25.08.2037				10 10 0,09			
					Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC							
					4,925 % fällig am 16.01.2033				€ 100 109 0,98			
					Contego CLO DAC							
					4,642 % fällig am 23.01.2030				100 108 0,97			
					Fremont Home Loan Trust							
					6,085 % fällig am 25.11.2035				\$ 100 88 0,79			
					Griffith Park CLO DAC							
					4,704 % fällig am 21.11.2031				€ 100 108 0,97			
					GSAA Home Equity Trust							
					7,345 % fällig am 25.02.2035				\$ 100 98 0,88			
					GSAMP Trust							
					5,610 % fällig am 25.12.2036				139 73 0,65			
					Home Equity Loan Trust							
					5,700 % fällig am 25.04.2037				65 62 0,55			
					HSI Asset Securitization Corp. Trust							
					6,250 % fällig am 25.01.2036				100 83 0,74			
					JPMorgan Mortgage Acquisition Trust							
					5,680 % fällig am 25.10.2036				18 18 0,16			
					Jubilee CLO DAC							
					4,575 % fällig am 15.04.2030				€ 94 104 0,93			
					Man GLG Euro CLO DAC							
					4,835 % fällig am 15.01.2030				26 29 0,26			
					Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust							
					6,325 % fällig am 25.03.2034				\$ 57 57 0,51			
					Oak Hill European Credit Partners DAC							
					4,723 % fällig am 20.01.2032				€ 91 100 0,89			
					Palmer Square European Loan Funding DAC							
					5,602 % fällig am 15.11.2032				97 107 0,96			
					5,938 % fällig am 12.04.2032				92 102 0,91			

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensionsgeschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
BOS	5,420 %	29.12.2023	02.01.2024	\$ 900	U.S. Treasury Notes 4,000 % fällig am 28.02.2030	\$ (921)	\$ 900	\$ 901	8,05
SSB	2,600	29.12.2023	02.01.2024	195	U.S. Treasury Notes 0,250 % fällig am 31.07.2025	(199)	195	195	1,75
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (1.120)	\$ 1.095	\$ 1.096	9,80

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablaufmonat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2024	22	\$ (34)	(0,31)
3-Month SOFR March Futures	Long	06.2024	22	20	0,18
E-mini S&P 500 Index March Futures	Long	03.2024	5	43	0,38
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2024	1	(5)	(0,04)
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Long	03.2024	11	23	0,21
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Short	03.2024	9	(20)	(0,18)
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2024	19	54	0,49
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Long	03.2024	1	9	0,08
				\$ 90	0,81
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 90	0,81

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	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-41 5-Year Index	5,000 %	20.12.2028	\$ 198	\$ 5	0,04
CDX.IG-41 5-Year Index	1,000	20.12.2028	5.700	20	0,18
				\$ 25	0,22

ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt ⁽³⁾	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	1,000 %	21.03.2034	¥ 40.000	\$ (5)	(0,04)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,407	21.07.2024	\$ 200	(1)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,500	16.06.2028	200	5	0,04
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,740	15.02.2027	100	1	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,000	16.12.2025	350	4	0,04
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,000	16.12.2027	300	(6)	(0,05)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,250	17.06.2030	100	(3)	(0,03)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,250	16.06.2051	100	(6)	(0,06)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,277	21.07.2031	200	(6)	(0,05)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,500	18.12.2029	200	(6)	(0,05)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.06.2024	600	(10)	(0,09)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.06.2032	700	(13)	(0,12)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,500	18.12.2024	100	0	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,750	21.06.2053	100	(7)	(0,07)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,000	21.06.2030	200	(4)	(0,04)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,000	21.06.2033	900	(29)	(0,25)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,250	21.06.2028	200	(3)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2030	300	(10)	(0,09)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2033	200	(9)	(0,08)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	21.06.2025	1.000	0	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.12.2028	900	23	0,20
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,950	13.09.2033	100	4	0,04
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,030	04.10.2033	100	4	0,04
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	20.12.2025	1.900	19	0,17
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,450	31.10.2033	100	5	0,04
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	20.09.2033	AUD 500	19	0,17
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	20.03.2054	€ 90	(10)	(0,09)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,880	19.12.2028	100	(2)	(0,02)
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.03.2034	200	10	0,09
					\$ (36)	(0,32)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ (11)	(0,10)

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

⁽³⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO StocksPLUS™ AR Fund (Forts.)

DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

VERKAUFSOPTIONEN

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfallsdatum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens
CBK	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,235 %	22.01.2024	100	\$ 0	\$ 0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,685	22.01.2024	100	0	0	0,00
MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,670	04.01.2024	100	(1)	(2)	(0,02)
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,120	04.01.2024	100	(1)	0	0,00
							\$ (2)	\$ (2)	(0,02)

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BOA	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	62	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 640	02.10.2024	\$ 0	\$ (3)	\$ (3)	(0,02)
BRC	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	123	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	1.270	02.10.2024	0	(5)	(5)	(0,05)
CBK	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	170	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	1.756	10.01.2024	0	(7)	(7)	(0,07)
RBC	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	569	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	5.877	21.02.2024	0	(25)	(25)	(0,22)
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	41	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	423	06.11.2024	0	(2)	(2)	(0,02)
							\$ 0	\$ (42)	\$ (42)	(0,38)

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
BOA	03.2024	IDR 223.881	\$ 14	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	(0,01)
	03.2024	\$ 4	IDR 62.106	0	0	0	0,00
	03.2024	1	INR 68	0	0	0	0,00
BPS	01.2024	6	CAD 8	0	0	0	0,00
BRC	01.2024	¥ 20.000	\$ 136	0	(6)	(6)	(0,05)
	01.2024	\$ 13	AUD 19	0	0	0	0,00
	01.2024	65	¥ 9.500	3	0	3	0,03
	01.2024	5	PLN 21	1	0	1	0,00
	01.2024	68	ZAR 1.304	3	0	3	0,03
	02.2024	¥ 30.000	\$ 202	0	(14)	(14)	(0,11)
	03.2024	10.000	\$ 68	0	(4)	(4)	(0,03)
	06.2024	KRW 31.791	\$ 24	0	0	0	0,00
CBK	01.2024	AUD 24	\$ 16	0	0	0	0,00
	01.2024	€ 4	\$ 4	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 22	CAD 30	0	0	0	0,00
	01.2024	14	£ 11	0	0	0	0,00
	01.2024	139	MXN 2.442	6	0	6	0,04
	01.2024	39	ZAR 712	0	0	0	0,00
	02.2024	7	BRL 36	0	0	0	0,00
	03.2024	CNH 44	\$ 6	0	0	0	0,00
	03.2024	\$ 4	IDR 62.047	0	0	0	0,00
	06.2024	7	KRW 9.019	0	0	0	0,00
DUB	06.2024	KRW 31.925	\$ 25	0	0	0	0,00
GLM	01.2024	CAD 393	\$ 289	0	(9)	(9)	(0,08)
	01.2024	DKK 535	\$ 79	0	0	0	0,00
	01.2024	MXN 81	\$ 5	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 12	AUD 18	0	0	0	0,00
	02.2024	62	BRL 318	3	0	3	0,03
	03.2024	CNH 1.729	\$ 238	0	(6)	(6)	(0,06)
	03.2024	\$ 17	CNH 121	0	0	0	0,00
	03.2024	92	IDR 1.456.820	4	0	4	0,02
JPM	01.2024	BRL 24	\$ 5	0	0	0	0,00
	01.2024	HUF 3.503	\$ 10	0	0	0	0,00
	01.2024	MXN 533	\$ 31	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 9	BRL 44	0	0	0	0,00
	01.2024	ZAR 143	\$ 8	0	0	0	0,00
	02.2024	CAD 100	\$ 73	0	(3)	(3)	(0,02)
	02.2024	\$ 25	BRL 124	0	0	0	0,00
	02.2024	113	INR 9.461	0	0	0	0,00
	03.2024	IDR 273.681	\$ 17	0	(1)	(1)	(0,01)
	03.2024	INR 584	\$ 7	0	0	0	0,00
	03.2024	TWD 5.537	\$ 178	0	(5)	(5)	(0,05)
	03.2024	\$ 5	IDR 78.257	0	0	0	0,00
	03.2024	1	INR 55	0	0	0	0,00
	03.2024	12	TWD 371	0	0	0	0,00

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
MBC	04.2024	BRL 44	\$ 9	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	06.2024	KRW 30.701	24	0	0	0	0,00
	01.2024	CAD 11	8	0	0	0	0,00
	01.2024	€ 1.251	1.375	0	(7)	(7)	(0,06)
	01.2024	¥ 1.100	8	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 4	BRL 20	0	0	0	0,00
MYI	02.2024	CAD 100	\$ 72	0	(4)	(4)	(0,03)
	02.2024	¥ 60.000	406	0	(23)	(23)	(0,20)
	03.2024	CNH 50	7	0	0	0	0,00
	01.2024	BRL 39	8	0	0	0	0,00
	01.2024	HUF 3.519	10	0	0	0	0,00
	03.2024	TWD 187	6	0	0	0	0,00
RBC	06.2024	KRW 24.886	19	0	0	0	0,00
	04.2024	MXN 0	0	0	0	0	0,00
RYL	03.2024	\$ 9	CNH 63	0	0	0	0,00
SCX	03.2024	7	INR 622	0	0	0	0,00
	06.2024	KRW 47.158	\$ 36	0	0	0	0,00
SSB	03.2024	\$ 6	TWD 181	0	0	0	0,00
UAG	01.2024	£ 47	\$ 59	0	0	0	0,00
	01.2024	MXN 236	13	0	(1)	(1)	(0,01)
				\$ 20	\$ (84)	\$ (64)	(0,57)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2023 standen fur die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BOA	01.2024	£ 60	\$ 76	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	01.2024	\$ 17	£ 14	0	0	0	0,00
BRC	01.2024	£ 165	\$ 209	0	(1)	(1)	(0,01)
	01.2024	\$ 40	£ 32	0	0	0	0,00
CBK	01.2024	£ 224	\$ 284	0	(1)	(1)	(0,02)
MBC	01.2024	165	208	0	(2)	(2)	(0,01)
	01.2024	\$ 9	£ 7	0	0	0	0,00
MYI	01.2024	£ 114	\$ 144	0	(1)	(1)	(0,01)
SCX	01.2024	19	25	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 313	£ 248	2	0	2	0,02
SSB	01.2024	251	199	3	0	3	0,02
UAG	01.2024	313	247	2	0	2	0,02
				\$ 7	\$ (6)	\$ 1	0,01
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ (107)	(0,96)
Summe Anlagen						\$ 11.363	101,68
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ (188)	(1,68)
Nettovermogen						\$ 11.175	100,00

ERLAUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi konnen fur faktisch vorhandene Betrage stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

- Nullkuponwertpapier.
- Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfalligkeit dar.
- Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- Mit dem Teilfonds verbunden.

Barmittel in Hohe von USD 389 (31. Dezember 2022: USD 221) waren zum 31. Dezember 2023 als Sicherheit fur borsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfandet.

Barmittel in Hohe von USD null (31. Dezember 2022: USD 640) waren zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten fur Finanzderivate gema den Rahmenvertragen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. verpfandet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Markten notierte Kurse fur identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
	Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 9.230	
Investmentfonds	663	379	0	1.042
Pensionsgeschafte	0	1.095	0	1.095
Finanzderivate ⁽³⁾	38	(66)	0	(28)
Summen	\$ 701	\$ 10.638	\$ 24	\$ 11.363

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO StocksPLUS™ AR Fund (Forts.)

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 7.750	\$ 0	\$ 7.750
Investmentfonds	528	376	0	904
Pensionsgeschäfte	0	1.374	0	1.374
Finanzderivate ⁽³⁾	9	(44)	0	(35)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(583)	0	(583)
Summen	\$ 537	\$ 8.873	\$ 0	\$ 9.410

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

(3) Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ (5)	\$ 0	\$ (5)	\$ (43)	\$ 0	\$ (43)
BRC	(23)	(30)	(53)	(4)	80	76
CBK	(2)	0	(2)	7	0	7
CLY	k. A.	k. A.	k. A.	(1)	0	(1)
DUB	k. A.	k. A.	k. A.	(47)	0	(47)
FAR	k. A.	k. A.	k. A.	(16)	280	264
GLM	(8)	0	(8)	(1)	0	(1)
JPM	(9)	0	(9)	k. A.	k. A.	k. A.
MBC	(36)	0	(36)	(19)	0	(19)
MYC	(2)	0	(2)	k. A.	k. A.	k. A.
MYI	(1)	0	(1)	k. A.	k. A.	k. A.
RBC	(27)	(260)	(287)	(17)	280	263
RYL	k. A.	k. A.	k. A.	(26)	0	(26)
SCX	2	0	2	3	0	3
SSB	3	0	3	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. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2023:

	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	46,60	20,10
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	36,21	61,13
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	k. A.	0,10
Investmentfonds	9,32	9,49
Pensionsgeschäfte	9,80	14,42
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,81	(0,07)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,10)	1,43
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,96)	(1,72)
Leerverkaufte Wertpapiere	k. A.	(6,12)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	4,71	8,52
US-Regierungsbehörden	14,54	7,38
US-Schatzobligationen	6,17	1,25
Non-Agency-MBS	6,28	9,36
Forderungsbesicherte Wertpapiere	15,08	20,52
Staatsemissionen	0,07	k. A.
Kurzfristige Instrumente	35,96	34,30
Investmentfonds	9,32	9,49
Pensionsgeschäfte	9,80	14,42
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,81	(0,07)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,22	0,46
Zinsswaps	(0,32)	0,97
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Zinsswapoptionen	(0,02)	k. A.
Total Return Swaps auf Indizes	(0,38)	(0,39)

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Devisenterminkontrakte	(0,57)	(1,42)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,01	0,09
Leerverkaufte Wertpapiere	k. A.	(6,12)
Sonstige Aktiva und Passiva	(1,68)	1,24
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Strategic Income Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE			
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG			
Emerald TopCo, Inc. 8,970 % fällig am 24.07.2026	\$ 39	\$ 39	0,01	Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 2,000 % fällig am 01.10.2047 DKK	0	\$ 0	0,00	Venture Global Calcasieu Pass LLC 3,875 % fällig am 15.08.2029	\$ 900	\$ 818	0,18
Envision Healthcare Corp. 13,258 % fällig am 15.09.2028	921	921	0,21	Nykredit Realkredit A/S 2,000 % fällig am 01.10.2047	0	0	0,00	Venture Global LNG, Inc. 9,500 % fällig am 01.02.2029	1.650	1.747	0,39
Lealand Finance Co. BV 8,470 % fällig am 28.06.2024	26	18	0,00	Park Aerospace Holdings Ltd. 5,500 % fällig am 15.02.2024	\$ 7	7	0,00	9,875 % fällig am 01.02.2032	550	573	0,13
Lealand Finance Co. BV (6,470 % bar und 3,000 % PIK) 9,470 % fällig am 30.06.2025 (b)	147	62	0,01	Santander UK Group Holdings PLC 7,482 % fällig am 29.08.2029	£ 260	361	0,08	Windstream Escrow LLC 7,750 % fällig am 15.08.2028	1.753	1.537	0,34
Poseidon Bidco SASU 9,175 % fällig am 30.09.2028	€ 1.900	2.101	0,47	Societe Generale S.A. 6,446 % fällig am 10.01.2029	\$ 1.700	1.760	0,39			21.447	4,77
PUG LLC 8,970 % fällig am 12.02.2027	\$ 44	44	0,01	6,691 % fällig am 10.01.2034	1.800	1.903	0,42	VERSORGUNGSUNTERNEHMEN			
SCUR-Alpha 1503 GmbH 10,883 % fällig am 29.03.2030	993	916	0,20	Sunac China Holdings Ltd. 6,000 % fällig am 30.09.2026	8	1	0,00	Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC 2,950 % fällig am 27.01.2029	5.100	2.933	0,65
Syniverse Holdings, Inc. 12,348 % fällig am 13.05.2027	100	88	0,02	6,250 % fällig am 30.09.2027	8	1	0,00	Pacific Gas & Electric Co. 2,950 % fällig am 01.03.2026	1.154	1.094	0,24
U.S. Renal Care, Inc. 10,470 % fällig am 20.06.2028	162	124	0,03	6,500 % fällig am 30.09.2027	15	1	0,00	3,250 % fällig am 01.06.2031	2.460	2.133	0,48
Windstream Services LLC 11,706 % fällig am 21.09.2027	20	19	0,00	6,750 % fällig am 30.09.2028	23	1	0,00	3,300 % fällig am 15.03.2027	324	303	0,07
		4.332	0,96	7,000 % fällig am 30.09.2029	23	1	0,00	3,400 % fällig am 15.08.2024	403	396	0,09
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
BANKEN UND FINANZEN				BANKEN UND FINANZEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
ABN AMRO Bank NV 6,575 % fällig am 13.10.2026	500	509	0,11	7,250 % fällig am 30.09.2030	11	0	0,00	3,750 % fällig am 01.07.2028	1.102	1.033	0,23
AIB Group PLC 5,250 % fällig am 23.10.2031	€ 700	837	0,19	UBS Group AG 3,869 % fällig am 12.01.2029	1.670	1.576	0,35	3,750 % fällig am 15.08.2042	20	15	0,00
Avolon Holdings Funding Ltd. 2,528 % fällig am 18.11.2027	\$ 1.580	1.401	0,31	5,959 % fällig am 12.01.2034	3.458	3.578	0,79	4,200 % fällig am 01.03.2029	1.000	946	0,21
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 6,750 % fällig am 02.03.2026	€ 700	792	0,18	6,373 % fällig am 15.07.2026	250	253	0,06	4,300 % fällig am 15.03.2045	236	185	0,04
Banco de Credito del Peru S.A. 4,650 % fällig am 17.09.2024 PEN	1.100	289	0,06	6,442 % fällig am 11.08.2028	250	260	0,06	4,500 % fällig am 15.12.2041	30	24	0,01
Banco Espirito Santo S.A. 2,625 % fällig am 08.05.2017	€ 100	30	0,01	6,537 % fällig am 12.08.2033	400	427	0,09	4,950 % fällig am 01.07.2050	1.481	1.268	0,28
Banco Santander S.A. 6,607 % fällig am 07.11.2028	\$ 1.500	1.598	0,35	Unique Pub Finance Co. PLC 5,659 % fällig am 30.06.2027	£ 569	725	0,16	Rio Oil Finance Trust 8,200 % fällig am 06.04.2028	188	192	0,04
Barclays PLC 7,437 % fällig am 02.11.2033	625	700	0,16	Voyager Aviation Holdings LLC 8,500 % fällig am 09.05.2026 ^	\$ 33	18	0,00	Sprint LLC 7,625 % fällig am 01.03.2026	47	49	0,01
BPCE S.A. 6,612 % fällig am 19.10.2027	750	772	0,17	Wells Fargo & Co. 6,303 % fällig am 23.10.2029	400	422	0,09			10.571	2,35
Corestate Capital Holding S.A. (8,000 % bar oder 9,000 % PIK) 8,000 % fällig am 31.12.2026 ^ (b)	€ 151	88	0,02	6,491 % fällig am 23.10.2034	200	218	0,05	Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		61.076	13,58
Credit Suisse AG AT1 Claim	\$ 600	72	0,02	INDUSTRIEWERTE				WANDELANLEIHEN & WECHSEL			
Deutsche Bank AG 3,547 % fällig am 18.09.2031	400	351	0,08	American Airlines Pass-Through Trust 3,350 % fällig am 15.04.2031	28	25	0,01	Sunac China Holdings Ltd. 1,000 % fällig am 30.09.2032	13	1	0,00
6,720 % fällig am 18.01.2029	300	314	0,07	Carvana Co. 12,000 % fällig am 01.12.2028	562	455	0,10	KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL			
EPR Properties 4,750 % fällig am 15.12.2026	15	14	0,00	13,000 % fällig am 01.06.2030	843	673	0,15	Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Bonds, Series 2022 0,000 % fällig am 01.11.2043	428	233	0,05
4,950 % fällig am 15.04.2028	24	23	0,01	14,000 % fällig am 01.06.2031	998	807	0,18	Illinois State General Obligation Bonds, (BABs), Series 2010 6,630 % fällig am 01.02.2035	28	29	0,01
GLP Capital LP 5,250 % fällig am 01.06.2025	39	39	0,01	Energy Transfer LP 4,950 % fällig am 15.05.2028	25	25	0,01	7,350 % fällig am 01.07.2035	13	14	0,00
5,300 % fällig am 15.01.2029	186	185	0,04	6,100 % fällig am 01.12.2028	750	790	0,17	Puerto Rico Electric Power Authority Revenue Bonds, (BABs), Series 2010 6,125 % fällig am 01.07.2040 ^	200	49	0,01
HSBC Holdings PLC 3,973 % fällig am 22.05.2030	1.700	1.589	0,35	Exela Intermediate LLC 11,500 % fällig am 15.04.2026	48	9	0,00			325	0,07
Intesa Sanpaolo SpA 7,200 % fällig am 28.11.2033	200	213	0,05	Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A. 2,949 % fällig am 24.01.2024	€ 500	456	0,10	US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
JPMorgan Chase & Co. 6,087 % fällig am 23.10.2029	750	789	0,18	Intelsat Jackson Holdings S.A. 6,500 % fällig am 15.03.2030	\$ 3.988	3.809	0,85	Fannie Mae 0,548 % fällig am 25.11.2049 (a)	104	15	0,00
Lloyds Banking Group PLC 4,750 % fällig am 21.09.2031	€ 1.500	1.753	0,39	Market Bidco Finco PLC 4,750 % fällig am 04.11.2027	€ 800	795	0,18	2,198 % fällig am 25.07.2033 (a)	37	4	0,00
Morgan Stanley 0,000 % fällig am 02.04.2032 (h)	\$ 700	425	0,09	Mitchells & Butlers Finance PLC 6,013 % fällig am 15.12.2030	£ 24	28	0,01	Freddie Mac 1,097 % fällig am 15.06.2042 (a)	37	5	0,00
Nationwide Building Society 4,500 % fällig am 01.11.2026	€ 300	342	0,08	NMG Holding Co., Inc. 7,125 % fällig am 01.04.2026	\$ 700	673	0,15	Ginnie Mae 4,500 % fällig am 20.07.2040 - 20.07.2043	9.623	9.627	2,14
6,557 % fällig am 18.10.2027	\$ 1.350	1.398	0,31	Petroleos de Venezuela S.A. 5,375 % fällig am 12.04.2037	707	79	0,02	5,500 % fällig am 20.07.2053	2.672	2.692	0,60
NatWest Group PLC 4,445 % fällig am 08.05.2030	1.200	1.151	0,26	5,500 % fällig am 12.04.2047	762	86	0,02	Ginnie Mae, TBA 3,500 % fällig am 01.01.2054	3.600	3.353	0,75
4,892 % fällig am 18.05.2029	500	491	0,11	6,000 % fällig am 16.05.2034	642	74	0,02	4,000 % fällig am 01.02.2054	2.300	2.198	0,49
5,076 % fällig am 27.01.2030	1.400	1.380	0,31	6,000 % fällig am 15.11.2036	518	60	0,01	4,500 % fällig am 01.02.2054	4.600	4.494	1,00
				9,750 % fällig am 17.05.2045	280	36	0,01	5,000 % fällig am 01.01.2054	800	795	0,18
				Petroleos Mexicanos 6,700 % fällig am 16.02.2032	2.084	1.732	0,38	Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % fällig am 01.03.2050 - 01.05.2052	1.388	1.232	0,27
				Roadster Finance DAC 2,375 % fällig am 08.12.2032	€ 100	98	0,02	3,500 % fällig am 01.04.2048 - 01.02.2050	497	463	0,10
				RTX Corp. 5,750 % fällig am 15.01.2029	\$ 750	784	0,17	4,000 % fällig am 01.08.2039 - 01.05.2047	1.164	1.125	0,25
				Topaz Solar Farms LLC 4,875 % fällig am 30.09.2039	66	61	0,01	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.01.2039 - 01.02.2054	18.400	16.468	3,66
				5,750 % fällig am 30.09.2039	572	570	0,13	3,500 % fällig am 01.01.2054	23.950	21.982	4,89
				U.S. Renal Care, Inc. 10,625 % fällig am 28.06.2028	32	24	0,01	4,000 % fällig am 01.01.2054	36.600	34.638	7,70
				United Airlines Pass-Through Trust 4,150 % fällig am 11.10.2025	7	7	0,00	4,500 % fällig am 01.02.2054	17.800	17.267	3,84
				5,875 % fällig am 15.04.2029	4.543	4.605	1,02	5,000 % fällig am 01.01.2054	11.525	11.405	2,53
				Valaris Ltd. 8,375 % fällig am 30.04.2030	11	11	0,00	5,500 % fällig am 01.02.2054	22.125	22.225	4,94

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
6,000 % fällig am 01.01.2054 \$	31.925	\$ 32.419	7,20	Eurosail PLC				Countrywide Asset-Backed Certificates Trust			
6,500 % fällig am 01.02.2054	12.625	12.937	2,88	6,039 % fällig am 13.09.2045 £	2.477	\$ 3.117	0,69	5,720 % fällig am 25.11.2047 \$	5.101	\$ 4.491	1,00
7,000 % fällig am 01.03.2054	3.300	3.398	0,76	6,289 % fällig am 13.06.2045	880	1.117	0,25	5,730 % fällig am 25.12.2036	1.891	1.718	0,38
		198.742	44,18	GreenPoint Mortgage Funding Trust				6,535 % fällig am 25.08.2035	973	971	0,22
				5,870 % fällig am 25.10.2046 \$	370	334	0,07	Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust			
				Grifonas Finance PLC				3,201 % fällig am 25.01.2037	167	52	0,01
				4,212 % fällig am 28.08.2039 €	177	191	0,04	Cumulus Static CLO DAC			
				GSMPs Mortgage Loan Trust				5,499 % fällig am 25.04.2033 €	1.400	1.546	0,34
				7,060 % fällig am 20.10.2032 \$	1.238	1.106	0,25	Fieldstone Mortgage Investment Trust			
				GSMSC Resecuritization Trust				5,697 % fällig am 25.11.2036 \$	1.748	1.013	0,23
				2,167 % fällig am 26.04.2037	7.355	1.939	0,43	First Franklin Mortgage Loan Trust			
				HomeBanc Mortgage Trust				5,590 % fällig am 25.12.2036	4.076	3.865	0,86
				3,815 % fällig am 25.04.2037	15	13	0,00	Fremont Home Loan Trust			
				JPMorgan Mortgage Trust				5,620 % fällig am 25.01.2037	1.431	650	0,14
				4,473 % fällig am 25.08.2036	30	24	0,01	Golden Bar Securitisation SRL			
				5,099 % fällig am 25.01.2037	76	65	0,01	6,816 % fällig am 22.09.2043 €	1.500	1.679	0,37
				Legacy Mortgage Asset Trust				GSAMP Trust			
				7,221 % fällig am 28.01.2070	679	680	0,15	5,840 % fällig am 25.03.2047 \$	9.000	6.882	1,53
				MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust				Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust			
				6,570 % fällig am 25.09.2037	7.300	3.203	0,71	5,590 % fällig am 25.04.2037	1.745	1.202	0,27
				Morgan Stanley Capital Trust				5,630 % fällig am 25.11.2036	3.219	2.816	0,63
				7,609 % fällig am 15.07.2035	3.026	2.961	0,66	5,640 % fällig am 25.04.2037	1.807	1.245	0,28
				Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				HSI Asset Securitization Corp. Trust			
				5,730 % fällig am 25.04.2035	49	46	0,01	5,610 % fällig am 25.01.2037	4.795	3.624	0,81
				Mortimer BTL PLC				Long Beach Mortgage Loan Trust			
				0,000 % fällig am 22.12.2056 £	1.200	1.534	0,34	5,830 % fällig am 25.03.2046	2.964	2.374	0,53
				Primrose Residential DAC				6,070 % fällig am 25.01.2036	2.589	2.252	0,50
				4,876 % fällig am 24.10.2061 €	2.064	2.267	0,50	Madison Avenue Manufactured Housing Contract Trust			
				RBSGC Mortgage Loan Trust				8,720 % fällig am 25.03.2032	165	165	0,04
				6,000 % fällig am 25.01.2037 \$	14	12	0,00	Madison Park Euro Funding DAC			
				RMAC PLC				4,715 % fällig am 15.01.2032 €	1.500	1.633	0,36
				0,000 % fällig am 15.02.2047 £	1.300	1.663	0,37	Man GLG Euro CLO DAC			
				Sandwell Commercial Finance PLC				5,779 % fällig am 15.10.2036	2.880	3.189	0,71
				5,875 % fällig am 30.09.2037	21	12	0,00	MASTR Asset-Backed Securities Trust			
				Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				5,990 % fällig am 25.06.2036 \$	1.400	1.234	0,27
				4,213 % fällig am 25.09.2035 \$	50	31	0,01	Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust			
				6,412 % fällig am 25.05.2035	117	82	0,02	3,938 % fällig am 25.01.2035	911	809	0,18
				Twin Bridges PLC				5,580 % fällig am 25.02.2037	699	331	0,07
				6,432 % fällig am 15.05.2056 £	1.200	1.533	0,34	5,620 % fällig am 25.02.2037	2.169	1.028	0,23
				WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				5,720 % fällig am 25.03.2037	7.988	3.424	0,76
				4,397 % fällig am 25.12.2046 \$	1.881	1.528	0,34	Nassau Ltd.			
				6,060 % fällig am 25.08.2046	819	662	0,15	6,905 % fällig am 15.01.2030	1.311	1.313	0,29
				Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust				Netnet Student Loan Trust			
				5,500 % fällig am 25.05.2035	269	216	0,05	5,910 % fällig am 27.09.2066	2.621	2.612	0,58
				Wells Fargo Alternative Loan Trust				New Century Home Equity Loan Trust			
				6,250 % fällig am 25.07.2037	845	719	0,16	6,250 % fällig am 25.03.2035	72	69	0,02
				Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust				7,495 % fällig am 25.05.2034	18	22	0,00
				6,376 % fällig am 25.10.2036	11	9	0,00	Palmer Square European Loan Funding DAC			
						36.322	8,07	0,000 % fällig am 15.05.2033 €	1.400	1.543	0,34
								Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates			
								6,790 % fällig am 25.01.2036 \$	5.365	4.991	1,11
								Penta CLO DAC			
								4,906 % fällig am 25.01.2033 €	1.500	1.634	0,36
								Renaissance Home Equity Loan Trust			
								5,434 % fällig am 25.08.2035 \$	17	17	0,00
								Saxon Asset Securities Trust			
								7,220 % fällig am 25.12.2037	1.574	1.479	0,33
								SLM Student Loan Trust			
								6,252 % fällig am 25.03.2026	3.012	2.982	0,66
								Sound Point Euro CLO Funding DAC			
								5,065 % fällig am 15.01.2035 €	1.500	1.641	0,36
								Soundview Home Loan Trust			
								5,935 % fällig am 25.06.2036 \$	7.565	6.302	1,40
								6,470 % fällig am 25.09.2037	5.597	3.892	0,86
								6,505 % fällig am 25.05.2035	1.012	1.000	0,22
								Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust			
								5,810 % fällig am 25.12.2036	90	88	0,02
								5,970 % fällig am 25.11.2037	2.600	2.284	0,51
								6,595 % fällig am 25.07.2035	1.220	1.201	0,27
								TruPS Financials Note Securitization Ltd.			
								7,202 % fällig am 20.09.2039	1.366	1.335	0,30
								Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust			
								5,890 % fällig am 25.03.2037	6	6	0,00
									100.577	22,35	

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Strategic Income Fund (Forts.)

AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablaufmonat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month SOFR December Futures	Long	03.2024	23	\$ (88)	(0,02)
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2025	7	26	0,01
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2026	8	18	0,00
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2024	10	53	0,01
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2025	9	23	0,01
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2024	13	79	0,02
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2025	7	22	0,00
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2026	9	20	0,00
3-Month SOFR September Futures	Short	12.2024	10	45	0,01
3-Month SOFR September Futures	Short	12.2025	6	14	0,00
Australia Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2024	103	(242)	(0,05)
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2024	43	(197)	(0,04)
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2024	12	29	0,01
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2024	343	1.366	0,30
U.S. Treasury 10-Year Ultra March Futures	Long	03.2024	11	56	0,01
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Short	03.2024	154	(1.503)	(0,33)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2024	126	(1.427)	(0,32)
				\$ (1.706)	(0,38)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (1.706)	(0,38)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2028	\$ 1.700	\$ 35	0,01
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2024	700	2	0,00
				\$ 37	0,01

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-31 5-Year Index	1,000 %	20.06.2024	\$ 946	\$ 38	0,01
CDX.EM-32 5-Year Index	1,000	20.12.2024	510	25	0,01
CDX.EM-34 5-Year Index	1,000	20.12.2025	2.208	41	0,01
CDX.EM-36 5-Year Index	1,000	20.12.2026	4.784	176	0,04
CDX.EM-38 5-Year Index	1,000	20.12.2027	600	42	0,01
CDX.EM-39 5-Year Index	1,000	20.06.2028	300	15	0,00
CDX.EM-40 5-Year Index	1,000	20.12.2028	3.000	63	0,01
CDX.HY-36 5-Year Index	5,000	20.06.2026	1.843	(49)	(0,01)
CDX.HY-37 5-Year Index	5,000	20.12.2026	873	15	0,00
CDX.HY-41 5-Year Index	5,000	20.12.2028	4.257	230	0,05
CDX.IG-41 5-Year Index	1,000	20.12.2028	600	4	0,00
				\$ 600	0,13

ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt	variabler Zinssatz	variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day GBP-SONIO	Compounded-OIS	4,320 %	20.10.2033	£ 100	\$ 11	0,00
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO	Compounded-OIS	4,500	20.03.2034	6.000	(614)	(0,14)
Zahlung ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO	Compounded-OIS	5,000	20.03.2029	9.690	6	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM	Compounded-OIS	0,000	15.03.2029	¥ 2.430.000	452	0,10
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM	Compounded-OIS	0,020	20.09.2028	2.950.000	464	0,10
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM	Compounded-OIS	0,176	27.04.2027	160.000	(4)	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM	Compounded-OIS	0,400	15.06.2032	248.400	41	0,01
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM	Compounded-OIS	0,500	15.03.2042	121.000	70	0,01
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM	Compounded-OIS	0,711	27.04.2042	37.000	23	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR	Compounded-OIS	0,500	16.06.2026	\$ 32.900	2.243	0,50
Zahlung	1-Day USD-SOFR	Compounded-OIS	0,500	16.06.2028	26.200	(2.169)	(0,48)
Zahlung	1-Day USD-SOFR	Compounded-OIS	0,750	15.12.2024	53.300	(2.420)	(0,54)
Zahlung	1-Day USD-SOFR	Compounded-OIS	0,750	16.06.2031	13.442	(1.372)	(0,30)
Erhalt	1-Day USD-SOFR	Compounded-OIS	0,750	16.06.2031	16.200	1.785	0,40
Erhalt	1-Day USD-SOFR	Compounded-OIS	0,940	08.06.2026	2.000	156	0,03
Erhalt	1-Day USD-SOFR	Compounded-OIS	1,000	15.06.2027	1.200	85	0,02

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,000 %	15.06.2027	\$ 15.700	\$ (1.467)	(0,33)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,000	15.06.2029	2.770	(320)	(0,07)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,000	16.12.2030	1.766	292	0,06
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,235	12.05.2028	700	79	0,02
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,250	15.12.2026	34.300	3.318	0,74
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,250	17.06.2027	12.000	(1.541)	(0,34)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,250	15.12.2028	3.900	(429)	(0,10)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,250	17.06.2030	47.620	4.824	1,07
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,250	15.06.2032	5.950	(673)	(0,15)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,250	16.06.2051	4.300	(1.035)	(0,23)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,350	20.01.2027	3.400	279	0,06
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,360	20.07.2031	800	132	0,03
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,370	19.07.2031	500	82	0,02
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,380	04.01.2027	1.400	(112)	(0,03)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,405	07.09.2031	1.300	209	0,05
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,425	18.01.2027	1.000	(77)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,443	18.01.2027	1.100	(84)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,450	17.02.2027	2.400	184	0,04
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,450	16.07.2031	1.200	193	0,04
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,491	21.01.2051	900	(330)	(0,07)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,500	15.12.2028	7.130	(898)	(0,20)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,500	12.01.2029	578	64	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,500	05.10.2031	600	(93)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,535	15.10.2031	600	(91)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,535	22.10.2031	400	(60)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,545	26.10.2031	400	(60)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,550	20.01.2027	15.100	(1.087)	(0,24)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,570	11.01.2027	800	(59)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,580	16.02.2027	900	(63)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,590	09.02.2051	7.200	(2.521)	(0,56)
Erhalt ⁽³⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,600	16.01.2026	6.600	221	0,05
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,625	16.01.2050	3.100	1.088	0,24
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,625	03.02.2050	3.900	1.368	0,30
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,700	06.03.2024	2.300	(11)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,700	17.02.2027	9.600	(622)	(0,14)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,700	12.01.2029	2.100	(204)	(0,05)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,740	16.12.2026	1.100	79	0,02
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.06.2027	26.000	743	0,16
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.06.2029	1.209	55	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.06.2032	1.878	110	0,02
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.06.2032	1.840	(183)	(0,04)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	22.01.2050	7.600	2.528	0,56
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,768	02.02.2032	300	(41)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,785	12.08.2051	700	237	0,05
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,817	05.04.2032	2.200	(305)	(0,07)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,872	06.04.2032	1.100	(148)	(0,03)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,875	07.02.2050	400	123	0,03
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,895	18.10.2049	700	231	0,05
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,910	17.10.2049	700	228	0,05
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,928	25.03.2027	1.100	(86)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	21.12.2027	1.250	(15)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	21.12.2029	5.740	(52)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	18.02.2032	900	(103)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	21.12.2032	9.130	(31)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	15.01.2050	1.400	407	0,09
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	15.12.2051	6.500	(2.357)	(0,53)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,250	11.12.2049	7.100	1.731	0,38
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,250	12.03.2050	3.400	809	0,18
Erhalt ⁽³⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,300	17.01.2026	4.600	150	0,03
Erhalt ⁽³⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,350	17.01.2025	7.900	178	0,04
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,450	20.12.2024	15.900	371	0,08
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,500	18.12.2024	6.000	486	0,11
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,500	20.12.2024	10.900	17	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,841	31.10.2024	600	(9)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,850	30.08.2027	1.000	(31)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,910	14.11.2024	600	(8)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,920	17.10.2024	1.700	(26)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,955	04.10.2027	1.000	(23)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,973	27.10.2024	600	(8)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,993	13.10.2024	600	(8)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,000	19.06.2024	41.600	1.920	0,43
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,000	19.06.2026	32.300	1.926	0,43
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,000	21.06.2030	2.090	23	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,000	21.06.2033	2.800	104	0,02
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,000	21.06.2033	160	(5)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,018	24.10.2024	500	(7)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,050	07.09.2027	500	(11)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,050	08.09.2029	500	(12)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,050	06.09.2032	700	(21)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,080	23.02.2053	200	(11)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,088	07.11.2024	600	(7)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,100	09.09.2029	500	(11)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Strategic Income Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,140 %	25.10.2024	\$ 500	\$ (6)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,190	25.10.2024	500	(6)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,225	25.10.2024	500	(5)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,250	21.06.2028	690	5	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,250	21.06.2028	590	(4)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,300	06.03.2033	300	(8)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,300	14.06.2033	1.000	(20)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,340	23.02.2030	600	(13)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,350	14.12.2032	200	3	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,370	01.03.2033	400	(8)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,370	12.07.2053	200	1	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,400	23.02.2033	200	(3)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,405	01.03.2033	300	(5)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,425	01.03.2033	300	(4)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,430	27.02.2033	300	(4)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,450	07.03.2033	600	(8)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,470	22.02.2030	600	(8)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	22.06.2030	900	(5)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2030	1.190	(61)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	22.05.2033	29.660	(24)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	21.06.2033	600	(2)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2033	860	25	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,525	02.03.2030	200	(2)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,610	12.12.2032	400	(2)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,650	22.11.2024	1.100	(10)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,650	05.12.2024	1.100	(10)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,650	10.07.2033	400	4	0,00
Erhalt ⁽³⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,684	03.01.2034	100	(1)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,700	06.06.2033	16.970	(16)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,730	03.08.2033	200	4	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,735	07.08.2033	200	4	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	21.11.2024	1.100	(9)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	11.12.2024	1.100	(9)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	13.12.2027	900	(2)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.12.2028	1.080	(48)	(0,01)
Erhalt ⁽³⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2029	13.800	(7)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	12.07.2033	400	7	0,00
Erhalt ⁽³⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	02.01.2034	100	(2)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,760	23.08.2033	500	11	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,800	10.03.2028	600	(1)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,800	05.09.2028	800	10	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,800	22.08.2030	100	2	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,800	30.08.2033	200	5	0,00
Erhalt ⁽³⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,810	02.01.2034	100	(2)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,830	12.10.2053	100	10	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,842	26.12.2033	100	(3)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,854	29.12.2033	200	(6)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,870	17.10.2053	100	11	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,880	16.10.2053	100	11	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,900	30.08.2033	600	20	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,950	13.09.2033	600	23	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,950	19.12.2033	200	(7)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,030	04.10.2033	500	23	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,030	15.12.2033	200	(8)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,040	20.06.2024	2.000	(15)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,060	20.06.2024	8.100	(61)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,140	22.06.2024	3.400	(23)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,150	12.10.2033	200	11	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,155	02.10.2033	400	23	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,165	27.09.2033	600	35	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,170	03.10.2033	400	23	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,175	10.10.2033	200	12	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,200	18.10.2033	200	12	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,220	20.10.2033	200	13	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,230	23.10.2033	100	6	0,00
Erhalt ⁽³⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	20.03.2029	620	(3)	0,00
Erhalt ⁽³⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	20.03.2031	730	(5)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	22.11.2033	200	(12)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,255	23.10.2033	100	7	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,393	25.10.2033	100	8	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,435	01.11.2033	100	8	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,450	31.10.2033	100	8	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,450	01.11.2033	300	25	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,500	22.05.2025	65.460	(135)	(0,03)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,900	06.06.2025	37.050	78	0,02
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	5,100	22.05.2024	126.930	(135)	(0,03)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	5,400	06.06.2024	71.750	77	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,874	02.01.2026	BRL 1.200	(1)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,899	02.01.2026	600	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,939	02.01.2026	1.100	(1)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,998	04.01.2027	1.900	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,037	04.01.2027	500	0	0,00

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,041 %	04.01.2027	BRL 1.500	\$ 0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,052	02.01.2026	1.800	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,085	02.01.2026	1.800	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,090	04.01.2027	2.800	1	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,105	02.01.2026	1.800	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,138	04.01.2027	700	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,157	02.01.2025	1.300	(5)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,177	02.01.2025	800	(3)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,250	04.01.2027	1.500	3	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,275	04.01.2027	700	2	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,290	04.01.2027	800	2	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,367	02.01.2025	1.000	(3)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,731	04.01.2027	400	2	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,746	04.01.2027	1.700	9	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,901	04.01.2027	4.000	25	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,018	02.01.2025	2.800	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,098	02.01.2025	4.700	2	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,158	02.01.2025	2.300	1	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,163	02.01.2025	2.300	1	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,178	02.01.2025	4.700	3	0,00
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,750	20.12.2025	CAD 5.300	80	0,02
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,360	07.08.2028	ZAR 500	0	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,380	04.08.2028	400	0	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,400	07.08.2028	500	0	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,410	31.07.2028	100	0	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,410	04.08.2028	1.100	1	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,410	07.08.2028	100	0	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,415	31.07.2028	100	0	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,415	04.08.2028	400	0	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,420	31.07.2028	300	0	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,421	04.08.2028	500	1	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,426	01.08.2028	100	0	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,428	31.07.2028	200	0	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,460	01.08.2028	200	0	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,460	02.08.2028	200	0	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,464	02.08.2028	200	0	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,543	04.08.2028	500	1	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,550	03.08.2028	800	1	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	2,750	17.06.2026	AUD 460	(13)	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	3,000	21.03.2027	18.640	(790)	(0,18)
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	3,250	17.12.2024	1.600	(69)	(0,02)
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	3,500	17.06.2025	19.492	(1.105)	(0,25)
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,250	17.12.2024	650	(56)	(0,01)
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	20.09.2033	300	7	0,00
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	987	0,22
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,250	18.03.2050	2.300	946	0,21
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,329	30.12.2025	100	7	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,363	30.06.2025	200	12	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,395	30.12.2024	100	4	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,425	28.06.2024	200	5	0,00
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,830	09.12.2052	6.800	397	0,09
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,000	21.09.2032	11.880	(734)	(0,16)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	11.04.2024	1.400	4	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	13.04.2024	2.900	8	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	17.05.2024	1.300	4	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	26.04.2024	1.400	8	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	28.04.2024	1.300	6	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	03.05.2024	1.300	6	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,547	09.03.2033	800	30	0,01
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	2,760	03.01.2029	200	(3)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,880	19.12.2028	300	(6)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,890	22.12.2033	200	(7)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,910	29.12.2033	100	(4)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,920	13.12.2028	300	(7)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,950	29.12.2028	200	(5)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,970	15.12.2033	200	(8)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,990	08.12.2033	200	(9)	0,00
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.03.2034	3.800	(239)	(0,05)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,063	06.12.2033	100	(5)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,128	04.12.2033	100	(6)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,148	20.11.2033	200	(11)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,179	29.11.2028	100	(3)	0,00
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,250	20.03.2029	9.100	(6)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,250	06.11.2033	200	(13)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,255	22.11.2028	100	(4)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,270	08.11.2028	300	(11)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	3,270	21.08.2033	200	15	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,280	22.11.2033	100	(7)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	3,300	03.10.2033	500	39	0,01
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,305	27.11.2033	200	(14)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	3,370	09.10.2028	300	14	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Strategic Income Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	3,450 %	20.10.2028	€ 300	\$ 15	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,160	06.06.2025	MXN 9.300	(39)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,535	04.05.2027	18.500	(110)	(0,03)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,950	30.01.2026	12.300	6	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,980	26.08.2024	500	1	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,990	30.01.2026	15.000	6	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,080	10.03.2026	20.700	6	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,490	08.09.2026	13.700	(11)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,620	18.02.2030	600	(1)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,710	20.09.2029	500	(1)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,150	11.06.2027	28.100	(56)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,165	06.09.2032	3.000	(8)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,200	11.06.2027	2.900	(6)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,360	21.08.2037	3.100	(11)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,370	11.10.2027	14.800	(37)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,380	04.11.2026	400	(1)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,380	14.08.2037	700	1	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,480	18.06.2037	1.300	(5)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,495	14.01.2032	8.100	(6)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,498	15.01.2032	33.500	(27)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,603	14.04.2025	49.000	(102)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,610	15.04.2025	3.000	(6)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,670	05.03.2025	52.900	(103)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,710	07.03.2025	6.400	(13)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,715	07.03.2025	6.300	(13)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,800	28.12.2027	2.900	6	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,818	17.02.2027	11.400	(39)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,865	02.02.2027	11.900	(43)	(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	11	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	77	0,02
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,010	04.02.2027	5.200	(20)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,030	31.01.2028	4.600	7	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,050	31.01.2028	3.400	4	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,090	15.01.2027	13.000	(52)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,103	04.01.2038	5.600	6	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,120	15.01.2027	2.700	(11)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,300	16.06.2028	6.800	(2)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,410	21.03.2027	11.100	12	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,444	25.07.2028	16.200	(7)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,471	26.07.2028	8.200	(3)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,512	24.07.2028	12.300	(4)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,550	27.07.2028	4.100	(1)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,556	27.07.2028	24.600	(5)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,600	31.07.2028	8.000	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,620	28.07.2028	4.200	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,636	28.07.2028	8.300	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,640	28.07.2028	1.700	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,650	28.07.2028	4.200	0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,660	04.04.2024	38.500	20	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,660	28.07.2028	4.200	0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,675	03.04.2024	92.600	48	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,701	31.03.2032	19.500	(17)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,730	06.04.2027	16.500	8	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,732	30.03.2032	8.200	(8)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,750	05.04.2024	39.700	20	0,00
Zahlung	UKRPI	4,000	15.09.2031	£ 300	(45)	(0,01)
Zahlung	UKRPI	4,020	15.10.2031	400	(57)	(0,01)
Zahlung	UKRPI	4,055	15.09.2031	400	(59)	(0,01)
Zahlung	UKRPI	4,066	15.09.2031	600	(78)	(0,02)
Zahlung	UKRPI	4,140	15.10.2031	1.000	(128)	(0,03)
Zahlung	UKRPI	4,250	15.11.2031	900	(90)	(0,02)
Zahlung	UKRPI	4,400	15.10.2031	400	(41)	(0,01)
					\$ 6.420	1,43
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ 7.057	1,57

(1) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

VERKAUFSOPTIONEN

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-		Nennbetrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Marktwert	% des Netto- vermögens
				kurs	Verfallsdatum				
BOA	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,288 %	19.01.2024	100	\$ 0	\$ 0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,738	19.01.2024	100	0	0	0,00
BPS	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,494	08.01.2024	100	0	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,545	16.01.2024	200	(1)	(3)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,994	08.01.2024	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,995	16.01.2024	200	(1)	0	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)	(5)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,235	22.01.2024	200	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,685	22.01.2024	200	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,310	18.01.2024	100	0	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,590	05.01.2024	200	(1)	(2)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,700	18.01.2024	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,960	05.01.2024	200	(1)	0	0,00
FAR	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,688	02.04.2024	600	(5)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,688	02.04.2024	600	(5)	(10)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,781	05.04.2024	1.000	(8)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,781	05.04.2024	1.000	(8)	(15)	(0,01)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,273	16.01.2024	200	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,489	08.01.2024	200	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,550	16.01.2024	100	0	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,723	16.01.2024	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,989	08.01.2024	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,000	16.01.2024	100	0	0	0,00
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,697	02.04.2024	1.200	(9)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,697	02.04.2024	1.200	(9)	(19)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,721	08.04.2024	600	(5)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,721	08.04.2024	600	(5)	(9)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,215	22.01.2024	200	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,285	19.01.2024	100	0	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300	16.01.2024	200	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,560	05.01.2024	200	(1)	(2)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,594	05.01.2024	200	(1)	(3)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,648	04.01.2024	200	(1)	(3)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,665	22.01.2024	200	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,735	19.01.2024	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	16.01.2024	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,010	05.01.2024	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,044	05.01.2024	200	(1)	0	0,00
GST	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,440	08.01.2024	300	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,860	08.01.2024	300	(1)	0	0,00
JPM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,170	29.01.2024	100	0	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,205	22.01.2024	100	0	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	18.01.2024	100	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,600	12.01.2024	100	0	(2)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,620	29.01.2024	100	0	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,655	22.01.2024	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	18.01.2024	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,050	12.01.2024	100	0	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,490	12.01.2024	200	(1)	(2)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,650	04.01.2024	200	(1)	(3)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,890	12.01.2024	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,030	04.01.2024	200	(1)	0	0,00
MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,455	08.01.2024	200	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,475	08.01.2024	100	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,600	12.01.2024	100	0	(2)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,670	04.01.2024	200	(1)	(4)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,955	08.01.2024	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,975	08.01.2024	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,050	12.01.2024	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,120	04.01.2024	200	(1)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,330	15.01.2024	200	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,740	15.01.2024	200	(1)	0	0,00
UAG	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,344	18.01.2024	100	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,744	18.01.2024	100	(1)	0	0,00
							\$ (95)	\$ (100)	(0,02)

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-	Verfallsdatum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-	% des Netto-
BOA	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 5,000 % fällig am 01.01.2054	\$ 97,891	09.01.2024	500	\$ (2)	\$ (6)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 6,000 % fällig am 01.02.2054	101,094	06.02.2024	500	(2)	(4)	0,00
JPM	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 6,000 % fällig am 01.02.2054	99,227	06.02.2024	500	(3)	0	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 6,000 % fällig am 01.02.2054	101,227	06.02.2024	500	(2)	(4)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Strategic Income Fund (Forts.)

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfallsdatum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens
SAL	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.02.2054	\$ 95,813	06.02.2024	500	\$ (3)	\$ (2)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.02.2054	97,813	06.02.2024	500	(2)	(3)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 5,000 % fällig am 01.01.2054	96,453	09.01.2024	500	(3)	0	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 5,000 % fällig am 01.01.2054	98,469	09.01.2024	500	(2)	(3)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 5,000 % fällig am 01.01.2054	99,906	09.01.2024	500	(1)	0	0,00
					\$ (20)	\$ (22)	0,00

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nennbetrag ⁽²⁾	Gezahlte/ (erhaltene) Abschluss- prämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BOA	Turkey Government International Bond	1,000 %	20.12.2024	\$ 100	\$ (11)	\$ 11	\$ 0	0,00
BPS	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	200	(18)	17	(1)	0,00
BRC	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2026	300	(14)	16	2	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2024	400	(36)	38	2	0,00
CBK	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	940	(110)	114	4	0,00
	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	2	4	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	100	(4)	4	0	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	700	(11)	14	3	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	100	(10)	10	0	0,00
GST	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2024	600	(9)	13	4	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	100	(4)	4	0	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	100	(9)	8	(1)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	800	(7)	14	7	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2028	300	(3)	5	2	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2024	400	(36)	38	2	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	900	(101)	105	4	0,00
HUS	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2024	300	(9)	10	1	0,00
JPM	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2026	300	(2)	7	5	0,00
MYC	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	200	(7)	7	0	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	200	(18)	17	(1)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	600	(5)	10	5	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	15	18	0,01
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2027	400	(1)	7	6	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2028	300	(6)	9	3	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2028	1.300	(14)	21	7	0,01
					\$ (452)	\$ 534	\$ 82	0,02

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nennbetrag ⁽²⁾	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BOA	ABX.HE.AAA.6-2 Index	0,110 %	25.05.2046	\$ 296	\$ (70)	\$ 58	\$ (12)	0,00
DUB	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	400	(6)	6	0	0,00
	CMBX.NA.AAA.7 Index	0,500	17.01.2047	3	0	0	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	6.850	15	(16)	(1)	0,00
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	7.300	(38)	26	(12)	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	8.682	(340)	345	5	0,00
	CMBX.NA.AAA.9 Index	0,500	17.09.2058	298	(12)	12	0	0,00
MEI	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	500	(4)	2	(2)	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	595	(47)	48	1	0,00
MYC	ABX.HE.AAA.6-2 Index	0,110	25.05.2046	469	(111)	93	(18)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	500	(4)	2	(2)	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	(17)	0	0,00
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	1.200	6	(8)	(2)	0,00
	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	300	0	(1)	(1)	0,00
	CMBX.NA.AAA.9 Index	0,500	17.09.2058	15.379	15	(6)	9	0,00
UAG	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500	17.10.2057	100	(6)	6	0	0,00
					\$ (602)	\$ 567	\$ (35)	(0,01)

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermogens
AZD	01.2024	AUD 623	\$ 412	\$ 0	\$ (13)	\$ (13)	0,00
	03.2024	CNH 6.769	939	0	(17)	(17)	(0,01)
BOA	01.2024	AUD 623	412	0	(13)	(13)	0,00
	01.2024	£ 484	615	0	(2)	(2)	0,00
	01.2024	\$ 3.303	¥ 487.399	157	0	157	0,03
	02.2024	5	CNY 33	0	0	0	0,00
	03.2024	CNH 9.527	\$ 1.315	0	(30)	(30)	(0,01)
	03.2024	IDR 3.139.050	200	0	(4)	(4)	0,00
	06.2024	KRW 194.402	149	0	(2)	(2)	0,00
BPS	01.2024	€ 1.614	1.759	0	(25)	(25)	(0,01)
	01.2024	£ 1.936	2.455	0	(13)	(13)	0,00
	01.2024	HUF 22.766	65	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	KRW 65.689	50	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	\$ 851	€ 765	0	(6)	(6)	0,00
	01.2024	100	IDR 1.546.618	0	0	0	0,00
	01.2024	ZAR 3.013	\$ 163	0	(2)	(2)	0,00
	02.2024	TWD 41.394	1.300	0	(68)	(68)	(0,02)
	02.2024	\$ 6	CNY 45	0	0	0	0,00
	03.2024	CNH 6.593	\$ 916	0	(15)	(15)	0,00
	03.2024	TWD 11.774	374	0	(16)	(16)	0,00
	03.2024	\$ 552	IDR 8.484.876	0	(2)	(2)	0,00
	06.2024	KRW 741.640	\$ 568	0	(10)	(10)	0,00
BRC	01.2024	129.230	100	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 403	TRY 12.121	2	(1)	1	0,00
	01.2024	99	ZAR 1.849	2	0	2	0,00
	02.2024	TRY 26	\$ 1	0	0	0	0,00
	02.2024	\$ 451	TRY 13.761	1	(2)	(1)	0,00
	03.2024	50	IDR 776.911	0	0	0	0,00
	03.2024	681	TRY 21.380	0	(6)	(6)	0,00
	04.2024	865	27.868	0	(12)	(12)	0,00
CBK	06.2024	KRW 764.439	\$ 586	0	(9)	(9)	0,00
	01.2024	BRL 56.131	11.528	0	(27)	(27)	(0,01)
	01.2024	HUF 2.741	8	0	0	0	0,00
	01.2024	IDR 1.542.854	100	0	0	0	0,00
	01.2024	MXN 23.799	1.342	0	(57)	(57)	(0,01)
	01.2024	\$ 227	€ 210	6	0	6	0,00
	01.2024	107	MXN 1.920	6	0	6	0,00
	01.2024	ZAR 36.392	\$ 1.914	0	(74)	(74)	(0,02)
	03.2024	\$ 100	IDR 1.543.250	0	0	0	0,00
	04.2024	11.528	BRL 56.699	48	0	48	0,01
DUB	01.2024	KRW 64.985	\$ 50	0	0	0	0,00
	03.2024	CNH 5.980	830	0	(15)	(15)	0,00
	06.2024	KRW 826.424	635	0	(8)	(8)	0,00
GLM	01.2024	CAD 11.291	8.311	0	(253)	(253)	(0,06)
	01.2024	¥ 46.600	318	0	(13)	(13)	0,00
	01.2024	\$ 11.149	BRL 56.163	414	0	414	0,09
	01.2024	828	CAD 1.122	23	0	23	0,01
	01.2024	1.991	MXN 34.928	62	0	62	0,01
	01.2024	392	TRY 11.960	4	0	4	0,00
	01.2024	ZAR 949	\$ 50	0	(2)	(2)	0,00
	03.2024	CNH 2.948	409	0	(8)	(8)	0,00
	03.2024	\$ 513	IDR 7.875.210	0	(2)	(2)	0,00
	03.2024	133	TRY 4.187	0	(1)	(1)	0,00
JPM	01.2024	HUF 118.893	\$ 339	0	(5)	(5)	0,00
	01.2024	\$ 100	IDR 1.538.700	0	0	0	0,00
	01.2024	50	KRW 64.807	0	0	0	0,00
	02.2024	TRY 920	\$ 30	0	0	0	0,00
	02.2024	TWD 4.001	125	0	(7)	(7)	0,00
	02.2024	\$ 737	BRL 3.612	6	0	6	0,00
	02.2024	3.252	INR 271.694	5	0	5	0,00
	03.2024	IDR 9.577.217	\$ 618	0	(3)	(3)	0,00
	03.2024	TWD 83.963	2.701	0	(81)	(81)	(0,02)
	06.2024	KRW 1.197.643	922	0	(11)	(11)	0,00
MBC	01.2024	€ 1.691	1.838	0	(31)	(31)	(0,01)
	01.2024	£ 88	111	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	HUF 24.087	68	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	ZAR 843	44	0	(2)	(2)	0,00
	03.2024	TWD 405	13	0	(1)	(1)	0,00
	03.2024	\$ 301	TRY 9.393	0	0	0	0,00
MYI	01.2024	€ 25.307	\$ 27.816	1	(147)	(146)	(0,03)
	01.2024	HUF 7.143	20	0	0	0	0,00
	01.2024	MXN 1.218	70	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	TRY 50	2	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 303	€ 273	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	1.256	¥ 185.146	58	0	58	0,01
	01.2024	329	ZAR 6.042	1	0	1	0,00
	02.2024	5	CNY 34	0	0	0	0,00
	02.2024	2	TRY 52	0	0	0	0,00
	03.2024	CNH 6.459	\$ 896	0	(17)	(17)	(0,01)
	03.2024	IDR 1.964.749	128	0	0	0	0,00
	03.2024	\$ 1.486	IDR 22.873.309	1	(4)	(3)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Strategic Income Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermogens
RBC	06.2024	KRW 483.813	\$ 372	\$ 0	\$ (5)	\$ (5)	0,00
SCX	04.2024	\$ 3	MXN 51	0	0	0	0,00
	01.2024	ZAR 8.876	\$ 468	0	(17)	(17)	0,00
	03.2024	CNH 6.341	876	0	(20)	(20)	(0,01)
	03.2024	IDR 1.577.776	100	0	(2)	(2)	0,00
	03.2024	TWD 8.965	284	0	(13)	(13)	0,00
	03.2024	\$ 471	IDR 7.284.202	3	(2)	1	0,00
SOG	03.2024	TWD 4.324	\$ 137	0	(6)	(6)	0,00
SSB	01.2024	\$ 187	CLP 164.907	2	0	2	0,00
TOR	01.2024	\$ 2.076	¥ 304.474	85	0	85	0,02
	03.2024	CNH 3.067	\$ 425	0	(8)	(8)	0,00
	03.2024	IDR 780.507	49	0	(1)	(1)	0,00
UAG	01.2024	£ 9.836	12.447	0	(91)	(91)	(0,02)
	01.2024	MXN 2.664	150	0	(6)	(6)	0,00
	01.2024	TRY 1.815	62	0	0	0	0,00
	01.2024	ZAR 1.983	104	0	(4)	(4)	0,00
	02.2024	\$ 62	TRY 1.872	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 887	\$ (1.219)	\$ (332)	(0,07)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2023 standen fur die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) ausschuttend II, Class T EUR (Hedged) thesaurierend und Class T EUR (Hedged) ausschuttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermogens
AZD	01.2024	AUD 2.293	\$ 1.518	\$ 0	\$ (46)	\$ (46)	(0,01)
BOA	01.2024	£ 127	161	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	¥ 525.415	3.560	0	(169)	(169)	(0,04)
BPS	01.2024	DKK 900	133	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	€ 2.688	2.939	2	(33)	(31)	(0,01)
	01.2024	£ 484	614	0	(3)	(3)	0,00
	01.2024	INR 55.636	667	0	(2)	(2)	0,00
	01.2024	¥ 327.307	2.232	0	(91)	(91)	(0,02)
	01.2024	\$ 14.713	€ 13.484	186	0	186	0,04
BRC	01.2024	1	CHF 0	0	0	0	0,00
	01.2024	102.687	€ 93.370	478	0	478	0,11
CBK	01.2024	€ 1.637	\$ 1.801	2	(10)	(8)	0,00
	01.2024	KRW 1.228.103	954	7	7	0	0,00
	01.2024	NOK 677	63	0	(3)	(3)	0,00
	01.2024	SEK 28	3	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 727	BRL 3.591	12	0	12	0,00
	01.2024	0	DKK 1	0	0	0	0,00
	01.2024	143	€ 131	1	0	1	0,00
	01.2024	448	MXN 7.597	0	0	0	0,00
	01.2024	0	NOK 1	0	0	0	0,00
	01.2024	ZAR 212	\$ 11	0	0	0	0,00
	02.2024	BRL 3.606	727	0	(14)	(14)	0,00
	02.2024	MXN 7.597	446	0	0	0	0,00
DUB	01.2024	SGD 79	60	0	0	0	0,00
FAR	01.2024	BRL 2	0	0	0	0	0,00
	02.2024	\$ 0	BRL 2	0	0	0	0,00
GLM	01.2024	CHF 6.268	\$ 7.153	0	(298)	(298)	(0,07)
	01.2024	CNY 2.902	411	1	0	1	0,00
	01.2024	ILS 687	184	0	(6)	(6)	0,00
	01.2024	MYR 1.754	377	0	(5)	(5)	0,00
	01.2024	\$ 378	MYR 1.754	4	0	4	0,00
	02.2024	MYR 1.754	\$ 378	0	(5)	(5)	0,00
JPM	01.2024	BRL 3.590	737	0	(2)	(2)	0,00
	01.2024	SGD 9	7	0	0	0	0,00
MBC	01.2024	AUD 1.423	944	0	(28)	(28)	(0,01)
	01.2024	CAD 2.746	2.029	0	(54)	(54)	(0,01)
	01.2024	€ 841	911	0	(18)	(18)	0,00
	01.2024	MXN 7.597	442	0	(7)	(7)	0,00
	01.2024	\$ 234	€ 213	2	0	2	0,00
MYI	01.2024	¥ 199.587	\$ 1.354	0	(63)	(63)	(0,02)
	01.2024	SGD 1.241	930	0	(11)	(11)	0,00
	01.2024	\$ 122.785	€ 111.712	645	0	645	0,13
SCX	01.2024	CNY 23	\$ 3	0	0	0	0,00
	01.2024	HKD 17.265	2.211	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	SEK 9.702	934	0	(29)	(29)	(0,01)
	01.2024	TWD 72.511	2.331	0	(48)	(48)	(0,01)
SOG	01.2024	IDR 8.120.471	522	0	(4)	(4)	0,00
SSB	01.2024	\$ 1	KRW 1.054	0	0	0	0,00
UAG	01.2024	AUD 869	\$ 577	0	(17)	(17)	0,00
	01.2024	DKK 1.194	175	0	(2)	(2)	0,00
	01.2024	£ 2.629	3.328	0	(24)	(24)	(0,01)
	01.2024	NOK 3.028	284	0	(14)	(14)	0,00
	01.2024	\$ 122.879	€ 111.712	552	0	552	0,12
	01.2024	ZAR 13.337	\$ 719	0	(10)	(10)	0,00
				\$ 1.892	\$ (1.019)	\$ 873	0,18

Zum 31. Dezember 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 Netto- vermögens
BOA	01.2024	AUD 3	\$ 2	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2024	¥ 347	2	0	0	0	0,00
	01.2024	TWD 5	0	0	0	0	0,00
BPS	01.2024	\$ 16	£ 13	0	0	0	0,00
	01.2024	DKK 0	\$ 0	0	0	0	0,00
	01.2024	€ 1	2	0	0	0	0,00
CBK	01.2024	INR 37	0	0	0	0	0,00
	01.2024	¥ 401	3	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	\$ 16	£ 12	0	0	0	0,00
FAR	01.2024	CAD 2	\$ 1	0	0	0	0,00
	01.2024	KRW 691	1	0	0	0	0,00
	01.2024	NOK 0	0	0	0	0	0,00
JPM	01.2024	SEK 0	0	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 1	BRL 3	0	0	0	0,00
	01.2024	ZAR 0	\$ 0	0	0	0	0,00
MYI	02.2024	BRL 3	1	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 0	BRL 0	0	0	0	0,00
	01.2024	BRL 3	\$ 1	0	0	0	0,00
RYL	01.2024	SGD 0	0	0	0	0	0,00
	01.2024	CHF 4	5	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	€ 5	6	0	0	0	0,00
SCX	01.2024	SGD 1	0	0	0	0	0,00
	01.2024	ILS 0	0	0	0	0	0,00
	01.2024	CNY 2	0	0	0	0	0,00
SOG	01.2024	HKD 12	2	0	0	0	0,00
	01.2024	MXN 8	0	0	0	0	0,00
	01.2024	SEK 6	1	0	0	0	0,00
SSB	01.2024	TWD 50	2	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 89	£ 71	1	0	1	0,00
	01.2024	IDR 4.814	\$ 0	0	0	0	0,00
UAG	01.2024	\$ 53	£ 42	1	0	1	0,00
	01.2024	0	KRW 1	0	0	0	0,00
	01.2024	DKK 1	\$ 0	0	0	0	0,00
	01.2024	NOK 2	0	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 90	£ 71	1	0	1	0,00
	01.2024	ZAR 9	\$ 0	0	0	0	0,00
				\$ 3	\$ (2)	\$ 1	0,00
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 467	0,10

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000\$)	MARKT- WERT (000\$)	% DES NETTO- VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Ginnie Mae, TBA 5,500 % fällig am 01.01.2054	\$ 2.000	\$ (2.015)	(0,45)
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.02.2054	10.600	(8.675)	(1,93)
4,500 % fällig am 01.03.2054	3.300	(3.200)	(0,71)
Summe leerverkaufte Wertpapiere		\$ (13.890)	(3,09)
Summe Anlagen		\$ 647.456	143,90
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (197.507)	(43,90)
Nettovermögen		\$ 449.949	100,00

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.

(b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(c) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(d) Nullkuponwertpapier.

(e) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(f) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(g) Mit dem Teilfonds verbunden.

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Strategic Income Fund (Forts.)

(h) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,64 %):

Emittentenbeschreibung	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
AMSURG Corp.	6.11.2023	\$ 2.204	\$ 2.706	0,60
Intelsat Emergence S.A.	19.06.17 – 23.02.22	5.147	1.565	0,35
Morgan Stanley 0,000 % fällig am 02.04.2032	11.02.2020	616	425	0,09
Neiman Marcus Group Ltd. LLC	25.09.2020	278	1.295	0,29
		\$ 8.245	\$ 5.991	1,33

(i) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 33.030 (31. Dezember 2022: USD null) waren zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte verpfändet.

(j) Ein Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 1.021 (31. Dezember 2022: USD null) war zum 31. Dezember 2023 als Sicherheit für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte verpfändet oder geliefert.

Barmittel in Höhe von USD 8.742 (31. Dezember 2022: USD 10.994) waren zum 31. Dezember 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 164 (31. Dezember 2022: USD 376) waren zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten für Finanzderivate gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 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	\$ 77.266	\$ 570.339	\$ 7.139	\$ 654.744
Investmentfonds	179	0	0	179
Pensionsgeschäfte	0	605	0	605
Finanzderivate ⁽³⁾	(439)	6.287	(30)	5.818
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(13.890)	0	(13.890)
Summen	\$ 77.006	\$ 563.341	\$ 7.109	\$ 647.456

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	\$ 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⁾ Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

⁽²⁾ Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

⁽³⁾ Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
GRE	5,520 %	14.12.2023	04.01.2024	\$ (10.161)	\$ (10.189)	(2,27)
	5,520	18.12.2023	04.01.2024	(5.891)	(5.903)	(1,31)
	5,520	20.12.2023	04.01.2024	(13.081)	(13.105)	(2,91)
SCX	5,750	28.12.2023	04.01.2024	(3.926)	(3.928)	(0,87)
Summe umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (33.125)	(7,36)

Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	% des Nettovermögens
TDM	5,530 %	19.12.2023	02.01.2024	\$ (1.035)	\$ (1.037)	(0,23)
Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte					\$ (1.037)	(0,23)

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement ⁽¹⁾
AZD	\$ (76)	\$ 0	\$ (76)	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ k. A.
BOA	(86)	60	(26)	(103)	0	(103)
BOM	k. A.	k. A.	k. A.	(10)	0	(10)
BPS	(107)	10	(97)	12	0	12
BRC	461	(1.010)	(549)	(125)	0	(125)
CBK	(100)	0	(100)	3.416	(3.380)	36
DUB	(23)	0	(23)	(14)	0	(14)
FAR	(28)	0	(28)	(25)	0	(25)
GLM	(124)	0	(124)	(221)	81	(140)
GST	9	0	9	(156)	191	35
HUS	1	0	1	17	0	17
JPM	(106)	0	(106)	67	0	67
MBC	(141)	0	(141)	2.861	(2.480)	381
MEI	(1)	0	(1)	(4)	0	(4)
MYC	10	94	104	(63)	94	31
MYI	456	(1.000)	(544)	(71)	(96)	(167)
RBC	k. A.	k. A.	k. A.	21	0	21
SAL	(2)	0	(2)	(26)	0	(26)
SCX	(128)	0	(128)	3.628	(3.470)	158
SOG	(10)	0	(10)	(53)	0	(53)
SSB	3	0	3	11	0	11
TOR	76	0	76	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	383	(990)	(607)	(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. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	68,71	59,01
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	76,18	59,05
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,64	2,47
Investmentfonds	0,04	5,86
Pensionsgeschäfte	0,13	0,15
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,38)	0,10
Zentral abgerechnete Finanzderivate	1,57	1,34
Freiverkehrsfinanzderivate	0,10	1,80
Leerverkaufte Wertpapiere	(3,09)	(2,58)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(7,36)	k. A.
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(0,23)	k. A.

* Gemäß der Liste der Märkte, die die Kriterien für einen geregelten OGAW-Markt erfüllen, in Anlage 1 zum Verkaufsprospekt.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	0,96	1,83
Unternehmensanleihen und Wechsel	13,58	14,21
Wandelanleihen & Wechsel	0,00	k. A.
Kommunalanleihen und Wechsel	0,07	0,08
US-Regierungsbehörden	44,18	31,14
US-Schatzobligationen	19,83	14,89
Non-Agency-MBS	8,07	5,69
Forderungsbesicherte Wertpapiere	22,35	16,75
Staatsemissionen	5,62	4,32
Stammaktien	24,64	24,18
Bezugsrechte	k. A.	0,02
Optionsscheine	0,00	0,01
Vorzugswertpapiere	0,60	0,42
Real Estate Investment Trusts	5,48	5,31
Kurzfristige Instrumente	0,15	1,68
Investmentfonds	0,04	5,86
Pensionsgeschäfte	0,13	0,15
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,38)	0,10
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	k. A.	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,01	0,01
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,13	0,21
Zinsswaps	1,43	1,12

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Strategic Income Fund (Forts.)

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	(0,02)	(0,09)
Optionen auf Wertpapiere	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,02	(0,05)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	(0,01)	(0,02)
Total Return Swaps auf Indizes	k. A.	0,00
Devisenterminkontrakte	(0,07)	0,05
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,18	1,91
Leerverkaufte Wertpapiere	(3,09)	(2,58)
Sonstige Aktiva und Passiva	(43,90)	(27,20)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS			
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE														
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL														
BANKEN UND FINANZEN														
AerCap Ireland Capital DAC	2,875 % fällig am 14.08.2024	\$ 4.400	4,318	0,10	CTP NV	0,500 % fällig am 21.06.2025	€ 1.400	\$ 1.458	0,03	Kookmin Bank	4,500 % fällig am 01.02.2029 (g)	\$ 7.400	7,104	0,16
6,100 % fällig am 15.01.2027	5,300	5,416	0,12	0,875 % fällig am 20.01.2026	10,200	10,455	0,24	LeasePlan Corp. NV	0,250 % fällig am 23.02.2026	€ 15,000	15,448	0,35		
AIB Group PLC	2,250 % fällig am 04.04.2028	€ 4,400	4,665	0,11	1,500 % fällig am 27.09.2031	4,700	4,055	0,09	Lendlease Finance Ltd.	3,400 % fällig am 27.10.2027	AUD 24,900	15,462	0,35	
2,875 % fällig am 30.05.2031	8,800	9,332	0,21	Danske Bank A/S	6,500 % fällig am 23.08.2028	£ 5,000	6,717	0,15	3,700 % fällig am 31.03.2031	4,800	2,686	0,06		
7,583 % fällig am 14.10.2026	\$ 2,400	2,478	0,06	Deutsche Bank AG	1,000 % fällig am 19.11.2025	€ 600	645	0,01	Lloyds Banking Group PLC	4,375 % fällig am 22.03.2028	\$ 1,200	1,174	0,03	
Altarea S.C.A.	1,875 % fällig am 17.01.2028	€ 8,500	7,911	0,18	1,625 % fällig am 20.01.2027	7,400	7,687	0,17	Logicor Financing SARL	1,625 % fällig am 15.07.2027	€ 1,100	1,119	0,03	
American Honda Finance Corp.	5,000 % fällig am 23.05.2025	\$ 800	803	0,02	1,750 % fällig am 19.11.2030	14,200	13,657	0,31	2,000 % fällig am 17.01.2034 (h)	11,600	10,055	0,23		
6,034 % fällig am 10.01.2025	8,600	8,609	0,19	1,875 % fällig am 23.02.2028	4,000	4,157	0,09	2,250 % fällig am 13.05.2025	2,000	2,142	0,05			
6,094 % fällig am 22.11.2024	6,300	6,311	0,14	2,625 % fällig am 16.12.2024	£ 9,000	11,125	0,25	3,250 % fällig am 13.11.2028	12,600	13,263	0,30			
Assicurazioni Generali SpA	2,429 % fällig am 14.07.2031	€ 1,800	1,744	0,04	3,961 % fällig am 26.11.2025	\$ 6,800	6,690	0,15	MassMutual Global Funding	5,050 % fällig am 07.12.2027	\$ 7,100	7,190	0,16	
Assured Guaranty U.S. Holdings, Inc.	6,125 % fällig am 15.09.2028	\$ 2,100	2,207	0,05	Digital Dutch Finco BV	0,625 % fällig am 15.07.2025	€ 4,600	4,817	0,11	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	1,412 % fällig am 17.07.2025	11,200	10,572	0,24
Aviation Capital Group LLC	4,125 % fällig am 01.08.2025	9,080	8,820	0,20	1,000 % fällig am 15.01.2032	1,000	882	0,02	4,636 % fällig am 07.06.2031	€ 1,000	1,168	0,03		
6,250 % fällig am 15.04.2028	100	102	0,00	Digital Euro Finco LLC	2,500 % fällig am 16.01.2026	6,100	6,567	0,15	5,719 % fällig am 20.02.2026	\$ 6,600	6,630	0,15		
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	6,750 % fällig am 05.09.2027	€ 11,200	12,955	0,29	DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank, Frankfurt am Main	4,637 % fällig am 16.11.2026	5,600	6,191	0,14	Mizuho Financial Group, Inc.	5,414 % fällig am 13.09.2028	8,800	8,924	0,20
Banco de Sabadell S.A.	0,875 % fällig am 16.06.2028	6,300	6,288	0,14	EQT AB	2,375 % fällig am 06.04.2028	10,000	10,453	0,24	Morgan Stanley	2,720 % fällig am 22.07.2025	5,000	4,918	0,11
Banco Santander S.A.	6,527 % fällig am 07.11.2027	\$ 4,000	4,139	0,09	2,875 % fällig am 06.04.2032	7,400	7,311	0,17	5,050 % fällig am 28.01.2027	6,000	6,008	0,14		
Bank of America Corp.	1,197 % fällig am 24.10.2026	15,000	13,939	0,32	Equitable Financial Life Global Funding	5,450 % fällig am 03.03.2028	\$ 4,900	4,921	0,11	Morgan Stanley Bank N.A.	5,882 % fällig am 30.10.2026	5,300	5,452	0,12
5,933 % fällig am 15.09.2027	10,700	10,923	0,25	Europäische Investitionsbank	0,750 % fällig am 15.11.2024	£ 9,700	11,940	0,27	Nationwide Building Society	6,557 % fällig am 18.10.2027	8,200	8,493	0,19	
Bank of Ireland Group PLC	0,375 % fällig am 10.05.2027	€ 12,300	12,642	0,29	Federation des Caisses Desjardins du Quebec	4,400 % fällig am 23.08.2025	\$ 11,000	10,867	0,25	NatWest Group PLC	0,750 % fällig am 15.11.2025	€ 15,000	16,115	0,36
Bank of Montreal	5,203 % fällig am 01.02.2028	\$ 5,400	5,505	0,12	5,700 % fällig am 14.03.2028	6,600	6,797	0,15	0,780 % fällig am 26.02.2030	10,000	9,531	0,22		
Banque Federative du Credit Mutuel S.A.	5,896 % fällig am 13.07.2026	3,100	3,167	0,07	Ford Motor Credit Co. LLC	1,744 % fällig am 19.07.2024	€ 7,600	8,279	0,19	NE Property BV	1,875 % fällig am 09.10.2026	10,700	10,822	0,25
Barclays PLC	1,700 % fällig am 03.11.2026	£ 5,400	6,443	0,15	2,748 % fällig am 14.06.2024	£ 4,600	5,786	0,13	3,375 % fällig am 14.07.2027	5,800	6,065	0,14		
2,852 % fällig am 07.05.2026	\$ 2,400	2,315	0,05	7,350 % fällig am 04.11.2027	\$ 1,000	1,055	0,02	New Immo Holding S.A.	2,750 % fällig am 26.11.2026 (h)	8,800	8,943	0,20		
7,285 % fällig am 13.09.2027	6,900	6,925	0,16	G City Europe Ltd.	4,250 % fällig am 11.09.2025	€ 11,600	11,803	0,27	Nomura Holdings, Inc.	2,172 % fällig am 14.07.2028	\$ 800	703	0,02	
BGC Group, Inc.	8,000 % fällig am 25.05.2028	4,200	4,389	0,10	Gaci First Investment Co.	5,125 % fällig am 14.02.2053	\$ 9,600	8,718	0,20	2,679 % fällig am 16.07.2030	7,300	6,227	0,14	
BNP Paribas S.A.	2,219 % fällig am 09.06.2026	10,500	10,029	0,23	Globalworth Real Estate Investments Ltd.	2,950 % fällig am 29.07.2026	€ 7,100	6,473	0,15	5,709 % fällig am 09.01.2026	8,300	8,379	0,19	
BPCE S.A.	6,612 % fällig am 19.10.2027	9,500	9,784	0,22	GLP Capital LP	4,000 % fällig am 15.01.2030	\$ 2,600	2,375	0,05	5,842 % fällig am 18.01.2028	7,500	7,665	0,17	
CaixaBank S.A.	0,750 % fällig am 26.05.2028	€ 2,100	2,116	0,05	5,300 % fällig am 15.01.2029	2,000	1,990	0,05	6,181 % fällig am 18.01.2033	4,000	4,289	0,10		
6,684 % fällig am 13.09.2027	\$ 6,900	7,078	0,16	Goldman Sachs Group, Inc.	1,948 % fällig am 21.10.2027	4,800	4,393	0,10	OneMain Finance Corp.	6,875 % fällig am 15.03.2025	800	810	0,02	
Castellum AB	0,750 % fällig am 04.09.2026 (h)	€ 9,700	9,710	0,22	3,272 % fällig am 29.09.2025	6,000	5,899	0,13	Pacific Life Global Funding	5,500 % fällig am 18.07.2028	6,000	6,142	0,14	
CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund	0,500 % fällig am 27.01.2028	13,300	13,012	0,29	Golub Capital BDC, Inc.	7,050 % fällig am 05.12.2028	5,800	6,086	0,14	Prologis International Funding S.A.	1,625 % fällig am 17.06.2032	€ 1,000	931	0,02
0,900 % fällig am 12.10.2029	7,600	6,993	0,16	Goodman HK Finance	4,375 % fällig am 19.06.2024	5,045	5,007	0,11	Royal Bank of Canada	4,900 % fällig am 12.01.2028	\$ 4,700	4,754	0,11	
Citibank N.A.	5,803 % fällig am 29.09.2028	\$ 2,800	2,925	0,07	Goodman U.S. Finance Four LLC	4,500 % fällig am 15.10.2037	6,900	5,902	0,13	Sagax AB	1,125 % fällig am 30.01.2027	€ 11,700	11,648	0,26
5,864 % fällig am 29.09.2025	3,200	3,254	0,07	GSPA Monetization Trust	6,422 % fällig am 09.10.2029	9,383	9,113	0,21	Santander UK Group Holdings PLC	2,421 % fällig am 17.01.2029	£ 800	912	0,02	
Citigroup, Inc.	1,250 % fällig am 06.07.2026	€ 5,000	5,320	0,12	Host Hotels & Resorts LP	4,500 % fällig am 01.02.2026	7,800	7,658	0,17	7,482 % fällig am 29.08.2029	1,500	2,081	0,05	
3,070 % fällig am 24.02.2028	\$ 7,400	6,976	0,16	HSBC Holdings PLC	7,390 % fällig am 03.11.2028	6,300	6,755	0,15	Societe Generale S.A.	1,488 % fällig am 14.12.2026	\$ 14,100	12,989	0,29	
Citycon Treasury BV	1,625 % fällig am 12.03.2028	€ 15,000	13,290	0,30	HSBC USA, Inc.	5,625 % fällig am 17.03.2025	8,100	8,145	0,18	4,677 % fällig am 15.06.2027	6,700	6,641	0,15	
Clarion Funding PLC	1,250 % fällig am 13.11.2032	£ 2,400	2,311	0,05	Indian Railway Finance Corp. Ltd.	3,835 % fällig am 13.12.2027	3,300	3,159	0,07	6,446 % fällig am 10.01.2029	700	725	0,02	
Cooperatieve Rabobank UA	4,655 % fällig am 22.08.2028	\$ 10,500	10,349	0,23	ING Groep NV	1,125 % fällig am 07.12.2028	£ 9,100	10,196	0,23	Standard Chartered PLC	0,800 % fällig am 17.11.2029	€ 3,600	3,465	0,08
5,500 % fällig am 18.07.2025	2,200	2,225	0,05	2,125 % fällig am 23.05.2026	€ 4,200	4,541	0,10	1,456 % fällig am 14.01.2027	\$ 15,800	14,483	0,33			
Corebridge Global Funding	5,750 % fällig am 02.07.2026	2,500	2,534	0,06	International Development Association	0,750 % fällig am 21.09.2028	£ 11,000	12,272	0,28	7,776 % fällig am 16.11.2025	1,700	1,733	0,04	
CPI Property Group S.A.	1,750 % fällig am 14.01.2030	€ 6,100	3,851	0,09	1,750 % fällig am 05.05.2037	€ 11,100	10,815	0,24	Starwood Property Trust, Inc.	3,750 % fällig am 31.12.2024	1,200	1,178	0,03	
2,750 % fällig am 12.05.2026	6,900	6,382	0,14	Intesa Sanpaolo SpA	0,750 % fällig am 16.03.2028	10,200	10,154	0,23	4,375 % fällig am 15.01.2027	800	755	0,02		
2,750 % fällig am 22.01.2028	£ 400	359	0,01	Jackson National Life Global Funding	6,586 % fällig am 28.06.2024	\$ 6,600	6,614	0,15	Stifel Financial Corp.	4,000 % fällig am 15.05.2030	12,900	11,714	0,27	
				JPMorgan Chase & Co.	4,851 % fällig am 25.07.2028	9,700	9,708	0,22	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	1,902 % fällig am 17.09.2028	2,500	2,190	0,05	
				5,299 % fällig am 24.07.2029	8,600	8,732	0,20	5,520 % fällig am 13.01.2028	5,200	5,325	0,12			
				6,070 % fällig am 22.10.2027	8,200	8,439	0,19	5,880 % fällig am 13.07.2026	6,600	6,751	0,15			
				KBC Group NV	0,250 % fällig am 01.03.2027	€ 3,000	\$ 3,102	0,07	Tesco Property Finance PLC	5,744 % fällig am 13.04.2040	£ 4,188	5,400	0,12	
				0,375 % fällig am 16.06.2027	3,200	3,297	0,07							

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Total Return Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
4,088 % fällig am 25.04.2034	\$ 159	\$ 141	0,00	5,500 % fällig am 25.01.2037	\$ 8	\$ 19	0,00	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust			
4,746 % fällig am 25.07.2034	6	5	0,00	HarborView Mortgage Loan Trust				3,440 % fällig am 25.02.2036	\$ 761	\$ 665	0,02
4,815 % fällig am 25.11.2030	1	1	0,00	5,730 % fällig am 19.03.2037	3,074	2,732	0,06	5,882 % fällig am 25.04.2034	1,096	1,083	0,03
5,308 % fällig am 25.04.2033	11	10	0,00	5,910 % fällig am 19.05.2035	157	143	0,00	5,926 % fällig am 25.09.2034	146	138	0,00
5,453 % fällig am 25.02.2034	62	57	0,00	IndyMac Adjustable Rate Mortgage Trust				Structured Asset Mortgage Investments Trust			
5,820 % fällig am 25.01.2034	137	135	0,00	5,545 % fällig am 25.01.2032	0	0	0,00	5,910 % fällig am 25.09.2047	9,967	8,586	0,19
5,877 % fällig am 25.12.2035	80	77	0,00	IndyMac Mortgage Loan Trust				5,950 % fällig am 19.04.2035	212	200	0,00
Bear Stearns ALT-A Trust				5,950 % fällig am 25.06.2037	969	882	0,02	5,970 % fällig am 19.07.2035	146	140	0,00
4,488 % fällig am 25.05.2035	353	334	0,01	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust				6,030 % fällig am 25.02.2036	409	336	0,01
4,730 % fällig am 25.09.2035	390	231	0,01	3,358 % fällig am 15.11.2048	7,166	7,008	0,16	6,050 % fällig am 19.05.2034	129	117	0,00
5,790 % fällig am 25.02.2034	40	38	0,00	JPMDB Commercial Mortgage Securities Trust				6,130 % fällig am 19.09.2032	15	15	0,00
Benchmark Mortgage Trust				2,994 % fällig am 15.12.2049	7,119	6,850	0,16	6,320 % fällig am 25.05.2047	7,278	5,873	0,13
3,666 % fällig am 15.01.2051	11.100	10.388	0,24	JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust				Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust			
3,965 % fällig am 10.04.2051	5.454	5.317	0,12	6,619 % fällig am 15.06.2035	10,951	9,797	0,22	7,500 % fällig am 25.10.2036	637	384	0,01
Citigroup Commercial Mortgage Trust				JPMorgan Mortgage Trust				Structured Asset Securities Corp. Mortgage Pass-Through Certificates			
3,251 % fällig am 10.05.2035	7.853	7.419	0,17	4,538 % fällig am 25.07.2035	115	108	0,00	7,323 % fällig am 25.06.2033	2	2	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust				5,750 % fällig am 25.01.2036	337	157	0,00	Thornburg Mortgage Securities Trust			
4,523 % fällig am 25.09.2037	92	81	0,00	Landmark Mortgage Securities PLC				3,875 % fällig am 25.09.2037	2,438	2,360	0,05
7,780 % fällig am 25.10.2035	31	30	0,00	5,620 % fällig am 17.04.2044	£ 6,068	7,532	0,17	6,815 % fällig am 25.06.2047	1,846	1,555	0,04
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				Lehman XS Trust				Towd Point Mortgage Funding PLC			
7,198 % fällig am 25.09.2035	841	839	0,02	5,830 % fällig am 25.12.2036	\$ 3,663	3,509	0,08	6,365 % fällig am 20.10.2051	£ 8,268	10,551	0,24
Commercial Mortgage Trust				5,870 % fällig am 25.03.2047	10,467	8,937	0,20	6,571 % fällig am 20.07.2045	16,545	21,150	0,48
3,144 % fällig am 10.03.2048	2,168	2,145	0,05	London Wall Mortgage Capital PLC				Tower Bridge Funding PLC			
3,545 % fällig am 10.02.2036	11,300	10,554	0,24	6,020 % fällig am 15.05.2052	£ 1,090	1,383	0,03	6,000 % fällig am 20.11.2063	3,955	5,031	0,11
3,590 % fällig am 10.11.2047	12,200	11,946	0,27	MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust				Trinity Square PLC			
Countrywide Alternative Loan Trust				4,889 % fällig am 25.01.2036	\$ 7	7	0,00	6,070 % fällig am 15.07.2059	9,332	11,896	0,27
3,810 % fällig am 25.11.2035	6,634	6,167	0,14	5,386 % fällig am 21.11.2034	1,572	1,478	0,03	Tudor Rose Mortgages			
5,500 % fällig am 25.02.2036	2,787	2,192	0,05	MASTR Reperforming Loan Trust				5,820 % fällig am 20.06.2048	412	522	0,01
5,500 % fällig am 25.05.2036	1,781	1,466	0,03	7,000 % fällig am 25.05.2035	515	360	0,01	Twin Bridges PLC			
5,750 % fällig am 25.02.2037	3,195	1,697	0,04	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				6,470 % fällig am 12.12.2054	2,776	3,544	0,08
6,000 % fällig am 25.02.2036	4,659	2,726	0,06	4,340 % fällig am 25.02.2035	645	614	0,01	Uropa Securities PLC			
6,000 % fällig am 25.04.2036	187	91	0,00	4,407 % fällig am 25.06.2035	283	269	0,01	5,540 % fällig am 10.10.2040	454	561	0,01
6,000 % fällig am 25.08.2036	5,828	3,703	0,08	5,970 % fällig am 25.11.2035	211	197	0,01	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
6,000 % fällig am 25.11.2036	252	139	0,00	Mettlife Securitization Trust				3,374 % fällig am 25.01.2037	\$ 3,826	3,352	0,08
6,000 % fällig am 25.08.2037	3,748	2,404	0,05	3,750 % fällig am 25.03.2057	5,969	5,704	0,13	3,787 % fällig am 25.02.2037	611	556	0,01
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				Mortgage Equity Conversion Asset Trust				4,238 % fällig am 25.09.2036	948	839	0,02
4,125 % fällig am 19.07.2031	0	0	0,00	5,340 % fällig am 25.05.2042	2,832	2,713	0,06	6,010 % fällig am 25.07.2045	304	285	0,01
4,587 % fällig am 20.10.2035	1,141	1,132	0,03	MortgageIT Trust				6,050 % fällig am 25.10.2045	2,868	2,729	0,06
4,765 % fällig am 25.11.2034	338	307	0,01	6,030 % fällig am 25.10.2035	571	555	0,01	6,090 % fällig am 25.01.2045	124	120	0,00
5,003 % fällig am 20.02.2035	81	80	0,00	NAAC Reperforming Loan REMIC Trust				6,110 % fällig am 25.01.2045	1,494	1,405	0,03
5,870 % fällig am 25.04.2046	782	728	0,02	7,000 % fällig am 25.10.2034	425	380	0,01	Warwick Finance Residential Mortgages PLC			
6,000 % fällig am 25.07.2037	250	118	0,00	7,500 % fällig am 25.03.2034	553	498	0,01	0,000 % fällig am			
7,884 % fällig am 20.02.2036	45	39	0,00	NAAC Reperforming Loan REMIC Trust Certificates				21.12.2049 (b)	£ 0	1,629	0,04
Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust				6,500 % fällig am 25.02.2035	1,782	1,494	0,03	6,170 % fällig am 21.12.2049	8,117	10,375	0,24
4,415 % fällig am 25.01.2034	14	12	0,00	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust				6,870 % fällig am 21.12.2049	2,030	2,566	0,06
5,810 % fällig am 25.06.2035	102	95	0,00	3,790 % fällig am 15.11.2032	8,000	6,792	0,15	7,370 % fällig am 21.12.2049	1,015	1,276	0,03
6,500 % fällig am 25.11.2034	21	20	0,00	New Residential Mortgage Loan Trust				7,870 % fällig am 21.12.2049	580	727	0,02
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.				3,500 % fällig am 25.12.2057	5,307	5,080	0,12	8,370 % fällig am 21.12.2049	580	714	0,02
4,631 % fällig am 25.06.2033	3	3	0,00	Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust				Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
Credit Suisse First Boston Mortgage-Backed Pass-Through Certificates				6,540 % fällig am 25.02.2035	362	352	0,01	5,500 % fällig am 25.05.2035	\$ 517	416	0,01
6,000 % fällig am 25.11.2035	2,322	625	0,01	Paragon Mortgages PLC				6,000 % fällig am 25.11.2035	456	379	0,01
Credit Suisse Mortgage Capital Certificates				4,242 % fällig am 15.11.2038	€ 500	542	0,01	Washington Mutual MSC Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
3,500 % fällig am 26.04.2038	706	686	0,02	Precise Mortgage Funding PLC				3,770 % fällig am 25.02.2031	1	1	0,00
Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust				0,000 % fällig am							
5,750 % fällig am 25.04.2036	763	411	0,01	12.12.2055 (b)	£ 0	393	0,01				
6,000 % fällig am 25.05.2036	1,869	1,066	0,02	Prime Mortgage Trust							
6,000 % fällig am 25.04.2037	562	212	0,01	5,870 % fällig am 25.02.2034	\$ 59	55	0,00				
CSAIL Commercial Mortgage Trust				Primrose Residential DAC							
3,458 % fällig am 15.11.2050	4,600	4,199	0,10	4,626 % fällig am 24.03.2061	€ 11,685	12,868	0,29	FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
DBGS Mortgage Trust				Residential Accredited Loans, Inc. Trust				ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust			
6,254 % fällig am 15.06.2033	2,000	1,838	0,04	5,870 % fällig am 25.05.2037	\$ 2,328	1,662	0,04	5,590 % fällig am 25.10.2036	226	84	0,00
Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust				6,000 % fällig am 25.04.2036	2,467	1,948	0,04	5,790 % fällig am 25.08.2036	6,199	1,517	0,04
5,800 % fällig am 25.08.2037	2,435	1,928	0,04	Residential Asset Securitization Trust				Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates			
Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust				6,000 % fällig am 25.01.2037	2,468	860	0,02	6,175 % fällig am 25.01.2036	182	182	0,00
6,046 % fällig am 19.07.2044	9	8	0,00	6,500 % fällig am 25.09.2036	708	243	0,01	6,400 % fällig am 25.05.2035	2,523	2,488	0,06
Eurohome UK Mortgages PLC				Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust				6,490 % fällig am 25.10.2034	931	920	0,02
5,490 % fällig am 15.06.2044	£ 1,422	1,787	0,04	5,834 % fällig am 25.02.2036	120	106	0,00	6,580 % fällig am 25.03.2035	4,169	4,074	0,09
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust				Resloc UK PLC				Armada Euro CLO DAC			
6,000 % fällig am 25.06.2037	\$ 1,132	413	0,01	5,499 % fällig am 15.12.2043	£ 3,413	4,209	0,10	4,685 % fällig am 15.07.2031	€ 11,936	13,045	0,30
6,222 % fällig am 25.10.2034	77	73	0,00	Ripon Mortgages PLC				Asset-Backed Funding Certificates Trust			
GS Mortgage Securities Corp. Trust				5,920 % fällig am 28.08.2056	12,036	15,298	0,35	6,170 % fällig am 25.06.2034	\$ 89	87	0,00
6,593 % fällig am 15.07.2025	3,810	3,781	0,09	RMAC PLC				Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust			
GSR Mortgage Loan Trust				0,000 % fällig am 15.02.2047	10,700	13,685	0,31	4,120 % fällig am 25.12.2036	1,886	1,836	0,04
4,240 % fällig am 25.06.2034	51	48	0,00	RMAC Securities PLC				Atlas Senior Loan Fund Ltd.			
4,381 % fällig am 25.06.2034	18	17	0,00	5,769 % fällig am 12.06.2044	706	851	0,02	6,805 % fällig am 16.01.2030	7,013	7,004	0,16
4,630 % fällig am 25.01.2036	1,112	1,021	0,02	Stratton Mortgage Funding PLC				Avoca CLO DAC			
4,836 % fällig am 25.09.2035	1,369	1,287	0,03	6,121 % fällig am 20.07.2060	13,543	17,262	0,39	4,655 % fällig am 15.07.2030	€ 7,729	8,494	0,19
								4,785 % fällig am 15.10.2032	5,200	5,674	0,13

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Baring's CLO Ltd. 6,605 % fällig am 15.04.2031	\$ 12.517	\$ 12.505	0,28	Massachusetts Educational Financing Authority 6,590 % fällig am 25.04.2038	\$ 4	\$ 4	0,00	4,000 % fällig am 30.11.2028 (d)	101.366	5.854	0,13
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust 5,356 % fällig am 25.05.2035	106	105	0,00	Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust 6,720 % fällig am 25.10.2037	9.085	7.520	0,17	8,500 % fällig am 01.03.2029	188.000	10.847	0,25
5,383 % fällig am 25.12.2035	1.042	1.034	0,02	MF1 LLC 7,506 % fällig am 19.06.2037	11.300	11.287	0,26	8,500 % fällig am 31.05.2029	87.000	5.043	0,12
6,670 % fällig am 25.01.2045	80	80	0,00	Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust 5,650 % fällig am 25.05.2037	527	447	0,01	Ministeries van de Vlaamse Gemeenschap 0,875 % fällig am 21.03.2046	€ 10.000	\$ 6.851	0,16
Black Diamond CLO DAC 4,982 % fällig am 15.05.2032	€ 11.725	12.789	0,29	5,670 % fällig am 25.09.2036	946	334	0,01	Paraguay Government International Bond 4,950 % fällig am 28.04.2031	\$ 2.300	2.251	0,05
Blackrock European CLO DAC 4,585 % fällig am 15.10.2031	12.766	13.882	0,31	5,700 % fällig am 25.11.2036	923	526	0,01	Province of Ontario 1,850 % fällig am 01.02.2027	CAD 7.000	5.031	0,11
BlueMountain CLO Ltd. 6,854 % fällig am 22.10.2030	\$ 760	760	0,02	5,770 % fällig am 25.07.2036	7.623	2.848	0,07	Romania Government International Bond 3,000 % fällig am 27.02.2027	\$ 12.000	11.200	0,25
BlueMountain Fuji EUR CLO DAC 4,615 % fällig am 15.07.2030	€ 1.357	1.492	0,03	5,790 % fällig am 25.09.2036	7.615	3.257	0,07	United Kingdom Gilt 0,875 % fällig am 31.07.2033	£ 1.300	1.298	0,03
BNPP AM Euro CLO DAC 4,822 % fällig am 22.07.2032	12.000	13.084	0,30	6,175 % fällig am 25.01.2035	1.476	1.424	0,03				
Bosphorus CLO DAC 4,745 % fällig am 15.12.2030	163	178	0,00	New Century Home Equity Loan Trust 5,830 % fällig am 25.05.2036	41	41	0,00				
Bridgepoint CLO DAC 5,175 % fällig am 15.01.2034	1.000	1.097	0,03	6,190 % fällig am 25.10.2035	3.148	3.026	0,07				
Cairn CLO DAC 4,552 % fällig am 30.04.2031	12.302	13.431	0,30	OZLM Ltd. 6,744 % fällig am 17.04.2031	9.504	9.500	0,22				
Carlyle Euro CLO DAC 4,632 % fällig am 15.08.2030	7.811	8.551	0,19	6,902 % fällig am 30.10.2030	6.428	6.437	0,15				
Carrington Mortgage Loan Trust 6,460 % fällig am 25.06.2035	\$ 770	755	0,02	Palmer Square European Loan Funding DAC 4,685 % fällig am 15.10.2031	€ 10.167	11.053	0,25	KURZFRISTIGE INSTRUMENTE COMMERCIAL PAPER			
CIFC Funding Ltd. 6,844 % fällig am 16.11.2030	1.245	1.246	0,03	Palmerston Park CLO DAC 4,625 % fällig am 18.04.2030	4.187	4.604	0,10	AT+T, Inc. 5,700 % fällig am 19.03.2024	\$ 11.000	10.862	0,25
Citigroup Mortgage Loan Trust 5,790 % fällig am 25.09.2036	4.418	3.209	0,07	Purple Finance CLO DAC 4,756 % fällig am 25.01.2031	394	434	0,01	KURZFRISTIGE SCHULDTITEL			
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. 5,720 % fällig am 25.03.2037	1.791	1.473	0,03	Renaissance Home Equity Loan Trust 6,670 % fällig am 25.11.2034	\$ 127	111	0,00	BGC Group, Inc. 3,750 % fällig am 01.10.2024	1.195	1.168	0,03
Commonbond Student Loan Trust 6,320 % fällig am 25.05.2041	496	487	0,01	Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust 5,710 % fällig am 25.11.2036	5.807	1.661	0,04	UNGARISCHE SCHATZWECHSEL			
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 5,610 % fällig am 25.06.2047	1.609	1.449	0,03	5,750 % fällig am 25.05.2036	429	225	0,01	10,900 % fällig am 04.01.2024 (b)(c)	HUF 3.394.000	9.803	0,22
5,690 % fällig am 25.09.2037	1.033	1.053	0,02	Starwood Commercial Mortgage Trust 6,556 % fällig am 15.07.2038	4.362	4.316	0,10	Summe kurzfristige Instrumente		21.833	0,50
5,700 % fällig am 25.07.2037	1.000	849	0,02	Structured Asset Investment Loan Trust 5,850 % fällig am 25.03.2036	433	421	0,01	Summe übertragbare Wertpapiere	\$ 5.908.989	133,69	
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc. 6,325 % fällig am 25.08.2034	163	163	0,00	6,235 % fällig am 25.08.2035	443	425	0,01				
6,370 % fällig am 25.10.2034	795	780	0,02	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust 5,625 % fällig am 25.09.2036	6.976	4.331	0,10	AKTIEN			
Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC 5,749 % fällig am 25.05.2046	1.627	1.378	0,03	Texas Natural Gas Securitization Finance Corp. 5,102 % fällig am 01.04.2035	6.400	6.528	0,15	ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust 5,590 % fällig am 25.11.2036	114	51	0,00	Venture CLO Ltd. 6,777 % fällig am 20.01.2029	10.418	10.422	0,24	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (f)	981.265	11.079	0,25
CVC Cordatus Loan Fund DAC 4,555 % fällig am 15.09.2031	€ 12.945	14.084	0,32	WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust 5,830 % fällig am 25.04.2037	4.889	1.855	0,04	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - US Short-Term Fund (f)	9.858.709	99.770	2,25
FBR Securitization Trust 6,175 % fällig am 25.11.2035	\$ 4.180	4.077	0,09	Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust 6,470 % fällig am 25.10.2034	1.054	1.046	0,02	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)	4.067.603	40.532	0,92
First Franklin Mortgage Loan Trust 5,690 % fällig am 25.12.2037	3.751	3.542	0,08		341.773	7,73		Summe Investmentfonds	\$ 151.381	3,42	
6,145 % fällig am 25.03.2034	316	312	0,01	STAATSEMISSIONEN							
6,745 % fällig am 25.07.2034	444	436	0,01	Action Logement Services 0,500 % fällig am 30.10.2034	€ 7.600	6.458	0,15				
GE-WMC Mortgage Securities Trust 5,550 % fällig am 25.08.2036	33	14	0,00	Airport Authority Hong Kong 4,750 % fällig am 12.01.2028	\$ 1.300	1.315	0,03				
Griffith Park CLO DAC 4,704 % fällig am 21.11.2031	€ 11.949	12.991	0,29	4,875 % fällig am 12.01.2030	5.000	5.087	0,12				
GSAMP Trust 5,610 % fällig am 25.12.2036	\$ 11.907	6.261	0,14	Canada Government International Bond 2,250 % fällig am 01.12.2029	CAD 38.600	28.023	0,63				
5,710 % fällig am 25.01.2037	405	233	0,01	Development Bank of Japan, Inc. 0,010 % fällig am 15.10.2024	€ 6.600	7.090	0,16				
Harvest CLO DAC 4,815 % fällig am 15.01.2032	€ 13.700	14.941	0,34	0,875 % fällig am 10.10.2025	4.300	4.575	0,10				
Home Equity Asset Trust 6,070 % fällig am 25.07.2036	\$ 4.678	4.266	0,10	Europäische Union 0,000 % fällig am 04.10.2028 (b)	1.678	1.655	0,04				
6,505 % fällig am 25.08.2035	113	109	0,00	Hungary Government International Bond 1,750 % fällig am 05.06.2035	10.000	8.503	0,19				
HSI Asset Securitization Corp. Trust 6,010 % fällig am 25.12.2035	443	441	0,01	Israel Government International Bond 5,000 % fällig am 30.10.2026	4.000	4.522	0,10				
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust 5,905 % fällig am 25.05.2036	3.585	3.371	0,08	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,300 % fällig am 15.05.2028 (d)	44.554	49.199	1,11				
Jubilee CLO DAC 4,575 % fällig am 15.04.2030	€ 18.890	20.744	0,47	Japan Finance Organization for Municipalities 0,010 % fällig am 02.02.2028	9.900	9.792	0,22				
Madison Park Euro Funding DAC 4,715 % fällig am 15.01.2032	12.300	13.389	0,30	Korea Development Bank 6,069 % fällig am 23.10.2026	\$ 1.800	1.809	0,04				
Man GLG Euro CLO DAC 4,615 % fällig am 15.12.2031	10.249	11.193	0,25	Mexico Government International Bond 2,750 % fällig am 27.11.2031 (d)	MXN 185.093	9.651	0,22				
				3,000 % fällig am 03.12.2026 (d)	55.712	3.056	0,07				

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Total Return Bond Fund (Forts.)

PENSIONS-GESCHÄFTE

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensionsgeschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
FICC	2,600 %	29.12.2023	02.01.2024	\$ 732	U.S. Treasury Notes 4,875 % fällig am 30.11.2025	\$ (747)	\$ 732	\$ 732	0,02
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (747)	\$ 732	\$ 732	0,02

⁽¹⁾ Umfasst aufgelaufene Zinsen.

AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablaufmonat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month SOFR December Futures	Long	03.2024	70	\$ (325)	(0,01)
3-Month SOFR June Futures	Long	09.2024	1.833	2.953	0,07
3-Month SOFR September Futures	Short	12.2024	1.833	(3.511)	(0,08)
Canada Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2024	385	1.155	0,03
Euro-Bobl March Futures	Short	03.2024	1.490	(3.246)	(0,07)
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2024	1.425	(6.841)	(0,16)
Japan Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2024	79	(663)	(0,02)
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Long	03.2024	976	1.773	0,04
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2024	1.109	2.920	0,07
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2024	83	342	0,01
U.S. Treasury 10-Year Ultra March Futures	Short	03.2024	2.014	(10.409)	(0,24)
				\$ (15.852)	(0,36)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (15.852)	(0,36)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2024	\$ 12.400	\$ 39	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2025	4.600	132	0,01
Boeing Co.	1,000	20.12.2027	4.600	290	0,01
British Telecommunications PLC	1,000	20.06.2028	€ 6.500	82	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2024	€ 4.700	28	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2024	5.500	127	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2025	€ 14.500	2.720	0,06
T-Mobile USA, Inc.	5,000	20.06.2028	\$ 6.700	64	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2024	8.000	22	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2027	500	12	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2028	5.000	59	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2028	1.200	17	0,00
				\$ 3.592	0,08

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF⁽²⁾

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-35 5-Year Index	(5,000) %	20.12.2025	\$ 9.312	\$ 126	0,00
CDX.HY-36 5-Year Index	(5,000)	20.06.2026	5.238	160	0,00
CDX.HY-38 5-Year Index	(5,000)	20.06.2027	96.127	(9.030)	(0,20)
				\$ (8.744)	(0,20)

ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,900 %	15.03.2052	£ 8.400	\$ 4.281	0,10
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,250	20.03.2054	4.900	(816)	(0,02)
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,320	20.10.2033	1.700	190	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,500	20.03.2034	23.600	(2.414)	(0,06)
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,062	18.09.2026	¥ 3.550.000	(275)	(0,01)
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,063	19.09.2026	7.000	(1)	0,00
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,064	19.09.2026	877.000	(69)	0,00
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,380	18.06.2028	5.170.000	(407)	(0,01)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,500 %	15.03.2042	¥ 2.698.500	\$ 1.519	0,03
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,662	19.04.2042	260.000	174	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,705	31.10.2038	1.180.000	443	0,01
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,750	20.03.2038	436.000	104	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,750	20.12.2038	1.947.000	750	0,02
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,785	12.11.2038	600.000	216	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,800	22.10.2038	400.000	137	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,800	15.06.2052	4.070.000	4.118	0,09
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,730	24.02.2032	\$ 14.800	(2.203)	(0,05)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	21.12.2052	60.600	4.856	0,11
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,765	16.03.2032	45.000	(6.487)	(0,15)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,943	21.04.2032	14.800	(1.871)	(0,04)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,680	11.07.2032	31.600	(1.796)	(0,04)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,690	11.07.2032	31.600	(1.765)	(0,04)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,050	08.09.2029	6.800	(166)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,050	14.12.2052	9.570	555	0,01
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,156	10.03.2033	21.900	165	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,300	06.03.2033	5.100	(132)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,340	23.02.2030	7.100	(151)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,370	01.03.2033	6.100	(115)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,400	23.02.2033	4.100	(68)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,405	01.03.2033	4.800	(77)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,425	01.03.2033	4.800	(71)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,430	27.02.2033	6.300	(90)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,450	07.03.2033	9.400	(119)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,470	22.02.2030	8.600	(111)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.09.2025	122.300	(519)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,525	02.03.2030	3.300	(33)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,650	05.12.2024	68.600	(618)	(0,01)
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,684	03.01.2034	1.800	(25)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	21.06.2025	196.100	138	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	02.01.2034	1.900	(37)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,800	22.08.2030	1.900	30	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,810	02.01.2034	1.900	(47)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,842	26.12.2033	2.100	(56)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,854	29.12.2033	3.700	(104)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,900	30.08.2033	4.200	141	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,950	13.09.2033	7.600	294	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,950	19.12.2033	3.800	(136)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,030	15.12.2033	4.100	(173)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,600	17.07.2025	28.800	11	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	5,388	18.10.2024	76.500	(247)	(0,01)
Erhalt ⁽⁴⁾	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,500	01.06.2032	CAD 35.400	(832)	(0,02)
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,750	20.09.2025	191.700	1.859	0,04
Erhalt	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,750	20.12.2033	12.000	(469)	(0,01)
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	4,000	21.06.2025	298.000	2.813	0,06
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	4,750	14.07.2025	64.000	381	0,01
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	4,820	13.07.2025	25.600	179	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	3,750	15.06.2027	NZD 39.100	90	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	4,000	14.06.2024	115.900	(190)	(0,01)
Zahlung	3-Month NZD-BBR	4,250	21.12.2027	3.300	3	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	20.09.2033	AUD 10.900	348	0,01
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	20.03.2034	12.000	554	0,01
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	10.08.2024	€ 4.000	(133)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	12.04.2027	25.000	(1.616)	(0,04)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027	21.000	(1.042)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,580	24.05.2024	239.500	(886)	(0,02)
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	20.03.2054	35.000	(5.442)	(0,12)
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	2,760	03.01.2029	3.100	(46)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,880	19.12.2028	4.600	(93)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,890	22.12.2033	3.500	(119)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,910	29.12.2033	2.200	(81)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,920	13.12.2028	5.100	(111)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,950	29.12.2028	2.800	(69)	0,00
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.03.2034	94.700	7.222	0,16
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,063	06.12.2033	2.300	(115)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,128	04.12.2033	1.800	(100)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,148	20.11.2033	2.900	(166)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,179	29.11.2028	2.300	(78)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,255	22.11.2028	1.900	(71)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,280	22.11.2033	1.400	(98)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,305	27.11.2033	2.700	(196)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,865	24.11.2028	MXN 43.600	29	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,945	22.11.2028	121.000	103	0,00
					\$ (1.449)	(0,03)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ (6.601)	(0,15)

(1) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Total Return Bond Fund (Forts.)

- (2) Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rücklerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (3) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.
- (4) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

OPTIONSKAUF

DEIVENSOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfallsdatum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Kosten	Marktwert	% des Netto- vermögens
GLM	Put - OTC GBP versus USD	\$ 1,200	26.09.2024	11.100	\$ 367	\$ 117	0,00

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfallsdatum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Kosten	Marktwert	% des Netto- vermögens
BPS	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,050 %	28.05.2024	55.200	\$ 63	\$ 17	0,00
CBK	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,433	06.02.2024	23.200	123	222	0,01
FAR	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,600	13.12.2024	29.100	330	202	0,00
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,975	29.05.2024	55.200	61	21	0,00
MYC	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,443	06.02.2024	23.300	124	230	0,01
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,636	07.10.2024	39.000	702	1.782	0,04
							\$ 1.403	\$ 2.474	0,06

VERKAUFSOPTIONEN

DEIVENSOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfallsdatum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Marktwert	% des Netto- vermögens
GLM	Put - OTC GBP versus USD	\$ 1,100	26.09.2024	22.200	\$ (228)	\$ (50)	0,00

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfallsdatum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Marktwert	% des Netto- vermögens
BOA	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,288 %	19.01.2024	1.200	\$ (5)	\$ (5)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,738	19.01.2024	1.200	(5)	(2)	0,00
BPS	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	28.05.2024	27.600	(63)	(124)	(0,01)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,494	08.01.2024	1.900	(9)	(14)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,545	16.01.2024	3.800	(17)	(48)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,994	08.01.2024	1.900	(9)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,995	16.01.2024	3.800	(17)	(1)	0,00
CBK	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,235	22.01.2024	3.800	(16)	(12)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,685	22.01.2024	3.800	(16)	(11)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,310	18.01.2024	1.700	(7)	(5)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,590	05.01.2024	2.600	(10)	(29)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,700	18.01.2024	1.700	(7)	(5)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,960	05.01.2024	2.600	(10)	0	0,00
FAR	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,273	16.01.2024	2.100	(9)	(6)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,489	08.01.2024	2.100	(10)	(15)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,550	16.01.2024	2.100	(9)	(27)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,723	16.01.2024	2.100	(9)	(4)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,989	08.01.2024	2.100	(10)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,000	16.01.2024	2.100	(9)	(1)	0,00
GLM	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,195	29.05.2024	27.600	(61)	(102)	(0,01)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,215	22.01.2024	3.700	(15)	(11)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,285	19.01.2024	1.800	(7)	(7)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300	16.01.2024	3.800	(16)	(13)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,560	05.01.2024	3.700	(19)	(39)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,594	05.01.2024	3.700	(18)	(47)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,648	04.01.2024	3.600	(16)	(58)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,665	22.01.2024	3.700	(15)	(12)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,735	19.01.2024	1.800	(7)	(4)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	16.01.2024	3.800	(16)	(5)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,010	05.01.2024	3.700	(19)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,044	05.01.2024	3.700	(18)	0	0,00
GST	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,440	08.01.2024	4.300	(10)	(15)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,860	08.01.2024	4.300	(10)	0	0,00
JPM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,170	29.01.2024	2.000	(9)	(6)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,205	22.01.2024	2.000	(8)	(5)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	18.01.2024	2.100	(10)	(11)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,600	12.01.2024	2.100	(10)	(33)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,620	29.01.2024	2.000	(9)	(10)	0,00

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfallsdatum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens
MYC	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,655 %	22.01.2024	2.000	\$ (8)	\$ (7)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	18.01.2024	2.100	(10)	(4)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,050	12.01.2024	2.100	(10)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,490	12.01.2024	2.700	(11)	(21)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,650	04.01.2024	3.600	(13)	(57)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,890	12.01.2024	2.700	(11)	(2)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,030	04.01.2024	3.600	(13)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,455	08.01.2024	3.900	(19)	(22)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,475	08.01.2024	1.900	(9)	(12)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,600	12.01.2024	2.000	(9)	(32)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,670	04.01.2024	3.900	(18)	(70)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,955	08.01.2024	3.900	(19)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,975	08.01.2024	1.900	(9)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,050	12.01.2024	2.000	(9)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,120	04.01.2024	3.900	(18)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,330	15.01.2024	2.700	(11)	(7)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,740	15.01.2024	2.700	(11)	(5)	0,00
	UAG	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,344	18.01.2024	2.000	(10)	(10)
Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap		3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,744	18.01.2024	2.000	(10)	(4)	0,00
							\$ (768)	\$ (940)	(0,02)

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfallsdatum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BOA	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 6,000 % fällig am 01.02.2054	\$ 101,094	06.02.2024	4.400	\$ (17)	\$ (36)	0,00
SAL	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 5,000 % fällig am 01.01.2054	99,906	09.01.2024	3.300	(8)	(2)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 5,000 % fällig am 01.02.2054	99,070	06.02.2024	60.700	(247)	(452)	(0,01)
					\$ (272)	\$ (490)	(0,01)

(1) Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHÜTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatu m	Nennbetrag ⁽²⁾	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BPS	Colombia Government International Bond	1,000 %	20.06.2027	\$ 1.600	\$ (77)	\$ 78	\$ 1	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	400	(36)	34	(2)	0,00
BRC	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2026	2.325	(107)	123	16	0,00
CBK	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	700	(25)	26	1	0,00
GST	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	3.000	(112)	114	2	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	1.300	(116)	109	(7)	0,00
JPM	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2026	2.275	(104)	119	15	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	400	(15)	15	0	0,00
MYC	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	2.900	(104)	106	2	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	3.400	(303)	285	(18)	0,00
					\$ (999)	\$ 1.009	\$ 10	0,00

(1) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEWISENTERMIKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
AZD	01.2024	\$ 23.372	AUD 35.282	\$ 709	\$ 0	\$ 709	0,01
	03.2024	CNH 35.832	\$ 4.971	0	(90)	(90)	0,00
BOA	01.2024	£ 9.380	11.914	0	(44)	(44)	0,00
	01.2024	NZD 3.765	2.294	0	(90)	(90)	0,00
	01.2024	\$ 1.050	£ 830	8	0	8	0,00
	01.2024	3.144	¥ 463.938	149	0	149	0,00
	01.2024	101	MXN 1.723	0	0	0	0,00
	03.2024	CNH 50.433	\$ 6.963	0	(160)	(160)	(0,01)
	03.2024	IDR 17.657.165	1.123	0	(22)	(22)	0,00
	03.2024	\$ 122	IDR 1.900.838	1	0	1	0,00
	03.2024	4.272	INR 357.498	9	0	9	0,00
	06.2024	KRW 972.012	\$ 747	0	(9)	(9)	0,00
BPS	01.2024	€ 766.008	843.005	0	(3.361)	(3.361)	(0,08)
	01.2024	£ 35.980	45.636	0	(233)	(233)	(0,01)
	01.2024	HUF 15.174	43	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	KRW 328.445	250	0	(4)	(4)	0,00
	01.2024	MXN 8.068	440	0	(34)	(34)	0,00
	01.2024	\$ 16.138	BRL 78.972	119	0	119	0,00
	01.2024	9.311	CAD 12.645	280	0	280	0,01

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Total Return Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
	01.2024	\$ 1.334	€ 1.219	\$ 13	\$ 0	\$ 13	0,00
	01.2024	2	HUF 700	0	0	0	0,00
	01.2024	550	IDR 8.506.948	2	0	2	0,00
	01.2024	4	SGD 6	0	0	0	0,00
	01.2024	12.516	ZAR 232.028	155	0	155	0,00
	02.2024	TWD 317.548	\$ 9.975	0	(520)	(520)	(0,01)
	03.2024	CNH 34.902	4.850	0	(80)	(80)	0,00
	03.2024	TWD 319	10	0	0	0	0,00
	03.2024	\$ 53	CNH 380	1	0	1	0,00
	03.2024	1.916	IDR 29.408.408	0	(9)	(9)	0,00
	03.2024	14.846	INR 1.241.756	25	0	25	0,00
	03.2024	3.443	TWD 108.466	151	0	151	0,00
BRC	06.2024	KRW 4.109.207	\$ 3.145	0	(53)	(53)	0,00
	01.2024	710.765	550	1	0	1	0,00
	01.2024	MXN 4.623	262	0	(9)	(9)	0,00
	01.2024	\$ 1.036	CLP 896.903	0	(10)	(10)	0,00
	01.2024	1.648	€ 1.507	17	0	17	0,00
	01.2024	1.566	TRY 46.565	0	(4)	(4)	0,00
	01.2024	496	ZAR 9.243	8	0	8	0,00
	02.2024	469	TRY 14.296	0	(3)	(3)	0,00
	03.2024	400	IDR 6.215.333	3	0	3	0,00
	03.2024	9	THB 296	0	0	0	0,00
	03.2024	5.773	TRY 182.349	36	(26)	10	0,00
	04.2024	7.724	248.597	0	(110)	(110)	0,00
CBK	06.2024	KRW 4.235.523	\$ 3.245	0	(52)	(52)	0,00
	01.2024	BRL 65.614	13.476	0	(32)	(32)	0,00
	01.2024	CAD 349	257	0	(7)	(7)	0,00
	01.2024	£ 1.994	2.526	0	(16)	(16)	0,00
	01.2024	HUF 1.261.771	3.603	0	(43)	(43)	0,00
	01.2024	IDR 7.714.269	501	1	0	1	0,00
	01.2024	MXN 219.721	12.482	0	(434)	(434)	(0,01)
	01.2024	\$ 1.341	€ 1.243	33	0	33	0,00
	01.2024	2.913	£ 2.302	21	0	21	0,00
	01.2024	1.180	MXN 21.671	94	0	94	0,00
	01.2024	24	TRY 703	0	0	0	0,00
	01.2024	ZAR 10.073	\$ 534	0	(16)	(16)	0,00
	02.2024	\$ 5.356	BRL 27.102	214	0	214	0,00
	03.2024	PEN 20.271	\$ 5.383	0	(79)	(79)	0,00
	03.2024	\$ 501	IDR 7.716.248	0	(1)	(1)	0,00
	03.2024	248	ILS 902	3	0	3	0,00
	04.2024	13.476	BRL 66.278	56	0	56	0,00
DUB	01.2024	CAD 193	\$ 142	0	(4)	(4)	0,00
	01.2024	KRW 389.910	300	0	(1)	(1)	0,00
	03.2024	CNH 24.002	3.331	0	(59)	(59)	0,00
	03.2024	SGD 22.042	16.652	0	(117)	(117)	0,00
	03.2024	\$ 196	IDR 3.064.741	3	0	3	0,00
	06.2024	KRW 4.578.969	\$ 3.518	0	(47)	(47)	0,00
FAR	01.2024	BRL 15.408	3.161	0	(11)	(11)	0,00
	04.2024	\$ 3.161	BRL 15.566	17	0	17	0,00
GLM	01.2024	CAD 105.017	\$ 77.278	0	(2.375)	(2.375)	(0,05)
	01.2024	CHF 387	442	0	(18)	(18)	0,00
	01.2024	¥ 397.000	2.708	0	(110)	(110)	0,00
	01.2024	MXN 37.123	2.116	0	(66)	(66)	0,00
	01.2024	\$ 416	BRL 2.034	3	0	3	0,00
	01.2024	6.867	MXN 119.084	133	0	133	0,00
	01.2024	ZAR 5.698	\$ 299	0	(12)	(12)	0,00
	02.2024	\$ 24	TRY 727	0	0	0	0,00
	03.2024	CNH 15.606	\$ 2.163	0	(41)	(41)	0,00
	03.2024	\$ 3.966	IDR 61.073.918	0	(5)	(5)	0,00
	03.2024	678	TRY 21.318	0	(7)	(7)	0,00
JPM	01.2024	HUF 2.025.125	\$ 5.785	0	(67)	(67)	0,00
	01.2024	\$ 600	IDR 9.232.200	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	251	KRW 324.038	0	0	0	0,00
	02.2024	TWD 33.785	\$ 1.055	0	(62)	(62)	0,00
	02.2024	\$ 3.990	BRL 19.570	32	0	32	0,00
	02.2024	2.084	TRY 63.616	0	(11)	(11)	0,00
	03.2024	IDR 53.871.800	\$ 3.475	0	(18)	(18)	0,00
	03.2024	TWD 626.768	20.159	0	(609)	(609)	(0,02)
	03.2024	\$ 4.254	IDR 65.683.759	5	0	5	0,00
	03.2024	4.452	INR 372.188	5	0	5	0,00
	03.2024	56	SGD 74	0	0	0	0,00
MBC	06.2024	KRW 4.411.528	\$ 3.404	0	(30)	(30)	0,00
	01.2024	€ 32.348	35.227	0	(514)	(514)	(0,01)
	01.2024	£ 714	901	0	(9)	(9)	0,00
	01.2024	¥ 387.700	2.712	0	(40)	(40)	0,00
	01.2024	\$ 9.529	AUD 14.371	279	0	279	0,01
	01.2024	2.064	CAD 2.793	55	0	55	0,00
	03.2024	CNH 366	\$ 50	0	(1)	(1)	0,00
	03.2024	\$ 5.190	IDR 80.003.935	0	(2)	(2)	0,00
MYI	01.2024	CAD 324	\$ 242	0	(3)	(3)	0,00
	01.2024	€ 275	305	1	0	1	0,00
	01.2024	£ 69	88	0	0	0	0,00
	01.2024	HUF 80.222	228	0	(4)	(4)	0,00

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
	01.2024	SGD 157	\$ 119	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2024	\$ 250	€ 225	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	144	£ 113	0	0	0	0,00
	01.2024	1.195	¥ 176.234	55	0	55	0,00
	01.2024	152	ZAR 2.797	0	0	0	0,00
	03.2024	CNH 34.193	\$ 4.741	0	(88)	(88)	0,00
	03.2024	IDR 58.985.403	\$ 3.832	7	0	7	0,00
	03.2024	\$ 2.906	IDR 44.777.289	4	(6)	(2)	0,00
	03.2024	\$ 2.986	TRY 93.223	0	(36)	(36)	0,00
RBC	06.2024	KRW 2.675.721	\$ 2.057	0	(26)	(26)	0,00
	01.2024	\$ 6.840	MXN 117.338	58	0	58	0,00
SCX	04.2024	MXN 54	\$ 3	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 21	€ 19	0	0	0	0,00
	01.2024	1.061	¥ 152.500	22	0	22	0,00
	03.2024	CNH 33.569	\$ 4.637	0	(105)	(105)	0,00
	03.2024	HKD 18.049	\$ 2.315	0	0	0	0,00
	03.2024	IDR 8.618.561	\$ 549	0	(10)	(10)	0,00
	03.2024	\$ 1.402	IDR 21.836.187	17	(3)	14	0,00
	03.2024	\$ 9.689	INR 810.300	15	0	15	0,00
	03.2024	\$ 19.764	THB 683.133	384	0	384	0,01
	03.2024	\$ 1.865	TWD 58.883	86	0	86	0,00
	06.2024	KRW 2.184.243	\$ 1.683	0	(18)	(18)	0,00
SOG	03.2024	CZK 4.799	\$ 213	0	(1)	(1)	0,00
TOR	01.2024	\$ 1.976	¥ 289.818	81	0	81	0,00
	03.2024	CNH 16.235	\$ 2.249	0	(44)	(44)	0,00
	03.2024	IDR 7.818.923	\$ 496	0	(11)	(11)	0,00
UAG	01.2024	CAD 10.827	\$ 7.982	0	(230)	(230)	(0,01)
	01.2024	£ 194.303	\$ 245.895	0	(1.811)	(1.811)	(0,04)
	01.2024	MXN 34.767	\$ 1.964	0	(80)	(80)	0,00
	01.2024	\$ 7.708	AUD 11.617	221	0	221	0,01
	01.2024	\$ 2.924	ZAR 55.824	124	0	124	0,00
				\$ 3.716	\$ (12.266)	\$ (8.550)	(0,20)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2023 standen fur die Anteilsklasse Institutional CAD (Hedged) ausschuttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BRC	01.2024	\$ 2.666	CAD 3.625	\$ 84	\$ 0	\$ 84	0,00
GLM	01.2024	CAD 82	\$ 62	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 2.972	CAD 4.039	91	0	91	0,01
MBC	01.2024	414	560	11	0	11	0,00
MYI	01.2024	CAD 82	\$ 62	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 319	CAD 420	0	0	0	0,00
UAG	01.2024	2.994	4.061	86	0	86	0,00
				\$ 272	\$ 0	\$ 272	0,01

Zum 31. Dezember 2023 standen fur die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Investor CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BPS	01.2024	CHF 28	\$ 33	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	01.2024	\$ 55	CHF 47	1	0	1	0,00
BRC	01.2024	1.049	914	38	0	38	(0,01)
CBK	01.2024	CHF 395	\$ 454	0	(15)	(15)	(0,01)
	01.2024	\$ 6.719	CHF 5.853	238	0	238	0,01
GLM	01.2024	7.111	6.231	297	0	297	0,01
MYI	01.2024	7.202	6.286	271	0	271	0,01
SCX	01.2024	30	26	1	0	1	0,00
				\$ 846	\$ (16)	\$ 830	0,01

Zum 31. Dezember 2023 standen fur die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschuttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Administrative EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) ausschuttend, Class R EUR (Hedged) thesaurierend und Class T EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BPS	01.2024	€ 15.176	\$ 16.607	\$ 3	\$ (165)	\$ (162)	0,00
	01.2024	\$ 448.709	€ 408.086	2.187	0	2.187	0,05
BRC	01.2024	391.980	356.417	1.826	0	1.826	0,04
CBK	01.2024	€ 3.519	\$ 3.824	0	(64)	(64)	0,00
	01.2024	\$ 562	€ 521	14	0	14	0,00
MBC	01.2024	€ 2.138	\$ 2.333	0	(30)	(30)	0,00
	01.2024	\$ 354.939	€ 324.618	3.733	0	3.733	0,08
				\$ 7.763	\$ (259)	\$ 7.504	0,17

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Total Return Bond Fund (Forts.)

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2024	\$ 1.840	£ 1.452	\$ 11	\$ 0	\$ 11	0,00
BPS	01.2024	£ 0	\$ 0	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 1.847	£ 1.456	10	0	10	0,00
BRC	01.2024	29	23	0	0	0	0,00
CBK	01.2024	£ 14	\$ 18	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 3.316	£ 2.620	24	0	24	0,00
GLM	01.2024	13	10	0	0	0	0,00
MBC	01.2024	£ 103	\$ 131	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 62	£ 49	0	0	0	0,00
MYI	01.2024	£ 18	\$ 23	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 41	£ 32	0	0	0	0,00
SCX	01.2024	10.105	7.989	80	0	80	0,01
SSB	01.2024	6.346	5.029	65	0	65	0,00
UAG	01.2024	10.104	7.984	74	0	74	0,00
				\$ 264	\$ 0	\$ 264	0,01

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) thesaurierend, Administrative SGD (Hedged) ausschüttend und Class E SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
DUB	01.2024	\$ 9.112	SGD 12.113	\$ 73	\$ 0	\$ 73	0,00
GLM	01.2024	SGD 77	\$ 57	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	\$ 81	SGD 108	1	0	1	0,00
JPM	01.2024	2.190	2.921	25	0	25	0,00
MBC	01.2024	SGD 202	\$ 152	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	\$ 1.891	SGD 2.519	20	0	20	0,00
	02.2024	SGD 15	\$ 12	0	0	0	0,00
	02.2024	\$ 283	SGD 373	0	0	0	0,00
MYI	01.2024	8.294	11.063	96	0	96	0,01
	02.2024	15	20	0	0	0	0,00
TOR	01.2024	7.332	9.782	86	0	86	0,00
UAG	01.2024	641	852	5	0	5	0,00
				\$ 306	\$ (2)	\$ 304	0,01

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 1.745 0,04

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000\$)	MARKT-WERT (000\$)	% DES NETTO-VERMÖGENS
REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,000 % fällig am 01.01.2054	\$ 32.300	(26.405)	(0,60)
2,000 % fällig am 01.02.2054	9.600	(7.857)	(0,18)
Summe leerverkaufte Wertpapiere		\$ (34.262)	(0,78)
Summe Anlagen		\$ 6.006.132	135,88
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (1.586.081)	(35,88)
Nettovermögen		\$ 4.420.051	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

- Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
- Nullkuponwertpapier.
- Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- Mit dem Teilfonds verbunden.
- Bedingt wandelbares Wertpapier.
- Wertpapiere mit Gesamtmarktwert von USD 3.484 (31. Dezember 2022: USD 1.858) waren zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte verpfändet.

Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD null (31. Dezember 2022: USD 25.953) waren zum 31. Dezember 2023 gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.

Barmittel in Höhe von USD 35 (31. Dezember 2022: USD null) waren zum 31. Dezember 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheiten erhalten worden.

Barmittel in Höhe von USD 53.307 (31. Dezember 2022: USD 94.783) waren zum 31. Dezember 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 9.980 (31. Dezember 2022: USD 13.885) waren zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten für Finanzderivate gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 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)	Markt- wert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 5.907.673	\$ 1.316	\$ 5.908.989
Investmentfonds	151.381	0	0	151.381
Pensionsgeschäfte	0	732	0	732
Finanzderivate ⁽³⁾	(9.595)	(11.113)	0	(20.708)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(34.262)	0	(34.262)
Summen	\$ 141.786	\$ 5.863.030	\$ 1.316	\$ 6.006.132

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)	Markt- wert
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⁾ Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

⁽²⁾ Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

⁽³⁾ Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus Pensions- geschäften	% des Netto- vermögens
BRC	2,500 %	20.09.2023	TBD ⁽¹⁾	€ (464)	\$ (517)	(0,01)
	3,350	20.09.2023	TBD ⁽¹⁾	(1.283)	(1.430)	(0,03)
MBC	3,400	15.08.2023	TBD ⁽¹⁾	(1.161)	(1.299)	(0,03)
Summe umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (3.246)	(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 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
AZD	\$ 619	\$ (660)	\$ (41)	\$ (27)	\$ 0	\$ (27)
BOA	(190)	260	70	(167)	280	113
BPS	(1.685)	4.030	2.345	1.927	(1.740)	187
BRC	1.815	(3.920)	(2.105)	(182)	20	(162)
CBK	152	0	152	8.777	(8.710)	67
CLY	k. A.	k. A.	k. A.	4	0	4
DUB	(152)	0	(152)	374	(270)	104
FAR	155	0	155	1	0	1
GLM	(2.320)	2.510	190	(710)	600	(110)
GST	(20)	260	240	(273)	260	(13)
JPM	(872)	930	58	(176)	0	(176)
MBC	3.501	(5.220)	(1.719)	6.728	(6.220)	508
MYC	1.848	(2.000)	(152)	(550)	470	(80)
MYI	270	(320)	(50)	(406)	270	(136)
RBC	58	0	58	(4)	0	(4)
RYL	k. A.	k. A.	k. A.	1	0	1
SAL	(454)	550	96	(68)	0	(68)
SCX	469	(320)	149	(11.948)	11.385	(563)
SOG	(1)	0	(1)	(34)	0	(34)
SSB	65	0	65	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	112	0	112	(2)	600	598
UAG	(1.625)	1.440	(185)	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. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	57,73	66,92
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	75,96	47,33
Sonstige übertragbare Wertpapiere	k. A.	0,68
Investmentfonds	3,42	7,05
Pensionsgeschäfte	0,02	4,12
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,36)	0,86
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,15)	(0,84)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,04	0,08
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,78)	(1,65)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,07)	(0,04)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	k. A.	(1,85)

* Gemäß der Liste der Märkte, die die Kriterien für einen geregelten OGAW-Markt erfüllen, in Anlage 1 zum Verkaufsprospekt.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	40,66	36,37
Kommunalanleihen und Wechsel	0,40	0,28
US-Regierungsbehörden	53,46	37,34
US-Schatzobligationen	18,14	17,09
Non-Agency-MBS	8,52	9,41
Forderungsbesicherte Wertpapiere	7,73	9,66
Staatsemissionen	4,28	2,46
Kurzfristige Instrumente	0,50	2,32
Investmentfonds	3,42	7,05
Pensionsgeschäfte	0,02	4,12
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,36)	0,87
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	k. A.	(0,01)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen - Schutzkauf	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,08	0,07
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,20)	(0,12)
Zinsswaps	(0,03)	(0,79)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	0,00	k. A.
Zinsswapoptionen	0,06	0,07
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Devisenoptionen	0,00	k. A.
Zinsswapoptionen	(0,02)	(0,11)
Optionen auf Wertpapiere	(0,01)	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,00	(0,03)
Devisenterminkontrakte	(0,20)	(0,57)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,21	0,72
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,78)	(1,65)
Sonstige Aktiva und Passiva	(35,88)	(24,55)
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund

31. Dezember 2023

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE											
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL											
BANKEN UND FINANZEN											
AerCap Ireland Capital DAC 2,875 % fällig am 14.08.2024	\$ 1.000	\$ 981	0,41	5,546 % fällig am 15.12.2025	\$ 800	\$ 801	0,33	Chugoku Electric Power Co., Inc. 2,401 % fällig am 27.08.2024	\$ 1.000	\$ 978	0,41
3,150 % fällig am 15.02.2024	1.550	1.544	0,64	Lloyds Banking Group PLC 4,450 % fällig am 08.05.2025	400	396	0,17	Dominion Energy, Inc. 3,071 % fällig am 15.08.2024	2.800	2.755	1,15
Aozora Bank Ltd. 1,050 % fällig am 09.09.2024	1.800	1.742	0,73	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 3,837 % fällig am 17.04.2026	500	491	0,20	DTE Energy Co. 4,220 % fällig am 01.11.2024	2.000	1.978	0,82
5,900 % fällig am 02.03.2026	2.000	2.021	0,84	Nationwide Building Society 0,550 % fällig am 22.01.2024	600	598	0,25	Enel Finance International NV 2,650 % fällig am 10.09.2024	2.800	2.735	1,14
Aries Capital DAC 0,000 % fällig am 18.09.2030 (a)	14.885	15.638	6,51	NatWest Markets PLC 3,479 % fällig am 22.03.2025	342	335	0,14	Mississippi Power Co. 5,736 % fällig am 28.06.2024	275	275	0,11
Athene Global Funding 0,950 % fällig am 08.01.2024	2.500	2.498	1,04	Nissan Motor Acceptance Co. LLC 1,050 % fällig am 08.03.2024	400	396	0,17	NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 2,940 % fällig am 21.03.2024	300	298	0,12
Banco Santander S.A. 3,892 % fällig am 24.05.2024	1.200	1.192	0,50	6,282 % fällig am 08.03.2024	700	700	0,29	6,449 % fällig am 21.03.2024	500	500	0,21
Bank of America Corp. 5,834 % fällig am 14.06.2024	1.100	1.099	0,46	Nomura Holdings, Inc. 2,648 % fällig am 16.01.2025	3.800	3.689	1,54	Pacific Gas & Electric Co. 3,400 % fällig am 15.08.2024	2.000	1.967	0,82
6,053 % fällig am 04.02.2025	1.000	999	0,42	Pacific Life Global Funding 6,035 % fällig am 04.06.2026	1.200	1.190	0,50	Southern California Edison Co. 6,266 % fällig am 01.04.2024	1.389	1.389	0,58
Bank of Montreal 5,682 % fällig am 09.07.2024	175	175	0,07	Protective Life Global Funding 6,469 % fällig am 11.12.2024	1.025	1.029	0,43	Spire Missouri, Inc. 5,914 % fällig am 02.12.2024	2.800	2.797	1,16
Bank of Nova Scotia 5,767 % fällig am 31.07.2024	123	123	0,05	Public Storage Operating Co. 5,975 % fällig am 25.07.2025	200	201	0,08	Victoria Power Networks Finance Pty. Ltd. 4,898 % fällig am 23.08.2024 AUD	500	340	0,14
6,378 % fällig am 11.03.2024	500	500	0,21	Royal Bank of Canada 5,701 % fällig am 07.10.2024	215	215	0,09	Vodafone Group PLC 6,645 % fällig am 16.01.2024	\$ 500	500	0,21
Banque Federative du Credit Mutuel S.A. 2,375 % fällig am 21.11.2024	700	682	0,28	Societe Generale S.A. 3,875 % fällig am 28.03.2024	2.000	1.991	0,83			17.107	7,12
5,792 % fällig am 04.02.2025	1.000	995	0,41	Standard Chartered PLC 0,991 % fällig am 12.01.2025	500	499	0,21	Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		138.340	57,56
5,799 % fällig am 04.02.2025	1.000	995	0,41	6,325 % fällig am 23.11.2025	1.000	995	0,41				
Barclays PLC 3,932 % fällig am 07.05.2025	600	596	0,25	6,337 % fällig am 23.11.2025	200	199	0,08				
BNP Paribas S.A. 3,800 % fällig am 10.01.2024	2.833	2.832	1,18	UBS AG 5,845 % fällig am 09.08.2024	1.200	1.202	0,50				
4,705 % fällig am 10.01.2025	700	700	0,29	Wells Fargo & Co. 2,406 % fällig am 30.10.2025	3.000	2.919	1,21				
BPCE S.A. 4,000 % fällig am 15.04.2024	1.000	996	0,41			94.110	39,16				
Capital One Financial Corp. 6,746 % fällig am 09.05.2025	2.400	2.399	1,00	INDUSTRIEWERTE							
CK Hutchison International Ltd. 3,250 % fällig am 11.04.2024	1.000	995	0,41	Arrow Electronics, Inc. 3,250 % fällig am 08.09.2024	1.800	1.768	0,74				
CNH Industrial Capital LLC 4,200 % fällig am 15.01.2024	1.000	999	0,42	Ausgrid Finance Pty. Ltd. 3,750 % fällig am 30.10.2024 AUD	1.000	675	0,28				
Cooperatieve Rabobank UA 4,567 % fällig am 19.04.2024 AUD	500	341	0,14	Baxter International, Inc. 1,322 % fällig am 29.11.2024	\$ 1.800	1.734	0,72				
Credit Agricole S.A. 3,250 % fällig am 04.10.2024	\$ 400	393	0,16	5,853 % fällig am 29.11.2024	200	200	0,08				
Credit Suisse AG 3,625 % fällig am 09.09.2024	1.200	1.184	0,49	Boeing Co. 1,433 % fällig am 04.02.2024	2.700	2.689	1,12				
4,750 % fällig am 09.08.2024	200	199	0,08	Broadcom Corp. 3,625 % fällig am 15.01.2024	499	499	0,21				
Crown Castle, Inc. 3,200 % fällig am 01.09.2024	1.200	1.181	0,49	Charter Communications Operating LLC 4,500 % fällig am 01.02.2024	1.000	998	0,41				
Danske Bank A/S 5,375 % fällig am 12.01.2024	2.000	2.000	0,83	7,289 % fällig am 01.02.2024	1.700	1.700	0,71				
Deutsche Bank AG 0,898 % fällig am 28.05.2024 (d)	2.500	2.456	1,02	Dell International LLC 4,000 % fällig am 15.07.2024	355	352	0,15				
DNB Bank ASA 0,856 % fällig am 30.09.2025	3.000	2.898	1,21	Enbridge, Inc. 6,031 % fällig am 16.02.2024	215	215	0,09				
First Abu Dhabi Bank PJSC 5,483 % fällig am 18.02.2025 AUD	500	341	0,14	Energy Transfer LP 3,900 % fällig am 15.05.2024	2.000	1.985	0,83				
GA Global Funding Trust 6,727 % fällig am 11.04.2025	\$ 700	699	0,29	4,500 % fällig am 15.04.2024	1.500	1.495	0,62				
General Motors Financial Co., Inc. 3,950 % fällig am 13.04.2024	1.500	1.491	0,62	Haleon U.S. Capital LLC 3,024 % fällig am 24.03.2024	1.000	994	0,41				
6,177 % fällig am 08.03.2024	899	899	0,37	Hyundai Capital America 0,800 % fällig am 08.01.2024	2.000	1.999	0,83				
Goldman Sachs Group, Inc. 5,900 % fällig am 02.05.2024 AUD	1.300	888	0,37	Mitsubishi Corp. 3,375 % fällig am 23.07.2024	1.569	1.550	0,64				
Greenleaves Capital Designated Activity Co. 0,000 % fällig am 18.09.2030 (a)	\$ 14.885	15.638	6,51	NetApp, Inc. 3,300 % fällig am 29.09.2024	2.800	2.753	1,15				
HSBC Holdings PLC 3,803 % fällig am 11.03.2025	1.200	1.195	0,50	Penske Truck Leasing Co. LP 3,900 % fällig am 01.02.2024	3.000	2.994	1,25				
6,863 % fällig am 11.03.2025	800	801	0,33	Siemens Financieringsmaatschappij NV 5,848 % fällig am 11.03.2024	1.527	1.527	0,63				
ING Bank Australia Ltd. 4,000 % fällig am 26.05.2025 AUD	1.600	1.083	0,45	Westinghouse Air Brake Technologies Corp. 4,150 % fällig am 15.03.2024	1.000	996	0,41				
Jackson National Life Global Funding 6,586 % fällig am 28.06.2024	\$ 400	401	0,17			27.123	11,28				
JPMorgan Chase & Co. 0,969 % fällig am 23.06.2025	1.000	977	0,41	VERSORGUNGSUNTERNEHMEN							
				CenterPoint Energy, Inc. 6,046 % fällig am 13.05.2024	595	595	0,25				

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Madison Park Funding Ltd. 6,405 % fällig am 15.04.2029	\$ 186	\$ 185	0,08	PSP Capital, Inc. 5,652 % fällig am 03.03.2025	\$ 2.500	\$ 2.499	1,04	INVESTMENTFONDS		
Magnetite Ltd. 6,777 % fällig am 18.10.2031	2.400	2.401	1,00			4.533	1,89	ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN		
Nassau Ltd. 6,905 % fällig am 15.01.2030	1.237	1.238	0,51	KURZFRISTIGE INSTRUMENTE						
Oak Hill European Credit Partners DAC 4,733 % fällig am 20.10.2031	€ 299	327	0,14	COMMERCIAL PAPER						
SLM Private Credit Student Loan Trust 5,936 % fällig am 15.06.2039	\$ 335	323	0,13	Marathon Oil Corp. 6,050 % fällig am 03.01.2024	1.000	999	0,42	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short- Term Floating NAV Fund (c)	169.652	\$ 1.691 0,71
		13.441	5,59	VW Credit, Inc. 5,700 % fällig am 04.01.2024	1.600	1.599	0,66	BÖRSENGEHANDELTE FONDS		
						2.598	1,08	PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (c)	220.110	21.949 9,13
STAATSEMISSIONEN				UNGARISCHE SCHATZWECHSEL				Summe Investmentfonds	\$ 23.640	9,84
Israel Government International Bond 3,750 % fällig am 31.03.2024	ILS 100	28	0,01	10,900 % fällig am 04.01.2024 (a)(b) HUF 2.513.000		7.258	3,02			
Korea Development Bank 5,606 % fällig am 09.03.2024	\$ 2.000	2.006	0,84	Summe kurzfristige Instrumente		9.856	4,10			
				Summe übertragbare Wertpapiere		\$ 203.304	84,59			

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensionsgeschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
DEU	5,420 %	29.12.2023	02.01.2024	\$ 17.200	U.S. Treasury Bonds 2,375 % fällig am 15.11.2049	\$ (17.608)	\$ 17.200	\$ 17.210	7,15
SSB	2,600	29.12.2023	02.01.2024	1.266	U.S. Treasury Notes 0,250 % fällig am 31.07.2025	(1.291)	1.266	1.266	0,53
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (18.899)	\$ 18.466	\$ 18.476	7,68

(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	Ablaufmonat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month Euribor December Futures	Long	12.2024	93	\$ 184	0,08
3-Month Euribor June Futures	Long	06.2024	28	39	0,02
3-Month Euribor June Futures	Long	06.2025	64	30	0,01
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2025	228	(485)	(0,20)
3-Month SONIA Index June Futures	Long	09.2024	117	232	0,10
3-Month SONIA Index March Futures	Short	06.2024	20	32	0,01
Australia Government 3-Year Note March Futures	Long	03.2024	146	46	0,02
Australia Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2024	98	166	0,07
BIST 30 Index February Futures	Short	02.2024	274	(9)	0,00
CAC 40 Index January Futures	Long	01.2024	28	(13)	(0,01)
DAX Index March Futures	Long	03.2024	5	(7)	0,00
E-mini NASDAQ 100 Index March Futures	Long	03.2024	17	197	0,08
E-mini Russell 2000 Index March Futures	Long	03.2024	11	80	0,03
E-mini S&P 500 Index March Futures	Long	03.2024	7	49	0,02
Euro STOXX Bank March Futures	Long	03.2024	591	(40)	(0,02)
Euro-BTP Italy Government Bond March Futures	Long	03.2024	186	319	0,13
Euro-OAT France Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2024	5	21	0,01
FTSE 100 Index March Futures	Long	03.2024	27	60	0,02
FTSE China A50 Index January Futures	Short	01.2024	1.177	(336)	(0,14)
FTSE Taiwan Index January Futures	Long	01.2024	149	198	0,08
FTSE/JSE Index March Futures	Short	03.2024	127	(141)	(0,06)
FTSE/MIB Index March Futures	Long	03.2024	11	(7)	0,00
Hang Seng China Enterprises Index January Futures	Short	01.2024	162	(195)	(0,08)
IBEX 35 January Futures	Long	01.2024	22	(20)	(0,01)
MSCI Singapore Index January Futures	Short	01.2024	113	(115)	(0,05)
Nikkei 225 Index March Futures	Long	03.2024	22	23	0,01
OMXS30 Index January Futures	Long	01.2024	210	90	0,04
S&P CNX Nifty Index January Futures	Long	01.2024	167	108	0,04
S&P/Toronto Stock Exchange 60 March Futures	Long	03.2024	14	62	0,03
SPI 200 Index March Futures	Long	03.2024	64	175	0,07
Topix Index March Futures	Long	03.2024	28	24	0,01
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Long	03.2024	54	106	0,04
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2024	8	19	0,01
U.S. Treasury 10-Year Ultra March Futures	Short	03.2024	11	(35)	(0,01)
Volatility S&P 500 Index January Futures	Short	01.2024	183	210	0,09
VSTOXX Mini January Futures	Short	01.2024	548	40	0,02
WIG20 Index March Futures	Long	03.2024	380	48	0,02
				\$ 1.155	0,48
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 1.155	0,48

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-39 5-Year Index	1,000 %	20.06.2028	\$ 9.500	\$ 261	0,11
CDX.EM-40 5-Year Index	1,000	20.12.2028	12.800	222	0,09
CDX.HY-41 5-Year Index	5,000	20.12.2028	4.158	113	0,05
iTraxx Crossover 40 5-Year Index	5,000	20.12.2028	€ 2.900	142	0,06
				\$ 738	0,31

ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variablem Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,250 %	20.03.2054	£ 2.700	\$ (516)	(0,21)
Zahlung ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,500	20.03.2034	29.200	1.525	0,63
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	5,500	20.03.2026	37.200	(343)	(0,14)
Zahlung ⁽³⁾	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,500	20.03.2029	INR 2.454.500	(10)	0,00
Zahlung ⁽³⁾	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	1,000	21.03.2034	¥ 4.916.200	405	0,17
Erhalt ⁽³⁾	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	1,500	21.03.2054	591.300	(235)	(0,10)
Zahlung ⁽³⁾	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	2,750	20.03.2029	SGD 33.300	78	0,03
Zahlung ⁽³⁾	1-Day THB-THORON Compounded-OIS	2,500	20.03.2029	THB 509.685	(2)	0,00
Erhalt ⁽³⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,000	20.03.2054	\$ 1.700	(221)	(0,09)
Zahlung ⁽³⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,250	20.03.2029	1.200	26	0,01
Zahlung ⁽³⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,250	20.03.2034	23.200	808	0,34
Erhalt ⁽³⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.03.2026	72.500	(713)	(0,30)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,342	02.01.2025	BRL 14.100	(209)	(0,09)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,585	02.01.2025	10.300	(223)	(0,09)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,776	02.01.2025	3.300	(77)	(0,03)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,846	02.01.2025	11.400	(265)	(0,11)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,882	02.01.2025	3.000	(66)	(0,03)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,626	02.01.2025	5.500	116	0,05
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,636	02.01.2025	4.900	104	0,04
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,847	02.01.2025	16.800	410	0,17
Erhalt	1-Year BRL-CDI	7,018	02.01.2025	7.900	185	0,08
Erhalt	1-Year BRL-CDI	7,335	02.01.2025	20.000	427	0,18
Zahlung	1-Year BRL-CDI	7,724	02.01.2025	7.800	(161)	(0,07)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	7,741	02.01.2025	8.200	158	0,07
Erhalt	1-Year BRL-CDI	8,190	02.01.2025	14.600	264	0,11
Zahlung	1-Year BRL-CDI	8,557	02.01.2025	700	(11)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	8,741	02.01.2025	21.700	329	0,14
Erhalt	1-Year BRL-CDI	8,996	02.01.2025	10.900	149	0,06
Erhalt	1-Year BRL-CDI	9,537	02.01.2025	13.300	144	0,06
Erhalt	1-Year BRL-CDI	9,642	02.01.2025	4.500	44	0,02
Erhalt	1-Year BRL-CDI	9,870	02.01.2029	8.100	2	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,038	02.01.2029	21.600	7	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,276	02.01.2029	11.000	(8)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,317	02.01.2029	9.500	(28)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,321	04.01.2027	6.000	(32)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,471	04.01.2027	20.100	(62)	(0,03)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,512	02.01.2029	28.400	(58)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,567	02.01.2029	23.700	79	0,03
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,583	02.01.2029	32.900	(99)	(0,04)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,804	02.01.2029	30.000	(133)	(0,06)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,827	02.01.2025	10.500	(46)	(0,02)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,829	02.01.2029	12.900	(61)	(0,03)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,933	02.01.2029	46.400	265	0,11
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,060	02.01.2029	18.700	(117)	(0,05)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,071	04.01.2027	10.400	(11)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,099	04.01.2027	8.900	9	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,113	02.01.2029	15.500	63	0,03
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,140	02.01.2029	26.900	157	0,07
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,210	04.01.2027	17.900	31	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,272	04.01.2027	24.300	86	0,04
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,344	02.01.2029	22.800	162	0,07
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,383	04.01.2027	63.000	239	0,10
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,394	02.01.2029	24.000	177	0,07
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,459	04.01.2027	7.500	30	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,485	04.01.2027	37.800	(180)	(0,08)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,540	04.01.2027	25.100	285	0,12
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,630	04.01.2027	28.200	(159)	(0,07)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,660	04.01.2027	36.700	(264)	(0,11)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,695	02.01.2029	500	(5)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,696	04.01.2027	9.100	(45)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,872	02.01.2029	63.300	649	0,27
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,920	02.01.2025	66.400	132	0,06
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,952	04.01.2027	28.000	195	0,08
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,975	02.01.2029	17.600	192	0,08

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,976 %	04.01.2027	BRL 21.800	\$ (150)	(0,06)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,094	02.01.2029	89.700	1.041	0,43
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,115	04.01.2027	12.200	97	0,04
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,173	04.01.2027	6.000	(48)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,226	02.01.2029	19.900	247	0,10
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,228	04.01.2027	25.200	(238)	(0,10)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,299	04.01.2027	27.200	267	0,11
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,490	04.01.2027	7.900	(79)	(0,03)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,492	02.01.2029	16.600	226	0,09
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,597	02.01.2029	36.400	534	0,22
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,677	02.01.2029	34.000	514	0,21
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,753	04.01.2027	35.400	(411)	(0,17)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,779	04.01.2027	45.700	(555)	(0,23)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,806	04.01.2027	11.000	132	0,05
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,073	04.01.2027	35.600	(495)	(0,21)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,120	04.01.2027	47.200	(661)	(0,27)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,207	04.01.2027	27.200	(341)	(0,14)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,231	04.01.2027	34.700	(506)	(0,21)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	13,318	04.01.2027	9.600	143	0,06
Zahlung ⁽³⁾	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,250	20.03.2029	CAD 7.700	78	0,03
Erhalt ⁽³⁾	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,250	20.03.2034	16.300	(765)	(0,32)
Zahlung ⁽³⁾	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,250	20.03.2054	17.500	1.580	0,66
Erhalt ⁽³⁾	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,750	20.03.2026	38.500	(176)	(0,07)
Zahlung ⁽³⁾	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,250	20.03.2029	CNY 219.000	24	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	5,980	14.10.2026	COP 4.816.400	(81)	(0,03)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	6,950	04.02.2027	6.498.500	56	0,02
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,730	28.06.2028	15.146.400	14	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,830	13.12.2028	16.270.800	47	0,02
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,900	08.04.2027	4.251.300	(9)	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,960	01.09.2028	13.217.800	(114)	(0,05)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,040	09.08.2028	30.999.700	(128)	(0,05)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,070	14.11.2028	27.811.700	119	0,05
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,106	15.06.2028	22.329.600	104	0,04
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,128	10.11.2028	10.475.000	50	0,02
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,130	22.08.2028	6.457.600	(9)	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,188	15.11.2028	23.532.500	130	0,05
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,338	09.11.2028	15.447.500	106	0,04
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,494	27.05.2027	5.817.600	(25)	(0,01)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,588	11.04.2028	27.727.300	189	0,08
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,700	10.04.2028	5.318.200	42	0,02
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,750	27.03.2028	21.497.700	221	0,09
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,830	28.04.2028	19.856.000	(230)	(0,10)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,850	06.05.2027	6.000.000	(38)	(0,02)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,970	05.08.2027	8.528.200	71	0,03
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,970	08.02.2028	9.288.600	98	0,04
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,990	08.02.2028	22.636.600	242	0,10
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,992	08.02.2028	23.240.200	249	0,10
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,020	24.03.2028	33.052.700	418	0,17
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	499	0,21
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,160	20.05.2027	8.106.600	(75)	(0,03)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,190	13.10.2028	14.222.000	(211)	(0,09)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,260	10.10.2028	5.040.000	(78)	(0,03)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,370	02.10.2028	45.690.000	(747)	(0,31)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,650	11.10.2028	20.400.000	(400)	(0,17)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,050	09.09.2027	8.150.200	(153)	(0,06)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,210	18.11.2027	3.214.900	66	0,03
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,240	24.02.2028	72.000.000	(1.632)	(0,68)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,275	18.11.2027	6.380.400	135	0,06
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,390	30.09.2027	10.319.800	(225)	(0,09)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,420	21.11.2027	6.380.400	144	0,06
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,430	21.11.2027	6.563.400	148	0,06
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,443	21.11.2027	19.784.200	450	0,19
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,478	29.09.2027	10.549.600	(237)	(0,10)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,800	31.10.2027	32.387.900	(1.051)	(0,44)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,810	14.10.2027	5.776.200	(143)	(0,06)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,920	18.10.2027	2.950.700	(76)	(0,03)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,940	18.10.2027	5.920.600	(154)	(0,06)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	11,424	21.10.2027	13.833.600	419	0,17
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	11,450	21.10.2027	4.011.800	122	0,05
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	11,800	24.10.2027	33.238.700	(1.046)	(0,44)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	11,850	24.10.2027	1.323.300	45	0,02
Zahlung ⁽³⁾	3-Month HKD-HIBOR	3,500	20.03.2029	HKD 60.231	44	0,02
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,520	26.07.2026	ILS 24.300	(521)	(0,22)
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,601	05.07.2026	2.800	63	0,03
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,628	25.06.2026	5.600	(100)	(0,04)
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,692	13.09.2026	48.400	939	0,39
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,728	04.06.2026	4.100	(77)	(0,03)
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,730	21.05.2026	3.500	63	0,03
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,750	10.12.2026	34.100	(721)	(0,30)
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,900	07.10.2026	9.000	(185)	(0,08)
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,905	25.11.2026	8.100	(176)	(0,07)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,965 %	14.01.2027	ILS 10.600	\$ 205	0,09
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,040	28.10.2026	10.400	(210)	(0,09)
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	1,049	12.11.2026	12.000	228	0,09
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	1,105	21.01.2027	16.900	300	0,12
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	1,178	04.02.2027	13.800	232	0,10
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	2,183	06.05.2027	7.500	57	0,02
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	2,390	27.05.2027	11.400	65	0,03
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	2,666	18.07.2027	7.500	8	0,00
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	2,670	15.07.2027	34.800	(124)	(0,05)
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	2,825	10.06.2027	10.900	(13)	(0,01)
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	3,210	17.06.2027	1.900	5	0,00
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	3,260	18.11.2027	38.400	(69)	(0,03)
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	3,290	16.11.2027	25.363	(28)	(0,01)
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	3,440	24.11.2028	65.100	(39)	(0,02)
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	3,460	23.11.2028	25.000	16	0,01
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	3,515	22.11.2028	23.200	31	0,01
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	3,530	03.04.2028	69.500	404	0,17
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	3,590	31.03.2028	24.500	161	0,07
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	3,590	18.05.2028	14.100	(93)	(0,04)
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	3,619	05.01.2028	27.400	(258)	(0,11)
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	3,650	02.01.2028	18.900	(185)	(0,08)
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	3,670	30.12.2027	19.000	(191)	(0,08)
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	3,720	21.10.2027	72.900	(190)	(0,08)
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	3,770	18.10.2028	13.000	57	0,02
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	3,800	18.08.2028	20.200	(218)	(0,09)
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	3,915	19.10.2028	34.100	213	0,09
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	3,980	23.02.2028	8.600	(126)	(0,05)
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	4,030	24.02.2028	54.700	(974)	(0,41)
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	4,130	03.03.2028	30.000	374	0,16
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	4,460	02.10.2028	39.300	(501)	(0,21)
Zahlung ⁽³⁾	3-Month KRW-KORIBOR	3,250	20.03.2029	KRW 20.589.950	119	0,05
Zahlung ⁽³⁾	3-Month TWD-TAIBOR	1,500	20.03.2029	TWD 171.850	3	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	4,900	12.11.2025	ZAR 3.400	(11)	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	4,938	18.09.2025	7.000	23	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	(35)	(0,01)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	5,375	27.05.2025	7.800	(33)	(0,01)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	5,601	09.06.2026	31.050	(83)	(0,03)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	5,680	08.06.2026	41.150	(113)	(0,05)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	5,739	28.07.2026	72.100	(200)	(0,08)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	5,780	03.03.2026	36.600	82	0,03
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	5,860	23.06.2026	75.600	174	0,07
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	5,950	17.03.2026	1.200	2	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	5,980	22.09.2026	43.900	104	0,04
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	6,023	01.07.2026	28.100	64	0,03
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	6,200	22.04.2025	7.800	(45)	(0,02)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	6,231	29.09.2026	55.400	113	0,05
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	6,300	23.12.2026	30.900	(65)	(0,03)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	6,320	23.04.2025	5.600	(34)	(0,01)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	6,400	30.12.2026	33.600	(75)	(0,03)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	6,540	04.01.2027	37.100	(73)	(0,03)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	6,540	23.02.2027	64.600	(127)	(0,05)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	6,670	12.01.2027	73.700	131	0,05
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	6,690	04.11.2026	2.000	4	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	(31)	(0,01)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,049	09.03.2027	70.000	80	0,03
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,489	18.05.2027	112.100	(17)	(0,01)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,600	19.06.2024	7.100	53	0,02
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,705	10.01.2028	504.000	(211)	(0,09)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,710	06.05.2027	22.200	27	0,01
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,730	09.01.2028	119.300	(35)	(0,01)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,740	17.08.2027	63.300	(110)	(0,05)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,750	20.03.2024	9.180	(68)	(0,03)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,900	06.01.2028	119.300	6	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,055	14.11.2027	8.400	10	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,064	27.07.2027	21.200	(19)	(0,01)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,120	13.03.2028	99.500	(119)	(0,05)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,205	17.02.2028	241.300	(157)	(0,07)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,205	31.08.2028	89.600	(156)	(0,06)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,220	30.08.2028	109.400	61	0,03
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,220	31.08.2028	30.900	(57)	(0,02)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,250	22.11.2028	188.600	8	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,291	27.07.2028	47.900	35	0,01
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,305	27.07.2028	84.400	64	0,03
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,310	27.07.2028	47.900	37	0,02
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,330	27.07.2028	54.000	44	0,02
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,352	09.11.2028	248.400	127	0,05
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,355	03.11.2028	160.100	135	0,06
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,360	06.11.2028	104.400	83	0,03
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,370	20.07.2028	197.600	186	0,08
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,411	19.07.2028	160.300	162	0,07

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,430 %	23.02.2028	ZAR 152.700	\$ (167)	(0,07)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,465	23.02.2028	240.400	(280)	(0,12)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,500	17.10.2027	12.000	(17)	(0,01)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,510	25.04.2028	262.000	(328)	(0,14)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,550	23.08.2028	137.100	(175)	(0,07)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,560	25.04.2028	72.800	113	0,05
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,625	23.08.2028	115.300	(166)	(0,07)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,700	22.08.2028	115.200	(184)	(0,08)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,950	11.05.2028	67.000	(188)	(0,08)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	9,090	28.09.2028	64.300	(127)	(0,05)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	9,185	12.06.2028	150.700	250	0,10
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	9,350	18.05.2028	56.800	(139)	(0,06)
Erhalt ⁽³⁾	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,000	20.03.2026	AUD 108.800	(111)	(0,05)
Zahlung ⁽³⁾	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	20.03.2034	23.900	121	0,05
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	4,649	20.12.2028	CLP 4.292.400	(11)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	4,899	11.12.2028	8.430.700	67	0,03
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,009	12.12.2028	8.694.300	120	0,05
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,133	23.06.2028	3.579.500	72	0,03
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,158	15.06.2028	7.959.600	152	0,06
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,160	13.07.2028	6.791.900	0	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,230	14.06.2028	1.732.400	42	0,02
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,237	14.06.2028	2.356.600	55	0,02
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,261	17.11.2027	3.774.600	60	0,03
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,280	17.11.2027	3.854.600	61	0,03
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,290	13.06.2028	1.707.900	46	0,02
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,293	21.03.2028	4.537.600	55	0,02
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,300	17.11.2027	940.100	16	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,300	22.03.2028	5.848.400	68	0,03
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,358	18.11.2027	2.390.300	47	0,02
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,420	18.11.2027	7.201.400	161	0,07
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,455	16.08.2028	7.508.700	(131)	(0,05)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,458	20.03.2028	7.549.300	142	0,06
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,475	13.11.2028	5.062.200	166	0,07
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,490	18.08.2028	2.882.200	(57)	(0,02)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,530	18.11.2027	2.406.700	64	0,03
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,530	22.08.2028	2.959.500	(67)	(0,03)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,540	17.08.2028	5.014.700	(115)	(0,05)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,540	14.11.2028	5.093.400	120	0,05
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,550	17.08.2028	5.014.700	(118)	(0,05)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,590	21.08.2028	5.749.900	(146)	(0,06)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,631	23.08.2028	6.961.700	(194)	(0,08)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,650	03.02.2028	5.748.800	(115)	(0,05)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,650	01.06.2028	2.946.200	(117)	(0,05)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,699	01.06.2028	4.644.000	(198)	(0,08)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,750	28.09.2028	3.942.400	165	0,07
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,780	31.05.2028	1.398.200	(67)	(0,03)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,798	31.05.2028	5.567.800	(262)	(0,11)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,830	25.04.2028	5.063.700	187	0,08
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,000	16.02.2028	5.590.200	(220)	(0,09)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,207	31.05.2027	1.836.600	92	0,04
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,230	27.05.2027	1.675.600	82	0,03
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,370	03.03.2028	4.119.100	(247)	(0,10)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,380	03.03.2028	4.366.200	(261)	(0,11)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,385	07.03.2028	6.138.400	(375)	(0,16)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,490	06.03.2028	8.848.600	(577)	(0,24)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,885	13.05.2027	1.642.400	(115)	(0,05)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	7,160	21.10.2027	5.870.000	(508)	(0,21)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	7,161	17.06.2027	2.386.300	(207)	(0,09)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	7,174	17.06.2027	1.432.400	(127)	(0,05)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	7,420	09.09.2027	2.595.500	(250)	(0,10)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	7,900	30.09.2027	2.317.200	(276)	(0,12)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	0,421	15.05.2025	CZK 900	(2)	0,00
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	0,590	26.03.2025	10.900	(26)	(0,01)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	0,637	24.07.2025	7.700	(26)	(0,01)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	0,665	22.09.2025	5.100	(15)	(0,01)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	0,690	04.05.2025	4.100	(9)	0,00
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	(26)	(0,01)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	1,100	31.12.2025	57.000	170	0,07
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	1,124	13.03.2025	12.000	(37)	(0,02)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	1,570	09.03.2026	59.800	171	0,07
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	1,580	19.03.2026	51.600	129	0,05
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	1,715	23.07.2026	100.200	(350)	(0,15)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	1,775	04.06.2026	57.900	(134)	(0,06)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	1,934	02.07.2026	95.200	323	0,13
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	1,972	07.07.2026	55.500	194	0,08
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	2,015	10.08.2026	132.200	364	0,15
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	3,340	06.01.2032	171.700	(635)	(0,26)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	3,770	11.02.2027	72.000	13	0,01
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,020	22.11.2033	124.600	181	0,08
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,190	09.11.2028	240.400	142	0,06
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,195	21.03.2033	125.300	376	0,16

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,220 %	21.03.2033	CZK 67.600	\$ 211	0,09
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,280	08.11.2033	124.900	282	0,12
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	4,300	18.03.2027	80.900	(102)	(0,04)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,420	22.03.2028	172.600	349	0,15
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,420	05.05.2032	9.700	21	0,01
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	4,420	01.06.2033	82.200	(322)	(0,13)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,440	12.12.2027	253.100	293	0,12
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	4,455	01.06.2033	29.100	(124)	(0,05)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,510	22.03.2028	151.800	335	0,14
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,560	09.12.2027	156.700	211	0,09
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	4,615	11.07.2028	197.900	(265)	(0,11)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,630	21.03.2028	151.800	373	0,16
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	4,638	03.10.2033	100.400	(328)	(0,14)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,640	07.12.2027	156.700	229	0,10
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,680	08.12.2027	156.700	240	0,10
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,695	04.05.2028	116.300	327	0,14
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	4,730	03.10.2028	67.700	(132)	(0,06)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,735	04.05.2028	95.500	276	0,12
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	5,070	20.04.2028	101.000	(354)	(0,15)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	5,090	20.04.2028	121.900	(432)	(0,18)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	5,103	16.11.2027	240.300	514	0,21
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	5,140	11.07.2027	58.000	94	0,04
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	5,175	11.07.2027	82.400	94	0,04
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	5,175	23.02.2028	48.100	(166)	(0,07)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	5,185	24.05.2027	64.000	(195)	(0,08)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	5,215	24.02.2028	249.500	(900)	(0,37)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	5,264	02.03.2028	224.100	(890)	(0,37)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	5,285	20.05.2027	83.300	(266)	(0,11)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	5,538	02.09.2027	52.400	(133)	(0,06)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	5,640	10.06.2027	3.400	(13)	(0,01)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	5,740	03.10.2027	121.600	(366)	(0,15)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	5,788	20.10.2027	538.000	(1.885)	(0,78)
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	20.03.2054	€ 2.800	(443)	(0,18)
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.03.2034	27.200	1.204	0,50
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,500	20.03.2026	42.800	(298)	(0,12)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	1,085	14.08.2025	HUF 186.300	70	0,03
Zahlung	6-Month HUF-BBR	1,115	08.01.2026	1.131.600	(487)	(0,20)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	1,220	15.01.2026	559.700	243	0,10
Erhalt	6-Month HUF-BBR	1,230	15.01.2026	872.700	380	0,16
Zahlung	6-Month HUF-BBR	1,920	16.04.2026	426.000	(135)	(0,06)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	1,958	19.03.2026	1.746.000	560	0,23
Erhalt	6-Month HUF-BBR	1,980	09.03.2026	646.300	215	0,09
Erhalt	6-Month HUF-BBR	2,499	05.07.2026	78.800	33	0,01
Erhalt	6-Month HUF-BBR	2,558	06.08.2026	1.156.900	435	0,18
Zahlung	6-Month HUF-BBR	5,060	18.02.2027	885.100	(95)	(0,04)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	5,500	04.03.2027	627.800	26	0,01
Zahlung	6-Month HUF-BBR	6,065	13.12.2028	963.600	31	0,01
Erhalt	6-Month HUF-BBR	6,100	11.03.2027	498.000	(13)	(0,01)
Zahlung	6-Month HUF-BBR	7,480	03.06.2027	700.700	243	0,10
Erhalt	6-Month HUF-BBR	7,640	13.05.2027	721.400	(165)	(0,07)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	7,740	26.10.2028	3.525.000	(722)	(0,30)
Zahlung	6-Month HUF-BBR	7,770	27.10.2028	2.046.400	170	0,07
Zahlung	6-Month HUF-BBR	8,320	20.01.2028	729.300	207	0,09
Zahlung	6-Month HUF-BBR	8,500	25.01.2028	5.485.200	1.837	0,76
Zahlung	6-Month HUF-BBR	8,550	24.01.2028	1.174.900	372	0,15
Zahlung	6-Month HUF-BBR	8,650	19.01.2028	731.300	238	0,10
Zahlung	6-Month HUF-BBR	8,712	28.04.2028	2.440.200	508	0,21
Zahlung	6-Month HUF-BBR	8,740	28.04.2028	4.994.100	1.769	0,74
Zahlung	6-Month HUF-BBR	8,800	27.04.2028	1.126.200	481	0,20
Erhalt	6-Month HUF-BBR	9,490	11.04.2028	2.501.700	(1.258)	(0,52)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	9,500	11.04.2028	1.025.500	(517)	(0,22)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	9,510	11.04.2028	1.038.900	(564)	(0,23)
Zahlung	6-Month HUF-BBR	9,625	15.08.2027	695.900	280	0,12
Zahlung	6-Month HUF-BBR	9,750	22.11.2027	283.976	105	0,04
Zahlung	6-Month HUF-BBR	9,800	16.11.2027	2.235.924	827	0,34
Erhalt	6-Month HUF-BBR	9,900	16.12.2027	162.500	(65)	(0,03)
Zahlung	6-Month HUF-BBR	10,000	18.11.2027	319.400	125	0,05
Erhalt	6-Month HUF-BBR	10,050	15.12.2027	164.000	(68)	(0,03)
Zahlung	6-Month HUF-BBR	10,070	18.07.2027	428.900	130	0,05
Zahlung	6-Month HUF-BBR	10,100	15.07.2027	488.900	149	0,06
Erhalt	6-Month HUF-BBR	10,340	15.12.2027	334.200	(148)	(0,06)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	11,140	23.12.2027	2.021.500	(1.017)	(0,42)
Zahlung	6-Month HUF-BBR	11,350	11.11.2027	289.300	125	0,05
Erhalt	6-Month HUF-BBR	11,524	12.09.2027	2.052.600	(982)	(0,41)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	11,650	09.09.2027	359.200	(184)	(0,08)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	12,500	19.10.2027	4.079.400	(2.614)	(1,09)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	0,481	11.08.2025	PLN 3.400	(78)	(0,03)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	0,560	17.04.2025	1.900	(32)	(0,01)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	0,580	11.01.2026	8.500	(229)	(0,10)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	0,585	22.09.2025	6.000	(131)	(0,05)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	0,635	08.05.2025	1.100	(19)	(0,01)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	0,730	05.02.2026	6.500	168	0,07

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	0,890 %	12.02.2026	PLN 20.900	\$ 514	0,21
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	1,188	19.03.2026	17.800	337	0,14
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	1,229	09.03.2026	7.000	145	0,06
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	1,405	10.08.2026	27.100	641	0,27
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	1,450	05.07.2026	5.300	(142)	(0,06)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	1,465	07.06.2026	2.400	43	0,02
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	2,185	08.10.2026	8.300	(147)	(0,06)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	2,983	08.11.2026	20.100	224	0,09
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	3,525	24.12.2026	3.300	(25)	(0,01)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	3,600	27.12.2026	3.300	(24)	(0,01)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	3,739	03.01.2027	1.000	(6)	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	3,934	04.03.2027	19.200	100	0,04
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	4,219	04.02.2027	10.200	8	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	4,735	09.10.2028	10.200	(7)	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	4,830	18.03.2027	2.000	(15)	(0,01)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	4,840	22.08.2028	6.800	(21)	(0,01)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	4,930	29.06.2028	15.900	181	0,08
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	5,179	01.04.2027	7.900	(87)	(0,04)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,300	12.01.2028	23.800	296	0,12
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,430	16.03.2028	6.700	102	0,04
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	5,460	16.08.2027	1.300	(22)	(0,01)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,490	12.12.2027	19.700	182	0,08
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,525	12.12.2027	6.500	62	0,03
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,540	01.06.2028	26.600	335	0,14
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,670	09.12.2027	19.500	212	0,09
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,750	08.12.2027	16.300	189	0,08
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,800	07.12.2027	32.600	392	0,16
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,830	08.12.2027	32.600	401	0,17
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,160	23.02.2028	42.600	(996)	(0,41)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	6,310	18.11.2027	14.800	245	0,10
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,348	09.09.2027	14.800	(238)	(0,10)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	6,365	17.11.2027	15.600	266	0,11
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	6,455	16.11.2027	23.630	423	0,18
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,650	29.09.2027	33.200	(799)	(0,33)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	7,223	29.06.2027	23.200	608	0,25
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	7,726	24.10.2027	87.700	(2.451)	(1,02)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	7,761	21.10.2027	7.052	203	0,08
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	4,775	26.06.2025	MXN 4.900	25	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	4,800	05.02.2026	65.500	317	0,13
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,080	09.10.2025	14.500	(85)	(0,04)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,095	30.10.2025	23.500	(133)	(0,06)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,120	06.05.2025	15.800	(81)	(0,03)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,443	17.04.2025	5.700	(31)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	5,550	12.03.2026	32.800	159	0,07
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,050	04.06.2026	22.600	(100)	(0,04)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,095	20.03.2026	51.800	218	0,09
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,210	28.03.2025	4.300	(28)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,230	07.04.2025	16.700	(107)	(0,04)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,255	21.05.2026	23.500	100	0,04
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,460	18.06.2026	43.000	165	0,07
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,625	11.09.2026	21.100	82	0,03
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,635	11.09.2026	21.100	82	0,03
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,740	17.09.2026	28.500	105	0,04
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,109	03.12.2026	102.300	(331)	(0,14)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,113	24.09.2026	134.600	417	0,17
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,264	17.12.2026	30.000	87	0,04
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,273	12.11.2026	33.880	(99)	(0,04)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,353	05.11.2026	58.150	166	0,07
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,370	14.10.2026	24.200	(68)	(0,03)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,383	28.01.2027	29.500	83	0,03
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,460	04.02.2027	44.800	(119)	(0,05)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,530	14.01.2027	24.100	60	0,03
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,590	29.10.2026	40.000	94	0,04
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,673	31.12.2026	23.900	56	0,02
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,745	11.02.2027	53.100	(114)	(0,05)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,055	13.06.2033	25.800	(56)	(0,02)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,207	19.06.2028	52.900	1	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,250	02.12.2032	85.900	(109)	(0,05)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,280	29.07.2027	40.300	(57)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,281	28.03.2033	68.000	(48)	(0,02)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,340	21.04.2033	35.500	(3)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,374	14.03.2033	135.600	(57)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,400	21.05.2027	47.400	(49)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,402	20.05.2027	34.800	(36)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,438	20.03.2028	307.500	(201)	(0,08)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,453	30.11.2027	332.600	(239)	(0,10)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,470	16.12.2033	18.500	1	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,480	30.11.2027	105.200	(70)	(0,03)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,498	11.03.2027	25.400	(22)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,500	25.07.2033	91.300	(15)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,563	16.05.2033	31.700	(11)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,616	05.11.2027	165.400	(69)	(0,03)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,620 %	09.11.2027	MXN 82.900	\$ (3)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,645	27.07.2033	115.700	(134)	(0,06)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,728	22.05.2028	135.300	(10)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,740	30.08.2027	30.800	(2)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,755	03.02.2033	45.900	(51)	(0,02)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,765	02.08.2028	113.400	(79)	(0,03)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,785	06.05.2027	24.900	8	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,800	02.02.2033	73.500	(94)	(0,04)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,810	01.07.2027	60.100	(11)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,844	07.02.2033	104.900	(154)	(0,06)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,921	25.08.2027	61.100	3	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,940	07.02.2028	136.200	(57)	(0,02)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,990	10.08.2033	34.000	(69)	(0,03)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,020	03.06.2027	91.300	(22)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,060	14.09.2027	61.100	(30)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,070	24.06.2027	13.500	(3)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,114	24.06.2027	11.700	(4)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,135	27.10.2033	63.600	165	0,07
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,215	09.02.2028	146.800	(146)	(0,06)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,238	02.11.2028	99.700	144	0,06
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,290	23.09.2027	22.500	20	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,295	21.10.2027	116.100	(111)	(0,05)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,300	24.09.2027	34.400	31	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,345	16.02.2028	99.400	(129)	(0,05)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,382	12.10.2027	153.800	(166)	(0,07)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,390	07.10.2027	40.300	(42)	(0,02)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,536	22.09.2027	67.800	(90)	(0,04)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,765	16.09.2033	43.100	221	0,09
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,890	22.09.2028	61.300	180	0,08
Zahlung	CPURNSA	2,500	29.03.2033	\$ 12.400	42	0,02
Erhalt	CPURNSA	2,525	07.06.2033	1.700	(19)	(0,01)
Erhalt	CPURNSA	2,595	12.07.2033	5.200	(67)	(0,03)
					\$ (5.407)	(2,25)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ (4.669)	(1,94)

(1) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nennbetrag	Gezahlte/ (erhaltene) Abschluss- prämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Netto- vermögens
BOA	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,750 %	20.09.2028	MYR 94.900	\$ 77	\$ (243)	\$ (166)	(0,07)
GST	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	20.09.2028	201.010	(336)	203	(133)	(0,05)
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	20.09.2028	91.300	157	(317)	(160)	(0,07)
SCX	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	20.09.2028	73.890	(142)	93	(49)	(0,02)
						\$ (244)	\$ (264)	\$ (508)	(0,21)

TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Gezahlte/ (erhaltene) Abschluss- prämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Netto- vermögens
MEI	Erhalt	BOVESPA Index	251	0,000 %	BRL 32.527	14.02.2024	\$ 0	\$ 320	\$ 320	0,13
	Erhalt	KOSPI2 Index	13.750.000	0,000	KRW 4.688.453	14.03.2024	0	232	232	0,10
	Zahlung	SET 50 Index	178.800	0,000	THB 154.546	28.03.2024	0	(46)	(46)	(0,02)
							\$ 0	\$ 506	\$ 506	0,21

DEWISENTERMIKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
AZD	01.2024	AUD 11.915	\$ 7.892	\$ 0	\$ (240)	\$ (240)	(0,10)
	03.2024	CNH 1.253	174	0	(3)	(3)	0,00
BOA	01.2024	AUD 527	348	0	(11)	(11)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
	01.2024	HUF 170.656	\$ 469	\$ 0	\$ (23)	\$ (23)	(0,01)
	01.2024	¥ 775.988	5.258	0	(249)	(249)	(0,10)
	01.2024	NOK 7.183	676	0	(32)	(32)	(0,01)
	01.2024	PLN 24.665	5.660	0	(610)	(610)	(0,25)
	01.2024	SEK 46	4	0	0	0	0,00
	01.2024	TRY 529	18	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 22	HUF 7.929	1	0	1	0,00
	01.2024	127	PLN 533	9	0	9	0,00
	03.2024	CNH 83.967	\$ 11.620	0	(239)	(239)	(0,10)
	03.2024	IDR 151.302.556	9.811	0	0	0	0,00
	03.2024	KRW 2.843.500	2.200	0	(3)	(3)	0,00
	03.2024	PHP 2.359	42	0	0	0	0,00
BPS	01.2024	AUD 222	146	0	(5)	(5)	0,00
	01.2024	CAD 305	224	0	(7)	(7)	0,00
	01.2024	€ 1.295	1.413	0	(18)	(18)	(0,01)
	01.2024	£ 1.415	1.795	0	(9)	(9)	0,00
	01.2024	HUF 8.825	26	0	0	0	0,00
	01.2024	¥ 463.700	3.154	0	(137)	(137)	(0,06)
	01.2024	NZD 16.552	10.178	0	(302)	(302)	(0,13)
	01.2024	\$ 125	AUD 184	0	0	0	0,00
	01.2024	66	CAD 88	1	0	1	0,00
	01.2024	940	€ 857	9	(2)	7	0,00
	01.2024	164	£ 128	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	482	¥ 70.667	20	0	20	0,01
	01.2024	33.791	MXN 619.708	2.639	0	2.639	1,10
	01.2024	25.124	NZD 40.300	392	0	392	0,16
	01.2024	75	PLN 318	5	0	5	0,00
	01.2024	ZAR 16.583	\$ 895	0	(11)	(11)	0,00
	03.2024	CNH 3.747	521	0	(9)	(9)	0,00
	03.2024	COP 85.863	21	0	(1)	(1)	0,00
	03.2024	HUF 313.748	900	1	0	1	0,00
	03.2024	TWD 104.774	3.319	0	(153)	(153)	(0,06)
	03.2024	\$ 1.162	AUD 1.700	1	0	1	0,00
	03.2024	9.400	CAD 12.480	75	0	75	0,03
	03.2024	12.664	CNH 89.528	0	(19)	(19)	(0,01)
	03.2024	64	IDR 990.380	0	0	0	0,00
	03.2024	2.130	ILS 7.703	14	0	14	0,01
	03.2024	795	INR 66.475	1	0	1	0,00
	03.2024	1.500	MXN 25.816	6	0	6	0,00
	03.2024	1.900	NOK 19.541	27	0	27	0,01
	03.2024	2.886	NZD 4.600	27	0	27	0,01
BRC	01.2024	CAD 6.871	\$ 5.053	0	(159)	(159)	(0,07)
	01.2024	£ 12	16	0	0	0	0,00
	01.2024	PLN 602	138	0	(15)	(15)	(0,01)
	01.2024	TRY 207	7	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 9.245	AUD 13.721	120	0	120	0,05
	01.2024	1.184	BRL 5.878	26	0	26	0,01
	01.2024	43	CAD 58	1	0	1	0,00
	01.2024	81	HUF 29.681	5	0	5	0,00
	01.2024	88	¥ 12.800	3	0	3	0,00
	01.2024	111	MXN 1.951	4	0	4	0,00
	01.2024	1.407	PLN 6.074	137	0	137	0,06
	01.2024	5	TRY 138	0	0	0	0,00
	01.2024	119	ZAR 2.281	6	0	6	0,00
	02.2024	7	TRY 210	0	0	0	0,00
	03.2024	CLP 2.686	\$ 3	0	0	0	0,00
	03.2024	£ 1.375	1.751	0	(2)	(2)	0,00
	03.2024	HKD 2.567	329	0	0	0	0,00
	03.2024	THB 106	3	0	0	0	0,00
	03.2024	TWD 93.563	3.102	2	0	2	0,00
	03.2024	\$ 885	ILS 3.200	6	0	6	0,00
CBK	06.2024	KRW 1.633.898	\$ 1.252	0	(20)	(20)	(0,01)
	01.2024	COP 34.622.924	8.799	0	(139)	(139)	(0,06)
	01.2024	MXN 9.374	534	0	(17)	(17)	(0,01)
	01.2024	NZD 11.348	7.005	0	(180)	(180)	(0,07)
	01.2024	PLN 3.010	708	0	(57)	(57)	(0,02)
	01.2024	\$ 98	AUD 146	2	0	2	0,00
	01.2024	3.374	BRL 16.428	8	0	8	0,00
	01.2024	17.781	CHF 15.371	491	0	491	0,20
	01.2024	17.416	COP69.387.508	461	0	461	0,19
	01.2024	158	€ 144	1	0	1	0,00
	01.2024	31.212	£ 24.568	108	0	108	0,04
	01.2024	32	HUF 11.219	0	0	0	0,00
	01.2024	90	MXN 1.555	1	0	1	0,00
	01.2024	107	PLN 433	3	0	3	0,00
	01.2024	30	SEK 310	0	0	0	0,00
	01.2024	154	ZAR 2.899	5	0	5	0,00
	01.2024	ZAR 9.717	\$ 528	0	(3)	(3)	0,00
	03.2024	IDR 48.474.960	3.120	0	(24)	(24)	(0,01)
	03.2024	ILS 13.558	3.724	0	(50)	(50)	(0,02)
	03.2024	\$ 14	BRL 71	0	0	0	0,00
	03.2024	2.596	IDR 40.022.615	0	(1)	(1)	0,00
	03.2024	10.500	INR 874.787	0	(24)	(24)	(0,01)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
	03.2024	\$ 9.800	KRW 12.649.854	\$ 2	\$ (2)	\$ 0	0,00
	03.2024	6.790	PEN 25.562	98	0	98	0,04
	03.2024	1.651	PLN 6.561	16	0	16	0,01
	04.2024	BRL 16.594	\$ 3.374	0	(14)	(14)	(0,01)
	04.2024	ILS 100	28	0	0	0	0,00
	06.2024	KRW 6.296	5	0	0	0	0,00
DUB	01.2024	\$ 1.085	PLN 4.291	6	0	6	0,00
	02.2024	3.801	BRL 18.644	31	0	31	0,01
	03.2024	CNH 15.003	\$ 2.082	0	(37)	(37)	(0,02)
	03.2024	SGD 4.133	3.122	0	(22)	(22)	(0,01)
	03.2024	\$ 614	CZK 13.719	0	(2)	(2)	0,00
	03.2024	40	SGD 53	0	0	0	0,00
	06.2024	KRW 1.766.386	\$ 1.357	0	(18)	(18)	(0,01)
GLM	01.2024	BRL 2.899	590	0	(6)	(6)	0,00
	01.2024	CAD 31.250	23.006	0	(695)	(695)	(0,29)
	01.2024	CHF 7.485	8.541	0	(357)	(357)	(0,15)
	01.2024	¥ 1.241.082	8.440	0	(369)	(369)	(0,15)
	01.2024	MXN 203.083	11.577	0	(361)	(361)	(0,15)
	01.2024	NOK 889	83	0	(5)	(5)	0,00
	01.2024	\$ 59	€ 54	0	0	0	0,00
	01.2024	100	HUF 37.550	8	0	8	0,00
	01.2024	71	ZAR 1.341	3	0	3	0,00
	02.2024	TRY 564	\$ 18	0	0	0	0,00
	03.2024	CNH 1.839	255	0	(5)	(5)	0,00
	03.2024	IDR 33.872	2	0	0	0	0,00
	03.2024	\$ 1.000	BRL 4.867	0	(5)	(5)	0,00
	03.2024	28	CZK 636	0	0	0	0,00
	03.2024	850	IDR 13.088.340	0	(2)	(2)	0,00
JPM	01.2024	BRL 19.415	\$ 3.854	0	(143)	(143)	(0,06)
	01.2024	HUF 42.863	121	0	(3)	(3)	0,00
	01.2024	MXN 3.460	196	0	(7)	(7)	0,00
	01.2024	PLN 932	213	0	(24)	(24)	(0,01)
	01.2024	\$ 4.011	MXN 68.960	43	0	43	0,02
	01.2024	3.551	PLN 15.503	391	0	391	0,16
	01.2024	3	TRY 82	0	0	0	0,00
	01.2024	56	ZAR 1.069	2	0	2	0,00
	02.2024	INR 994.748	\$ 11.907	0	(20)	(20)	(0,01)
	02.2024	\$ 1.731	RON 7.870	16	0	16	0,01
	03.2024	CNH 20.429	\$ 2.833	0	(52)	(52)	(0,02)
	03.2024	ILS 11.041	3.024	0	(49)	(49)	(0,02)
	03.2024	TWD 120.153	3.865	0	(117)	(117)	(0,05)
	03.2024	\$ 2.600	CHF 2.197	30	0	30	0,01
	03.2024	434	IDR 6.707.489	1	0	1	0,00
	03.2024	6.185	ILS 22.278	16	0	16	0,01
	03.2024	2.200	¥ 307.597	8	0	8	0,00
MBC	06.2024	KRW 1.577.864	\$ 1.217	0	(12)	(12)	(0,01)
	01.2024	AUD 5.068	3.360	0	(98)	(98)	(0,04)
	01.2024	€ 5.636	6.197	0	(31)	(31)	(0,01)
	01.2024	HUF 66.573	181	0	(10)	(10)	0,00
	01.2024	\$ 1.064	AUD 1.571	8	0	8	0,00
	01.2024	661	€ 606	9	0	9	0,00
	01.2024	271	£ 214	2	0	2	0,00
	01.2024	421	¥ 60.300	7	0	7	0,00
	01.2024	134	MXN 2.486	13	0	13	0,01
	01.2024	43	PLN 184	3	0	3	0,00
	03.2024	HKD 1.124	\$ 144	0	0	0	0,00
	03.2024	TWD 37.987	1.204	0	(55)	(55)	(0,02)
	03.2024	\$ 8.921	CNH 63.291	19	0	19	0,01
	03.2024	217	HKD 1.692	0	0	0	0,00
	03.2024	1.379	IDR 21.255.709	0	(1)	(1)	0,00
MYI	03.2024	7.222	PHP 404.156	73	0	73	0,03
	01.2024	€ 13	\$ 15	0	0	0	0,00
	01.2024	£ 172	216	0	(3)	(3)	0,00
	01.2024	HUF 145.049	388	0	(30)	(30)	(0,01)
	01.2024	¥ 1.623.433	11.019	0	(503)	(503)	(0,21)
	01.2024	MYR 25.123	5.384	0	(99)	(99)	(0,04)
	01.2024	\$ 40.002	CAD 53.543	609	0	609	0,25
	01.2024	20	€ 18	0	0	0	0,00
	01.2024	590	£ 462	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	88	HUF 31.368	2	0	2	0,00
	01.2024	53	MXN 914	1	0	1	0,00
	01.2024	4.651	NOK 48.165	93	0	93	0,04
	01.2024	397	PLN 1.625	16	0	16	0,01
	01.2024	137	ZAR 2.549	2	0	2	0,00
	01.2024	ZAR 8.076	\$ 434	0	(7)	(7)	0,00
	03.2024	CNH 1.429	198	0	(4)	(4)	0,00
	03.2024	CZK 3.693	165	0	0	0	0,00
	03.2024	HUF 319.594	900	0	(16)	(16)	(0,01)
	03.2024	IDR 11.077.534	720	1	0	1	0,00
	03.2024	\$ 2.628	AUD 3.900	40	0	40	0,02
	03.2024	9.415	BRL 46.914	185	0	185	0,08
	03.2024	4.700	CAD 6.197	5	0	5	0,00
	03.2024	388	IDR 5.965.505	0	(1)	(1)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
	03.2024	\$ 1.000	NOK 10.089	\$ 0	\$ (5)	\$ (5)	0,00
	06.2024	KRW 1.015.778	\$ 781	0	(10)	(10)	0,00
RBC	04.2024	MXN 371.328	\$ 20.991	0	(557)	(557)	(0,23)
RYL	01.2024	\$ 77	CAD 103	1	0	1	0,00
	01.2024	8.998	€ 8.222	87	0	87	0,04
	01.2024	33.134	¥ 4.778.400	780	0	780	0,32
SCX	01.2024	£ 5.666	\$ 7.167	0	(56)	(56)	(0,02)
	01.2024	SEK 70.168	\$ 6.756	0	(208)	(208)	(0,09)
	01.2024	TRY 72	2	0	0	0	0,00
	03.2024	CNH 3.455	477	0	(11)	(11)	0,00
	03.2024	HKD 22.032	2.826	0	0	0	0,00
	03.2024	THB 243.851	7.055	0	(137)	(137)	(0,06)
	03.2024	TWD 33.695	1.067	0	(49)	(49)	(0,02)
	03.2024	\$ 3.429	CNH 24.768	70	0	70	0,03
	03.2024	111	IDR 1.696.780	0	(1)	(1)	0,00
	06.2024	KRW 2.423.665	\$ 1.867	0	(20)	(20)	(0,01)
SOG	02.2024	RON 8.000	1.744	0	(31)	(31)	(0,01)
	03.2024	TWD 34.680	1.101	0	(48)	(48)	(0,02)
SSB	01.2024	CLP 2.566.931	2.904	0	(33)	(33)	(0,01)
	01.2024	£ 2.706	3.415	0	(35)	(35)	(0,01)
	03.2024	CLP 1.602.026	1.797	0	(30)	(30)	(0,01)
	03.2024	\$ 1.500	COP 5.997.000	24	0	24	0,01
	03.2024	1.013	NZD 1.600	0	0	0	0,00
TOR	01.2024	HUF 60.856	\$ 163	0	(12)	(12)	(0,01)
	01.2024	\$ 8	PLN 33	0	0	0	0,00
	03.2024	CNH 5.100	\$ 706	0	(14)	(14)	(0,01)
	03.2024	\$ 53	SGD 70	0	0	0	0,00
UAG	01.2024	AUD 4.097	\$ 2.718	0	(78)	(78)	(0,03)
	01.2024	CAD 13.971	10.300	0	(297)	(297)	(0,12)
	01.2024	£ 1.756	2.221	0	(17)	(17)	(0,01)
	01.2024	¥ 1.508.891	10.300	0	(410)	(410)	(0,17)
	01.2024	NOK 40.805	3.825	0	(193)	(193)	(0,08)
	01.2024	SEK 29.448	2.853	0	(69)	(69)	(0,03)
	01.2024	\$ 14.707	SEK 150.115	192	0	192	0,08
	01.2024	ZAR 16.616	\$ 870	0	(37)	(37)	(0,02)
	03.2024	\$ 6.600	CAD 8.816	93	0	93	0,04
				\$ 7.624	\$ (8.319)	\$ (695)	(0,29)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 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 Netto- vermögens
BPS	01.2024	€ 135	\$ 148	\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	0,00
	01.2024	\$ 539	€ 495	8	0	8	0,00
CBK	01.2024	€ 101	\$ 111	0	(1)	(1)	0,00
MBC	01.2024	10	11	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 6.980	€ 6.351	37	0	37	0,02
MYI	01.2024	6.669	6.068	35	0	35	0,01
UAG	01.2024	6.601	6.001	30	0	30	0,01
				\$ 110	\$ (3)	\$ 107	0,04

Zum 31. Dezember 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 Netto- vermögens
BRC	01.2024	£ 1.314	\$ 1.663	\$ 0	\$ (13)	\$ (13)	(0,01)
	01.2024	\$ 127	£ 101	1	0	1	0,00
CBK	01.2024	45	36	0	0	0	0,00
GLM	01.2024	167	131	0	0	0	0,00
MBC	01.2024	£ 95	\$ 121	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 72	£ 56	0	0	0	0,00
MYI	01.2024	1.632	1.285	7	(1)	6	0,00
SCX	01.2024	19.665	15.545	153	(1)	152	0,07
SSB	01.2024	19.958	15.817	208	0	208	0,09
UAG	01.2024	19.929	15.747	146	0	146	0,06
				\$ 515	\$ (15)	\$ 500	0,21

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (90) (0,04)

Summe Anlagen

\$ 241.806 100,61

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (1.460) (0,61)

Nettvermögen

\$ 240.346 100,00

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

- (a) Nullkuponwertpapier.
 (b) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
 (c) Mit dem Teilfonds verbunden.
 (d) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,21 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits- datum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Netto- vermögens
Deutsche Bank AG	0,898 %	28.05.2024	31.03.2023 - 31.05.2023	\$ 2.458	\$ 2.456	1,02

Barmittel in Höhe von USD 21.778 (31. Dezember 2022: USD 21.987) waren zum 31. Dezember 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 4.760 (31. Dezember 2022: USD 6.601) waren zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten für Finanzderivate gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 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	\$ 203.304	\$ 0	\$ 203.304
Investmentfonds	1.691	21.949	0	23.640
Pensionsgeschäfte	0	18.466	0	18.466
Finanzderivate ⁽³⁾	1.550	(5.154)	0	(3.604)
Summen	\$ 3.241	\$ 238.565	\$ 0	\$ 241.806

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 335.879	\$ 0	\$ 335.879
Investmentfonds	10.879	30.814	0	41.693
Pensionsgeschäfte	0	27.452	0	27.452
Finanzderivate ⁽³⁾	467	(2.020)	0	(1.553)
Einlagen bei Kreditinstituten	0	600	0	600
Summen	\$ 11.346	\$ 392.725	\$ 0	\$ 404.071

⁽¹⁾ Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

⁽²⁾ Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

⁽³⁾ Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
AZD	\$ (243)	\$ 260	\$ 17	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ k. A.
BOA	(1.323)	1.370	47	(475)	490	15
BPS	2.550	(2.380)	170	(159)	380	221
BRC	102	(80)	22	(2.750)	2.340	(410)
CBK	684	(830)	(146)	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	(42)	80	38	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	(1.794)	1.680	(114)	(251)	330	79
GST	(293)	270	(23)	(299)	261	(38)
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	267	(260)	7
IND	k. A.	k. A.	k. A.	(8)	0	(8)
JPM	80	(100)	(20)	153	(390)	(237)
MBC	(24)	0	(24)	931	(880)	51
MEI	506	(690)	(184)	(165)	450	285
MYC	k. A.	k. A.	k. A.	204	0	204
MYI	316	(550)	(234)	(99)	120	21
RBC	(557)	330	(227)	(69)	50	(19)
RYL	868	(940)	(72)	(21)	0	(21)
SCX	(309)	360	51	1.408	(1.310)	98

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Forts.)

31. Dezember 2023

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement ⁽¹⁾
SOG	\$ (79)	\$ 0	\$ (79)	\$ 1	\$ 0	\$ 1
SSB	134	(270)	(136)	38	0	38
TOR	(26)	60	34	(1.737)	1.620	(117)
UAG	(640)	350	(290)	(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. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	56,26	28,54
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	28,33	48,50
Investmentfonds	9,84	9,56
Pensionsgeschäfte	7,68	6,30
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,48	0,13
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(1,94)	(0,06)
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,04)	(0,42)
Einlagenzertifikate	k. A.	0,14

* Gemäß der Liste der Märkte, die die Kriterien für einen geregelten OGAW-Markt erfüllen, in Anlage 1 zum Verkaufsprospekt.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	57,56	39,15
Kommunalanleihen und Wechsel	k. A.	0,23
US-Regierungsbehörden	14,95	1,39
Non-Agency-MBS	0,50	0,45
Forderungsbesicherte Wertpapiere	5,59	1,06
Staatsemissionen	1,89	0,53
Kurzfristige Instrumente	4,10	34,23
Investmentfonds	9,84	9,56
Pensionsgeschäfte	7,68	6,30
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,48	0,13
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,31	0,09
Zinsswaps	(2,25)	(0,15)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Zinsswaps	(0,21)	0,04
Total Return Swaps auf Indizes	0,21	(0,04)
Devisenterminkontrakte	(0,29)	(1,20)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,25	0,78
Einlagenzertifikate	k. A.	0,14
Sonstige Aktiva und Passiva	(0,61)	7,31
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des UK Corporate Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
SINGAPUR											
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL											
DBS Bank Ltd.				3,250 % fällig am 12.02.2027	£ 200	\$ 189	0,05	Manchester Airport Group Funding PLC			
5,851 % fällig am 17.11.2026	£ 200	\$ 200	0,06	6,369 % fällig am 31.01.2031	1.500	1.559	0,43	6,125 % fällig am 30.09.2041	£ 800	\$ 891	0,25
				7,090 % fällig am 06.11.2029	2.650	2.825	0,78	Metropolitan Housing Trust Ltd.			
				8,407 % fällig am 14.11.2032	300	320	0,09	1,875 % fällig am 28.07.2036	1.800	1.290	0,36
SPANIEN											
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL											
Abertis Infraestructuras S.A.				Berkeley Group PLC				Mitchells & Butlers Finance PLC			
3,375 % fällig am 27.11.2026	200	191	0,05	2,500 % fällig am 11.08.2031	1.200	929	0,26	6,013 % fällig am 15.12.2030	404	383	0,11
Banco Santander S.A.				Beyond Housing Ltd.				6,135 % fällig am 15.12.2030	\$ 1.070	779	0,22
1,500 % fällig am 14.04.2026	700	646	0,18	2,125 % fällig am 17.05.2051	250	150	0,04	Morhomes PLC			
CaixaBank S.A.				BG Energy Capital PLC				3,400 % fällig am 19.02.2040	£ 1.100	901	0,25
1,500 % fällig am 03.12.2026	500	466	0,13	2,250 % fällig am 21.11.2029	€ 1.146	944	0,26	Motability Operations Group PLC			
International Consolidated Airlines Group S.A.				5,000 % fällig am 04.11.2036	£ 300	310	0,09	2,125 % fällig am 18.01.2042	950	654	0,18
3,750 % fällig am 25.03.2029	€ 1.100	927	0,26	Blend Funding PLC				3,625 % fällig am 10.03.2036	1.250	1.139	0,32
Lorca Telecom Bondco S.A.				3,459 % fällig am 21.09.2049	800	639	0,18	5,625 % fällig am 29.11.2030	100	108	0,03
4,000 % fällig am 18.09.2027	400	339	0,09	BP Capital Markets PLC				5,625 % fällig am 11.09.2035	1.100	1.196	0,33
Summe Spanien		2.569	0,71	5,773 % fällig am 25.05.2038	600	657	0,18	National Gas Transmission PLC			
				British Land Co. PLC				1,375 % fällig am 07.02.2031	800	635	0,18
				British Telecommunications PLC				National Grid Electricity Distribution East Midlands PLC			
				6,375 % fällig am 23.06.2037	1.000	1.097	0,30	1,750 % fällig am 09.09.2031	400	326	0,09
				Cadent Finance PLC				National Grid Electricity Distribution West Midlands PLC			
				2,250 % fällig am 10.10.2035	900	671	0,19	5,750 % fällig am 16.04.2032	1.600	1.706	0,47
				2,625 % fällig am 22.09.2038	950	690	0,19	National Grid Electricity Transmission PLC			
				5,750 % fällig am 14.03.2034	500	522	0,14	1,125 % fällig am 07.07.2028	1.400	1.217	0,34
				Clarion Funding PLC				2,000 % fällig am 16.09.2038	1.600	1.098	0,30
				1,875 % fällig am 22.01.2035	1.000	746	0,21	2,750 % fällig am 06.02.2035	900	729	0,20
				3,125 % fällig am 19.04.2048	300	218	0,06	Nationwide Building Society			
				Compass Group PLC				5,890 % fällig am 24.10.2030	1.400	1.402	0,39
				4,375 % fällig am 08.09.2032	1.100	1.111	0,31	6,178 % fällig am 07.12.2027	1.200	1.233	0,34
				Derwent London PLC				NatWest Group PLC			
				1,875 % fällig am 17.11.2031	1.500	1.196	0,33	2,057 % fällig am 09.11.2028	1.800	1.608	0,44
				Diageo Finance PLC				2,875 % fällig am 19.09.2026	500	479	0,13
				2,750 % fällig am 08.06.2038	1.700	1.379	0,38	3,125 % fällig am 28.03.2027	500	475	0,13
				ENW Finance PLC				3,619 % fällig am 29.03.2029	900	844	0,23
				1,415 % fällig am 30.07.2030	400	334	0,09	7,416 % fällig am 06.06.2033	600	628	0,17
				4,893 % fällig am 24.11.2032	1.700	1.748	0,48	NatWest Markets PLC			
				GlaxoSmithKline Capital PLC				6,375 % fällig am 08.11.2027	1.300	1.372	0,38
				1,625 % fällig am 12.05.2035	2.100	1.608	0,44	NIE Finance PLC			
				Grainger PLC				5,875 % fällig am 01.12.2032	1.100	1.190	0,33
				3,000 % fällig am 03.07.2030	1.215	1.043	0,29	Northern Gas Networks Finance PLC			
				3,375 % fällig am 24.04.2028	400	370	0,10	4,875 % fällig am 15.11.2035	250	246	0,07
				Greene King Finance PLC				5,625 % fällig am 23.03.2040	50	52	0,01
				3,593 % fällig am 15.03.2035	351	315	0,09	Northern Powergrid Yorkshire PLC			
				4,064 % fällig am 15.03.2035	195	179	0,05	4,375 % fällig am 05.07.2032	300	295	0,08
				5,106 % fällig am 15.03.2034	514	499	0,14	5,125 % fällig am 04.05.2035	200	205	0,06
				5,318 % fällig am 15.09.2031	1.315	1.291	0,36	Northumbrian Water Finance PLC			
				Haleon UK Capital PLC				4,500 % fällig am 14.02.2031	1.000	966	0,27
				2,875 % fällig am 29.10.2028	1.450	1.369	0,38	5,625 % fällig am 29.04.2033	883	909	0,25
				3,375 % fällig am 29.03.2038	1.100	941	0,26	Notting Hill Genesis			
				HSBC Holdings PLC				2,000 % fällig am 03.06.2036	700	510	0,14
				3,000 % fällig am 29.05.2030	1.700	1.530	0,42	3,750 % fällig am 20.12.2032	300	279	0,08
				6,000 % fällig am 29.03.2040	978	986	0,27	Pacific Quay Finance PLC			
				6,800 % fällig am 14.09.2031	1.100	1.188	0,33	5,565 % fällig am 25.07.2034	150	156	0,04
				InterContinental Hotels Group PLC				Paragon Treasury PLC			
				2,125 % fällig am 24.08.2026	1.000	931	0,26	2,000 % fällig am 07.05.2036	100	72	0,02
				3,375 % fällig am 08.10.2028	800	747	0,21	Peabody Capital PLC			
				International Distributions Services PLC				3,250 % fällig am 14.09.2048	900	667	0,18
				7,375 % fällig am 14.09.2030	500	530	0,15	Places for People Homes Ltd.			
				John Lewis PLC				3,625 % fällig am 22.11.2028	900	852	0,24
				4,250 % fällig am 18.12.2034	1.344	978	0,27	5,875 % fällig am 23.05.2031	568	596	0,16
				6,125 % fällig am 21.01.2025	600	599	0,17	Places for People Treasury PLC			
				Karbon Homes Ltd.				2,500 % fällig am 26.01.2036	800	604	0,17
				3,375 % fällig am 15.11.2047	400	321	0,09	Platform HG Financing PLC			
				Land Securities Capital Markets PLC				1,926 % fällig am 15.09.2041	100	68	0,02
				2,399 % fällig am 08.02.2031	1.251	1.143	0,32	Prudential Funding Asia PLC			
				4,875 % fällig am 15.09.2034	500	514	0,14	6,125 % fällig am 19.12.2031	580	608	0,17
				Legal & General Group PLC				Quadgas Finance PLC			
				5,375 % fällig am 27.10.2045	1.200	1.193	0,33	3,375 % fällig am 17.09.2029	800	710	0,20
				Liberty Living Finance PLC				Reckitt Benckiser Treasury Services PLC			
				3,375 % fällig am 28.11.2029	100	92	0,03	5,625 % fällig am 14.12.2038	1.100	1.235	0,34
				Lloyds Banking Group PLC				Riverside Finance PLC			
				2,000 % fällig am 12.04.2028	5.100	4.649	1,29	3,875 % fällig am 05.12.2044	900	731	0,20
				8,500 % fällig am 27.09.2027 (c)(e)	300	306	0,08	Rolls-Royce PLC			
				London & Quadrant Housing Trust				1,625 % fällig am 09.05.2028	€ 250	200	0,06
				2,000 % fällig am 20.10.2038	1.250	855	0,24	5,750 % fällig am 15.10.2027	£ 900	906	0,25
				2,250 % fällig am 20.07.2029	400	353	0,10	Sage Group PLC			
				M&G PLC				1,625 % fällig am 25.02.2031	800	657	0,18
				5,625 % fällig am 20.10.2051	400	382	0,11	2,875 % fällig am 08.02.2034	1.500	1.267	0,35

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Santander UK Group Holdings PLC				NON-AGENCY-MBS				Athene Global Funding			
2,421 % fällig am 17.01.2029 £ 1.700	1.520	0,42		Alba PLC	766	\$ 746	0,21	1,750 % fällig am 24.11.2027 £ 400	\$ 355	0,10	
3,625 % fällig am 14.01.2026 600	581	0,16		5,509 % fällig am 15.12.2038 £				Bank of America Corp.			
7,482 % fällig am 29.08.2029 1.800	1.959	0,54		Albion PLC	300	300	0,08	3,584 % fällig am 27.04.2031 2.800	2.625	0,73	
Scotland Gas Networks PLC				0,000 % fällig am 17.07.2066				Becton Dickinson & Co.			
4,875 % fällig am 21.12.2034 300	293	0,08		Atlas Funding PLC	898	898	0,25	3,020 % fällig am 24.05.2025 1.000	973	0,27	
Scottish Hydro Electric Transmission PLC				6,120 % fällig am 25.07.2058	581	584	0,16	Berkshire Hathaway Finance Corp.			
2,250 % fällig am 27.09.2035 1.175	919	0,25		6,348 % fällig am 20.01.2061				2,375 % fällig am 19.06.2039 1.600	1.194	0,33	
Segro PLC				Barley Hill PLC	534	532	0,15	Cantor Fitzgerald LP			
5,750 % fällig am 20.06.2035 300	321	0,09		6,118 % fällig am 27.08.2058				7,200 % fällig am 12.12.2028 \$ 600	483	0,13	
Severn Trent Utilities Finance PLC				Brants Bridge PLC	185	186	0,05	Citigroup, Inc.			
2,000 % fällig am 02.06.2040 600	400	0,11		6,470 % fällig am 12.12.2064				1,750 % fällig am 23.10.2026 £ 1.000	926	0,26	
4,625 % fällig am 30.11.2034 400	392	0,11		Canada Square Funding PLC	58	58	0,02	2,750 % fällig am 24.01.2024 650	649	0,18	
4,875 % fällig am 24.01.2042 800	779	0,22		6,170 % fällig am 17.06.2058				5,150 % fällig am 21.05.2026 1.060	1.068	0,29	
5,250 % fällig am 04.04.2036 300	311	0,09		Eurohome UK Mortgages PLC	63	63	0,02	Comcast Corp.			
6,250 % fällig am 07.06.2029 1.300	1.395	0,39		5,490 % fällig am 15.06.2044				1,500 % fällig am 20.02.2029 400	353	0,10	
Sky Ltd.				EuroMASTR PLC	502	474	0,13	1,875 % fällig am 20.02.2036 1.200	907	0,25	
4,000 % fällig am 26.11.2029 500	495	0,14		5,531 % fällig am 15.06.2040			Credit Suisse AG AT1				
Society of Lloyd's				Great Hall Mortgages PLC	174	173	0,05	Claim	\$ 200	19	0,01
4,875 % fällig am 07.02.2047 500	485	0,13		5,469 % fällig am 18.03.2039	2	2	0,00	Digital Stout Holding LLC			
South Eastern Power Networks PLC				5,489 % fällig am 18.06.2038				3,750 % fällig am 17.10.2030 £ 1.675	1.564	0,43	
1,750 % fällig am 30.09.2034 3.800	2.886	0,80		Harbour Energy PLC	300	298	0,08	Edison International			
Southern Electric Power Distribution PLC				6,120 % fällig am 28.01.2054				7,875 % fällig am 15.06.2054 \$ 900	713	0,20	
5,500 % fällig am 07.06.2032 800	857	0,24		Hops Hill PLC	604	604	0,17	Fiserv, Inc.			
Southern Gas Networks PLC				6,148 % fällig am 27.05.2054				3,000 % fällig am 01.07.2031 £ 791	711	0,20	
3,100 % fällig am 15.09.2036 1.600	1.286	0,36		London Wall Mortgage Capital PLC	307	305	0,08	Ford Motor Credit Co. LLC			
Southern Housing				5,970 % fällig am 15.05.2051				6,860 % fällig am 05.06.2026 500	517	0,14	
2,375 % fällig am 08.10.2036 400	300	0,08		Ludgate Funding PLC	1.435	1.387	0,38	General Motors Financial Co., Inc.			
Sovereign Housing Capital PLC				6,014 % fällig am 01.01.2061				5,150 % fällig am 15.08.2026 500	503	0,14	
2,375 % fällig am 04.11.2048 1.000	638	0,18		Mansard Mortgages PLC	67	66	0,02	Goldman Sachs Group, Inc.			
SW Finance PLC				5,989 % fällig am 15.12.2049				1,875 % fällig am 16.12.2030 1.600	1.335	0,37	
7,375 % fällig am 12.12.2041 1.100	1.181	0,33		Mortimer BTL PLC	1.388	1.380	0,38	3,625 % fällig am 29.10.2029 1.175	1.113	0,31	
Telereal Securitisation PLC				5,920 % fällig am 23.06.2053	812	813	0,22	JPMorgan Chase & Co.			
4,974 % fällig am 10.12.2033 124	123	0,03		6,269 % fällig am 23.03.2054				1,895 % fällig am 28.04.2033 1.500	1.231	0,34	
Tesco Corporate Treasury Services PLC				Permanent Master Issuer PLC	600	601	0,17	MassMutual Global Funding			
1,875 % fällig am 02.11.2028 1.000	883	0,24		5,720 % fällig am 15.07.2073				1,375 % fällig am 15.12.2026 1.500	1.377	0,38	
2,750 % fällig am 27.04.2030 600	531	0,15		Pierpont BTL PLC	952	954	0,26	5,000 % fällig am 12.12.2027 1.500	1.533	0,42	
5,500 % fällig am 27.02.2035 300	304	0,08		6,320 % fällig am 21.09.2054			McDonald's Corp.				
Tesco Property Finance PLC				Polaris PLC	654	653	0,18	2,950 % fällig am			
5,661 % fällig am 13.10.2041 273	275	0,08		5,985 % fällig am 23.12.2058	1.083	1.087	0,30	15.03.2034 (f) 1.400	1.221	0,34	
5,744 % fällig am 13.04.2040 960	971	0,27		6,496 % fällig am 23.05.2059			3,750 % fällig am 31.05.2038 500	446	0,12		
5,801 % fällig am 13.10.2040 274	281	0,08		Residential Mortgage Securities PLC	963	965	0,27	Metropolitan Life Global Funding			
6,052 % fällig am 13.10.2039 111	116	0,03		6,470 % fällig am 20.06.2070				0,625 % fällig am 08.12.2027 400	349	0,10	
Thames Water Utilities Finance PLC				Stratton Mortgage Funding PLC	61	61	0,02	1,625 % fällig am 21.09.2029 400	347	0,10	
2,375 % fällig am 22.04.2040 800	493	0,14		6,069 % fällig am 25.09.2051	57	57	0,02	3,500 % fällig am 30.09.2026 740	724	0,20	
3,500 % fällig am 25.02.2028 1.300	1.173	0,32		6,120 % fällig am 12.03.2052	1.104	1.104	0,31	5,000 % fällig am 10.01.2030 900	928	0,26	
4,625 % fällig am 04.06.2046 1.000	796	0,22		6,121 % fällig am 20.07.2060			Morgan Stanley				
7,738 % fällig am 09.04.2058 400	456	0,13		Towd Point Mortgage Funding PLC	1.055	1.056	0,29	5,789 % fällig am 18.11.2033 600	640	0,18	
8,250 % fällig am 25.04.2040 500	562	0,16		6,365 % fällig am 20.10.2051	208	209	0,06	Nestle Holdings, Inc.			
Together Housing Finance PLC				6,571 % fällig am 20.07.2045				2,500 % fällig am 04.04.2032 750	669	0,18	
4,500 % fällig am 17.12.2042 100	92	0,03		Twin Bridges PLC	1.208	1.204	0,33	5,125 % fällig am 21.09.2032 700	748	0,21	
TP ICAP Finance PLC				6,070 % fällig am 12.03.2055				New York Life Global Funding			
2,625 % fällig am 18.11.2028 1.650	1.382	0,38						1,250 % fällig am 17.12.2026 500	459	0,13	
Travis Perkins PLC								4,350 % fällig am 16.09.2025 1.600	1.594	0,44	
3,750 % fällig am 17.02.2026 600	566	0,16						4,950 % fällig am 07.12.2029 900	935	0,26	
Unique Pub Finance Co. PLC				STAATSEMISSIONEN				Pacific Life Global Funding			
5,659 % fällig am 30.06.2027 792	792	0,22		United Kingdom Gilt	11.000	10.231	2,83	5,000 % fällig am 12.01.2028 1.100	1.122	0,31	
7,395 % fällig am 28.03.2024 46	46	0,01		0,125 % fällig am 30.01.2026	800	428	0,12	5,375 % fällig am 30.11.2028 300	311	0,09	
UNITE Group PLC				0,875 % fällig am 31.01.2046	3.400	1.812	0,50	PacificCorp			
3,500 % fällig am 15.10.2028 900	856	0,24		1,250 % fällig am 31.07.2051	10.100	5.633	1,56	5,500 % fällig am 15.05.2054 \$ 900	694	0,19	
Weir Group PLC				1,500 % fällig am 31.07.2053				Pfizer, Inc.			
6,875 % fällig am 14.06.2028 900	950	0,26		1,625 % fällig am				2,735 % fällig am 15.06.2043 £ 1.000	758	0,21	
Wellcome Trust Ltd.				22.10.2028 (f)	12.400	11.483	3,18	Procter & Gamble Co.			
1,500 % fällig am 14.07.2071 650	293	0,08		3,500 % fällig am	10.500	10.417	2,89	6,250 % fällig am 31.01.2030 400	445	0,12	
Workspace Group PLC				22.10.2025 (f)	700	686	0,19	Protective Life Global Funding			
2,250 % fällig am 11.03.2028 1.000	859	0,24		3,750 % fällig am 29.01.2038	2.300	2.161	0,60	5,248 % fällig am 13.01.2028 1.100	1.136	0,31	
Yorkshire Building Society				3,750 % fällig am 22.07.2052				Realty Income Corp.			
1,500 % fällig am 15.09.2029 800	667	0,18		3,750 % fällig am 22.10.2053	9.700	9.063	2,51	1,750 % fällig am 13.07.2033 825	628	0,17	
Yorkshire Water Finance PLC								5,750 % fällig am 05.12.2031 100	105	0,03	
1,750 % fällig am 27.10.2032 949	715	0,20						6,000 % fällig am 05.12.2039 300	323	0,09	
2,750 % fällig am 18.04.2041 700	485	0,13						Time Warner Cable LLC			
5,250 % fällig am 28.04.2030 900	900	0,25						5,750 % fällig am 02.06.2031 900	901	0,25	
5,500 % fällig am 28.04.2035 500	495	0,14		USA				Toyota Motor Credit Corp.			
	120.781	33,45		UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				5,625 % fällig am 23.10.2028 300	317	0,09	
				Amgen, Inc.	740	730	0,20	Verizon Communications, Inc.			
				4,000 % fällig am 13.09.2029				1,875 % fällig am 19.09.2030 500	424	0,12	
				AT&T, Inc.	1.800	1.560	0,43	2,500 % fällig am 08.04.2031 1.400	1.222	0,35	
				4,250 % fällig am 01.06.2043	1.000	988	0,27	3,375 % fällig am 27.10.2036 1.200	1.031	0,28	
				4,375 % fällig am 14.09.2029							
				7,000 % fällig am 30.04.2040							
						189.515	52,49				

Aufstellung der Wertpapieranlagen des UK Corporate Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
NON-AGENCY-MBS				US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				KÜRZFRISTIGE INSTRUMENTE			
Walgreens Boots Alliance, Inc. 3,600 % fällig am 20.11.2025	£ 400	\$ 382	0,11	US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				UNGARISCHE SCHATZWECHSEL			
Wells Fargo & Co. 2,125 % fällig am 24.09.2031	1.800	1.479	0,41	Fannie Mae				10,900 % fällig am			
2,500 % fällig am 02.05.2029	2.050	1.839	0,51	4,560 % fällig am 01.08.2036	\$ 3	\$ 3	0,00	04.01.2024 (a)(b)	HUF1.021.000	\$ 2.313	0,64
3,500 % fällig am 12.09.2029	700	660	0,18	6,129 % fällig am 01.07.2044	3	2	0,00	Summe kurzfristige Instrumente		2.313	0,64
Welltower OP LLC				Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				Summe übertragbare Wertpapiere	£	365.325	101,19
4,800 % fällig am 20.11.2028	500	503	0,14	4,000 % fällig am 01.02.2054	1.400	1.040	0,29				
		47.821	13,25	4,500 % fällig am 01.02.2054	2.680	2.039	0,56	AKTIEN			
				5,000 % fällig am 01.02.2054	1.180	916	0,25	INVESTMENTFONDS			
				5,500 % fällig am 01.02.2054	3.280	2.585	0,72	BÖRSENGEHANDELTE FONDS			
				6,000 % fällig am 01.02.2054	4.080	3.250	0,90	PIMCO ETFs plc - PIMCO			
				6,500 % fällig am 01.02.2054	5.480	4.405	1,22	Sterling Short Maturity	177.500	18.137	5,02
						14.240	3,94	UCITS ETF (d)			
				US-SCHATZobligationen				Summe Investmentfonds	£	18.137	5,02
				U.S. Treasury Notes							
				3,250 % fällig am 31.08.2024	1.800	1.395	0,39				
				Summe USA		63.526	17,60				

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft ⁽¹⁾	% des Netto- vermögens
FICC	2,600 %	29.12.2023	02.01.2024	\$ 325	U.S. Treasury Notes 4,875 % fällig am 30.11.2025	£ (260)	£ 255	£ 255	0,07
SCX	5,160	29.12.2023	02.01.2024	£ 5.200	United Kingdom Inflation-Linked Gilt 3,750 % fällig am 22.10.2053	(5.300)	5.200	5.203	1,44
Summe Pensionsgeschäfte						£ (5.560)	£ 5.455	£ 5.458	1,51

(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	Ablaufmonat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
Euro-Bobl March Futures	Short	03.2024	166	£ (27)	(0,01)
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Long	03.2024	19	27	0,01
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Short	03.2024	19	(148)	(0,04)
Euro-Schatz March Futures	Short	03.2024	88	(45)	(0,01)
Japan Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2024	12	(79)	(0,02)
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Short	03.2024	91	(138)	(0,04)
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Short	03.2024	103	(65)	(0,02)
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2024	148	459	0,13
U.S. Treasury 10-Year Ultra March Futures	Short	03.2024	40	(161)	(0,05)
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Long	03.2024	3	18	0,01
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2024	19	(173)	(0,05)
United Kingdom Long Gilt March Futures	Long	03.2024	56	41	0,01
				£ (291)	(0,08)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				£ (291)	(0,08)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
Cellnex Telecom S.A.	5,000 %	20.06.2030	€ 800	£ 19	0,01
Cellnex Telecom S.A.	5,000	20.12.2033	200	7	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.12.2028	\$ 500	8	0,00
Marks & Spencer PLC	1,000	20.06.2030	€ 500	6	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2030	400	16	0,01
				£ 56	0,02

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,500 %	21.09.2024	£ 52.400	£ (338)	(0,09)
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,728	16.12.2025	10.300	138	0,04
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,250	20.03.2054	2.400	(220)	(0,06)
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,500	20.03.2034	3.200	(207)	(0,06)
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	5,000	20.03.2029	2.900	(58)	(0,02)
Zahlung ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	5,500	20.03.2026	37.600	425	0,12
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,000	15.12.2026	\$ 3.100	53	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,250	17.06.2030	9.000	(303)	(0,09)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,500	18.12.2029	9.300	(292)	(0,08)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	12.02.2045	2.100	156	0,04
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2033	600	(28)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,750	20.12.2024	11.400	32	0,01
Zahlung ⁽³⁾	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,750	20.12.2033	AUD 8.900	117	0,03
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,547	09.03.2033	€ 1.600	81	0,02
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	20.03.2054	500	(49)	(0,01)
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	2,760	03.01.2029	400	(5)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,880	19.12.2028	600	(9)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,890	22.12.2033	400	(11)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,910	29.12.2033	300	(9)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,950	29.12.2028	300	(6)	0,00
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.03.2034	4.280	198	0,05
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,063	06.12.2033	200	(8)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,128	04.12.2033	200	(9)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,148	20.11.2033	300	(9)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,179	29.11.2028	200	(5)	0,00
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,250	20.03.2029	7.700	205	0,06
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,250	06.11.2033	300	(13)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,255	22.11.2028	300	(9)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,270	08.11.2028	600	(15)	(0,01)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,280	22.11.2033	200	(11)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,305	27.11.2033	300	(17)	(0,01)
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,500	20.03.2026	5.100	59	0,01
					£ (167)	(0,05)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					£ (111)	(0,03)

(1) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

VERKAUFSOPTIONEN

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variable Zinssatzindex	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Marktwert	% des Netto- vermögens
CBK	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,310 %	18.01.2024	200	£ 0	£ 0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,590	05.01.2024	300	(1)	(3)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,700	18.01.2024	200	(1)	0	0,00
GST	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,960	05.01.2024	300	(1)	0	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,440	08.01.2024	600	(1)	(2)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,860	08.01.2024	600	(1)	0	0,00
JPM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,490	12.01.2024	300	(1)	(2)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,650	04.01.2024	400	(1)	(5)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,890	12.01.2024	300	(1)	0	0,00
MYC	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,030	04.01.2024	400	(1)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,330	15.01.2024	300	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,740	15.01.2024	300	(1)	0	0,00
							£ (11)	£ (13)	0,00

(1) Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

DEVISENTERMIKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
BOA	01.2024	\$ 603	£ 475	£ 2	0	£ 2	0,00
BPS	01.2024	HUF 298.959	\$ 851	0	(10)	(10)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des UK Corporate Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
	01.2024	\$ 2.296	£ 1.810	\$ 9	\$ 0	\$ 9	0,00
	01.2024	2	HUF 855	0	0	0	0,00
BRC	01.2024	€ 1.679	£ 1.450	0	(6)	(6)	0,00
CBK	01.2024	HUF 87.567	\$ 250	0	(2)	(2)	0,00
	01.2024	¥ 25.100	£ 139	0	(1)	(1)	0,00
GLM	01.2024	€ 2.008	£ 1.737	0	(4)	(4)	0,00
	01.2024	\$ 1.052	834	9	0	9	0,00
JPM	01.2024	HUF 521.594	\$ 1.486	0	(17)	(17)	(0,01)
MBC	01.2024	€ 476	£ 409	0	(3)	(3)	0,00
	01.2024	HUF 30.973	\$ 88	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	\$ 2.900	£ 2.280	5	0	5	0,00
MYI	01.2024	€ 3.410	£ 2.938	0	(17)	(17)	(0,01)
	01.2024	£ 129	€ 150	1	0	1	0,00
	01.2024	7.325	\$ 9.300	0	(30)	(30)	(0,01)
	01.2024	HUF 79.166	225	0	(3)	(3)	0,00
	01.2024	¥ 14.900	£ 80	0	(3)	(3)	0,00
	01.2024	\$ 909	720	7	0	7	0,00
SCX	01.2024	€ 18.179	15.783	28	0	28	0,01
	01.2024	£ 395	\$ 496	0	(6)	(6)	0,00
SSB	01.2024	€ 2.371	£ 2.766	26	0	26	0,01
UAG	01.2024	\$ 12.625	£ 9.976	73	0	73	0,02
				£ 160	£ (103)	£ 57	0,01
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						£ 44	0,01
Summe Anlagen						£ 388.559	107,62
Sonstige Aktiva und Passiva						£ (27.498)	(7,62)
Nettovermogen						£ 361.061	100,00

ERLAUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi konnen fur faktisch vorhandene Betrage stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

- Nullkuponwertpapier.
- Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfalligkeit dar.
- Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nachsten vertraglichen Kundigungstermin dar.
- Mit dem Teilfonds verbunden.
- Bedingt wandelbares Wertpapier.

Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von GBP 21.034 (31. Dezember 2022: GBP null) waren zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten gema den Rahmenvertragen und/oder globalen Rahmenvertragen fur Pensionsgeschafte verpfandet.

Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von GBP 483 (31. Dezember 2022: GBP null) waren zum 31. Dezember 2023 gema den Rahmenvertragen und/oder globalen Rahmenvertragen fur Pensionsgeschafte als Sicherheiten erhalten worden.

Barmittel in Hohe von GBP 3.382 (31. Dezember 2022: GBP 7.199) waren zum 31. Dezember 2023 als Sicherheit fur borsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfandet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Markten notierte Kurse fur identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	£ 0	£ 365.325	£ 0	£ 365.325
Investmentfonds	18.137	0	0	18.137
Pensionsgeschafte	0	5.455	0	5.455
Finanzderivate ⁽³⁾	(231)	(127)	0	(358)
Summen	£ 17.906	£ 370.653	£ 0	£ 388.559

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Markten notierte Kurse fur identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	£ 0	£ 372.745	£ 0	£ 372.745
Investmentfonds	0	5.370	0	5.370
Pensionsgeschafte	0	177	0	177
Finanzderivate ⁽³⁾	637	1.806	0	2.443
Summen	£ 637	£ 380.098	£ 0	£ 380.735

⁽¹⁾ Zwecks zusatzlicher Informationen siehe Erlauterung 3 in den Erlauterungen zum Abschluss.

⁽²⁾ Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

⁽³⁾ Finanzderivate konnen offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
BPS	4,500 %	22.11.2023	TBD ⁽¹⁾	£ (503)	£ (506)	(0,14)
MEI	5,140	27.11.2023	06.02.2024	(11.044)	(11.099)	(3,07)
	5,400	07.11.2023	06.02.2024	(8.915)	(8.987)	(2,49)
Summe umgekehrte Pensionsgeschäfte					£ (20.592)	(5,70)

⁽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 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement ⁽¹⁾
BOA	£ 2	£ 0	£ 2	£ 260	£ (330)	£ (70)
BPS	(1)	0	(1)	k. A.	k. A.	k. A.
BRC	(6)	0	(6)	k. A.	k. A.	k. A.
CBK	(6)	0	(6)	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	5	0	5	(87)	0	(87)
GST	(2)	0	(2)	k. A.	k. A.	k. A.
JPM	(24)	0	(24)	k. A.	k. A.	k. A.
MBC	1	0	1	(9)	0	(9)
MYC	(1)	0	(1)	k. A.	k. A.	k. A.
MYI	(45)	0	(45)	(8)	0	(8)
SCX	22	0	22	k. A.	k. A.	k. A.
SSB	26	0	26	(213)	0	(213)
UAG	73	0	73	k. A.	k. A.	k. A.

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	96,47	94,43
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	4,71	1,35
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,01	k. A.
Investmentfonds	5,02	1,38
Pensionsgeschäfte	1,51	0,05
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,08)	0,16
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,03)	0,48
Freiverkehrsfinanzderivate	0,01	(0,02)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(5,70)	k. A.

* Gemäß der Liste der Märkte, die die Kriterien für einen geregelten OGAW-Markt erfüllen, in Anlage 1 zum Verkaufsprospekt.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Australien	0,42	k. A.
Österreich	k. A.	0,05
Belgien	k. A.	0,07
Kanada	0,95	0,20
Cayman-Inseln	0,37	0,12
Tschechische Republik	0,58	k. A.
Dänemark	1,27	0,82
Finnland	0,53	k. A.
Frankreich	6,42	3,51
Deutschland	1,66	2,21
Irland	1,20	1,24
Italien	1,31	0,57
Japan	k. A.	0,31
Jersey, Kanalinseln	2,61	1,71
Luxemburg	1,19	1,18
Mexiko	0,11	k. A.
Niederlande	5,46	5,67
Norwegen	0,51	0,42
Singapur	0,06	0,20
Spanien	0,71	1,11
Supranational	3,56	3,11
Schweden	0,43	0,44
Schweiz	1,11	0,89
Großbritannien	52,49	59,89
USA	17,60	11,68

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Kurzfristige Instrumente	0,64	0,38
Investmentfonds	5,02	1,38
Pensionsgeschäfte	1,51	0,05
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,08)	0,16
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.	0,10
Zinsswaps	(0,05)	0,39
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	0,00	(0,03)
Devisenterminkontrakte	0,01	0,01
Sonstige Aktiva und Passiva	(7,62)	2,17
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE			
AUSTRALIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
BHP Billiton Finance Ltd. 4,300 % fällig am 25.09.2042	£ 500	£ 461	0,14
BERMUDA			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Aegon Ltd. 6,625 % fällig am 16.12.2039	500	572	0,18
CAYMAN INSELN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Southern Water Services Finance Ltd. 3,000 % fällig am 28.05.2037 4,500 % fällig am 31.03.2052	2.700 700	1.939 590	0,60 0,18
Summe Cayman Inseln		2.529	0,78
DÄNEMARK			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Orsted A/S 2,500 % fällig am 16.05.2033 5,125 % fällig am 13.09.2034 5,375 % fällig am 13.09.2042	850 1.900 2.100	692 1.895 2.110	0,21 0,59 0,65
Summe Dänemark		4.697	1,45
FRANKREICH			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
AXA S.A. 5,453 % fällig am 04.03.2026 (a)	600	594	0,18
BNP Paribas S.A. 2,000 % fällig am 13.09.2036	1.600	1.192	0,37
Electricite de France S.A. 5,125 % fällig am 22.09.2050 5,500 % fällig am 27.03.2037 5,500 % fällig am 17.10.2041 5,625 % fällig am 25.01.2053 6,000 % fällig am 23.01.2114	4.800 3.600 4.800 1.900 400	4.474 3.581 4.730 1.867 392	1,38 1,10 1,46 0,57 0,12
Engie S.A. 5,000 % fällig am 01.10.2060	700	695	0,21
Orange S.A. 5,625 % fällig am 23.01.2034	1.575	1.714	0,53
		19.239	5,92
STAATSEMISSIONEN			
SNCF Réseau			
4,830 % fällig am 25.03.2060 5,000 % fällig am 11.03.2052	3.160 400	3.213 412	0,99 0,13
		3.625	1,12
Summe Frankreich		22.864	7,04
DEUTSCHLAND			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Bayer AG 7,000 % fällig am 25.09.2083	€ 900	807	0,25
Deutsche Telekom AG 3,125 % fällig am 06.02.2034	£ 800	717	0,22
Summe Deutschland		1.524	0,47
IRLAND			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
Toro European CLO DAC 4,908 % fällig am 12.01.2032	€ 1.300	1.117	0,34
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
ESB Finance DAC 1,875 % fällig am 21.07.2035	£ 300	227	0,07
Zurich Finance Ireland Designated Activity Co. 5,125 % fällig am 23.11.2052	1.200	1.159	0,36
		1.386	0,43
Summe Irland		2.503	0,77

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ITALIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Enel SpA 5,750 % fällig am 22.06.2037	£ 2.000	£ 2.102	0,65
Telecom Italia SpA 7,875 % fällig am 31.07.2028	€ 300	290	0,09
Summe Italien		2.392	0,74
JERSEY, KANALINSELN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
AA Bond Co. Ltd. 3,250 % fällig am 31.07.2050 5,500 % fällig am 31.07.2050	£ 200 180	170 171	0,05 0,05
Gatwick Funding Ltd. 2,625 % fällig am 07.10.2048 2,875 % fällig am 05.07.2051 3,125 % fällig am 28.09.2041 3,250 % fällig am 26.02.2050 5,750 % fällig am 23.01.2039	1.400 1.800 1.000 1.700 129	903 1.184 768 1.214 133	0,28 0,36 0,24 0,37 0,04
Heathrow Funding Ltd. 2,750 % fällig am 09.08.2051 4,625 % fällig am 31.10.2048 5,875 % fällig am 13.05.2043	2.900 2.377 300	1.928 2.193 325	0,59 0,68 0,10
HSBC Bank Capital Funding Sterling LP 5,844 % fällig am 05.11.2031 (a)	2.321	2.425	0,75
Summe Jersey, Kanalinseln		11.414	3,51
LUXEMBURG			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Becton Dickinson Euro Finance SARL 1,336 % fällig am 13.08.2041	€ 900	539	0,17
Nestle Finance International Ltd. 5,125 % fällig am 07.12.2038	£ 500	533	0,16
Prologis International Funding S.A. 3,000 % fällig am 22.02.2042	1.000	754	0,23
Summe Luxemburg		1.826	0,56
MEXIKO			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
America Movil S.A.B. de C.V. 4,375 % fällig am 07.08.2041 4,948 % fällig am 22.07.2033	388 100	362 103	0,11 0,03
		465	0,14
STAATSEMISSIONEN			
Mexico Government International Bond			
5,625 % fällig am 19.03.2114	1.600	1.251	0,39
Summe Mexiko		1.716	0,53
NIEDERLANDE			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Cooperatieve Rabobank UA 5,250 % fällig am 23.05.2041	1.050	1.164	0,36
CTP NV 1,250 % fällig am 21.06.2029	€ 400	288	0,09
E.ON International Finance BV 4,750 % fällig am 31.01.2034 5,875 % fällig am 30.10.2037 6,125 % fällig am 06.07.2039	£ 2.100 2.500 1.650	2.063 2.681 1.809	0,63 0,82 0,56
Enel Finance International NV 5,750 % fällig am 14.09.2040	2.763	2.894	0,89
Holcim Sterling Finance Netherlands BV 3,000 % fällig am 12.05.2032	300	261	0,08
ING Groep NV 6,250 % fällig am 20.05.2033	600	605	0,19
JAB Holdings BV 2,250 % fällig am 19.12.2039	€ 400	271	0,08
Siemens Financieringsmaatschappij NV 3,750 % fällig am 10.09.2042	£ 1.000	917	0,28
Volkswagen Financial Services NV 5,875 % fällig am 23.05.2029	900	932	0,29
Summe Niederlande		13.885	4,27

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
NORWEGEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Equinor ASA 4,250 % fällig am 10.04.2041	£ 700	£ 678	0,21
SINGAPUR			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Temasek Financial Ltd. 5,125 % fällig am 26.07.2040	1.050	1.137	0,35
SPANIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 8,250 % fällig am 30.11.2033	400	431	0,13
SCHWEDEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Investor AB 5,500 % fällig am 05.05.2037	1.300	1.417	0,44
SCHWEIZ			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
UBS Group AG 7,375 % fällig am 07.09.2033	700	808	0,25
GROSSBRITANNIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
3i Group PLC 3,750 % fällig am 05.06.2040	1.400	1.128	0,35
Accent Capital PLC 2,625 % fällig am 18.07.2049	400	273	0,08
Anglian Water Services Financing PLC 6,000 % fällig am 20.06.2039	400	434	0,13
Annington Funding PLC 2,924 % fällig am 06.10.2051 3,685 % fällig am 12.07.2034	2.500 1.319	1.550 1.113	0,48 0,34
Aviva PLC 4,000 % fällig am 03.06.2055 6,875 % fällig am 27.11.2053 6,875 % fällig am 20.05.2058	1.600 200 700	1.319 210 727	0,41 0,07 0,22
Barclays PLC 3,250 % fällig am 17.01.2033 8,875 % fällig am 15.09.2027 (a)(b)	1.000 500	856 500	0,26 0,15
Berkeley Group PLC 2,500 % fällig am 11.08.2031	800	619	0,19
Beyond Housing Ltd. 2,125 % fällig am 17.05.2051	500	300	0,09
BG Energy Capital PLC 5,000 % fällig am 04.11.2036	2.100	2.170	0,67
Blend Funding PLC 3,459 % fällig am 21.09.2049	1.600	1.277	0,39
BP Capital Markets PLC 5,773 % fällig am 25.05.2038	100	110	0,03
BPHA Finance PLC 4,816 % fällig am 11.04.2044	495	484	0,15
British Land Co. PLC 2,375 % fällig am 14.09.2029 5,264 % fällig am 24.09.2035	800 400	692 392	0,21 0,12
British Telecommunications PLC 3,625 % fällig am 21.11.2047 5,750 % fällig am 13.02.2041 8,375 % fällig am 20.12.2083	300 1.500 800	235 1.551 847	0,07 0,48 0,26
Broadgate Financing PLC 4,999 % fällig am 05.10.2033 5,098 % fällig am 05.04.2035	600 87	591 83	0,18 0,03
Cadent Finance PLC 2,250 % fällig am 10.10.2035 2,625 % fällig am 22.09.2038 2,750 % fällig am 22.09.2046 3,125 % fällig am 21.03.2040	500 2.700 1.500 300	373 1.961 997 229	0,12 0,60 0,31 0,07
Catalyst Housing Ltd. 3,125 % fällig am 31.10.2047	900	652	0,20
Chancellor Masters & Scholars of the University of Cambridge 2,350 % fällig am 27.06.2078	200	129	0,04

Aufstellung der Wertpapieranlagen des UK Long Term Corporate Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Church Commissioners for England 3,625 % fällig am 14.07.2052	£ 1.400	£ 1.174	0,36	Longstone Finance PLC 4,896 % fällig am 19.04.2036	£ 100	£ 95	0,03	Platform HG Financing PLC 1,926 % fällig am 15.09.2041	£ 1.200	£ 813	0,25
Citizen Treasury PLC 3,250 % fällig am 20.10.2048	1.300	967	0,30	M&G FLLC 5,560 % fällig am 20.07.2055	3.450	3.161	0,97	Prudential Funding Asia PLC 6,125 % fällig am 19.12.2031	620	650	0,20
Clarion Funding PLC 1,250 % fällig am 13.11.2032	100	76	0,02	Manchester Airport Group Funding PLC 2,875 % fällig am 30.09.2044	2.050	1.458	0,45	RHP Finance PLC 3,250 % fällig am 05.02.2048	700	544	0,17
1,875 % fällig am 22.01.2035	3.600	2.687	0,83	6,125 % fällig am 30.09.2041	200	223	0,07	Riverside Finance PLC 3,875 % fällig am 05.12.2044	600	487	0,15
1,875 % fällig am 07.09.2051	2.600	1.380	0,43	Marks & Spencer PLC 3,750 % fällig am 19.05.2026	100	97	0,03	Sage Group PLC 2,875 % fällig am 08.02.2034	1.700	1.436	0,44
3,125 % fällig am 19.04.2048	1.000	726	0,22	Meadowhall Finance PLC 4,988 % fällig am 12.07.2037	61	49	0,02	Sanctuary Capital PLC 2,375 % fällig am 14.04.2050	1.000	631	0,19
Derwent London PLC 1,875 % fällig am 17.11.2031	1.150	917	0,28	Metropolitan Housing Trust Ltd. 1,875 % fällig am 28.07.2036	2.400	1.720	0,53	5,000 % fällig am 26.04.2047	500	496	0,15
Diageo Finance PLC 2,750 % fällig am 08.06.2038	2.200	1.785	0,55	Mitchells & Butlers Finance PLC 6,013 % fällig am 15.12.2030	505	479	0,15	Scottish Hydro Electric Transmission PLC 2,125 % fällig am 24.03.2036	3.300	2.496	0,77
Eastern Power Networks PLC 2,125 % fällig am 25.11.2033	721	582	0,18	6,135 % fällig am 15.12.2030	\$ 606	442	0,14	2,250 % fällig am 27.09.2035	400	313	0,10
EMH Treasury PLC 4,500 % fällig am 29.01.2044	800	749	0,23	7,214 % fällig am 15.09.2034	£ 993	826	0,25	Segro PLC 5,750 % fällig am 20.06.2035	300	321	0,10
Eversholt Funding PLC 3,529 % fällig am 07.08.2042	800	636	0,20	Morhomes PLC 3,400 % fällig am 19.02.2040	2.800	2.295	0,71	Severn Trent Utilities Finance PLC 2,000 % fällig am 02.06.2040	1.800	1.200	0,37
Futures Treasury PLC 3,375 % fällig am 08.02.2044	1.000	800	0,25	Motability Operations Group PLC 1,500 % fällig am 20.01.2041	800	506	0,16	4,625 % fällig am 30.11.2034	300	294	0,09
GlaxoSmithKline Capital PLC 1,625 % fällig am 12.05.2035	4.000	3.063	0,94	2,125 % fällig am 18.01.2042	2.600	1.791	0,55	4,875 % fällig am 24.01.2042	1.300	1.266	0,39
6,375 % fällig am 09.03.2039	500	599	0,18	2,375 % fällig am 03.07.2039	1.400	1.052	0,32	5,250 % fällig am 04.04.2036	300	311	0,10
Grainger PLC 3,000 % fällig am 03.07.2030	2.100	1.802	0,56	4,875 % fällig am 17.01.2043	1.100	1.111	0,34	Society of Lloyd's 4,875 % fällig am 07.02.2047	1.200	1.163	0,36
3,375 % fällig am 24.04.2028	100	92	0,03	5,750 % fällig am 11.09.2048	600	677	0,21	South Eastern Power Networks PLC 1,750 % fällig am 30.09.2034	5.000	3.797	1,17
Great Places Housing Group Ltd. 4,750 % fällig am 22.10.2042	1.000	967	0,30	National Gas Transmission PLC 5,750 % fällig am 05.04.2035	1.850	1.953	0,60	Southern Electric Power Distribution PLC 4,625 % fällig am 20.02.2037	1.500	1.466	0,45
Greene King Finance PLC 3,593 % fällig am 15.03.2035	702	629	0,19	National Grid Electricity Distribution East Midlands PLC 6,250 % fällig am 10.12.2040	500	563	0,17	Southern Gas Networks PLC 3,100 % fällig am 15.09.2036	2.100	1.688	0,52
4,064 % fällig am 15.03.2035	261	239	0,07	National Grid Electricity Distribution South Wales PLC 1,625 % fällig am 07.10.2035	1.100	781	0,24	6,375 % fällig am 15.05.2040	600	654	0,20
5,106 % fällig am 15.03.2034	2.076	2.017	0,62	National Grid Electricity Distribution South West PLC 5,750 % fällig am 23.03.2040	700	747	0,23	6,625 % fällig am 14.03.2035	600	666	0,21
5,318 % fällig am 15.09.2031	1.355	1.330	0,41	National Grid Electricity Transmission PLC 2,000 % fällig am 16.09.2038	1.200	823	0,25	Southern Housing 2,375 % fällig am 08.10.2036	1.500	1.124	0,35
Guinness Partnership Ltd. 4,000 % fällig am 24.10.2044	1.000	876	0,27	2,000 % fällig am 17.04.2040	2.008	1.331	0,41	3,500 % fällig am 19.10.2047	1.400	1.051	0,32
Haleon UK Capital PLC 3,375 % fällig am 29.03.2038	1.920	1.642	0,51	2,750 % fällig am 06.02.2035	600	486	0,15	Sovereign Housing Capital PLC 2,375 % fällig am 04.11.2048	600	383	0,12
Hexagon Housing Association Ltd. 3,625 % fällig am 22.04.2048	1.300	978	0,30	5,272 % fällig am 18.01.2043	2.000	2.019	0,62	5,705 % fällig am 10.09.2039	700	763	0,24
High Speed Rail Finance PLC 4,375 % fällig am 01.11.2038	1.500	1.406	0,43	Nationwide Building Society 5,875 % fällig am 20.12.2024 (a)(b)	700	689	0,21	Standard Chartered PLC 4,375 % fällig am 18.01.2038	900	848	0,26
Home Group Ltd. 3,125 % fällig am 27.03.2043	1.300	965	0,30	NatWest Group PLC 3,619 % fällig am 29.03.2029	2.000	1.876	0,58	5,125 % fällig am 06.06.2034	500	476	0,15
HSBC Holdings PLC 5,875 % fällig am 28.09.2026 (a)(b)	200	191	0,06	Network Rail Infrastructure Finance PLC 4,750 % fällig am 29.11.2035	400	425	0,13	SW Finance PLC 7,375 % fällig am 12.12.2041	800	859	0,26
6,000 % fällig am 29.03.2040	1.000	1.009	0,31	Northern Electric Finance PLC 2,750 % fällig am 24.05.2049	2.150	1.499	0,46	Telereal Secured Finance PLC 4,010 % fällig am 10.12.2033	1.174	1.107	0,34
Hyde Housing Association Ltd. 1,750 % fällig am 18.08.2055	1.600	817	0,25	Northern Gas Networks Finance PLC 4,875 % fällig am 15.11.2035	900	885	0,27	Telereal Securitisation PLC 6,165 % fällig am 10.12.2033	82	84	0,03
Jigsaw Funding PLC 3,375 % fällig am 05.05.2052	800	631	0,19	5,625 % fällig am 23.03.2040	800	827	0,25	Tesco Corporate Treasury Services PLC 5,500 % fällig am 27.02.2035	1.800	1.826	0,56
John Lewis PLC 4,250 % fällig am 18.12.2034	1.222	889	0,27	Northern Powergrid Northeast PLC 1,875 % fällig am 16.06.2062	100	53	0,02	Tesco Property Finance PLC 5,411 % fällig am 13.07.2044	1.970	1.916	0,59
Juturna European Loan Conduit PLC 5,064 % fällig am 10.08.2033	936	951	0,29	3,250 % fällig am 01.04.2052	600	455	0,14	5,661 % fällig am 13.10.2041	188	190	0,06
Karbon Homes Ltd. 3,375 % fällig am 15.11.2047	300	241	0,07	Northern Powergrid Yorkshire PLC 2,250 % fällig am 09.10.2059	1.000	577	0,18	5,744 % fällig am 13.04.2040	2.854	2.887	0,89
Land Securities Capital Markets PLC 2,625 % fällig am 22.09.2039	1.373	1.083	0,33	5,125 % fällig am 04.05.2035	710	728	0,22	5,801 % fällig am 13.10.2040	322	329	0,10
2,750 % fällig am 22.09.2059	301	195	0,06	Northumbrian Water Finance PLC 4,500 % fällig am 14.02.2031	800	772	0,24	6,052 % fällig am 13.10.2039	111	116	0,04
LCR Finance PLC 4,500 % fällig am 07.12.2038	75	77	0,02	5,625 % fällig am 29.04.2033	400	412	0,13	Thames Water Utilities Finance PLC 2,375 % fällig am 22.04.2040	1.100	678	0,21
Legal & General Group PLC 4,500 % fällig am 01.11.2050	400	369	0,11	6,375 % fällig am 28.10.2034	1.020	1.095	0,34	2,625 % fällig am 24.01.2032	300	235	0,07
5,500 % fällig am 27.06.2064	900	890	0,27	Notting Hill Genesis 2,000 % fällig am 03.06.2036	2.534	1.846	0,57	4,375 % fällig am 03.07.2034	3.700	3.155	0,97
5,625 % fällig am 24.03.2031 (a)(b)	900	766	0,24	3,250 % fällig am 12.10.2048	1.141	839	0,26	5,125 % fällig am 28.09.2037	800	700	0,22
Lloyds Bank PLC 6,500 % fällig am 17.09.2040	3.700	4.430	1,36	5,250 % fällig am 07.07.2042	199	200	0,06	5,500 % fällig am 11.02.2041	200	178	0,06
Lloyds Banking Group PLC 2,707 % fällig am 03.12.2035	127	102	0,03	Optivo Finance PLC 2,857 % fällig am 07.10.2035	2.200	1.776	0,55	7,738 % fällig am 09.04.2058	600	684	0,21
London & Quadrant Housing Trust 2,000 % fällig am 31.03.2032	2.000	1.632	0,50	Orbit Capital PLC 3,375 % fällig am 14.06.2048	700	531	0,16	8,250 % fällig am 25.04.2040	400	450	0,14
2,000 % fällig am 20.10.2038	1.200	821	0,25	Pacific Quay Finance PLC 5,565 % fällig am 25.07.2034	748	781	0,24	Together Housing Finance PLC 4,500 % fällig am 17.12.2042	300	275	0,09
3,125 % fällig am 28.02.2053	1.000	706	0,22	Paragon Treasury PLC 2,000 % fällig am 07.05.2036	1.300	935	0,29	TP ICAP Finance PLC 2,625 % fällig am 18.11.2028	1.000	838	0,26
3,750 % fällig am 27.10.2049	300	238	0,07	Peabody Capital PLC 3,250 % fällig am 14.09.2048	2.400	1.778	0,55	Unique Pub Finance Co. PLC 5,659 % fällig am 30.06.2027	883	882	0,27
4,625 % fällig am 05.12.2033	900	886	0,27	5,250 % fällig am 17.03.2043	300	304	0,09	7,395 % fällig am 28.03.2024	106	106	0,03
				Places for People Treasury PLC 2,500 % fällig am 26.01.2036	1.100	831	0,26	United Utilities Water Finance PLC 5,750 % fällig am 26.06.2036	1.700	1.840	0,57
				6,250 % fällig am 06.12.2041	100	108	0,03	University of Oxford 2,544 % fällig am 08.12.2117	3.150	1.857	0,57
								Virgin Media Secured Finance PLC 4,250 % fällig am 15.01.2030	1.100	965	0,30

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Vodafone Group PLC				STAATSEMISSIONEN				Realty Income Corp.			
3,000 % fällig am 12.08.2056	£ 2.100	£ 1.353	0,42	United Kingdom Gilt				1,750 % fällig am 13.07.2033	£ 1.100	£ 837	0,26
3,375 % fällig am 08.08.2049	3.900	2.827	0,87	1,250 % fällig am 31.07.2051 (c)	£ 19.100	£ 10.179	3,13	2,500 % fällig am 14.01.2042	500	345	0,11
Wellcome Trust Finance PLC				1,500 % fällig am 31.07.2053	400	223	0,07	6,000 % fällig am 05.12.2039	200	216	0,07
4,625 % fällig am 25.07.2036	500	520	0,16	1,750 % fällig am 22.07.2057	2.100	1.225	0,38	Time Warner Cable LLC			
Wellcome Trust Ltd.				3,250 % fällig am 22.01.2044 (c)	3.300	2.909	0,90	5,250 % fällig am 15.07.2042	2.986	2.654	0,82
1,500 % fällig am 14.07.2071	5.600	2.523	0,78	3,750 % fällig am 22.10.2053	2.800	2.616	0,80	Venture Global LNG, Inc.			
2,517 % fällig am 07.02.2118	1.500	891	0,27					9,500 % fällig am 01.02.2029	\$ 1.000	831	0,26
4,000 % fällig am 09.05.2059	400	379	0,12	Summe Großbritannien		17.152	5,28	Verizon Communications, Inc.			
Workspace Group PLC						196.195	60,41	1,875 % fällig am 03.11.2038	£ 2.700	1.834	0,56
2,250 % fällig am 11.03.2028	450	387	0,12	USA				3,125 % fällig am 02.11.2035	600	507	0,16
Yorkshire Housing Finance PLC				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				3,375 % fällig am 27.10.2036	2.800	2.406	0,74
4,125 % fällig am 31.10.2044	800	690	0,21	Apple, Inc.				4,750 % fällig am 17.02.2034	1.000	996	0,31
Yorkshire Water Finance PLC				3,600 % fällig am 31.07.2042	1.400	1.277	0,39	Walmart, Inc.			
1,750 % fällig am 27.10.2032	715	539	0,17	AT&T, Inc.				5,250 % fällig am 28.09.2035	2.000	2.198	0,68
2,750 % fällig am 18.04.2041	1.100	763	0,24	4,250 % fällig am 01.06.2043	5.113	4.430	1,36	5,625 % fällig am 27.03.2034	1.600	1.795	0,55
5,500 % fällig am 28.04.2035	1.300	1.288	0,40	4,875 % fällig am 01.06.2044	4.038	3.765	1,16	Wells Fargo & Co.			
		172.371	53,08	Berkshire Hathaway Finance Corp.				2,125 % fällig am 24.09.2031	400	329	0,10
NON-AGENCY-MBS				2,375 % fällig am 19.06.2039	400	299	0,09	4,625 % fällig am 02.11.2035	1.729	1.688	0,52
Atlas Funding PLC				2,625 % fällig am 19.06.2059	1.700	1.092	0,34	4,875 % fällig am 29.11.2035	1.700	1.606	0,49
6,348 % fällig am 20.01.2061	581	583	0,18	Charter Communications Operating LLC				Welltower OP LLC			
Great Hall Mortgages PLC				5,125 % fällig am 01.07.2049	\$ 500	319	0,10	4,500 % fällig am 01.12.2034	1.000	948	0,29
4,082 % fällig am 18.06.2038	€ 2	2	0,00	Citigroup, Inc.						45.331	13,96
5,469 % fällig am 18.03.2039	£ 3	3	0,00	6,800 % fällig am 25.06.2038	£ 2.000	2.396	0,74	NON-AGENCY-MBS			
Hops Hill PLC				7,375 % fällig am 01.09.2039	400	508	0,16	Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust			
6,148 % fällig am 27.05.2054	378	378	0,12	Comcast Corp.				5,970 % fällig am 25.04.2035	\$ 136	94	0,03
Mansard Mortgages PLC				1,875 % fällig am 20.02.2036	2.400	1.814	0,56	GSR Mortgage Loan Trust			
5,989 % fällig am 15.12.2049	106	105	0,03	Credit Suisse AG AT1 Claim	\$ 1.600	151	0,05	5,778 % fällig am 25.09.2035	0	0	0,00
Mortimer BTL PLC				Eli Lilly & Co.				Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust			
5,920 % fällig am 23.06.2053	902	897	0,28	1,625 % fällig am 14.09.2043	£ 700	452	0,14	5,916 % fällig am 15.12.2030	3	2	0,00
6,269 % fällig am 23.03.2054	721	722	0,22	Entergy Corp.				Sequoia Mortgage Trust			
Newgate Funding PLC				3,750 % fällig am 15.06.2050	\$ 57	34	0,01	3,675 % fällig am 20.07.2037	6	4	0,00
4,525 % fällig am 15.12.2050	€ 1.148	976	0,30	Goldman Sachs Group, Inc.						100	0,03
5,509 % fällig am 01.12.2050	£ 56	54	0,02	3,625 % fällig am 29.10.2029	£ 1.800	1.705	0,52	US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Pierpont BTL PLC				JPMorgan Chase & Co.				Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
6,320 % fällig am 21.09.2054	857	858	0,26	1,895 % fällig am 28.04.2033	1.400	1.149	0,35	4,000 % fällig am 01.02.2054	5.900	4.382	1,35
Polaris PLC				McDonald's Corp.				4,500 % fällig am 01.02.2054	3.000	2.283	0,70
5,985 % fällig am 23.12.2058	374	373	0,11	2,950 % fällig am 15.03.2034 (c)	400	349	0,11	5,000 % fällig am 01.02.2054	4.400	3.416	1,05
Stratton Mortgage Funding PLC				3,750 % fällig am 31.05.2038	2.100	1.873	0,58	5,500 % fällig am 01.02.2054	4.100	3.231	0,99
6,121 % fällig am 20.07.2060	581	581	0,18	Mondelez International, Inc.				6,500 % fällig am 01.02.2054	5.600	4.501	1,39
Towd Point Mortgage Funding PLC				3,875 % fällig am 06.03.2045	100	81	0,02			17.813	5,48
6,365 % fällig am 20.10.2051	470	471	0,14	Morgan Stanley				Summe USA		63.244	19,47
Twin Bridges PLC				5,789 % fällig am 18.11.2033	800	853	0,26	Summe Übertragbare Wertpapiere	£ 330.293	101,70	
6,070 % fällig am 12.03.2055	671	669	0,21	National Fuel Gas Co.							
		6.672	2,05	2,950 % fällig am 01.03.2031	\$ 159	105	0,03				
				Pfizer, Inc.							
				2,735 % fällig am 15.06.2043	£ 4.600	3.489	1,07				

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
SCX	5,160 %	29.12.2023	02.01.2024	£ 6.500	United Kingdom Inflation-Linked Gilt 3,750 % fällig am 22.10.2053	£ (6.625)	£ 6.500	£ 6.504	2,00
Summe Pensionsgeschäfte						£ (6.625)	£ 6.500	£ 6.504	2,00

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2024	21	£ (32)	(0,01)
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Long	03.2024	3	(7)	0,00
Euro-Schatz March Futures	Long	03.2024	48	28	0,01
Japan Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2024	14	(95)	(0,03)
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Short	03.2024	44	(57)	(0,02)

Aufstellung der Wertpapieranlagen des UK Long Term Corporate Bond Fund (Forts.)

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2024	13	£ 17	0,01
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2024	35	22	0,01
U.S. Treasury 10-Year Ultra March Futures	Long	03.2024	57	172	0,05
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Long	03.2024	7	30	0,01
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2024	3	(14)	(0,01)
United Kingdom Long Gilt March Futures	Long	03.2024	202	1.142	0,35
				£ 1.206	0,37
				£ 1.206	0,37

Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Cellnex Telecom S.A.	5,000 %	20.12.2033	€ 700	£ 48	0,02
Deutsche Lufthansa AG	1,000	20.12.2028	1.100	2	0,00
				£ 50	0,02

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	4,250 %	20.03.2054	£ 5.800	£ 749	0,23
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	5,000	20.03.2029	9.300	(280)	(0,09)
Zahlung ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	5,500	20.03.2026	9.500	70	0,02
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,000	16.12.2030	\$ 3.700	458	0,14
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,250	16.12.2050	100	29	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,500	18.12.2029	2.700	400	0,12
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,625	16.01.2050	100	35	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	21.06.2047	1.300	443	0,14
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	18.12.2049	400	143	0,05
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	12.02.2045	6.600	2.218	0,68
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,750	20.12.2025	CAD 14.000	170	0,05
Zahlung ⁽³⁾	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,750	20.12.2033	AUD 8.100	103	0,03
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,547	09.03.2033	€ 1.400	43	0,01
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	20.03.2054	3.200	(264)	(0,08)
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.03.2034	6.300	313	0,10
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,250	20.03.2029	500	(16)	0,00
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,500	20.03.2026	4.300	(59)	(0,02)
					£ 4.555	1,40
					£ 4.605	1,42

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

⁽³⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2024	\$ 128	£ 101	£ 0	£ 0	£ 0	0,00
BPS	01.2024	487	384	2	0	2	0,00
BRC	01.2024	€ 185	160	0	0	0	0,00
	01.2024	¥ 15.300	82	0	(3)	(3)	0,00
GLM	01.2024	£ 99	CAD 171	3	0	3	0,00
MBC	01.2024	689	€ 801	6	0	6	0,00
	01.2024	\$ 355	£ 278	0	(1)	(1)	0,00
MYI	01.2024	£ 444	\$ 557	0	(6)	(6)	0,00
	01.2024	¥ 23.100	£ 124	0	(4)	(4)	0,00
SCX	01.2024	€ 5.862	5.089	9	0	9	0,00

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
UAG	01.2024	£ 445	\$ 564	£ 0	£ (3)	£ (3)	0,00
	01.2024	\$ 2.639	£ 2.085	14	0	14	0,01
				£ 34	£ (17)	£ 17	0,01
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						£ 17	0,01
Summe Anlagen						£ 342.621	105,50
Sonstige Aktiva und Passiva						£ (17.853)	(5,50)
Nettovermogen						£ 324.768	100,00

ERLAUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi konnen fur faktisch vorhandene Betrage stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

(a) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nachsten vertraglichen Kundigungstermin dar.

(b) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(c) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von GBP 4.309 (31. Dezember 2022: GBP null) waren zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten gema den Rahmenvertragen und/oder globalen Rahmenvertragen fur Pensionsgeschafte verpfandet.

Barmittel in Hohede von GBP 197 (31. Dezember 2022: GBP null) wurden zum 31. Dezember 2023 gema den Rahmenvertragen und/oder globalen Rahmenvertragen fur Pensionsgeschafte als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Hohede von GBP 3.754 (31. Dezember 2022: GBP 10.123) waren zum 31. Dezember 2023 als Sicherheit fur borsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfandet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Markten notierte Kurse fur identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Ubertragbare Wertpapiere	£ 0	£ 330.293	£ 0	£ 330.293
Pensionsgeschafte	0	6.500	0	6.500
Finanzderivate ⁽³⁾	1.036	4.792	0	5.828
Summen	£ 1.036	£ 341.585	£ 0	£ 342.621

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Markten notierte Kurse fur identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Ubertragbare Wertpapiere	£ 0	£ 309.110	£ 0	£ 309.110
Pensionsgeschafte	0	269	0	269
Finanzderivate ⁽³⁾	(1.767)	6.087	0	4.320
Summen	£ (1.767)	£ 315.466	£ 0	£ 313.699

⁽¹⁾ Zwecks zusatzlicher Informationen siehe Erlauterung 3 in den Erlauterungen zum Abschluss.

⁽²⁾ Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

⁽³⁾ Finanzderivate konnen offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschafte zum 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Falligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensionsgeschafte	% des Nettovermogens
BPS	4,500 %	22.11.2023	TBD ⁽¹⁾	£ (168)	£ (168)	(0,05)
CEW	5,360	07.11.2023	06.02.2024	(2.675)	(2.697)	(0,83)
MEI	5,400	07.11.2023	06.02.2024	(1.072)	(1.081)	(0,34)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschafte					£ (3.946)	(1,22)

⁽¹⁾ Umgekehrtes Pensionsgeschafte mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	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)
BPS	2	0	2	k. A.	k. A.	k. A.
BRC	(3)	0	(3)	1	0	1
GLM	3	0	3	(76)	0	(76)
JPM	k. A.	k. A.	k. A.	48	0	48
MBC	5	0	5	9	0	9
MYI	(10)	0	(10)	2	0	2
SCX	9	0	9	(4)	0	(4)
SSB	k. A.	k. A.	k. A.	(239)	0	(239)
UAG	11	0	11	(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. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	95,70	93,60
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	5,95	1,51
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,05	k. A.
Pensionsgeschäfte	2,00	0,08
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,37	(0,54)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	1,42	1,83
Freiverkehrsfinanzderivate	0,01	0,04
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(1,22)	k. A.

* Gemäß der Liste der Märkte, die die Kriterien für einen geregelten OGAW-Markt erfüllen, in Anlage 1 zum Verkaufsprospekt.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Australien	0,14	k. A.
Belgien	k. A.	0,19
Bermuda	0,18	k. A.
Cayman-Inseln	0,78	k. A.
Dänemark	1,45	1,23
Frankreich	7,04	5,11
Deutschland	0,47	2,80
Indien	k. A.	0,05
Irland	0,77	2,32
Italien	0,74	0,78
Japan	k. A.	0,09
Jersey, Kanalinseln	3,51	2,73
Luxemburg	0,56	1,21
Mexiko	0,53	0,13
Niederlande	4,27	5,45
Norwegen	0,21	0,27
Singapur	0,35	0,33
Spanien	0,13	0,22
Supranational	k. A.	1,18
Schweden	0,44	0,16
Schweiz	0,25	1,21
Großbritannien	60,41	52,18
USA	19,47	13,85
Kurzfristige Instrumente	k. A.	3,62
Pensionsgeschäfte	2,00	0,08
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,37	(0,54)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,02	0,05
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	k. A.	0,14
Zinsswaps	1,40	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	0,01	0,05
Sonstige Aktiva und Passiva	(5,50)	3,48
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des US High Yield Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
5,875 % fällig am 01.10.2028	\$ 1.500	\$ 1.477	0,08	6,125 % fällig am 01.12.2028	\$ 2.000	\$ 1.732	0,09	4,500 % fällig am 01.06.2033	\$ 7.000	\$ 5.932	0,32
PennyMac Financial Services, Inc.				Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC				4,750 % fällig am 01.03.2030	5.000	4.576	0,24
5,375 % fällig am 15.10.2025	1.000	989	0,05	3,250 % fällig am 01.09.2028	2.000	1.752	0,09	5,000 % fällig am 01.02.2028	2.000	1.915	0,10
5,750 % fällig am 15.09.2031	2.000	1.854	0,10	4,000 % fällig am 01.09.2029	2.000	1.695	0,09	5,125 % fällig am 01.05.2027	600	580	0,03
7,875 % fällig am 15.12.2029	2.400	2.474	0,13	6,000 % fällig am 15.06.2027	1.000	997	0,05	5,375 % fällig am 01.06.2029	4.000	3.776	0,20
PRA Group, Inc.				Ascent Resources Utica Holdings LLC				CD&R Smokey Buyer, Inc.			
7,375 % fällig am 01.09.2025	2.725	2.712	0,15	5,875 % fällig am 30.06.2029	2.000	1.863	0,10	6,750 % fällig am 15.07.2025	2.589	2.564	0,14
Rocket Mortgage LLC				8,250 % fällig am 31.12.2028	1.000	1.007	0,05	Central Garden & Pet Co.			
3,625 % fällig am 01.03.2029	1.000	906	0,05	Athenahealth Group, Inc.				4,125 % fällig am 15.10.2030	4.100	3.734	0,20
3,875 % fällig am 01.03.2031	2.000	1.761	0,09	6,500 % fällig am 15.02.2030	5.000	4.543	0,24	Central Parent LLC			
4,000 % fällig am 15.10.2033	2.000	1.701	0,09	Avantor Funding, Inc.				8,000 % fällig am 15.06.2029	2.400	2.507	0,13
SBA Communications Corp.				4,625 % fällig am 15.07.2028	6.000	5.803	0,31	Cerba Healthcare SACA			
3,125 % fällig am 01.02.2029	10.000	8.996	0,48	Axalta Coating Systems LLC				3,500 % fällig am 31.05.2028	€ 9.900	9.187	0,49
3,875 % fällig am 15.02.2027	1.000	961	0,05	3,375 % fällig am 15.02.2029	8.000	7.187	0,38	Charles River Laboratories International, Inc.			
UBS Group AG				B&G Foods, Inc.				3,750 % fällig am 15.03.2029	\$ 2.000	1.834	0,10
9,250 % fällig am 13.11.2028 (d)(f)	300	324	0,02	8,000 % fällig am 15.09.2028	4.750	4.994	0,27	4,000 % fällig am 15.03.2031	100	90	0,00
UniCredit SpA				B.C. Ltd.				Cheplapharm Arzneimittel GmbH			
5,459 % fällig am 30.06.2035	1.000	942	0,05	9,000 % fällig am 30.01.2028	2.150	2.098	0,11	5,500 % fällig am 15.01.2028	800	757	0,04
USI, Inc.				B.C. Unlimited Liability Co.				Chesapeake Energy Corp.			
7,500 % fällig am 15.01.2032	600	615	0,03	3,500 % fällig am 15.02.2029	8.750	8.077	0,43	6,750 % fällig am 15.04.2029	7.500	7.578	0,40
Voyager Aviation Holdings LLC				3,875 % fällig am 15.01.2028	2.000	1.891	0,10	Chobani LLC			
8,500 % fällig am 09.05.2026 ^	1.805	981	0,05	4,000 % fällig am 15.10.2030	11.575	10.396	0,56	4,625 % fällig am 15.11.2028	2.000	1.872	0,10
		159.091	8,49	4,375 % fällig am 15.01.2028	2.000	1.912	0,10	Churchill Downs, Inc.			
				Ball Corp.				4,750 % fällig am 15.01.2028	5.000	4.795	0,26
INDUSTRIEWERTE				2,875 % fällig am 15.08.2030	5.000	4.296	0,23	5,500 % fällig am 01.04.2027	1.600	1.584	0,08
24 Hour Fitness Worldwide, Inc.				6,000 % fällig am 15.06.2029	1.050	1.074	0,06	5,750 % fällig am 01.04.2030	2.000	1.952	0,10
8,000 % fällig am 01.06.2022 ^	9.500	24	0,00	Bath & Body Works, Inc.				6,750 % fällig am 01.05.2031	800	813	0,04
Academy Ltd.				6,875 % fällig am 01.11.2035	3.000	3.042	0,16	Cimpress PLC			
6,000 % fällig am 15.11.2027	550	541	0,03	9,375 % fällig am 01.07.2025	1.438	1.520	0,08	7,000 % fällig am 15.06.2026	800	783	0,04
Acushnet Co.				Bausch & Lomb Escrow Corp.				Cinemark USA, Inc.			
7,375 % fällig am 15.10.2028	350	365	0,02	8,375 % fällig am 01.10.2028	7.225	7.631	0,41	5,250 % fällig am 15.07.2028	1.225	1.125	0,06
AdaptHealth LLC				BCPE Empire Holdings, Inc.				5,875 % fällig am 15.03.2026	600	588	0,03
6,125 % fällig am 01.08.2028	200	173	0,01	7,625 % fällig am 01.05.2027	12.200	11.777	0,63	CITGO Petroleum Corp.			
Adient Global Holdings Ltd.				Beacon Roofing Supply, Inc.				8,375 % fällig am 15.01.2029	3.100	3.190	0,17
7,000 % fällig am 15.04.2028	1.000	1.034	0,06	6,500 % fällig am 01.08.2030	3.200	3.274	0,17	Clarios Global LP			
ADT Security Corp.				Block, Inc.				6,750 % fällig am 15.05.2028	5.000	5.104	0,27
4,875 % fällig am 15.07.2032	3.200	2.963	0,16	3,500 % fällig am 01.06.2031	5.000	4.449	0,24	Clarivate Science Holdings Corp.			
Advantage Sales & Marketing, Inc.				Bombardier, Inc.				4,875 % fällig am 01.07.2029	5.000	4.697	0,25
6,500 % fällig am 15.11.2028	5.725	5.282	0,28	6,000 % fällig am 15.02.2028	3.000	2.926	0,16	Clear Channel International BV			
Ahead DB Holdings LLC				7,125 % fällig am 15.06.2026	3.879	3.864	0,21	6,625 % fällig am 01.08.2025	1.300	1.307	0,07
6,625 % fällig am 01.05.2028	10.000	8.723	0,47	7,500 % fällig am 01.02.2029	3.700	3.765	0,20	Clear Channel Outdoor Holdings, Inc.			
Ahlstrom Holding Oy				7,875 % fällig am 15.04.2027	2.611	2.614	0,14	5,125 % fällig am 15.08.2027	2.200	2.102	0,11
4,875 % fällig am 04.02.2028	4.000	3.512	0,19	Boyne USA, Inc.				Cloud Software Group, Inc.			
Air Canada				4,750 % fällig am 15.05.2029	2.500	2.354	0,13	6,500 % fällig am 31.03.2029	7.000	6.673	0,36
3,875 % fällig am 15.08.2026	2.500	2.390	0,13	Buckeye Partners LP				Clydesdale Acquisition Holdings, Inc.			
4,625 % fällig am 15.08.2029	CAD 1.750	1.230	0,07	4,125 % fällig am 01.03.2025	2.000	1.941	0,10	8,750 % fällig am 15.04.2030	10.000	9.336	0,50
Albion Financing SARL				4,500 % fällig am 01.03.2028	700	660	0,04	Coherent Corp.			
6,125 % fällig am 15.10.2026	\$ 4.250	4.215	0,23	Builders FirstSource, Inc.				5,000 % fällig am 15.12.2029	600	570	0,03
Allegiant Travel Co.				5,000 % fällig am 01.03.2030	5.000	4.834	0,26	CommScope, Inc.			
7,250 % fällig am 15.08.2027	1.000	980	0,05	CAB SELAS				4,750 % fällig am 01.09.2029	1.525	1.025	0,05
Allison Transmission, Inc.				3,375 % fällig am 01.02.2028	€ 5.000	4.937	0,26	6,000 % fällig am 01.03.2026	2.500	2.230	0,12
3,750 % fällig am 30.01.2031	4.000	3.538	0,19	Cable One, Inc.				Community Health Systems, Inc.			
Altice Financing S.A.				4,000 % fällig am 15.11.2030	\$ 900	730	0,04	4,750 % fällig am 15.02.2031	5.000	3.937	0,21
5,000 % fällig am 15.01.2028	4.000	3.629	0,19	Cablevision Lightpath LLC				5,250 % fällig am 15.05.2030	3.000	2.513	0,13
Altice France S.A.				5,625 % fällig am 15.09.2028	4.000	3.157	0,17	5,625 % fällig am 15.03.2027	6.650	6.187	0,33
5,125 % fällig am 15.01.2029	3.000	2.336	0,12	Caesars Entertainment, Inc.				8,000 % fällig am 15.03.2026	741	739	0,04
5,125 % fällig am 15.07.2029	4.000	3.117	0,17	4,625 % fällig am 15.10.2029	8.200	7.407	0,40	Comstock Resources, Inc.			
5,500 % fällig am 15.01.2028	8.000	6.595	0,35	7,000 % fällig am 15.02.2030	1.300	1.334	0,07	5,875 % fällig am 15.01.2030	3.000	2.606	0,14
5,500 % fällig am 15.10.2029	2.000	1.571	0,08	Capstone Borrower, Inc.				6,750 % fällig am 01.03.2029	4.075	3.732	0,20
8,125 % fällig am 01.02.2027	3.000	2.768	0,15	8,000 % fällig am 15.06.2030	2.050	2.135	0,11	Connect Finco SARL			
11,500 % fällig am 01.02.2027 (a)(g) €	800	890	0,05	Cargo Aircraft Management, Inc.				6,750 % fällig am 01.10.2026	2.000	1.990	0,11
AMC Networks, Inc.				4,750 % fällig am 01.02.2028	5.300	4.857	0,26	Consolidated Communications, Inc.			
4,250 % fällig am 15.02.2029	\$ 6.100	4.660	0,25	Carnival Corp.				5,000 % fällig am 01.10.2028	2.000	1.642	0,09
4,750 % fällig am 01.08.2025	4.900	4.775	0,26	4,000 % fällig am 01.08.2028	5.000	4.652	0,25	Coty, Inc.			
American Airlines Pass-Through Trust				5,750 % fällig am 01.03.2027	8.900	8.688	0,46	5,000 % fällig am 15.04.2026	1.045	1.029	0,06
3,375 % fällig am 01.11.2028	2.013	1.847	0,10	6,000 % fällig am 01.05.2029	2.500	2.407	0,13	6,625 % fällig am 15.07.2030	3.700	3.803	0,20
American Airlines, Inc.				7,625 % fällig am 01.03.2026 (h)	5.000	5.094	0,27	Covanta Holding Corp.			
5,500 % fällig am 20.04.2026	5.583	5.547	0,30	Carnival PLC				4,875 % fällig am 01.12.2029	750	656	0,04
5,750 % fällig am 20.04.2029	16.725	16.322	0,87	1,000 % fällig am 28.10.2029	€ 5.000	4.020	0,21	5,000 % fällig am 01.09.2030	1.000	853	0,05
Antero Resources Corp.				Catalent Pharma Solutions, Inc.				CQP Holdco LP			
5,375 % fällig am 01.03.2030	700	672	0,04	2,375 % fällig am 01.03.2028	2.000	1.929	0,10	5,500 % fällig am 15.06.2031	3.500	3.322	0,18
API Group DE, Inc.				3,125 % fällig am 15.02.2029	\$ 6.000	5.257	0,28	Crocs, Inc.			
4,750 % fällig am 15.10.2029	4.000	3.762	0,20	CCO Holdings LLC				4,250 % fällig am 15.03.2029	2.000	1.794	0,10
Arches Buyer, Inc.				4,250 % fällig am 01.02.2031	5.000	4.376	0,23	Crowdstrike Holdings, Inc.			
4,250 % fällig am 01.06.2028	3.500	3.173	0,17	4,250 % fällig am 15.01.2034	3.700	3.012	0,16	3,000 % fällig am 15.02.2029	1.800	1.629	0,09
				4,500 % fällig am 15.08.2030	10.000	9.028	0,48	Crown Americas LLC			
				4,500 % fällig am 01.05.2032	10.000	8.578	0,46	5,250 % fällig am 01.04.2030	1.000	986	0,05

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
CSC Holdings LLC	\$ 4.000	\$ 2.923	0,16	Graphic Packaging International LLC	\$ 5.000	\$ 4.520	0,24	Legacy LifePoint Health LLC	\$ 4.900	\$ 4.529	0,24
3,375 % fällig am 15.02.2031				3,500 % fällig am 01.03.2029				4,375 % fällig am 15.02.2027			
4,125 % fällig am 01.12.2030	2.500	1.905	0,10	Gray Television, Inc.				Level 3 Financing, Inc.			
4,500 % fällig am 15.11.2031	1.000	757	0,04	5,875 % fällig am 15.07.2026	1.000	974	0,05	3,750 % fällig am 15.07.2029	5.000	2.600	0,14
6,500 % fällig am 01.02.2029	3.000	2.650	0,14	Grifols S.A.				LifePoint Health, Inc.			
DaVita, Inc.				4,750 % fällig am 15.10.2028	9.675	8.785	0,47	11,000 % fällig am 15.10.2030	3.800	4.007	0,21
4,625 % fällig am 01.06.2030	4.100	3.583	0,19	GTCR W-2 Merger Sub LLC				Light & Wonder International, Inc.			
Diamond Foreign Asset Co.				7,500 % fällig am 15.01.2031	3.400	3.595	0,19	7,500 % fällig am 01.09.2031	2.000	2.087	0,11
8,500 % fällig am 01.10.2030	775	793	0,04	Harbour Energy PLC				Lindblad Expeditions Holdings, Inc.			
Diamond Offshore Drilling, Inc.				5,500 % fällig am 15.10.2026	3.800	3.718	0,20	9,000 % fällig am 15.05.2028	3.000	3.115	0,17
13,000 % fällig am 21.12.2026	77	75	0,00	HealthEquity, Inc.				Lindblad Expeditions LLC			
Diamond Sports Group LLC				4,500 % fällig am 01.10.2029	1.800	1.674	0,09	6,750 % fällig am 15.02.2027	1.900	1.892	0,10
5,375 % fällig am 15.08.2026 ^	8.000	410	0,02	Hertz Corp.				Live Nation Entertainment, Inc.			
Directv Financing LLC				4,625 % fällig am 01.12.2026	1.200	1.077	0,06	3,750 % fällig am 15.01.2028	825	771	0,04
5,875 % fällig am 15.08.2027	10.000	9.404	0,50	Hilton Domestic Operating Co., Inc.				Madison IAQ LLC			
DISH DBS Corp.				3,625 % fällig am 15.02.2032	5.975	5.222	0,28	4,125 % fällig am 30.06.2028	2.450	2.230	0,12
5,250 % fällig am 01.12.2026	5.000	4.293	0,23	3,750 % fällig am 01.05.2029	2.000	1.856	0,10	MajorDrive Holdings LLC			
5,750 % fällig am 01.12.2028	12.800	10.233	0,55	4,000 % fällig am 01.05.2031	2.000	1.834	0,10	6,375 % fällig am 01.06.2029	12.475	10.755	0,57
5,875 % fällig am 15.11.2024	5.000	4.693	0,25	Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC				Marriott Ownership Resorts, Inc.			
7,750 % fällig am 01.07.2026	3.000	2.093	0,11	4,875 % fällig am 01.07.2031	3.000	2.659	0,14	4,500 % fällig am 15.06.2029	2.350	2.074	0,11
DISH Network Corp.				5,000 % fällig am 01.06.2029	2.500	2.309	0,12	Mauser Packaging Solutions Holding Co.			
11,750 % fällig am 15.11.2027	2.500	2.612	0,14	Hologic, Inc.				7,875 % fällig am 15.08.2026	3.500	3.565	0,19
DT Midstream, Inc.				3,250 % fällig am 15.02.2029	1.000	908	0,05	9,250 % fällig am 15.04.2027	2.000	1.965	0,11
4,125 % fällig am 15.06.2029	4.000	3.685	0,20	Howard Midstream Energy Partners LLC				McAfee Corp.			
4,375 % fällig am 15.06.2031	1.700	1.536	0,08	6,750 % fällig am 15.01.2027	3.000	2.970	0,16	7,375 % fällig am 15.02.2030	4.000	3.658	0,20
Edgewell Personal Care Co.				8,875 % fällig am 15.07.2028	2.825	2.968	0,16	Medline Borrower LP			
4,125 % fällig am 01.04.2029	800	729	0,04	Howmet Aerospace, Inc.				3,875 % fällig am 01.04.2029	10.925	9.891	0,53
Element Solutions, Inc.				5,950 % fällig am 01.02.2037	2.000	2.090	0,11	5,250 % fällig am 01.10.2029	3.800	3.587	0,19
3,875 % fällig am 01.09.2028	1.200	1.106	0,06	iHeartCommunications, Inc.				Merlin Entertainments Ltd.			
Embecta Corp.				4,750 % fällig am 15.01.2028	2.100	1.617	0,09	5,750 % fällig am 15.06.2026	2.000	1.981	0,11
5,000 % fällig am 15.02.2030 (h)	4.300	3.653	0,20	8,375 % fällig am 01.05.2027	2.200	1.430	0,08	Midwest Gaming Borrower LLC			
Emerald Debt Merger Sub LLC				IHO Verwaltungs GmbH (4,750 % bar oder 5,500 % PIK)				4,875 % fällig am 01.05.2029	5.000	4.656	0,25
6,625 % fällig am 15.12.2030	3.800	3.886	0,21	4,750 % fällig am 15.09.2026 (b)	2.000	1.918	0,10	Molina Healthcare, Inc.			
EnLink Midstream LLC				IHO Verwaltungs GmbH (6,000 % bar oder 6,750 % PIK)				3,875 % fällig am 15.05.2032	1.900	1.662	0,09
5,625 % fällig am 15.01.2028	5.000	4.948	0,26	6,000 % fällig am 15.05.2027 (b)	2.000	1.951	0,10	MPH Acquisition Holdings LLC			
6,500 % fällig am 01.09.2030	3.500	3.577	0,19	IHO Verwaltungs GmbH (6,375 % bar oder 7,125 % PIK)				5,500 % fällig am 01.09.2028	4.247	3.808	0,20
EnLink Midstream Partners LP				6,375 % fällig am 15.05.2029 (b)	1.750	1.719	0,09	5,750 % fällig am 01.11.2028 (h)	5.000	4.068	0,22
4,150 % fällig am 01.06.2025	1.987	1.944	0,10	Imola Merger Corp.				Murphy Oil USA, Inc.			
EQM Midstream Partners LP				4,750 % fällig am 15.05.2029	5.000	4.757	0,25	3,750 % fällig am 15.02.2031	1.000	872	0,05
4,000 % fällig am 01.08.2024	1.123	1.113	0,06	Ingevity Corp.				Nabors Industries, Inc.			
4,500 % fällig am 15.01.2029	7.700	7.281	0,39	3,875 % fällig am 01.11.2028	5.000	4.484	0,24	7,375 % fällig am 15.05.2027	3.000	2.942	0,16
4,750 % fällig am 15.01.2031	4.650	4.334	0,23	Innophos Holdings, Inc.				9,125 % fällig am 31.01.2030	500	502	0,03
6,000 % fällig am 01.07.2025	735	735	0,04	9,375 % fällig am 15.02.2028	7.200	6.546	0,35	NCL Corp. Ltd.			
6,500 % fällig am 01.07.2027	4.000	4.075	0,22	Intelligent Packaging Holdco Issuer LP (9,000 % bar oder 9,750 % PIK)				5,875 % fällig am 15.03.2026	4.800	4.694	0,25
6,500 % fällig am 15.07.2048	3.800	3.899	0,21	9,000 % fällig am 15.01.2026 (b)	3.000	2.581	0,14	5,875 % fällig am 15.02.2027	1.775	1.761	0,09
Fertitta Entertainment LLC				Intelligent Packaging Ltd. Finco, Inc.				NCR Atleos Corp.			
4,625 % fällig am 15.01.2029	2.000	1.816	0,10	6,000 % fällig am 15.09.2028	4.000	3.736	0,20	9,500 % fällig am 01.04.2029	6.575	6.992	0,37
First Student Bidco, Inc.				Intelsat Jackson Holdings S.A.				NCR Voyix Corp.			
4,000 % fällig am 31.07.2029	3.000	2.604	0,14	6,500 % fällig am 15.03.2030	11.249	10.744	0,57	5,000 % fällig am 01.10.2028	950	899	0,05
Ford Motor Co.				Iris Holdings, Inc. (8,750 % bar oder 9,500 % PIK)				5,125 % fällig am 15.04.2029	2.200	2.094	0,11
6,100 % fällig am 19.08.2032	2.500	2.521	0,13	8,750 % fällig am 15.02.2026 (b)	2.875	2.444	0,13	5,250 % fällig am 01.10.2030	1.200	1.104	0,06
Fortrea Holdings, Inc.				Jazz Securities DAC				NESCO Holdings, Inc.			
7,500 % fällig am 01.07.2030	2.500	2.571	0,14	4,375 % fällig am 15.01.2029	1.000	932	0,05	5,500 % fällig am 15.04.2029	2.250	2.083	0,11
Foundation Building Materials, Inc.				Jeld-Wen, Inc.				Newell Brands, Inc.			
6,000 % fällig am 01.03.2029	11.000	9.902	0,53	4,625 % fällig am 15.12.2025	750	726	0,04	6,375 % fällig am 15.09.2027 (h)	1.250	1.245	0,07
Frontier Communications Holdings LLC				4,875 % fällig am 15.12.2027	200	189	0,01	6,375 % fällig am 01.04.2036	300	275	0,01
5,000 % fällig am 01.05.2028	2.000	1.850	0,10	Kaiser Aluminum Corp.				Newfold Digital Holdings Group, Inc.			
5,875 % fällig am 15.10.2027	3.000	2.901	0,16	4,500 % fällig am 01.06.2031	1.000	864	0,05	6,000 % fällig am 15.02.2029	12.000	9.078	0,48
Gap, Inc.				4,625 % fällig am 01.03.2028	800	741	0,04	Nexstar Media, Inc.			
3,625 % fällig am 01.10.2029	9.300	7.963	0,43	Kinetik Holdings LP				5,625 % fällig am 15.07.2027	1.000	968	0,05
3,875 % fällig am 01.10.2031	2.800	2.310	0,12	6,625 % fällig am 15.12.2028	3.000	3.058	0,16	NextEra Energy Operating Partners LP			
Garda World Security Corp.				LABL, Inc.				3,875 % fällig am 15.10.2026	200	191	0,01
4,625 % fällig am 15.02.2027	4.500	4.342	0,23	5,875 % fällig am 01.11.2028	4.825	4.381	0,23	4,500 % fällig am 15.09.2027	2.925	2.818	0,15
6,000 % fällig am 01.06.2029	5.000	4.487	0,24	6,750 % fällig am 15.07.2026	2.000	1.947	0,10	7,250 % fällig am 15.01.2029	4.400	4.609	0,25
7,750 % fällig am 15.02.2028	6.000	6.214	0,33	8,250 % fällig am 01.11.2029	1.000	844	0,05	Noble Finance LLC			
GFL Environmental, Inc.				10,500 % fällig am 15.07.2027	2.000	1.920	0,10	8,000 % fällig am 15.04.2030	5.600	5.832	0,31
3,500 % fällig am 01.09.2028	5.000	4.625	0,25	Lamar Media Corp.				Novelis Corp.			
4,000 % fällig am 01.08.2028	5.000	4.625	0,25	3,625 % fällig am 15.01.2031	275	245	0,01	3,250 % fällig am 15.11.2026	3.000	2.826	0,15
5,125 % fällig am 15.12.2026	1.000	990	0,05	Lamb Weston Holdings, Inc.				3,875 % fällig am 15.08.2031	7.000	6.179	0,33
GN Bondco LLC				4,125 % fällig am 31.01.2030	3.000	2.769	0,15	4,750 % fällig am 30.01.2030	5.000	4.710	0,25
9,500 % fällig am 15.10.2031	6.200	6.061	0,32	4,375 % fällig am 31.01.2032	1.000	914	0,05	NuStar Logistics LP			
Go Daddy Operating Co. LLC				4,875 % fällig am 15.05.2028	2.000	1.958	0,10	5,750 % fällig am 01.10.2025	2.000	1.989	0,11
3,500 % fällig am 01.03.2029	5.000	4.534	0,24	Las Vegas Sands Corp.				6,375 % fällig am 01.10.2030	1.300	1.304	0,07
goeasly Ltd.				3,900 % fällig am 08.08.2029	15.275	14.094	0,75	Olympus Water U.S. Holding Corp.			
9,250 % fällig am 01.12.2028	6.600	7.054	0,38					3,875 % fällig am 01.10.2028	€ 1.000	1.016	0,05
Graham Packaging Co., Inc.								4,250 % fällig am 01.10.2028	\$ 7.000	6.307	0,34
7,125 % fällig am 15.08.2028	6.700	6.038	0,32								

Aufstellung der Wertpapieranlagen des US High Yield Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (0000)	MARKT- WERT (0000)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (0000)	MARKT- WERT (0000)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (0000)	MARKT- WERT (0000)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	
5,375 % fällig am 01.10.2029 (h) €	8.000	7.586	0,41	Seadrill Finance Ltd.				5,500 % fällig am 15.11.2027	\$	7.000	63.864	0,37
6,250 % fällig am 01.10.2029	2.000	1.779	0,10	8,375 % fällig am 01.08.2030	\$	3.500	3.655	0,20	6,250 % fällig am 15.03.2026	1.750	1.749	0,09
ON Semiconductor Corp.				Seagate HDD Cayman				6,750 % fällig am 15.08.2028	5.000	5.122	0,27	
3,875 % fällig am 01.09.2028	4.275	3.969	0,21	5,750 % fällig am 01.12.2034	1.800	1.732	0,09	6,875 % fällig am 15.12.2030	1.800	1.855	0,10	
Organon & Co.				8,250 % fällig am 15.12.2029	1.150	1.241	0,07	7,125 % fällig am 01.12.2031	700	734	0,04	
4,125 % fällig am 30.04.2028	6.800	6.265	0,33	8,500 % fällig am 15.07.2031	1.175	1.276	0,07	Transocean Titan Financing Ltd.				
5,125 % fällig am 30.04.2031	10.400	8.907	0,48	9,625 % fällig am 01.12.2032	2.000	2.288	0,12	8,375 % fällig am 01.02.2028	4.000	4.153	0,22	
Outfront Media Capital LLC				Sealed Air Corp.				Transocean, Inc.				
4,250 % fällig am 15.01.2029	2.000	1.807	0,10	7,250 % fällig am 15.02.2031	1.505	1.598	0,09	8,750 % fällig am 15.02.2030	1.900	1.987	0,11	
5,000 % fällig am 15.08.2027	2.125	2.056	0,11	Sensata Technologies BV				Travel + Leisure Co.				
Owens-Brockway Glass Container, Inc.				4,000 % fällig am 15.04.2029	5.000	4.652	0,25	4,625 % fällig am 01.03.2030	5.000	4.478	0,24	
7,250 % fällig am 15.05.2031	3.000	3.045	0,16	Sensata Technologies, Inc.				6,000 % fällig am 01.04.2027	25	25	0,00	
Pactiv Evergreen Group Issuer LLC				3,750 % fällig am 15.02.2031	5.000	4.414	0,24	6,625 % fällig am 31.07.2026	3.500	3.534	0,19	
4,375 % fällig am 15.10.2028	3.000	2.808	0,15	Simmons Foods, Inc.				Trident TPI Holdings, Inc.				
Pactiv Evergreen Group Issuer, Inc.				4,625 % fällig am 01.03.2029	8.000	6.929	0,37	12,750 % fällig am 31.12.2028	9.750	10.445	0,56	
4,000 % fällig am 15.10.2027	5.000	4.678	0,25	Sirius XM Radio, Inc.				TriNet Group, Inc.				
Performance Food Group, Inc.				3,875 % fällig am 01.09.2031	2.000	1.713	0,09	3,500 % fällig am 01.03.2029	5.000	4.479	0,24	
4,250 % fällig am 01.08.2029	3.000	2.755	0,15	4,125 % fällig am 01.07.2030	3.250	2.900	0,15	Triton Water Holdings, Inc.				
6,875 % fällig am 01.05.2025	1.000	1.004	0,05	5,000 % fällig am 01.08.2027	2.000	1.933	0,10	6,250 % fällig am 01.04.2029	3.000	2.616	0,14	
Permian Resources Operating LLC				SM Energy Co.				Triumph Group, Inc.				
5,375 % fällig am 15.01.2026	5.000	4.938	0,26	6,500 % fällig am 15.07.2028	800	801	0,04	7,750 % fällig am 15.08.2025	4.000	3.990	0,21	
7,000 % fällig am 15.01.2032	1.800	1.858	0,10	Southwestern Energy Co.				9,000 % fällig am 15.03.2028	6.950	7.399	0,40	
PetSmart, Inc.				4,750 % fällig am 01.02.2032	200	185	0,01	Twilio, Inc.				
4,750 % fällig am 15.02.2028	6.000	5.661	0,30	5,375 % fällig am 01.02.2029	1.800	1.758	0,09	3,625 % fällig am 15.03.2029	3.000	2.740	0,15	
Post Holdings, Inc.				5,375 % fällig am 15.03.2030	2.200	2.151	0,12	3,875 % fällig am 15.03.2031	3.500	3.124	0,17	
4,500 % fällig am 15.09.2031	2.779	2.494	0,13	Spectrum Brands, Inc.				U.S. Acute Care Solutions LLC				
4,625 % fällig am 15.04.2030	9.000	8.288	0,44	3,875 % fällig am 15.03.2031	3.100	2.825	0,15	6,375 % fällig am 01.03.2026	6.000	5.020	0,27	
5,625 % fällig am 15.01.2028	4.975	4.934	0,26	5,500 % fällig am 15.07.2030	2.200	2.137	0,11	U.S. Foods, Inc.				
Presidio Holdings, Inc.				Spirit AeroSystems, Inc.				4,750 % fällig am 15.02.2029	7.000	6.654	0,36	
4,875 % fällig am 01.02.2027	2.500	2.453	0,13	4,600 % fällig am 15.06.2028	6.275	5.557	0,30	7,250 % fällig am 15.01.2032	900	940	0,05	
8,250 % fällig am 01.02.2028	3.750	3.792	0,20	9,375 % fällig am 30.11.2029	3.000	3.287	0,18	Uber Technologies, Inc.				
Prestige Brands, Inc.				9,750 % fällig am 15.11.2030	900	969	0,05	4,500 % fällig am 15.08.2029	4.000	3.823	0,20	
3,750 % fällig am 01.04.2031	50	44	0,00	Spirit Loyalty Cayman Ltd.				United Airlines, Inc.				
Prime Security Services Borrower LLC				8,000 % fällig am 20.09.2025	4.600	3.313	0,18	4,375 % fällig am 15.04.2026	4.975	4.852	0,26	
3,375 % fällig am 31.08.2027	2.000	1.856	0,10	SRS Distribution, Inc.				4,625 % fällig am 15.04.2029	9.700	9.082	0,49	
5,750 % fällig am 15.04.2026	1.000	1.006	0,05	2,250 % fällig am 01.07.2029	4.300	4.082	0,22	Univision Communications, Inc.				
6,250 % fällig am 15.01.2028	5.000	4.975	0,27	Stagwell Global LLC				4,500 % fällig am 01.05.2029	7.000	6.254	0,33	
PTC, Inc.				5,625 % fällig am 15.08.2029	1.000	921	0,05	6,625 % fällig am 01.06.2027	2.000	1.996	0,11	
4,000 % fällig am 15.02.2028	1.550	1.470	0,08	Standard Industries, Inc.				8,000 % fällig am 15.08.2028	3.050	3.149	0,17	
Raising Cane's Restaurants LLC				3,375 % fällig am 15.01.2031	4.000	3.447	0,18	UPC Holding BV				
9,375 % fällig am 01.05.2029	1.025	1.095	0,06	4,375 % fällig am 15.07.2030	2.500	2.299	0,12	5,500 % fällig am 15.01.2028	3.000	2.831	0,15	
Resorts World Las Vegas LLC				4,750 % fällig am 15.01.2028	3.500	3.372	0,18	Valaris Ltd.				
4,625 % fällig am 16.04.2029	250	218	0,01	5,000 % fällig am 15.02.2027	1.500	1.464	0,08	8,375 % fällig am 30.04.2030	6.925	7.101	0,38	
8,450 % fällig am 27.07.2030	2.275	2.348	0,13	Star Parent, Inc.				Venture Global Calcasieu Pass LLC				
Ritchie Bros Holdings, Inc.				9,000 % fällig am 01.10.2030	600	633	0,03	3,875 % fällig am 15.08.2029	5.000	4.542	0,24	
6,750 % fällig am 15.03.2028	1.250	1.289	0,07	Station Casinos LLC				4,125 % fällig am 15.08.2031	3.000	2.647	0,14	
7,750 % fällig am 15.03.2031	2.000	2.135	0,11	4,500 % fällig am 15.02.2028	2.800	2.642	0,14	Venture Global LNG, Inc.				
RockCliff Energy LLC				4,625 % fällig am 01.12.2031	1.900	1.715	0,09	8,125 % fällig am 01.06.2028	6.000	6.065	0,32	
5,500 % fällig am 15.10.2029	6.000	5.679	0,30	Strathcona Resources Ltd.				8,375 % fällig am 01.06.2031	10.800	10.811	0,58	
Rockies Express Pipeline LLC				6,875 % fällig am 01.08.2026	4.625	4.420	0,24	9,500 % fällig am 01.02.2029	3.200	3.388	0,18	
4,800 % fällig am 15.05.2030	2.000	1.833	0,10	Sugarhouse HSP Gaming Prop Mezz LP				9,875 % fällig am 01.02.2032	1.600	1.668	0,09	
4,950 % fällig am 15.07.2029	2.000	1.915	0,10	5,875 % fällig am 15.05.2025	3.150	3.132	0,17	Vertiv Group Corp.				
Roller Bearing Co. of America, Inc.				Tapstry, Inc.				4,125 % fällig am 15.11.2028	7.000	6.572	0,35	
4,375 % fällig am 15.10.2029	3.000	2.780	0,15	7,700 % fällig am 27.11.2030	3.525	3.714	0,20	ViaSat, Inc.				
Rolls-Royce PLC				TEGNA, Inc.				5,625 % fällig am 15.09.2025	1.700	1.659	0,09	
3,625 % fällig am 14.10.2025	1.000	964	0,05	4,625 % fällig am 15.03.2028	1.000	935	0,05	5,625 % fällig am 15.04.2027	1.800	1.743	0,09	
5,750 % fällig am 15.10.2027	£	1.750	2.245	4,750 % fällig am 15.03.2026	1.000	973	0,05	6,500 % fällig am 15.07.2028	2.000	1.645	0,09	
Royal Caribbean Cruises Ltd.				5,000 % fällig am 15.09.2029	4.000	3.670	0,20	Victoria's Secret & Co.				
4,250 % fällig am 01.07.2026	\$	5.000	4.832	Teleflex, Inc.				4,625 % fällig am 15.07.2029	2.000	1.673	0,09	
5,375 % fällig am 15.07.2027	3.000	2.972	0,16	4,250 % fällig am 01.06.2028	800	759	0,04	Viking Cruises Ltd.				
5,500 % fällig am 31.08.2026	10.000	9.908	0,53	Tenet Healthcare Corp.				5,875 % fällig am 15.09.2027	5.000	4.829	0,26	
5,500 % fällig am 01.04.2028	7.100	7.014	0,37	4,375 % fällig am 15.01.2030	4.000	3.711	0,20	7,000 % fällig am 15.02.2029	4.000	3.970	0,21	
7,250 % fällig am 15.01.2030	2.000	2.090	0,11	5,125 % fällig am 01.11.2027	3.500	3.424	0,18	9,125 % fällig am 15.07.2031	3.000	3.199	0,17	
7,500 % fällig am 15.10.2027	700	737	0,04	6,125 % fällig am 01.10.2028	9.200	9.182	0,49	Virgin Media Secured Finance PLC				
9,250 % fällig am 15.01.2029	1.000	1.076	0,06	6,125 % fällig am 15.06.2030	5.000	5.062	0,27	4,500 % fällig am 15.08.2030	5.000	4.458	0,24	
Sabre GBLB, Inc.				6,875 % fällig am 15.11.2031	3.200	3.290	0,18	5,500 % fällig am 15.05.2029	4.000	3.869	0,21	
8,625 % fällig am 01.06.2027	1.983	1.806	0,10	Thor Industries, Inc.				Vital Energy, Inc.				
11,250 % fällig am 15.12.2027	800	787	0,04	4,000 % fällig am 15.10.2029	700	625	0,03	9,750 % fällig am 15.10.2030	675	700	0,04	
Scientific Games Holdings LP				TK Elevator Holdco GmbH				Vmed O2 UK Financing PLC				
6,625 % fällig am 01.03.2030	7.000	6.626	0,35	7,625 % fällig am 15.07.2028	4.734	4.656	0,25	4,250 % fällig am 31.01.2031	5.000	4.372	0,23	
SCIH Salt Holdings, Inc.				TK Elevator U.S. Newco, Inc.				VOC Escrow Ltd.				
4,875 % fällig am 01.05.2028	3.000	2.810	0,15	5,250 % fällig am 15.07.2027	3.500	3.441	0,18	5,000 % fällig am 15.02.2028	2.000	1.917	0,10	
Scotts Miracle-Gro Co.				TopBuild Corp.				WESCO Distribution, Inc.				
4,375 % fällig am 01.02.2032	4.025	3.406	0,18	4,125 % fällig am 15.02.2032	900	802	0,04	7,125 % fällig am 15.06.2025	3.000	3.024	0,16	
Scripps Escrow, Inc.				TransDigm, Inc.				White Cap Buyer LLC				
5,375 % fällig am 15.01.2031	3.800	2.793	0,15	4,625 % fällig am 15.01.2029	17.400	16.347	0,87	6,875 % fällig am 15.10.2028	7.200	6.979	0,37	
				4,875 % fällig am 01.05.2029	800	749	0,04					

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
White Cap Parent LLC (8.250% Cash or 9.000% PIK)				FirstEnergy Corp.				STAMMAKTIE			
8,250 % fällig am 15.03.2026 (b)	\$ 5.250	\$ 5.232	0,28	3,400 % fällig am 01.03.2050	\$ 1.000	\$ 706	0,04	KOMMUNIKATIONSDIENSTE			
Williams Scotsman, Inc.				Genesis Energy LP				Clear Channel Outdoor Holdings, Inc. (c)	167.378	\$ 305	0,02
4,625 % fällig am 15.08.2028	2.750	2.600	0,14	7,750 % fällig am 01.02.2028	2.000	2.009	0,11	iHeartMedia, Inc. 'B' (c)	29.972	72	0,00
7,375 % fällig am 01.10.2031	800	839	0,04	8,000 % fällig am 15.01.2027	3.000	3.052	0,16	Intelsat Emergence S.A. (c)(g)	152.416	4.342	0,23
WMG Acquisition Corp.				High Ridge Brands Co.						4.719	0,25
3,000 % fällig am 15.02.2031	4.150	3.561	0,19	8,875 % fällig am 15.03.2025 ^	2.500	41	0,00	ENERGIE			
3,875 % fällig am 15.07.2030	3.000	2.717	0,15	NGL Energy Operating LLC				CHC Group LLC (c)	3.887	0	0,00
WR Grace Holdings LLC				7,500 % fällig am 01.02.2026	3.975	4.018	0,21	FINANZWERTE			
4,875 % fällig am 15.06.2027	1.000	963	0,05	NSG Holdings LLC				Voyager Aviation Holdings LLC (c)	833	0	0,00
Wyndham Hotels & Resorts, Inc.				7,750 % fällig am 15.12.2025	146	146	0,01	INDUSTRIEWERTE			
4,375 % fällig am 15.08.2028	3.000	2.807	0,15	PBF Holding Co. LLC				Serta Simmons Bedding LLC (c)(g)	1.852	23	0,00
Wynn Las Vegas LLC				6,000 % fällig am 15.02.2028	1.000	975	0,05			4.742	0,25
5,250 % fällig am 15.05.2027	3.000	2.922	0,16	7,875 % fällig am 15.09.2030	1.125	1.147	0,06	OPTIONSSCHEINE			
5,500 % fällig am 01.03.2025	1.245	1.239	0,07	Tallgrass Energy Partners LP				Revlon Group Holdings LLC - 28/04/2028	30.870	0	0,00
Wynn Resorts Finance LLC				6,000 % fällig am 31.12.2030	2.000	1.862	0,10	VORZUGSWERTPAPIERE			
5,125 % fällig am 01.10.2029	3.000	2.835	0,15	7,500 % fällig am 01.10.2025	1.000	1.006	0,05	Voyager Aviation Holdings LLC 9,500 %	5.000	0	0,00
XPO, Inc.				Telecom Italia Capital S.A.				Summe Übertragbare Wertpapiere	\$ 1.770.912	94,55	
7,125 % fällig am 01.06.2031	2.000	2.073	0,11	6,375 % fällig am 15.11.2033	2.500	2.449	0,13	INVESTMENTFONDS			
Yum! Brands, Inc.				7,200 % fällig am 18.07.2036	2.500	2.513	0,13	ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
3,625 % fällig am 15.03.2031	2.975	2.686	0,14	7,721 % fällig am 04.06.2038	1.000	1.020	0,05	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (e)	661.211	6.110	0,33
4,625 % fällig am 31.01.2032	5.000	4.681	0,25	Telecom Italia SpA				PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO European High Yield Bond Fund (e)	1.743.573	21.783	1,16
4,750 % fällig am 15.01.2030	2.000	1.941	0,10	7,875 % fällig am 31.07.2028	€11.400	14.026	0,75	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e)	4.640.942	46.245	2,47
6,875 % fällig am 15.11.2037	2.000	2.198	0,12	TerraForm Power Operating LLC				Summe Investmentfonds	\$ 74.138	3,96	
Zayo Group Holdings, Inc.				4,750 % fällig am 15.01.2030	\$ 2.000	1.862	0,10				
4,000 % fällig am 01.03.2027	2.500	2.007	0,11	5,000 % fällig am 31.01.2028	2.000	1.944	0,10				
ZF North America Capital, Inc.				Vistra Operations Co. LLC							
6,875 % fällig am 14.04.2028	550	570	0,03	5,000 % fällig am 31.07.2027	650	633	0,03				
7,125 % fällig am 14.04.2030	1.450	1.547	0,08	7,750 % fällig am 15.10.2031	5.000	5.197	0,28				
Ziggo BV											
4,875 % fällig am 15.01.2030	5.100	4.555	0,24	Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		1.671.373	89,24				
ZipRecruiter, Inc.											
5,000 % fällig am 15.01.2030	900	787	0,04	US-SCHATZOBIGATIONEN							
		1.427.639	76,23	U.S. Treasury Notes							
				4,250 % fällig am 15.10.2025	50.000	49.913	2,66				
VERSORGUNGSUNTERNEHMEN				NON-AGENCY-MBS							
Antero Midstream Partners LP				Countrywide Alternative Loan Trust							
5,375 % fällig am 15.06.2029	2.500	2.406	0,13	5,932 % fällig am 20.05.2046	53	45	0,01				
5,750 % fällig am 01.03.2027	2.500	2.482	0,13	Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust							
Blue Racer Midstream LLC				6,170 % fällig am 25.02.2036	1	0	0,00				
6,625 % fällig am 15.07.2026	2.000	1.990	0,11	Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust							
7,625 % fällig am 15.12.2025	1.100	1.115	0,06	5,500 % fällig am 25.12.2035	38	31	0,00				
Calpine Corp.				GSR Mortgage Loan Trust							
3,750 % fällig am 01.03.2031	10.000	8.783	0,47	5,939 % fällig am 25.04.2035	1	1	0,00				
4,500 % fällig am 15.02.2028	2.500	2.379	0,13	MortgageIT Trust							
5,000 % fällig am 01.02.2031	2.300	2.111	0,11	6,110 % fällig am 25.02.2035	26	25	0,00				
5,125 % fällig am 15.03.2028	4.200	4.029	0,22								
Clearway Energy Operating LLC											
3,750 % fällig am 15.02.2031	4.600	4.057	0,22								
CrownRock LP											
5,625 % fällig am 15.10.2025	3.000	2.998	0,16								
Edison International											
8,125 % fällig am 15.06.2053	1.000	1.023	0,06								
Endeavor Energy Resources LP											
5,750 % fällig am 30.01.2028	5.000	5.008	0,27								
				FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE							
				Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust							
				3,311 % fällig am 25.01.2037	76	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	2,600 %	29.12.2023	02.01.2024	\$ 912	U.S. Treasury Notes 4,875 % fällig am 30.11.2025	\$ (930)	\$ 912	\$ 912	0,05
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (930)	\$ 912	\$ 912	0,05

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

Aufstellung der Wertpapieranlagen des US High Yield Bond Fund (Forts.)

AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2024	204	\$ (934)	(0,05)
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Long	03.2024	528	1.134	0,06
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Short	03.2024	1.027	(2.419)	(0,13)
U.S. Treasury 10-Year Ultra March Futures	Long	03.2024	214	1.071	0,06
				<u>\$ (1.148)</u>	<u>(0,06)</u>
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				<u>\$ (1.148)</u>	<u>(0,06)</u>

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5,000 %	20.06.2028	€ 9.600	\$ 776	0,04
Newell Brands, Inc.	1,000	20.06.2028	\$ 2.275	129	0,01
				<u>\$ 905</u>	<u>0,05</u>

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	\$ 99	\$ 5	0,00
CDX.HY-41 5-Year Index	5,000	20.12.2028	90.981	5.101	0,27
				<u>\$ 5.106</u>	<u>0,27</u>
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate				<u>\$ 6.011</u>	<u>0,32</u>

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	01.2024	€ 2.952	\$ 3.224	\$ 2	\$ (40)	\$ (38)	0,00
	01.2024	£ 186	236	0	(1)	(1)	0,00
CBK	01.2024	\$ 5.430	€ 4.959	49	0	49	0,00
MBC	01.2024	CAD 1.299	\$ 960	0	(25)	(25)	0,00
	01.2024	€ 269	293	0	(5)	(5)	0,00
MYI	01.2024	66.484	73.076	1	(383)	(382)	(0,02)
	01.2024	\$ 3.315	€ 3.029	32	0	32	0,00
	01.2024	£ 42	33	0	0	0	0,00
UAG	01.2024	£ 1.062	\$ 1.344	0	(10)	(10)	0,00
				<u>\$ 84</u>	<u>\$ (464)</u>	<u>\$ (380)</u>	<u>(0,02)</u>

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 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
BPS	01.2024	€ 402	\$ 437	\$ 0	\$ (7)	\$ (7)	0,00
	01.2024	\$ 19.777	€ 18.120	246	(2)	244	0,01
BRC	01.2024	102.372	93.084	477	0	477	0,02
CBK	01.2024	€ 18.632	\$ 20.323	(1)	(264)	(265)	(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	\$ 51	€ 47	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
MBC	01.2024	€ 15.943	\$ 17.209	0	(407)	(407)	(0,02)
	01.2024	\$ 59	€ 54	1	0	1	0,00
MYI	01.2024	114.579	104.246	603	0	603	0,03
UAG	01.2024	114.667	104.246	515	0	515	0,03
				\$ 1.842	\$ (680)	\$ 1.162	0,06

Zum 31. Dezember 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	01.2024	\$ 2.718	€ 2.146	\$ 17	\$ 0	\$ 17	0,00
BPS	01.2024	€ 115	\$ 145	0	(2)	(2)	0,00
	01.2024	\$ 2.299	€ 1.812	12	0	12	0,00
BRC	01.2024	38	30	0	0	0	0,00
CBK	01.2024	€ 24	\$ 30	0	0	0	0,00
GLM	01.2024	\$ 26	€ 20	0	0	0	0,00
MBC	01.2024	€ 35	\$ 44	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 118	€ 94	1	0	1	0,00
MYI	01.2024	5	4	0	0	0	0,00
SCX	01.2024	13.304	10.518	105	0	105	0,01
SSB	01.2024	€ 5	\$ 6	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 8.293	€ 6.572	85	0	85	0,00
UAG	01.2024	13.301	10.510	98	0	98	0,01
				\$ 318	\$ (2)	\$ 316	0,02
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 1.098	0,06
Summe Anlagen						\$ 1.851.923	98,88
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ 20.964	1,12
Nettovermögen						\$ 1.872.887	100,00

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(c) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(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: 0,39 %):

Emittentenbeschreibung	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Altice France S.A, 11,500 % fällig am 01.02.2027	20.12.2023	\$ 852	\$ 890	0,05
Intelsat Emergence S.A.	11.02.2014 - 02.03.2022	15.552	4.342	0,23
Serta Simmons Bedding LLC	29.06.2023	2.634	23	0,00
		\$ 19.038	\$ 5.255	0,28

(h) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 10.428 (31. Dezember 2022: USD null) waren zum 31. Dezember 2023 Wertpapiere als Sicherheiten gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 18.197 (31. Dezember 2022: USD 10.449) waren zum 31. Dezember 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 630 (31. Dezember 2022: USD null) waren zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten für Finanzderivate gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 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	\$ 305	\$ 1.765.023	\$ 5.584	\$ 1.770.912
Investmentfonds	74.138	0	0	74.138
Pensionsgeschäfte	0	912	0	912
Finanzderivate ⁽³⁾	(934)	6.895	0	5.961
Summen	\$ 73.509	\$ 1.772.830	\$ 5.584	\$ 1.851.923

Aufstellung der Wertpapieranlagen des US High Yield Bond Fund (Forts.)

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 413	\$ 1.889.527	\$ 5.525	\$ 1.895.465
Investmentfonds	39.162	0	0	39.162
Pensionsgeschäfte	0	9.269	0	9.269
Finanzderivate ⁽³⁾	0	11.167	0	11.167
Summen	\$ 39.575	\$ 1.909.963	\$ 5.525	\$ 1.955.063

⁽¹⁾ Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

⁽²⁾ Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

⁽³⁾ Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BOS	(1,000) %	15.12.2023	02.02.2024	\$ (2.976)	\$ (2.975)	(0,16)
	4,250	15.12.2023	02.02.2024	(3.090)	(3.096)	(0,17)
BPS	4,500	22.11.2023	TBD ⁽¹⁾	(791)	(795)	(0,04)
	5,000	22.11.2023	TBD ⁽¹⁾	(246)	(247)	(0,01)
MYI	2,500	17.05.2023	TBD ⁽¹⁾	€ (968)	(1.087)	(0,06)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (8.200)	(0,44)

⁽¹⁾ Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ 17	\$ 0	\$ 17	\$ 9	\$ 0	\$ 9
BPS	208	(310)	(102)	k. A.	k. A.	k. A.
BRC	477	(1.020)	(543)	1	0	1
CBK	(215)	300	85	3.592	(3.540)	52
GLM	k. A.	k. A.	k. A.	2	0	2
JPM	k. A.	k. A.	k. A.	(258)	0	(258)
MBC	(435)	330	(105)	1.402	(1.320)	82
MYI	253	(510)	(257)	(4)	0	(4)
RBC	k. A.	k. A.	k. A.	(1)	0	(1)
SCX	105	0	105	3.187	(3.050)	137
SSB	85	0	85	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	k. A.	k. A.	k. A.	11	(20)	(9)
UAG	603	(1.280)	(677)	4	0	4

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	29,96	39,23
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	64,32	56,03
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,27	0,24
Investmentfonds	3,96	1,97
Pensionsgeschäfte	0,05	0,47
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,06)	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,32	0,16
Freiverkehrsfinanzderivate	0,06	0,40
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,44)	k. A.

* Gemäß der Liste der Märkte, die die Kriterien für einen geregelten OGAW-Markt erfüllen, in Anlage 1 zum Verkaufsprospekt.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	2,39	0,70
Unternehmensanleihen und Wechsel	89,24	79,60
US-Schatzobligationen	2,66	11,62
Non-Agency-MBS	0,01	0,04

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Forderungsbesicherte Wertpapiere	0,00	0,00
Stammaktien	0,25	0,21
Bezugsrechte	k. A.	0,01
Optionsscheine	0,00	0,00
Vorzugswertpapiere	0,00	0,07
Kurzfristige Instrumente	k. A.	3,25
Investmentfonds	3,96	1,97
Pensionsgeschäfte	0,05	0,47
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,06)	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,05	k. A.
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,27	0,16
Freiverkehrsfinanzderivate		
Devisenterminkontrakte	(0,02)	(0,05)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,08	0,45
Sonstige Aktiva und Passiva	1,12	1,50
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des US Investment Grade Corporate Bond Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE			
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				Block Financial LLC				Ford Motor Credit Co. LLC			
Charter Communications Operating LLC				3,875 % fällig am 15.08.2030	\$ 1.500	\$ 1.373	0,29	7,350 % fällig am 06.03.2030	\$ 200	\$ 215	0,04
7,133 % fällig am 01.02.2027	\$ 88	\$ 88	0,02	Blue Owl Capital Corp.				Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC			
7,360 % fällig am 07.12.2030	500	499	0,10	2,875 % fällig am 11.06.2028	300	264	0,05	7,875 % fällig am 01.12.2030	300	313	0,06
		587	0,12	BNP Paribas S.A.				FS KKR Capital Corp.			
				7,750 % fällig am 16.08.2029 (d)(f)	700	716	0,15	7,875 % fällig am 15.01.2029	700	742	0,15
				8,500 % fällig am 14.08.2028 (d)(f)	500	525	0,11	Gaci First Investment Co.			
				BPCE S.A.				5,125 % fällig am 14.02.2053	600	545	0,11
				6,612 % fällig am 19.10.2027	500	515	0,11	GAIF Bond Issuer Pty. Ltd.			
				Brandywine Operating Partnership LP				3,400 % fällig am 30.09.2026	500	474	0,10
				3,950 % fällig am 15.11.2027	500	447	0,09	Global Atlantic Fin Co.			
				Brookfield Finance, Inc.				3,125 % fällig am 15.06.2031	200	164	0,03
				3,500 % fällig am 30.03.2051	400	293	0,06	4,400 % fällig am 15.10.2029	800	737	0,15
				3,900 % fällig am 25.01.2028	1.400	1.350	0,28	GLP Capital LP			
				Cantor Fitzgerald LP				3,350 % fällig am 01.09.2024	700	691	0,14
				7,200 % fällig am 12.12.2028	800	821	0,17	4,000 % fällig am 15.01.2031	300	271	0,06
				Capital One Financial Corp.				5,750 % fällig am 01.06.2028	700	707	0,15
				6,312 % fällig am 08.06.2029	400	411	0,09	Goldman Sachs Group, Inc.			
				Carlyle Finance Subsidiary LLC				2,383 % fällig am 21.07.2032	1.500	1.233	0,26
				3,500 % fällig am 19.09.2029	1.900	1.779	0,37	2,615 % fällig am 22.04.2032	1.000	840	0,17
				CBRE Services, Inc.				3,272 % fällig am 29.09.2025	1.800	1.770	0,37
				5,950 % fällig am 15.08.2034	300	315	0,07	3,691 % fällig am 05.06.2028	655	626	0,13
				Charles Schwab Corp.				5,798 % fällig am 10.08.2026	500	505	0,10
				5,643 % fällig am 19.05.2029	800	821	0,17	6,484 % fällig am 24.10.2029	1.800	1.911	0,40
				6,196 % fällig am 17.11.2029	600	630	0,13	Golub Capital BDC, Inc.			
				Citigroup, Inc.				7,050 % fällig am 05.12.2028	200	210	0,04
				2,976 % fällig am 05.11.2030	1.600	1.426	0,30	Goodman U.S. Finance Three LLC			
				3,785 % fällig am 17.03.2033 (g)	200	180	0,04	3,700 % fällig am 15.03.2028	1.600	1.491	0,31
				4,075 % fällig am 23.04.2029	400	385	0,08	Great-West Lifeco Finance LP			
				6,270 % fällig am 17.11.2033 (g)	2.000	2.141	0,45	4,581 % fällig am 17.05.2048	300	269	0,06
				Citizens Bank N.A.				Guardian Life Global Funding			
				5,284 % fällig am 26.01.2026	500	484	0,10	1,100 % fällig am 23.06.2025	2.300	2.172	0,45
				Commonwealth Bank of Australia				Hanover Insurance Group, Inc.			
				3,784 % fällig am 14.03.2032 (f)	400	350	0,07	4,500 % fällig am 15.04.2026	800	786	0,16
				Corebridge Financial, Inc.				HAT Holdings LLC			
				3,850 % fällig am 05.04.2029	900	849	0,18	8,000 % fällig am 15.06.2027	400	417	0,09
				Corporate Office Properties LP				Highwoods Realty LP			
				2,250 % fällig am 15.03.2026	300	280	0,06	4,125 % fällig am 15.03.2028	500	461	0,10
				2,750 % fällig am 15.04.2031	1.400	1.133	0,24	4,200 % fällig am 15.04.2029	200	181	0,04
				Credit Acceptance Corp.				Host Hotels & Resorts LP			
				9,250 % fällig am 15.12.2028	200	213	0,04	3,500 % fällig am 15.09.2030	1.300	1.161	0,24
				Credit Agricole S.A.				4,000 % fällig am 15.06.2025	1.233	1.205	0,25
				6,316 % fällig am 03.10.2029	500	524	0,11	HSBC Capital Funding Dollar LP			
				Credit Suisse AG				10,176 % fällig am 30.06.2030 (d)	400	509	0,11
				7,500 % fällig am 15.02.2028	700	767	0,16	HSBC Holdings PLC			
				Crown Castle, Inc.				2,099 % fällig am 04.06.2026	900	857	0,18
				2,100 % fällig am 01.04.2031	500	408	0,08	2,357 % fällig am 18.08.2031	1.600	1.326	0,28
				3,100 % fällig am 15.11.2029	900	806	0,17	4,292 % fällig am 12.09.2026	1.000	980	0,20
				4,300 % fällig am 15.02.2029	600	578	0,12	4,583 % fällig am 19.06.2029	400	388	0,08
				4,800 % fällig am 01.09.2028	200	198	0,04	5,402 % fällig am 11.08.2033	900	904	0,19
				CubeSmart LP				6,500 % fällig am 15.09.2037	100	105	0,02
				3,125 % fällig am 01.09.2026	600	570	0,12	6,800 % fällig am 01.06.2038	220	235	0,05
				Deutsche Bank AG				Hudson Pacific Properties LP			
				3,375 % fällig am 13.03.2029	€ 1.500	1.711	0,36	4,650 % fällig am 01.04.2029	200	162	0,03
				6,720 % fällig am 18.01.2029	\$ 1.300	1.362	0,28	5,950 % fällig am 15.02.2028	500	443	0,09
				EPR Properties				Huntington Bancshares, Inc.			
				4,500 % fällig am 01.06.2027	450	425	0,09	6,208 % fällig am 21.08.2029	400	413	0,09
				4,750 % fällig am 15.12.2026	100	96	0,02	IHG Finance LLC			
				4,950 % fällig am 15.04.2028	400	380	0,08	4,375 % fällig am 28.11.2029	€ 500	573	0,12
				Equitable Financial Life Global Funding				Invitation Homes Operating Partnership LP			
				5,500 % fällig am 02.12.2025	2.100	2.102	0,44	2,300 % fällig am 15.11.2028	\$ 1.300	1.154	0,24
				Equitable Holdings, Inc.				JAB Holdings BV			
				5,594 % fällig am 11.01.2033	200	206	0,04	2,200 % fällig am 23.11.2030	535	431	0,09
				ERP Operating LP				Jefferies Financial Group, Inc.			
				3,250 % fällig am 01.08.2027	100	95	0,02	5,875 % fällig am 21.07.2028	600	616	0,13
				Extra Space Storage LP				JPMorgan Chase & Co.			
				2,350 % fällig am 15.03.2032	400	326	0,07	2,182 % fällig am 01.06.2028	700	641	0,13
				3,875 % fällig am 15.12.2027	800	765	0,16	2,545 % fällig am 08.11.2032	900	751	0,16
				Fairfax Financial Holdings Ltd.				2,580 % fällig am 22.04.2032	5.100	4.316	0,90
				2,750 % fällig am 29.03.2028	€ 200	211	0,04	3,509 % fällig am 23.01.2029	1.505	1.427	0,30
				4,625 % fällig am 29.04.2030	\$ 900	866	0,18	3,782 % fällig am 01.02.2028	40	39	0,01
				4,850 % fällig am 17.04.2028	300	296	0,06	4,000 % fällig am 01.04.2025 (d)	2.900	2.739	0,57
				Federal Realty OP LP				5,350 % fällig am 01.06.2034	800	812	0,17
				3,500 % fällig am 01.06.2030	400	363	0,08	6,087 % fällig am 23.10.2029	500	526	0,11
				Fifth Third Bancorp				JPMorgan Chase Bank N.A.			
				4,772 % fällig am 28.07.2030	800	782	0,16	5,110 % fällig am 08.12.2026	900	908	0,19

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Kilroy Realty LP				Santander UK Group Holdings PLC				Adani Transmission Step-One Ltd.			
3,050 % fällig am 15.02.2030	\$ 1.800	\$ 1.533	0,32	1,532 % fällig am 21.08.2026	\$ 1.700	\$ 1.586	0,33	4,000 % fällig am 03.08.2026	\$ 400	\$ 367	0,08
KKR Group Finance Co. LLC				SBA Tower Trust				Adventist Health System			
3,625 % fällig am 25.02.2050	1.100	791	0,16	1,884 % fällig am 15.07.2050	1.000	928	0,19	5,430 % fällig am 01.03.2032	300	305	0,06
Lazard Group LLC				Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.				Air Canada Pass-Through Trust			
3,625 % fällig am 01.03.2027	100	95	0,02	5,125 % fällig am 29.10.2022 ^	2.100	126	0,03	3,300 % fällig am 15.07.2031	744	669	0,14
4,500 % fällig am 19.09.2028	200	195	0,04	5,250 % fällig am 23.05.2023 ^f)	600	36	0,01	3,750 % fällig am 15.06.2029	128	118	0,02
Legg Mason, Inc.				SBL Holdings, Inc.				5,250 % fällig am 01.10.2030	249	245	0,05
5,625 % fällig am 15.01.2044	200	205	0,04	5,125 % fällig am 13.11.2026	1.000	943	0,20	Alaska Airlines Pass-Through Trust			
Lloyds Bank PLC				SELP Finance SARL				4,800 % fällig am 15.02.2029	612	595	0,12
0,000 % fällig am 02.04.2032	200	129	0,03	3,750 % fällig am 10.08.2027	€ 300	332	0,07	Alcon Finance Corp.			
Lloyds Banking Group PLC				SLM Corp.				2,600 % fällig am 27.05.2030	500	434	0,09
5,985 % fällig am 07.08.2027	1.000	1.018	0,21	3,125 % fällig am 02.11.2026	\$ 500	467	0,10	Allegion U.S. Holding Co., Inc.			
Metropolitan Life Global Funding				SMBC Aviation Capital Finance DAC				3,550 % fällig am 01.10.2027	1.100	1.046	0,22
1,875 % fällig am 11.01.2027	1.400	1.280	0,27	3,550 % fällig am 15.04.2024	1.100	1.093	0,23	Amdocs Ltd.			
Mid-America Apartments LP				Societe Generale S.A.				2,538 % fällig am 15.06.2030	1.600	1.381	0,29
1,100 % fällig am 15.09.2026	1.200	1.089	0,23	6,691 % fällig am 10.01.2034	200	211	0,04	American Airlines Pass-Through Trust			
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.				6,750 % fällig am 06.04.2028 (d)/f)	400	358	0,07	3,200 % fällig am 15.12.2029	607	554	0,12
2,309 % fällig am 20.07.2032	2.000	1.661	0,35	Spirit Realty LP				3,250 % fällig am 15.04.2030	673	589	0,12
5,133 % fällig am 20.07.2033	900	914	0,19	3,200 % fällig am 15.02.2031	100	88	0,02	3,375 % fällig am 01.11.2028	345	317	0,07
5,406 % fällig am 19.04.2034	300	311	0,06	4,000 % fällig am 15.07.2029	200	190	0,04	3,500 % fällig am 15.08.2033	405	345	0,07
5,441 % fällig am 22.02.2034	300	310	0,06	Standard Chartered PLC				3,575 % fällig am 15.07.2029	133	125	0,03
Mizuho Financial Group, Inc.				3,265 % fällig am 18.02.2036	200	164	0,03	3,600 % fällig am 15.04.2031	211	185	0,04
3,153 % fällig am 16.07.2030	1.873	1.687	0,35	6,296 % fällig am 06.07.2034	250	263	0,05	4,000 % fällig am 15.01.2027	391	374	0,08
Morgan Stanley				6,301 % fällig am 09.01.2029	1.000	1.027	0,21	Amgen, Inc.			
4,889 % fällig am 20.07.2033	1.400	1.366	0,28	Stifel Financial Corp.				5,250 % fällig am 02.03.2033	500	513	0,11
5,250 % fällig am 21.04.2034	3.600	3.601	0,75	4,000 % fällig am 15.05.2030	600	545	0,11	5,600 % fällig am 02.03.2043	3.075	3.179	0,66
6,407 % fällig am 01.11.2029	1.700	1.803	0,37	STORE Capital Corp.				Apple, Inc.			
Mutual of Omaha Cos. Global Funding				4,500 % fällig am 15.03.2028	200	184	0,04	4,850 % fällig am 10.05.2053	2.100	2.142	0,45
5,450 % fällig am 12.12.2028	400	409	0,08	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.				ArcelorMittal S.A.			
Nasdaq, Inc.				1,474 % fällig am 08.07.2025	1.100	1.041	0,22	6,800 % fällig am 29.11.2032	1.000	1.082	0,23
5,550 % fällig am 15.02.2034	400	416	0,09	3,202 % fällig am 17.09.2029 (f)	700	637	0,13	Ashtead Capital, Inc.			
Nationwide Building Society				5,710 % fällig am 13.01.2030	1.100	1.143	0,24	4,000 % fällig am 01.05.2028	400	377	0,08
6,557 % fällig am 18.10.2027	1.100	1.139	0,24	5,716 % fällig am 14.09.2028	400	414	0,09	AstraZeneca PLC			
NatWest Group PLC				Synchrony Financial				4,000 % fällig am 17.01.2029	500	494	0,10
4,892 % fällig am 18.05.2029	1.700	1.671	0,35	7,250 % fällig am 02.02.2033	1.200	1.192	0,25	Bacardi Ltd.			
Neuberger Berman Group LLC				Toyota Motor Credit Corp.				5,250 % fällig am 15.01.2029	1.100	1.100	0,23
4,500 % fällig am 15.03.2027	1.000	959	0,20	4,625 % fällig am 12.01.2028	900	912	0,19	BAE Systems PLC			
New York Life Global Funding				TP ICAP Finance PLC				3,400 % fällig am 15.04.2030	200	185	0,04
1,200 % fällig am 07.08.2030	2.800	2.248	0,47	5,250 % fällig am 29.05.2026	£ 400	494	0,10	Baptist Healthcare System Obligated Group			
Nippon Life Insurance Co.				Truist Financial Corp.				3,540 % fällig am 15.08.2050	300	222	0,05
6,250 % fällig am 13.09.2053	200	210	0,04	7,161 % fällig am 30.10.2029	\$ 900	973	0,20	BAT Capital Corp.			
Nissan Motor Acceptance Co. LLC				U.S. Bancorp				7,079 % fällig am 02.08.2043	500	532	0,11
2,750 % fällig am 09.03.2028	1.900	1.678	0,35	6,787 % fällig am 26.10.2027	1.250	1.306	0,27	Bayer U.S. Finance LLC			
Nomura Holdings, Inc.				UBS Group AG				4,250 % fällig am 15.12.2025	1.100	1.072	0,22
2,679 % fällig am 16.07.2030	1.300	1.109	0,23	2,593 % fällig am 11.09.2025	400	391	0,08	Berry Global, Inc.			
5,386 % fällig am 06.07.2027	2.100	2.109	0,44	3,126 % fällig am 13.08.2030	900	804	0,17	1,570 % fällig am 15.01.2026	1.500	1.394	0,29
Nykredit Realkredit A/S				4,282 % fällig am 09.01.2028	1.250	1.212	0,25	Boardwalk Pipelines LP			
1,500 % fällig am 01.10.2053	DKK 9.146	1.093	0,23	5,959 % fällig am 12.01.2034	1.400	1.449	0,30	3,400 % fällig am 15.02.2031	500	447	0,09
Omega Healthcare Investors, Inc.				6,537 % fällig am 12.08.2033	2.750	2.936	0,61	Boeing Co.			
4,750 % fällig am 15.01.2028	\$ 1.200	1.155	0,24	UDR, Inc.				5,930 % fällig am 01.05.2060	700	726	0,15
OneMain Finance Corp.				3,100 % fällig am 01.11.2034	300	248	0,05	Booz Allen Hamilton, Inc.			
7,875 % fällig am 15.03.2030	500	515	0,11	3,500 % fällig am 15.01.2028	300	283	0,06	5,950 % fällig am 04.08.2033	100	106	0,02
Pacific Life Global Funding				VICI Properties LP				British Airways Pass-Through Trust			
1,375 % fällig am 14.04.2026	2.600	2.404	0,50	3,875 % fällig am 15.02.2029	300	276	0,06	4,125 % fällig am 20.03.2033	258	235	0,05
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia				4,500 % fällig am 15.01.2028	100	95	0,02	4,250 % fällig am 15.05.2034	200	187	0,04
2,800 % fällig am 23.06.2030	300	271	0,06	5,125 % fällig am 15.05.2032	600	586	0,12	Broadcom, Inc.			
Physicians Realty LP				5,750 % fällig am 01.02.2027	100	100	0,02	3,469 % fällig am 15.04.2034	569	495	0,10
4,300 % fällig am 15.03.2027	300	292	0,06	Vonovia SE				Burlington Northern Santa Fe LLC			
Protective Life Global Funding				0,000 % fällig am 01.12.2025 (b)	€ 1.200	1.237	0,26	5,200 % fällig am 15.04.2054	100	104	0,02
1,170 % fällig am 15.07.2025	2.300	2.168	0,45	Wells Fargo & Co.				Caesars Entertainment, Inc.			
Reliance Standard Life Global Funding				2,393 % fällig am 02.06.2028	\$ 1.000	916	0,19	7,000 % fällig am 15.02.2030	400	410	0,09
2,500 % fällig am 30.10.2024	2.200	2.142	0,45	2,406 % fällig am 30.10.2025	300	292	0,06	Cameron LNG LLC			
Retail Opportunity Investments Partnership LP				3,196 % fällig am 17.06.2027	4.400	4.208	0,88	3,302 % fällig am 15.01.2035	1.400	1.194	0,25
6,750 % fällig am 15.10.2028	200	210	0,04	4,897 % fällig am 25.07.2033	2.100	2.047	0,43	Canadian Pacific Railway Co.			
RGA Global Funding				5,557 % fällig am 25.07.2034	100	102	0,02	3,125 % fällig am 01.06.2026	300	288	0,06
6,000 % fällig am 21.11.2028	500	519	0,11	6,491 % fällig am 23.10.2034	700	762	0,16	Carnival Corp.			
Rocket Mortgage LLC				Weyerhaeuser Co.				7,000 % fällig am 15.08.2029	200	209	0,04
2,875 % fällig am 15.10.2026	200	185	0,04	4,000 % fällig am 15.04.2030	1.300	1.239	0,26	Carrier Global Corp.			
Sagax AB				4,750 % fällig am 15.05.2026	600	597	0,12	5,800 % fällig am 30.11.2025	400	406	0,08
2,250 % fällig am 13.03.2025	€ 300	323	0,07	7,375 % fällig am 15.03.2032	343	398	0,08	CDW LLC			
Santander Holdings USA, Inc.						194.246	40,40	3,569 % fällig am 01.12.2031	700	622	0,13
2,490 % fällig am 06.01.2028	\$ 700	641	0,13	INDUSTRIEWERTE				Centene Corp.			
4,400 % fällig am 13.07.2027	400	389	0,08	AbbVie, Inc.				2,450 % fällig am 15.07.2028	1.100	981	0,20
6,499 % fällig am 09.03.2029	600	620	0,13	4,250 % fällig am 21.11.2049	200	178	0,04	Charter Communications Operating LLC			
				4,850 % fällig am 15.06.2044	400	390	0,08	4,200 % fällig am 15.03.2028	1.300	1.250	0,26

Aufstellung der Wertpapieranlagen des US Investment Grade Corporate Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
6,150 % fällig am 10.11.2026	\$ 1.600	\$ 1.636	0,34	Greensaf Pipelines Bidco SARL	\$ 300	\$ 313	0,07	Mundys SpA	€ 100	\$ 102	0,02
Cheniere Energy Partners LP				6,129 % fällig am 23.02.2038				1,875 % fällig am 12.02.2028			
3,250 % fällig am 31.01.2032	400	341	0,07	Haleon U.S. Capital LLC				Netflix, Inc.			
4,000 % fällig am 01.03.2031	2.100	1.912	0,40	3,375 % fällig am 24.03.2029	2.400	2.271	0,47	4,875 % fällig am 15.06.2030	\$ 400	405	0,08
5,950 % fällig am 30.06.2033	600	617	0,13	3,625 % fällig am 24.03.2032	750	692	0,14	Newmont Corp.			
Cheniere Energy, Inc.				HCA, Inc.				5,750 % fällig am 15.11.2041	200	207	0,04
4,625 % fällig am 15.10.2028	800	781	0,16	3,500 % fällig am 01.09.2030	1.000	907	0,19	NextEra Energy Operating Partners LP			
Cigna Group				3,500 % fällig am 15.07.2051	700	494	0,10	4,250 % fällig am 15.07.2024	550	544	0,11
4,375 % fällig am 15.10.2028	1.400	1.389	0,29	5,500 % fällig am 01.06.2033	900	915	0,19	Norfolk Southern Corp.			
Cloud Software Group, Inc.				5,625 % fällig am 01.09.2028	200	205	0,04	4,100 % fällig am 15.05.2049	45	38	0,01
6,500 % fällig am 31.03.2029	100	95	0,02	Health & Happiness International Holdings Ltd.				5,950 % fällig am 15.03.2064	200	223	0,05
Comcast Corp.				13,500 % fällig am 26.06.2026	600	580	0,12	Northern Star Resources Ltd.			
5,500 % fällig am 15.05.2064	500	527	0,11	Howard Midstream Energy Partners LLC				6,125 % fällig am 11.04.2033	1.100	1.106	0,23
ConocoPhillips Co.				8,875 % fällig am 15.07.2028	200	210	0,04	NVR, Inc.			
5,550 % fällig am 15.03.2054	300	319	0,07	Humana, Inc.				3,000 % fällig am 15.05.2030	300	267	0,06
Continental Airlines Pass-Through Trust				5,750 % fällig am 01.03.2028	500	520	0,11	NXP BV			
4,000 % fällig am 29.04.2026	201	197	0,04	5,875 % fällig am 01.03.2033	800	853	0,18	4,875 % fällig am 01.03.2024	1.100	1.098	0,23
Continental Resources, Inc.				Hyundai Capital America				Occidental Petroleum Corp.			
5,750 % fällig am 15.01.2031	400	398	0,08	2,000 % fällig am 15.06.2028	1.600	1.399	0,29	8,875 % fällig am 15.07.2030	1.300	1.523	0,32
CVS Health Corp.				6,532 % fällig am 04.08.2025	300	300	0,06	OCI NV			
4,125 % fällig am 01.04.2040	900	774	0,16	Illumina, Inc.				6,700 % fällig am 16.03.2033	400	409	0,09
5,125 % fällig am 21.02.2030	1.500	1.524	0,32	5,750 % fällig am 13.12.2027	900	924	0,19	Oracle Corp.			
CVS Pass-Through Trust				Imperial Brands Finance PLC				4,000 % fällig am 15.07.2046	600	482	0,10
5,789 % fällig am 10.01.2026	29	29	0,01	3,875 % fällig am 26.07.2029	600	560	0,12	4,000 % fällig am 15.11.2047	600	476	0,10
6,036 % fällig am 10.12.2028	122	123	0,03	4,250 % fällig am 21.07.2025	500	491	0,10	4,650 % fällig am 06.05.2030	1.100	1.096	0,23
DAE Funding LLC				Infor, Inc.				6,250 % fällig am 09.11.2032 (g)	1.000	1.088	0,23
1,625 % fällig am 15.02.2024	700	696	0,14	1,750 % fällig am 15.07.2025	600	566	0,12	Pacific National Finance Pty. Ltd.			
Dell International LLC				Intel Corp.				4,750 % fällig am 22.03.2028	1.700	1.594	0,33
6,020 % fällig am 15.06.2026	548	561	0,12	5,200 % fällig am 10.02.2033	1.200	1.254	0,26	Penske Truck Leasing Co. LP			
6,200 % fällig am 15.07.2030	900	966	0,20	Jabil, Inc.				4,450 % fällig am 29.01.2026	100	98	0,02
Delta Air Lines Pass-Through Trust				5,450 % fällig am 01.02.2029	200	205	0,04	Petroleos Mexicanos			
2,000 % fällig am 10.12.2029	870	772	0,16	JDE Peet's NV				7,690 % fällig am 23.01.2050	100	71	0,01
Directv Financing LLC				2,250 % fällig am 24.09.2031	400	321	0,07	10,000 % fällig am 07.02.2033	400	402	0,08
5,875 % fällig am 15.08.2027	1.100	1.034	0,22	4,125 % fällig am 23.01.2030	€ 400	455	0,09	Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd.			
Dyno Nobel Finance LLC				JetBlue Pass-Through Trust				5,340 % fällig am 19.05.2063	1.200	1.213	0,25
3,950 % fällig am 03.08.2027	500	480	0,10	2,750 % fällig am 15.11.2033	\$ 245	207	0,04	Philip Morris International, Inc.			
Eastern Gas Transmission & Storage, Inc.				4,000 % fällig am 15.05.2034	80	74	0,02	5,125 % fällig am 15.02.2030	2.000	2.034	0,42
3,900 % fällig am 15.11.2049	2.300	1.705	0,35	Kenvue, Inc.				5,750 % fällig am 17.11.2032	200	210	0,04
Ecopetrol S.A.				5,100 % fällig am 22.03.2043	300	312	0,07	Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC			
8,875 % fällig am 13.01.2033	300	326	0,07	Kinder Morgan, Inc.				3,050 % fällig am 23.01.2025	400	340	0,07
Elevance Health, Inc.				4,800 % fällig am 01.02.2033	300	289	0,06	POSCO			
4,750 % fällig am 15.02.2033	1.800	1.802	0,37	5,200 % fällig am 01.06.2033	600	597	0,12	5,625 % fällig am 17.01.2026	900	908	0,19
Energy Transfer LP				Kraft Heinz Foods Co.				Royalty Pharma PLC			
4,400 % fällig am 15.03.2027	1.400	1.370	0,29	6,875 % fällig am 26.01.2039	550	635	0,13	3,550 % fällig am 02.09.2050	711	506	0,11
5,750 % fällig am 15.02.2033	1.000	1.032	0,21	Las Vegas Sands Corp.				RTX Corp.			
5,950 % fällig am 01.10.2043	100	99	0,02	2,900 % fällig am 25.06.2025	1.500	1.442	0,30	6,400 % fällig am 15.03.2054	500	579	0,12
6,050 % fällig am 01.12.2026	300	309	0,06	3,900 % fällig am 08.08.2029	600	554	0,12	Sabine Pass Liquefaction LLC			
6,500 % fällig am 01.02.2042	100	106	0,02	Leidos, Inc.				5,000 % fällig am 15.03.2027	300	301	0,06
EnLink Midstream LLC				4,375 % fällig am 15.05.2030	600	575	0,12	Sands China Ltd.			
6,500 % fällig am 01.09.2030	700	715	0,15	LG Energy Solution Ltd.				3,100 % fällig am 08.03.2029	1.000	873	0,18
Enterprise Products Operating LLC				5,750 % fällig am 25.09.2028	700	722	0,15	3,500 % fällig am 08.08.2031	400	336	0,07
2,800 % fällig am 31.01.2030	1.000	905	0,19	Marriott International, Inc.				4,300 % fällig am 08.01.2026	600	577	0,12
5,700 % fällig am 15.02.2042	300	317	0,07	3,500 % fällig am 15.10.2032	200	178	0,04	Santos Finance Ltd.			
Equifax, Inc.				Mattel, Inc.				5,250 % fällig am 13.03.2029	1.600	1.567	0,33
5,100 % fällig am 01.06.2028	500	505	0,11	3,375 % fällig am 01.04.2026	500	476	0,10	Spirit AeroSystems, Inc.			
ERAC USA Finance LLC				McCormick & Co., Inc.				9,375 % fällig am 30.11.2029	200	219	0,05
3,300 % fällig am 01.12.2026	1.000	958	0,20	4,950 % fällig am 15.04.2033	900	904	0,19	9,750 % fällig am 15.11.2030	400	431	0,09
Expedia Group, Inc.				Melco Resorts Finance Ltd.				Spirit Airlines Pass-Through Trust			
5,000 % fällig am 15.02.2026	1.300	1.299	0,27	4,875 % fällig am 06.06.2025	1.000	971	0,20	3,650 % fällig am 15.08.2031	418	343	0,07
Ferguson Finance PLC				5,250 % fällig am 26.04.2026	600	579	0,12	4,100 % fällig am 01.10.2029	113	104	0,02
3,250 % fällig am 02.06.2030	300	269	0,06	Meta Platforms, Inc.				Stryker Corp.			
Flex Ltd.				5,600 % fällig am 15.05.2053	800	868	0,18	4,850 % fällig am 08.12.2028	600	607	0,13
4,750 % fällig am 15.06.2025	300	297	0,06	MGM China Holdings Ltd.				Sutter Health			
Fox Corp.				5,250 % fällig am 18.06.2025	900	885	0,18	5,164 % fällig am 15.08.2033	100	101	0,02
6,500 % fällig am 13.10.2033	100	108	0,02	5,375 % fällig am 15.05.2024	200	199	0,04	Sysco Corp.			
Gatwick Funding Ltd.				Micron Technology, Inc.				3,150 % fällig am 14.12.2051	300	215	0,04
6,125 % fällig am 02.03.2028	£ 200	261	0,05	4,663 % fällig am 15.02.2030	950	928	0,19	T-Mobile USA, Inc.			
Glencore Funding LLC				Mitchells & Butlers Finance PLC				2,550 % fällig am 15.02.2031	4.300	3.706	0,77
5,400 % fällig am 08.05.2028	\$ 400	408	0,09	6,013 % fällig am 15.12.2030	£ 404	489	0,10	2,875 % fällig am 15.02.2031	365	322	0,07
Global Payments, Inc.				Moody's Corp.				Tapestry, Inc.			
2,900 % fällig am 15.05.2030	600	528	0,11	3,250 % fällig am 20.05.2050	\$ 900	664	0,14	7,350 % fällig am 27.11.2028	300	315	0,07
GN Bondco LLC				Motorola Solutions, Inc.				7,700 % fällig am 27.11.2030	300	316	0,07
9,500 % fällig am 15.10.2031	400	391	0,08	2,300 % fällig am 15.11.2030	300	253	0,05	Targa Resources Corp.			
Greene King Finance PLC				MSCI, Inc.				5,200 % fällig am 01.07.2027	700	704	0,15
5,318 % fällig am 15.09.2031	£ 106	133	0,03	3,250 % fällig am 15.08.2033	200	167	0,03	6,125 % fällig am 15.03.2033	200	211	0,04
				3,875 % fällig am 15.02.2031	100	92	0,02				

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
TD SYNEX Corp.				CenterPoint Energy Houston Electric LLC				Pacific Gas & Electric Co.			
1,750 % fällig am 09.08.2026	\$ 2.300	\$ 2.086	0,43	5,300 % fällig am 01.04.2053	\$ 500	\$ 524	0,11	2,100 % fällig am 01.08.2027	2.300	\$ 2.075	0,43
Tencent Music Entertainment Group				CenterPoint Energy, Inc.				3,000 % fällig am 15.06.2028	900	821	0,17
2,000 % fällig am 03.09.2030	400	325	0,07	4,250 % fällig am 01.11.2028	90	87	0,02	3,150 % fällig am 01.01.2026	700	672	0,14
Tennessee Gas Pipeline Co. LLC				Clearway Energy Operating LLC				3,750 % fällig am 01.07.2028	300	281	0,06
7,000 % fällig am 15.10.2028	900	976	0,20	3,750 % fällig am 15.02.2031	200	176	0,04	4,250 % fällig am 15.03.2046	1.100	849	0,18
Time Warner Cable LLC				Cleveland Electric Illuminating Co.				4,300 % fällig am 15.03.2045	100	79	0,02
5,875 % fällig am 15.11.2040	1.400	1.269	0,26	3,500 % fällig am 01.04.2028	1.561	1.463	0,30	6,750 % fällig am 15.01.2053	400	436	0,09
Transcontinental Gas Pipe Line Co. LLC				Columbia Pipelines Holding Co. LLC				PacifiCorp			
4,000 % fällig am 15.03.2028	900	873	0,18	6,042 % fällig am 15.08.2028	300	310	0,07	6,250 % fällig am 15.10.2037	1.400	1.496	0,31
Transurban Finance Co. Pty. Ltd.				Columbia Pipelines Operating Co. LLC				PECO Energy Co.			
2,450 % fällig am 16.03.2031	150	125	0,03	6,036 % fällig am 15.11.2033	500	524	0,11	3,000 % fällig am 15.09.2049	100	71	0,02
Trimble, Inc.				Connecticut Light and Power Co.				PPL Electric Utilities Corp.			
6,100 % fällig am 15.03.2033	100	107	0,02	4,900 % fällig am 01.07.2033	1.000	1.010	0,21	5,000 % fällig am 15.05.2033	300	307	0,06
U.S. Airways Pass-Through Trust				Consolidated Edison Co. of New York, Inc.				Progress Energy, Inc.			
5,900 % fällig am 01.04.2026	184	184	0,04	5,300 % fällig am 01.03.2035	900	919	0,19	7,750 % fällig am 01.03.2031	204	236	0,05
United Airlines Pass-Through Trust				Dominion Energy, Inc.				Public Service Co. of Colorado			
2,700 % fällig am 01.11.2033	333	283	0,06	5,375 % fällig am 15.11.2032	100	103	0,02	6,250 % fällig am 01.09.2037	300	327	0,07
2,875 % fällig am 07.04.2030	370	331	0,07	DTE Electric Co.				Public Service Co. of Oklahoma			
3,100 % fällig am 07.04.2030	206	180	0,04	5,200 % fällig am 01.04.2033	100	104	0,02	2,200 % fällig am 15.08.2031	300	249	0,05
3,700 % fällig am 01.09.2031	456	399	0,08	DTE Energy Co.				San Diego Gas & Electric Co.			
3,750 % fällig am 03.03.2028	553	528	0,11	2,950 % fällig am 01.03.2030	600	531	0,11	5,350 % fällig am 01.04.2053	1.100	1.115	0,23
4,000 % fällig am 11.10.2027	161	153	0,03	Duke Energy Carolinas LLC				SCE Recovery Funding LLC			
4,150 % fällig am 11.10.2025	483	481	0,10	6,000 % fällig am 15.01.2038	50	54	0,01	5,112 % fällig am 14.12.2049	200	198	0,04
4,550 % fällig am 25.02.2033	73	65	0,01	Duke Energy Ohio, Inc.				Southern California Edison Co.			
United Rentals North America, Inc.				5,650 % fällig am 01.04.2053	2.400	2.519	0,52	2,850 % fällig am 01.08.2029	800	730	0,15
3,875 % fällig am 15.11.2027	200	191	0,04	Edison International				3,900 % fällig am 01.12.2041	108	88	0,02
UnitedHealth Group, Inc.				6,950 % fällig am 15.11.2029	100	109	0,02	4,200 % fällig am 01.03.2029	200	196	0,04
5,200 % fällig am 15.04.2063	900	920	0,19	8,125 % fällig am 15.06.2053	300	307	0,06	5,300 % fällig am 01.03.2028	700	719	0,15
Var Energi ASA				EDP Finance BV				6,650 % fällig am 01.04.2029	2.035	2.171	0,45
8,000 % fällig am 15.11.2032	200	225	0,05	6,300 % fällig am 11.10.2027	900	945	0,20	Southern California Gas Co.			
Venture Global Calcasieu Pass LLC				Electricite de France S.A.				5,200 % fällig am 01.06.2033	1.300	1.338	0,28
6,250 % fällig am 15.01.2030	2.000	1.992	0,41	4,875 % fällig am 21.09.2038	600	556	0,12	Southern Co. Gas Capital Corp.			
Venture Global LNG, Inc.				Enel Finance America LLC				3,250 % fällig am 15.06.2026	2.700	2.599	0,54
8,375 % fällig am 01.06.2031	800	801	0,17	7,100 % fällig am 14.10.2027	600	641	0,13	Southwest Gas Corp.			
Verisk Analytics, Inc.				Enel Finance International NV				5,800 % fällig am 01.12.2027	1.000	1.030	0,21
4,125 % fällig am 15.03.2029	200	195	0,04	1,375 % fällig am 12.07.2026	1.600	1.458	0,30	Southwestern Public Service Co.			
VMware LLC				Entergy Corp.				3,750 % fällig am 15.06.2049	500	383	0,08
4,650 % fällig am 15.05.2027	350	347	0,07	1,900 % fällig am 15.06.2028	200	177	0,04	System Energy Resources, Inc.			
4,700 % fällig am 15.05.2030	900	888	0,18	Entergy Mississippi LLC				2,140 % fällig am 09.12.2025	800	745	0,16
Walgreens Boots Alliance, Inc.				2,850 % fällig am 01.06.2028	700	647	0,14	6,000 % fällig am 15.04.2028	600	613	0,13
3,450 % fällig am 01.06.2026	300	285	0,06	Exelon Corp.				Tallgrass Energy Partners LP			
Warnermedia Holdings, Inc.				4,050 % fällig am 15.04.2030	800	764	0,16	6,000 % fällig am 31.12.2030	500	465	0,10
4,279 % fällig am 15.03.2032	800	732	0,15	FirstEnergy Transmission LLC				Targa Resources Partners LP			
5,050 % fällig am 15.03.2042	1.500	1.323	0,28	4,350 % fällig am 15.01.2025	500	492	0,10	5,500 % fällig am 01.03.2030	300	300	0,06
Waste Connections, Inc.				India Green Energy Holdings				Telecom Italia SpA			
4,200 % fällig am 15.01.2033	900	875	0,18	5,375 % fällig am 29.04.2024	250	247	0,05	7,875 % fällig am 31.07.2028	900	1.107	0,23
Weibo Corp.				Interstate Power & Light Co.				Transcanada Trust			
3,375 % fällig am 08.07.2030	700	604	0,13	3,600 % fällig am 01.04.2029	1.400	1.330	0,28	5,300 % fällig am 15.03.2077	50	45	0,01
Weir Group PLC				Ipalco Enterprises, Inc.				Vistra Operations Co. LLC			
2,200 % fällig am 13.05.2026	1.300	1.209	0,25	3,700 % fällig am 01.09.2024	1.500	1.477	0,31	6,950 % fällig am 15.10.2033	400	421	0,09
Western Midstream Operating LP				Jersey Central Power & Light Co.							
6,150 % fällig am 01.04.2033	700	728	0,15	4,300 % fällig am 15.01.2026	3.350	3.280	0,68				
Woodside Finance Ltd.				Louisville Gas and Electric Co.				Summe Unternehmensanleihen und Wechsel			
3,650 % fällig am 05.03.2025	1.100	1.077	0,22	5,450 % fällig am 15.04.2033	700	730	0,15				
Xiaomi Best Time International Ltd.				MidAmerican Energy Co.							
2,875 % fällig am 14.07.2031	400	333	0,07	2,700 % fällig am 01.08.2052	100	65	0,01	US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Zimmer Biomet Holdings, Inc.				Mississippi Power Co.				Uniform Mortgage-Backed Security			
4,250 % fällig am 15.08.2035	228	207	0,04	3,950 % fällig am 30.03.2028	500	486	0,10	3,000 % fällig am 01.05.2052	846	749	0,16
Zoetis, Inc.				National Grid PLC				4,500 % fällig am 01.09.2052	3.583	3.476	0,72
2,000 % fällig am 15.05.2030	1.400	1.206	0,25	5,809 % fällig am 12.06.2033	500	526	0,11	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
		135.448	28,17	New York State Electric & Gas Corp.				3,500 % fällig am 01.01.2054	5.640	5.179	1,08
				5,850 % fällig am 15.08.2033	800	838	0,17	4,000 % fällig am 01.01.2054	11.800	11.169	2,32
VERSORGUNGSUNTERNEHMEN				NextEra Energy Capital Holdings, Inc.				5,000 % fällig am 01.02.2054	5.700	5.642	1,17
AEP Texas, Inc.				5,050 % fällig am 28.02.2033	600	602	0,13	5,500 % fällig am 01.02.2054	3.900	3.918	0,82
5,400 % fällig am 01.06.2033	1.100	1.118	0,23	NiSource, Inc.				6,000 % fällig am 01.02.2054	11.800	11.982	2,49
6,650 % fällig am 15.02.2033	300	326	0,07	3,600 % fällig am 01.05.2030	300	279	0,06	6,500 % fällig am 01.02.2054	1.700	1.742	0,36
Ameren Illinois Co.				Oklahoma Gas & Electric Co.							
3,250 % fällig am 15.03.2050	400	295	0,06	5,400 % fällig am 15.01.2033	200	208	0,04	US-SCHATZobligationen			
Appalachian Power Co.				ONEOK, Inc.				U.S. Treasury Bonds			
7,000 % fällig am 01.04.2038	900	1.041	0,22	4,350 % fällig am 15.03.2029	200	195	0,04	2,500 % fällig am 15.02.2046	15.800	11.863	2,47
AT&T, Inc.				4,550 % fällig am 15.07.2028	200	198	0,04	2,750 % fällig am 15.08.2047	6.900	5.376	1,12
3,500 % fällig am 15.09.2053	1.000	727	0,15	5,800 % fällig am 01.11.2030	200	208	0,04	2,750 % fällig am 15.11.2047	1.200	935	0,19
Black Hills Corp.				6,100 % fällig am 15.11.2032	500	532	0,11	3,000 % fällig am 15.02.2048	8.004	6.525	1,36
1,037 % fällig am 23.08.2024	400	388	0,08	6,625 % fällig am 01.09.2053	1.700	1.905	0,40	U.S. Treasury Inflation Protected Securities (c)			
6,150 % fällig am 15.05.2034	200	208	0,04					0,125 % fällig am 15.07.2024	1.166	1.146	0,24
								0,125 % fällig am 15.10.2024	720	704	0,15
								0,125 % fällig am 15.04.2025	715	689	0,14

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.12.2026	\$ 900	\$ (5)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2028	1.000	21	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2025	200	6	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2026	500	11	0,00
Boeing Co.	1,000	20.06.2027	2.900	210	0,04
BP Capital Markets PLC	1,000	20.12.2025	€ 700	(3)	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2024	400	(3)	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.06.2028	1.100	24	0,01
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2028	500	8	0,00
Cellnex Telecom S.A.	5,000	20.12.2030	400	9	0,00
Devon Energy Corp.	1,000	20.12.2026	\$ 800	15	0,00
Enbridge, Inc.	1,000	20.12.2026	900	3	0,00
Exelon Generation Co. LLC	1,000	20.12.2024	1.600	(4)	0,00
Expedia Group, Inc.	1,000	20.12.2026	300	2	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.12.2024	1.300	(94)	(0,02)
General Electric Co.	1,000	20.06.2024	300	6	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	1.200	9	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2026	200	1	0,00
General Motors Co.	5,000	20.12.2026	710	(59)	(0,01)
General Motors Co.	5,000	20.06.2028	890	25	0,01
Hess Corp.	1,000	20.12.2026	1.200	27	0,01
MetLife, Inc.	1,000	20.12.2024	1.400	(26)	(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	234	0,05
Southwest Airlines Co.	1,000	20.12.2026	\$ 550	8	0,00
Telefonica Emisiones S.A.	1,000	20.06.2028	€ 800	13	0,00
Tesco PLC	1,000	20.12.2024	1.000	(13)	0,00
Tesco PLC	1,000	20.12.2027	1.050	24	0,01
Tesco PLC	1,000	20.06.2028	100	2	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2026	\$ 1.200	(15)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2026	1.800	(21)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2028	1.100	14	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2028	300	4	0,00
Vodafone Group PLC	1,000	20.06.2024	€ 200	(5)	0,00
Volkswagen International Finance NV	1,000	20.06.2028	1.600	(6)	0,00
				\$ 427	0,09

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-41 5-Year Index	1,000 %	20.12.2028	\$ 60.700	\$ 540	0,11

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variablem Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS		1,175 %	28.02.2052	£ 200	\$ (105)	(0,02)
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS		4,500	20.03.2034	500	(51)	(0,01)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS		0,300	20.03.2028	¥ 231.200	59	0,01
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS		1,000	20.09.2043	170.000	37	0,01
Erhalt ⁽³⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,684	03.01.2034	\$ 200	(3)	0,00
Erhalt ⁽³⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,750	02.01.2034	200	(4)	0,00
Erhalt ⁽³⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,810	02.01.2034	200	(5)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,854	29.12.2033	400	(11)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		4,500	18.07.2024	11.200	12	0,00
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS		3,750	20.09.2025	CAD 100	1	0,00
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS		3,750	20.12.2025	16.300	186	0,04
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR		7,195	25.04.2027	ZAR 22.300	23	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR		7,300	28.04.2027	3.900	3	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW		4,500	20.09.2033	AUD 4.300	103	0,02
Zahlung ⁽³⁾	6-Month AUD-BBR-BBSW		4,500	20.03.2034	4.500	104	0,02
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		0,000	17.03.2053	€ 3.850	1.740	0,37
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR		2,750	20.03.2054	600	(56)	(0,01)
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR		2,760	03.01.2029	300	(4)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		2,880	19.12.2028	500	(10)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		2,920	13.12.2028	500	(11)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		2,950	29.12.2028	300	(7)	0,00
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR		3,000	20.03.2034	800	33	0,01
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		3,179	29.11.2028	200	(7)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		3,255	22.11.2028	200	(8)	0,00
						\$ 2.019	0,43
						\$ 2.986	0,63

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnahmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückzahlungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

Aufstellung der Wertpapieranlagen des US Investment Grade Corporate Bond Fund (Forts.)

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,975 %	29.05.2024	5.200	\$ 6	\$ 2	0,00

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	3,288 %	19.01.2024	100	\$ 0	\$ 0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,738	19.01.2024	100	0	0	0,00
BPS	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,494	08.01.2024	200	(1)	(2)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,545	16.01.2024	400	(2)	(5)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,994	08.01.2024	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,995	16.01.2024	400	(2)	0	0,00
CBK	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,235	22.01.2024	400	(2)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,685	22.01.2024	400	(2)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,310	18.01.2024	200	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,590	05.01.2024	300	(1)	(3)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,700	18.01.2024	200	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,960	05.01.2024	300	(1)	0	0,00
GLM	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,195	29.05.2024	2.600	(6)	(10)	(0,01)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,215	22.01.2024	400	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,285	19.01.2024	200	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300	16.01.2024	400	(2)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,560	05.01.2024	400	(2)	(4)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,594	05.01.2024	400	(2)	(5)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,648	04.01.2024	400	(2)	(7)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,665	22.01.2024	400	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,735	19.01.2024	200	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	16.01.2024	400	(2)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,010	05.01.2024	400	(2)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,044	05.01.2024	400	(2)	0	0,00
GST	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,440	08.01.2024	400	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,860	08.01.2024	400	(1)	0	0,00
JPM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,170	29.01.2024	200	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,205	22.01.2024	200	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	18.01.2024	200	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,600	12.01.2024	200	(1)	(3)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,620	29.01.2024	200	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,655	22.01.2024	200	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	18.01.2024	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,050	12.01.2024	200	(1)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,490	12.01.2024	300	(1)	(2)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,650	04.01.2024	400	(1)	(6)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,890	12.01.2024	300	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,030	04.01.2024	400	(1)	0	0,00
MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,455	08.01.2024	400	(2)	(2)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,475	08.01.2024	200	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,600	12.01.2024	200	(1)	(3)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,670	04.01.2024	400	(2)	(7)	(0,01)
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,955	08.01.2024	400	(2)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,975	08.01.2024	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,050	12.01.2024	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,120	04.01.2024	400	(2)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,330	15.01.2024	300	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,740	15.01.2024	300	(1)	(1)	0,00
							\$ (66)	\$ (78)	(0,02)

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.01.2054	\$ 97,891	09.01.2024	500	\$ (2)	\$ (6)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 6,000 % fällig am 01.02.2054	101,094	06.02.2024	400	(1)	(3)	0,00
JPM	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 6,000 % fällig am 01.02.2054	99,227	06.02.2024	200	(1)	0	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 6,000 % fällig am 01.02.2054	101,227	06.02.2024	200	(1)	(2)	0,00
SAL	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.02.2054	95,813	06.02.2024	500	(2)	(2)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.02.2054	97,813	06.02.2024	500	(3)	(3)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.01.2054	99,906	09.01.2024	200	(1)	0	0,00
					\$ (11)	\$ (16)	0,00

(1) Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Brazil Government International Bond	1,000 %	20.06.2026	\$ 100	\$ (4)	\$ 5	\$ 1	0,00
BRC	Alibaba Group Holding Ltd.	1,000	20.12.2024	400	5	(2)	3	0,00
	NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	1,000	20.12.2025	500	11	(5)	6	0,01
	Pertamina Persero PT	1,000	20.12.2024	400	(2)	5	3	0,00
DUB	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2025	300	0	3	3	0,00
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	3	3	0,00
JPM	Banco do Brasil S.A.	1,000	20.12.2024	400	(9)	9	0	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2025	400	0	4	4	0,00
MYC	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2027	1.000	(62)	68	6	0,00
	Brookfield Asset Management, Inc.	1,000	20.06.2025	300	0	3	3	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	2	3	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2028	100	(3)	4	1	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2028	300	(3)	5	2	0,00
					\$ (69)	\$ 110	\$ 41	0,01

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens	
AZD	01.2024	\$ 1.558	AUD 2.351	\$ 46	\$ 0	\$ 46	0,01	
BOA	01.2024	£ 102	\$ 129	0	0	0	0,00	
	01.2024	\$ 1.050	¥ 155.011	50	0	50	0,01	
BPS	01.2024	585	NOK 6.221	28	0	28	0,01	
	01.2024	DKK 2.918	\$ 430	0	(2)	(2)	0,00	
	01.2024	€ 461	502	0	(8)	(8)	0,00	
	01.2024	£ 387	491	0	(2)	(2)	0,00	
	01.2024	\$ 624	¥ 91.900	28	0	28	0,01	
	01.2024	181	ZAR 3.320	1	0	1	0,00	
	01.2024	ZAR 13.253	\$ 715	0	(9)	(9)	0,00	
BRC	03.2024	\$ 77	IDR 1.181.351	0	0	0	0,00	
	01.2024	€ 241	\$ 263	0	(3)	(3)	0,00	
	02.2024	\$ 57	TRY 1.724	0	0	0	0,00	
	03.2024	287	9.012	0	(4)	(4)	0,00	
	04.2024	307	9.900	0	(4)	(4)	0,00	
CBK	01.2024	MXN 17.748	\$ 982	0	(61)	(61)	(0,01)	
	01.2024	\$ 141	NOK 1.505	7	0	7	0,00	
	01.2024	ZAR 8.052	\$ 423	0	(17)	(17)	0,00	
	02.2024	\$ 864	BRL 4.348	29	0	29	0,01	
	03.2024	92	IDR 1.412.365	0	0	0	0,00	
GLM	01.2024	AUD 721	\$ 476	0	(16)	(16)	0,00	
	01.2024	CAD 4.241	3.134	0	(83)	(83)	(0,03)	
	01.2024	DKK 3.865	570	0	(3)	(3)	0,00	
	01.2024	¥ 11.000	77	0	(1)	(1)	0,00	
	01.2024	MXN 18.509	1.062	0	(26)	(26)	(0,01)	
	01.2024	\$ 469	MXN 8.233	15	0	15	0,00	
	01.2024	ZAR 10.036	\$ 528	0	(20)	(20)	(0,01)	
	02.2024	BRL 4	1	0	0	0	0,00	
	03.2024	\$ 152	IDR 2.340.854	0	0	0	0,00	
	03.2024	63	TRY 1.968	0	(1)	(1)	0,00	
JPM	02.2024	1.307	INR 109.187	2	0	2	0,00	
	03.2024	75	IDR 1.159.253	0	0	0	0,00	
MYI	01.2024	CAD 721	\$ 547	0	0	0	0,00	
	01.2024	€ 10.557	11.603	0	(61)	(61)	(0,01)	
	01.2024	£ 105	134	0	0	0	0,00	
	01.2024	MXN 4.853	280	0	(5)	(5)	0,00	
	01.2024	\$ 13	€ 12	0	0	0	0,00	
	01.2024	405	£ 317	0	(1)	(1)	0,00	
	01.2024	399	¥ 58.883	19	0	19	0,00	
	01.2024	ZAR 38.593	\$ 2.012	0	(96)	(96)	(0,02)	
	03.2024	\$ 805	IDR 12.387.801	0	(2)	(2)	0,00	
SCX	01.2024	£ 1.740	\$ 2.201	0	(17)	(17)	(0,01)	
	03.2024	\$ 67	IDR 1.033.834	0	0	0	0,00	
					\$ 225	\$ (442)	\$ (217)	(0,05)

Aufstellung der Wertpapieranlagen des US Investment Grade Corporate Bond Fund (Forts.)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 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	01.2024	€ 21	\$ 23	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BPS	01.2024	98	107	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	\$ 29.563	€ 26.894	153	0	153	0,03
BRC	01.2024	€ 102	\$ 112	0	(2)	(2)	0,00
	01.2024	\$ 28.056	€ 25.511	131	0	131	0,03
CBK	01.2024	€ 48	\$ 52	0	(1)	(1)	0,00
MYI	01.2024	\$ 28.045	€ 25.516	147	0	147	0,03
SCX	01.2024	4	4	0	0	0	0,00
				\$ 431	\$ (4)	\$ 427	0,09

Zum 31. Dezember 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	01.2024	\$ 2.375	£ 1.875	\$ 15	\$ 0	\$ 15	0,00
BPS	01.2024	£ 294	\$ 374	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	\$ 9.123	£ 7.219	80	0	80	0,02
BRC	01.2024	£ 57	\$ 73	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	\$ 130	£ 103	0	0	0	0,00
CBK	01.2024	£ 818	\$ 1.034	0	(8)	(8)	0,00
	01.2024	\$ 94	£ 74	1	0	1	0,00
DUB	01.2024	14	11	0	0	0	0,00
GLM	01.2024	£ 21	\$ 26	0	0	0	0,00
MYI	01.2024	391	495	0	(4)	(4)	0,00
	01.2024	\$ 56	£ 45	1	0	1	0,00
SCX	01.2024	£ 89	\$ 112	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024	\$ 11.727	£ 9.272	92	0	92	0,02
SSB	01.2024	11.805	9.355	122	0	122	0,02
				\$ 311	\$ (15)	\$ 296	0,06
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 455	0,09
Summe Anlagen						\$ 512.000	106,48
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ (31.139)	(6,48)
Nettovermögen						\$ 480.861	100,00

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(b) Nullkuponwertpapier.

(c) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(d) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(e) Mit dem Fonds verbunden.

(f) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(g) Eingeschränkte Wertpapiere: (31. Dezember 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	\$ 180	0,04
Citigroup, Inc.	6,270	17.11.2033	09.11.2022	2.000	2.141	0,45
Oracle Corp.	6,250	09.11.2032	07.11.2022	998	1.088	0,23
				\$ 3.198	\$ 3.409	0,72

Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von USD null (31. Dezember 2022: USD 12.732) waren zum 31. Dezember 2023 gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.

Barmittel in Höhe von USD 8.248 (31. Dezember 2022: USD 11.785) waren zum 31. Dezember 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 110 (31. Dezember 2022: USD 830) waren zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten für Finanzderivate gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 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	\$ 725	\$ 486.459	\$ 162	\$ 487.346
Investmentfonds	18.239	0	0	18.239
Pensionsgeschäfte	0	259	0	259
Finanzderivate ⁽³⁾	(25)	6.181	0	6.156
Summen	\$ 18.939	\$ 492.899	\$ 162	\$ 512.000

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 672	\$ 345.328	\$ 399	\$ 346.399
Investmentfonds	38.657	0	0	38.657
Pensionsgeschäfte	0	15.383	0	15.383
Finanzderivate ⁽³⁾	587	303	0	890
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(2.035)	0	(2.035)
Summen	\$ 39.916	\$ 358.979	\$ 399	\$ 399.294

⁽¹⁾ Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

⁽²⁾ Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

⁽³⁾ Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
AZD	\$ 46	\$ 0	\$ 46	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ k. A.
BOA	85	0	85	(108)	0	(108)
BPS	232	(420)	(188)	(856)	740	(116)
BRC	129	(280)	(151)	14	0	14
CBK	(57)	0	(57)	988	(750)	238
CLY	k. A.	k. A.	k. A.	(36)	0	(36)
DUB	3	0	3	(1)	0	(1)
FBF	k. A.	k. A.	k. A.	8	0	8
GLM	(165)	0	(165)	138	0	138
GST	4	0	4	23	0	23
JPM	(12)	0	(12)	240	(170)	70
MYC	1	90	91	(71)	90	19
MYI	(2)	20	18	(5)	(10)	(15)
RYL	k. A.	k. A.	k. A.	294	0	294
SAL	(5)	0	(5)	(3)	0	(3)
SCX	74	0	74	979	(930)	49
SSB	122	0	122	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. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	66,97	59,33
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	34,39	29,34
Sonstige übertragbare Wertpapiere	k. A.	0,48
Investmentfonds	3,79	9,95
Pensionsgeschäfte	0,05	3,96
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,56	0,18
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,63	(0,37)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,09	0,42
Leerverkaufte Wertpapiere	k. A.	(0,52)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	k. A.	(9,95)

* Gemäß der Liste der Märkte, die die Kriterien für einen geregelten OGAW-Markt erfüllen, in Anlage 1 zum Verkaufsprospekt.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	0,12	1,26
Unternehmensanleihen und Wechsel	79,76	67,65
US-Regierungsbehörden	9,12	5,09
US-Schatzobligationen	8,15	8,62
Non-Agency-MBS	0,60	0,26
Forderungsbesicherte Wertpapiere	1,56	0,52
Staatsemissionen	1,43	2,12
Stammaktien	0,00	0,00
Optionsscheine	0,00	0,00
Vorzugswertpapiere	0,15	0,17
Kurzfristige Instrumente	0,47	3,46
Investmentfonds	3,79	9,95
Pensionsgeschäfte	0,05	3,96
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,56	0,18
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,09	(0,05)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,11	(0,03)
Zinsswaps	0,43	(0,29)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswaptionen	0,00	0,54
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Zinsswaptionen	(0,02)	(0,96)
Optionen auf Wertpapiere	0,00	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,01	0,01
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	k. A.	0,01
Devisenterminkontrakte	(0,05)	(0,06)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,15	0,89
Leerverkaufte Wertpapiere	k. A.	(0,52)
Sonstige Aktiva und Passiva	(6,48)	(2,77)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE			
AUSTRALIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Ausgrid Finance Pty. Ltd.			
3,750 % fällig am 30.10.2024 AUD	4.690	\$ 3.167	0,17
5,562 % fällig am 30.10.2024	6.100	4.171	0,22
ING Bank Australia Ltd.			
5,158 % fällig am 26.05.2025	10.200	6.973	0,38
Toyota Finance Australia Ltd.			
4,790 % fällig am 09.09.2024	2.000	1.362	0,07
4,915 % fällig am 26.03.2024	1.000	682	0,04
Transurban Queensland Finance Pty. Ltd.			
6,413 % fällig am 16.12.2024	1.570	1.080	0,06
Victoria Power Networks Finance Pty. Ltd.			
4,898 % fällig am 23.08.2024	3.000	2.041	0,11
Summe Australien		19.476	1,05
KANADA			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
National Bank of Canada			
3,750 % fällig am 09.06.2025	\$ 800	793	0,04
CAYMAN INSELN			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
Atlas Senior Loan Fund Ltd.			
6,745 % fällig am 15.01.2031	3.203	3.207	0,17
Carlyle U.S. CLO Ltd.			
6,835 % fällig am 15.01.2030	999	999	0,05
Catamaran CLO Ltd.			
6,774 % fällig am 22.04.2030	1.080	1.081	0,06
CBAM Ltd.			
6,684 % fällig am 17.04.2031	2.904	2.900	0,16
6,797 % fällig am 20.10.2029	5.922	5.926	0,32
CIFC Funding Ltd.			
6,710 % fällig am 24.04.2030	11.160	11.137	0,60
Crestline Denali CLO Ltd.			
6,797 % fällig am 20.01.2030	4.038	4.038	0,22
Dryden CLO Ltd.			
6,705 % fällig am 15.07.2031	641	641	0,03
Dryden Senior Loan Fund			
6,555 % fällig am 15.04.2029	443	442	0,02
Elevation CLO Ltd.			
6,885 % fällig am 15.10.2029	2.581	2.585	0,14
6,935 % fällig am 15.07.2029	1.051	1.052	0,06
Greenwood Park CLO Ltd.			
6,665 % fällig am 15.04.2031	7.618	7.625	0,41
Nassau Ltd.			
6,805 % fällig am 15.10.2029	233	233	0,01
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd.			
6,788 % fällig am 19.10.2031	20.250	20.275	1,09
Octagon Investment Partners Ltd.			
6,615 % fällig am 16.04.2031	283	283	0,02
6,625 % fällig am 15.04.2031	474	474	0,03
Octagon Loan Funding Ltd.			
6,809 % fällig am 18.11.2031	5.640	5.647	0,30
OZLM Ltd.			
6,675 % fällig am 15.04.2031	1.200	1.199	0,06
6,734 % fällig am 17.01.2031	1.953	1.952	0,11
6,827 % fällig am 20.01.2031	401	402	0,02
Palmer Square CLO Ltd.			
6,794 % fällig am 17.01.2031	779	780	0,04
Sound Point CLO Ltd.			
6,807 % fällig am 18.04.2031	4.600	4.596	0,25
Steele Creek CLO Ltd.			
6,744 % fällig am 21.04.2031	2.635	2.639	0,14
Tralee CLO Ltd.			
6,997 % fällig am 20.07.2029	369	370	0,02
Venture CLO Ltd.			
6,535 % fällig am 15.04.2027	2.539	2.539	0,14
6,631 % fällig am 07.09.2030	1.339	1.337	0,07
6,777 % fällig am 20.01.2029	3.093	3.094	0,17
		87.453	4,71

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Avolon Holdings Funding Ltd.			
2,875 % fällig am 15.02.2025	\$ 2.500	\$ 2.413	0,13
3,950 % fällig am 01.07.2024	1.000	987	0,05
5,250 % fällig am 15.05.2024	2.000	1.990	0,11
Park Aerospace Holdings Ltd.			
5,500 % fällig am 15.02.2024	2.875	2.870	0,16
QNB Finance Ltd.			
1,125 % fällig am 17.06.2024	32.100	31.386	1,69
		39.646	2,14
Summe Cayman Inseln		127.099	6,85
DÄNEMARK			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Danske Bank A/S			
0,976 % fällig am 10.09.2025	1.000	967	0,05
3,244 % fällig am 20.12.2025	600	585	0,03
3,773 % fällig am 28.03.2025	3.410	3.393	0,19
5,375 % fällig am 12.01.2024	5.800	5.799	0,31
Summe Dänemark		10.744	0,58
FINNLAND			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Nordea Bank Abp			
6,376 % fällig am 06.06.2025	2.700	2.711	0,15
FRANKREICH			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
Cars Alliance Auto Leases France			
4,503 % fällig am 21.10.2038	€ 4.600	5.097	0,27
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
BNP Paribas S.A.			
3,375 % fällig am 09.01.2025	\$ 9.100	8.915	0,48
4,705 % fällig am 10.01.2025	12.000	11.999	0,65
6,124 % fällig am 28.02.2024 AUD	1.800	1.230	0,07
BPCE S.A.			
2,375 % fällig am 14.01.2025	\$ 500	484	0,02
Societe Generale S.A.			
2,625 % fällig am 16.10.2024	1.300	1.270	0,07
2,625 % fällig am 22.01.2025	11.600	11.247	0,61
3,875 % fällig am 28.03.2024	4.500	4.479	0,24
6,425 % fällig am 21.01.2026	8.975	8.918	0,48
		48.542	2,62
Summe Frankreich		53.639	2,89
DEUTSCHLAND			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Deutsche Bank AG			
0,898 % fällig am 28.05.2024 (f)	5.609	5.510	0,30
3,700 % fällig am 30.05.2024	8.200	8.117	0,44
3,961 % fällig am 26.11.2025	7.400	7.280	0,39
Summe Deutschland		20.907	1,13
IRLAND			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
Black Diamond CLO DAC			
4,982 % fällig am 15.05.2032	€ 5.374	5.862	0,32
BNPP AM Euro CLO DAC			
4,565 % fällig am 15.04.2031	2.000	2.176	0,12
Carlyle Euro CLO DAC			
4,665 % fällig am 15.01.2031	19.832	21.694	1,17
Contego CLO DAC			
4,642 % fällig am 23.01.2030	13.454	14.651	0,79
Harvest CLO DAC			
4,566 % fällig am 26.06.2030	6.219	6.796	0,37
Oak Hill European Credit Partners DAC			
4,733 % fällig am 20.10.2031	1.396	1.526	0,08
Palmer Square European Loan Funding DAC			
4,695 % fällig am 15.07.2031	3.789	4.134	0,22
4,745 % fällig am 15.04.2031	5.216	5.681	0,31
Tikehau CLO DAC			
4,844 % fällig am 04.08.2034	15.000	16.378	0,88

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Voya Euro CLO DAC			
4,715 % fällig am 15.10.2030	€ 9.346	\$ 10.228	0,55
		89.126	4,81
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
AerCap Ireland Capital DAC			
1,650 % fällig am 29.10.2024	\$ 11.000	10.622	0,57
4,875 % fällig am 16.01.2024	8.812	8.807	0,48
SMBC Aviation Capital Finance DAC			
3,550 % fällig am 15.04.2024	10.340	10.271	0,55
		29.700	1,60
Summe Irland		118.826	6,41
ISRAEL			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Israel Electric Corp. Ltd.			
5,000 % fällig am 12.11.2024	11.800	11.656	0,63
JAPAN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Aozora Bank Ltd.			
1,050 % fällig am 09.09.2024	26.300	25.451	1,37
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.			
6,801 % fällig am 12.09.2025	11.000	11.036	0,60
7,023 % fällig am 18.07.2025	9.100	9.137	0,49
Mizuho Financial Group, Inc.			
2,839 % fällig am 16.07.2025	10.000	9.851	0,53
Nomura Holdings, Inc.			
1,851 % fällig am 16.07.2025	7.027	6.657	0,36
2,648 % fällig am 16.01.2025	5.300	5.146	0,28
ORIX Corp.			
3,250 % fällig am 04.12.2024	1.600	1.569	0,08
Panasonic Holdings Corp.			
2,679 % fällig am 19.07.2024	1.000	984	0,05
Renesas Electronics Corp.			
1,543 % fällig am 26.11.2024	1.485	1.429	0,08
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.			
5,402 % fällig am 16.10.2024 AUD	9.700	6.633	0,36
6,796 % fällig am 13.01.2026	\$ 9.700	9.777	0,53
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.			
0,850 % fällig am 25.03.2024	1.000	990	0,05
Summe Japan		88.660	4,78
MULTINATIONAL			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Broadcom Corp.			
3,625 % fällig am 15.01.2024	8.226	8.219	0,44
NIEDERLANDE			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
ABN AMRO Bank NV			
6,575 % fällig am 13.10.2026	4.000	4.068	0,22
Enel Finance International NV			
2,650 % fällig am 10.09.2024	11.990	11.713	0,63
4,250 % fällig am 15.06.2025	4.310	4.252	0,23
6,800 % fällig am 14.10.2025	3.600	3.692	0,20
ING Groep NV			
6,442 % fällig am 01.04.2027	5.000	4.934	0,26
7,076 % fällig am 28.03.2026	13.400	13.486	0,73
JDE Peet's NV			
0,800 % fällig am 24.09.2024	9.955	9.578	0,52
LeasePlan Corp. NV			
2,875 % fällig am 24.10.2024	4.575	4.474	0,24
Summe Niederlande		56.197	3,03
NORWEGEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
DNB Bank ASA			
2,968 % fällig am 28.03.2025	2.700	2.683	0,14
SAUDI-ARABIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Saudi Arabian Oil Co.			
1,625 % fällig am 24.11.2025	2.200	2.073	0,11

Aufstellung der Wertpapieranlagen des US Short-Term Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
HUNGARY TREASURY BILLS				INVESTMENTFONDS			
10,900 % fällig am 04.01.2024 (b)(c)	HUF 1.409.000	\$ 4.070	0,22	ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
JAPAN TREASURY BILLS				PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short- Term Floating NAV			
(0,207) % fällig am 05.02.2024 (b)(c)	¥ 2.520.000	17.877	0,96	Fund (e)	6.725	\$ 67	0,00
Summe kurzfristige Instrumente		50.640	2,73	EXCHANGE-TRADED FUNDS			
				PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (e)			
Summe Übertragbare Wertpapiere	\$ 1.683.085	90,76		1.849.322	184.415	9,95	
				Summe Investmentfonds			
					\$ 184.482	9,95	

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Zu erhaltende Pensions- geschäfte, zum Wert	Erlöse aus Pensions- geschäft ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
FICC	2,600 %	29.12.2023	02.01.2024	\$ 4.561	U.S. Treasury Notes 4,875 % fällig am 30.11.2025	\$ (4.652)	\$ 4.561	\$ 4.562	0,25
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (4.652)	\$ 4.561	\$ 4.562	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
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2025	882	\$ (1.654)	(0,08)
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Short	03.2024	708	(1.404)	(0,08)
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2024	46	124	0,01
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Short	03.2024	61	(216)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Ultra March Futures	Short	03.2024	67	(381)	(0,02)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2024	20	(258)	(0,02)
				\$ (3.789)	(0,20)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (3.789)	(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 KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-41 5-Year Index	(1,000) %	20.12.2028	\$ 175.300	\$ (1.273)	(0,07)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate				\$ (1.273)	(0,07)

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	01.2024	AUD 62.049	\$ 41.167	\$ 0	\$ (1.179)	\$ (1.179)	(0,07)
BOA	01.2024	£ 1.604	2.037	0	(8)	(8)	0,00
	02.2024	CAD 1.000	747	0	(12)	(12)	0,00
BPS	01.2024	£ 6.115	7.757	0	(39)	(39)	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
	01.2024	HUF	212.774	\$ 605	\$ 0	\$ (10)	0,00	
	01.2024	\$	1.346	€ 1.210	0	(9)	0,00	
BRC	01.2024		1.003	£ 785	0	(2)	0,00	
CBK	01.2024	HUF	533.026	\$ 1.520	0	(20)	0,00	
	03.2024	\$	55	ILS 199	1	0	0,00	
DUB	02.2024	CAD	2.000	\$ 1.493	0	(24)	0,00	
GLM	01.2024	\$	1.036	£ 813	1	0	0,00	
	01.2024		15	MXN 262	1	0	0,00	
JPM	01.2024	HUF	540.467	\$ 1.541	0	(21)	0,00	
MBC	01.2024		38.716	110	0	(2)	0,00	
	01.2024	\$	2.076	CAD 2.810	54	0	0,00	
MYI	01.2024	€	24	\$ 27	0	0	0,00	
	01.2024	HUF	79.166	225	0	(4)	0,00	
TOR	02.2024	¥	2.520.000	17.030	0	(932)	(0,05)	
UAG	01.2024	€	86.600	95.257	0	(428)	(0,02)	
	01.2024	£	33.226	42.048	0	(310)	(0,02)	
					\$ 57	\$ (3.000)	\$ (2.943)	(0,16)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilklassen 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	
BPS	01.2024	€	1.445	\$ 1.581	\$ 0	\$ (15)	0,00	
	01.2024	\$	1.683	€ 1.529	7	(1)	0,00	
CBK	01.2024		3.023	2.758	25	0	0,00	
MBC	01.2024	€	846	\$ 925	0	(10)	0,00	
	01.2024	\$	34.126	€ 31.039	169	0	0,01	
MYI	01.2024		34.007	30.940	179	0	0,01	
SCX	01.2024	€	8.556	\$ 9.231	0	(223)	(0,01)	
UAG	01.2024	\$	34.033	€ 30.940	153	0	0,01	
					\$ 533	\$ (249)	\$ 284	0,02

Zum 31. Dezember 2023 standen für die Anteilklasse 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	01.2024	\$	86	£ 68	\$ 1	\$ 0	0,00	
BRC	01.2024		1	1	(1)	0	0,00	
SCX	01.2024		87	69	1	0	0,00	
SSB	01.2024		87	69	1	0	0,00	
					\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,00

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (2.657) (0,14)

Summe Anlagen

\$ 1.864.409 100,55

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (10.203) (0,55)

Nettovermögen

\$ 1.854.206 100,00

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

(a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.

(b) Nullkuponwertpapier.

(c) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(d) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(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 %	28.05.2024	31.03.2022 - 31.05.2023	\$ 5.506	\$ 5.510	0,30

(g) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 43.306 (31. Dezember 2022: USD null) waren zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte verpfändet oder geliefert.

Barmittel in Höhe von USD 9.098 (31. Dezember 2022: USD 16.350) waren zum 31. Dezember 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Aufstellung der Wertpapieranlagen des US Short-Term Fund (Forts.)

Barmittel in Höhe von USD 3.460 (31. Dezember 2022: USD 1.780) waren zum 31. Dezember 2023 als Sicherheiten für Finanzderivate gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 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	\$ 1.682.857	\$ 228	\$ 1.683.085
Investmentfonds	67	184.415	0	184.482
Pensionsgeschäfte	0	4.561	0	4.561
Finanzderivate ⁽³⁾	0	(7.719)	0	(7.719)
Summen	\$ 67	\$ 1.864.114	\$ 228	\$ 1.864.409

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.891.711	\$ 0	\$ 1.891.711
Investmentfonds	62	225.956	0	226.018
Pensionsgeschäfte	0	154.472	0	154.472
Finanzderivate ⁽³⁾	0	4.760	0	4.760
Summen	\$ 62	\$ 2.276.899	\$ 0	\$ 2.276.961

⁽¹⁾ Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

⁽²⁾ Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

⁽³⁾ Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Zahlbar für Rückkauf- Finanzierungs- geschäfte ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
BPG	5,600 %	19.12.2023	02.01.2024	\$ (32.265)	\$ (32.279)	(1,74)
MSC	5,550	19.12.2023	02.01.2024	(11.609)	(11.615)	(0,63)
Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte					\$ (43.894)	(2,37)

⁽¹⁾ In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag sind USD 7 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 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
AZD	\$ (1.179)	\$ 1.230	\$ 51	\$ 1.566	\$ (1.460)	\$ 106
BOA	(20)	0	(20)	(2.159)	1.770	(389)
BPS	(66)	0	(66)	131	0	131
BRC	(3)	0	(3)	(17)	0	(17)
CBK	6	0	6	1.487	(1.350)	137
DUB	(24)	0	(24)	(4)	0	(4)
GLM	2	0	2	k. A.	k. A.	k. A.
JPM	(21)	0	(21)	350	(290)	60
MBC	211	(390)	(179)	(153)	0	(153)
MYI	175	(370)	(195)	(2)	10	8
SCX	(222)	280	58	2.590	(2.250)	340
SSB	1	0	1	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	(932)	870	(62)	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	(585)	1.080	495	(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. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	48,81	43,64
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	41,02	38,19
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,93	0,05
Investmentfonds	9,95	9,78
Pensionsgeschäfte	0,25	6,69
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,20)	0,04
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,07)	0,01
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,14)	0,16
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(2,37)	k. A.

* Gemäß der Liste der Märkte, die die Kriterien für einen geregelten OGAW-Markt erfüllen, in Anlage 1 zum Verkaufsprospekt.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Australien	1,05	1,66
Belgien	k. A.	0,39
Bermuda	k. A.	0,39
Kanada	0,04	k. A.
Cayman-Inseln	6,85	3,83
Dänemark	0,58	0,66
Finnland	0,15	0,38
Frankreich	2,89	2,56
Deutschland	1,13	1,17
Irland	6,41	5,43
Israel	0,63	0,35
Italien	k. A.	0,22
Japan	4,78	5,03
Luxemburg	k. A.	0,10
Multinational	0,44	k. A.
Niederlande	3,03	3,03
Norwegen	0,14	0,04
Saudi-Arabien	0,11	0,11
Singapur	0,18	0,07
Südkorea	0,92	0,84
Spanien	0,80	0,42
Supranational	0,50	1,10
Schweden	0,46	k. A.
Schweiz	1,35	1,42
Vereinigte Arabische Emirate	0,04	0,08
Großbritannien	8,94	8,42
USA	46,61	42,70
Kurzfristige Instrumente	2,73	1,48
Investmentfonds	9,95	9,78
Pensionsgeschäfte	0,25	6,69
Financial Derivative Instruments Dealt in on a Regulated Market		
Futures	(0,20)	0,04
Centrally Cleared Financial Derivative Instruments		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,07)	0,01
Zinsswaps — Basiswaps	k. A.	0,00
OTC Financial Derivative Instruments		
Devisenterminkontrakte	(0,16)	(0,11)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,02	0,27
Sonstige Aktiva und Passiva	(0,55)	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

Es folgt eine Zusammenfassung der wichtigen Bilanzierungs- und Bewertungsmethoden und der Schätzungstechniken, die von der Gesellschaft angewandt und beim Aufstellen dieses Abschlusses verwendet werden:

(a) Erstellunggrundlage

Der Abschluss wird gemäß dem vom Financial Reporting Council herausgegebenen Financial Reporting Standard 102 („FRS 102“), „The Financial Reporting Standard applicable in the United Kingdom and Republic of Ireland“, dem Companies Act von 2014 und den OGAW-Richtlinien erstellt. Die Abschlüsse werden für alle Fonds nach dem Grundsatz der Unternehmensfortführung erstellt.

Die in der Aufstellung der ausgewiesenen Gesamtgewinne und -verluste sowie in einer Überleitung der Eigenkapitalveränderungen aufzuführenden Angaben sind nach Meinung des Verwaltungsrats in der Betriebsergebnisrechnung sowie im Ausweis der Nettovermögensänderungen enthalten.

Die Gesellschaft hat von der für offene Investmentfonds, die einen erheblichen Anteil ihres Vermögens in äußerst liquiden und zum Marktwert bewerteten Anlagen halten, verfügbaren Ausnahmeregelung gemäß Section 7 von FRS 102 Gebrauch gemacht und legt daher keine Kapitalflussrechnung vor.

Der Abschluss wird nach dem Anschaffungskostenprinzip unter Zugrundelegung der Neubewertung der ergebniswirksam zum Marktwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten aufgestellt.

Die Gesellschaft führt für jeden Fonds gesonderte Konten. Anteile werden von der Gesellschaft ausgegeben und dem Fonds zugewiesen, den der Anteilinhaber auswählt. Der Erlös aus der Ausgabe und der daraus entstehende Ertrag werden jeder Fondsklasse im Verhältnis zu der gesamten Bewertung jeder Klasse gutgeschrieben. Bei der Rücknahme haben Anteilinhaber nur Anspruch auf ihren

Teil des am Fonds gehaltenen Nettovermögens, für den Anteile an sie ausgegeben wurden.

Die Gesellschaft verwendet den US-Dollar als Präsentationswährung. Die Abschlüsse der einzelnen Fonds werden in der jeweiligen Funktionswährung erstellt. Die Gesellschaftssummen der Fonds, die durch das irische Gesellschaftsrecht vorgeschrieben werden, lauten auf US-Dollar, da diese Währung das vorherrschende wirtschaftliche Umfeld der Gesellschaft darstellt. Falls nicht anders angegeben, sind alle Beträge in US-Dollar ausgewiesen. Die Abschlüsse der einzelnen Fonds werden in US-Dollar umgerechnet und zur Erstellung des Abschlusses der Gesellschaft zusammengefasst.

Der Finanzstatus der Gesellschaft wird mithilfe von Wechselkursen zum Ende des Geschäftsjahres umgerechnet und der Finanzstatus und der Ausweis der Veränderungen im Nettovermögen der Gesellschaft werden zum durchschnittlichen Wechselkurs (als Annäherung an die tatsächlichen Kurse) des Geschäftsjahres umgerechnet, um diese in den Abschluss der Gesellschaft einzubeziehen.

Der Währungsgewinn oder -verlust aus der Umrechnung des Nettovermögens der Gesellschaft zu Beginn des Geschäftsjahres und die durchschnittliche Wechselkursdifferenz aus der Umrechnung der Betriebsergebnisrechnung und des Ausweises der Nettovermögensänderungen der Gesellschaft sind im Ausweis der Nettovermögensänderungen der Gesellschaft ausgewiesen. Diese Umrechnungsanpassung hat keinen Einfluss auf das den einzelnen Fonds zugeordnete Nettovermögen.

Alle Beträge wurden, sofern nicht anders angegeben, auf die nächsten Tausend gerundet. Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. In der Aufstellung der Wertpapieranlagen bestimmter Fonds finden sich gegebenenfalls übertragbare Wertpapiere, die sowohl einen Nennwert als auch einen Marktwert von null aufweisen, wenn der tatsächliche Nennwert und Marktwert auf das nächste Tausend gerundet werden.

(b) Ermittlung des Nettoinventarwerts

Der Nettoinventarwert (der „NIW“) jedes Fonds und/oder jeder Anteilsklasse wird, wie im aktuell gültigen Verkaufsprospekt der Gesellschaft bzw. in der jeweiligen Ergänzung offengelegt, mit dem Schluss des regulären Handels an jedem Handelstag berechnet.

Die Gesellschaft hat beschlossen, die auf den Ansatz und die Bewertung bezogenen Bestimmungen von International Accounting Standard („IAS“) 39 Finanzinstrumente: Ansatz und Bewertung sowie die Angabe- und Darstellungspflichten gemäß FRS 102 für die Bilanzierung ihrer Finanzinstrumente anzuwenden. Gemäß IAS 39 wurden Wertpapiere der Teilfonds sowie andere Vermögenswerte zum Mittel- oder Schlusskurs am 31. Dezember 2023 bewertet, um das Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber (das „Nettovermögen“) zu bestimmen.

(c) Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge

Wertpapiertransaktionen werden zum Handelstag zum Zwecke der Finanzberichterstattung ausgewiesen. Wertpapiere, die auf der Basis des Emissionstermins oder der verzögerten Lieferung gekauft oder verkauft werden, können im Anschluss an einen standardmäßigen Abrechnungszeitraum für das Wertpapier nach dem Handelstag abgerechnet werden. Realisierte Gewinne und Verluste aus Wertpapierverkäufen werden auf der Basis der festgestellten Kosten erfasst. Dividendeneinkünfte werden zum Ex-Dividende-Datum erfasst; ausgenommen hiervon sind bestimmte Dividenden von ausländischen Wertpapieren, bei denen das Ex-Dividende-Datum möglicherweise bereits verstrichen ist. Diese werden erfasst, sobald der Fonds Informationen über das Ex-Dividende-Datum erhält. Um Disagios und Prämienabschreibungen bereinigte Zinseinkünfte werden auf Rechnungsabgrenzungsbasis erfasst und mithilfe von Effektivzinsmethoden berechnet. Davon ausgenommen sind Wertpapiere mit einem in der Zukunft liegenden Effektivdatum: Hier werden die Zinseinkünfte ab dem Effektivdatum auf Rechnungsabgrenzungsbasis erfasst. Für wandelbare Wertpapiere werden Aufschläge, die dem Wandlungsrecht zuzuordnen sind, nicht abgeschrieben. Gegebenenfalls anfallende Rückzahlungsgewinne (-verluste) auf hypothekenähnliche und sonstige forderungsbesicherte Wertpapiere werden in der Betriebsergebnisrechnung als Bestandteile des Zinsertrags ausgewiesen.

Wenn die Eintreibung der Zinsen bzw. eines Teils der Zinsen auf der Basis konsequent angewandter Verfahren zweifelhaft geworden ist, können Schuldtitel so behandelt werden, als würden keine weiteren Zinsen darauf auflaufen. Zudem kann der hiermit verbundene Zinsertrag reduziert werden, indem die Schuldtitel zinslos gestellt und entsprechende Zinsforderungen abgeschrieben werden. Die Zinslosstellung eines Schuldtitels wird aufgehoben, wenn der Emittent seine Zinszahlungen wieder aufnimmt oder die Eintreibbarkeit der Zinsen als wahrscheinlich erachtet wird.

Erträge werden vor Abzug nicht erstattungsfähiger Quellensteuern sowie nach Abzug von Steuergutschriften ausgewiesen. Quellensteuern werden in der Betriebsergebnisrechnung separat ausgewiesen. Die Fonds können Steuern unterliegen, die von bestimmten Ländern auf Kapitalgewinne aus dem Verkauf von Anlagen erhoben werden. Kapitalertragsteuern werden nach dem Prinzip der Periodenabgrenzung verbucht und in der Betriebsergebnisrechnung separat ausgewiesen.

(d) Mehrfach-Klassen-Zuordnungen und abgesicherte Anteilsklassen

Wenn nicht anders angegeben, verfügen sämtliche von der Gesellschaft angebotene Klassen in Bezug auf Vermögenswerte und Stimmprivilegien über gleiche Rechte (außer bei Anteilhabern einer Klasse, die über ausschließliche Stimmrechte in Bezug auf Angelegenheiten verfügen, die ausschließlich diese Klasse betreffen). Innerhalb jeder Klasse eines jeden Fonds darf die Gesellschaft entweder teilweise oder nur ausschüttende Anteile (Einkommen ausschüttende Anteile), thesaurierende Anteile (Einkommen thesaurierende Anteile) und Income II-Anteile (Anteile, die eine erhöhte Rendite ausschütten sollen) ausgeben. Aufgrund der Mehrklassen-Struktur kann der Anteilinhaber die Methode für den Anteilserwerb wählen, die ihm unter Berücksichtigung der zu erwerbenden Menge, des Zeitraums, für den der Anteilinhaber die Anteile halten möchte, sowie der sonstigen Umstände am vorteilhaftesten erscheint. Sind Anteile abweichender Klassen oder Emissionen im Umlauf, kann der NIW je Anteil zwischen den Klassen abweichen, um die Tatsache wiederzugeben, dass das Einkommen thesauriert oder ausgeschüttet wurde, oder für sie können unterschiedliche Gebühren und Aufwendungen anfallen. Realisierte und nicht realisierte Kapitalerträge und -verluste der einzelnen Fonds werden jeder Anteilsklasse täglich auf der Basis des relativen Nettovermögens der einzelnen Klassen des betreffenden Fonds zugewiesen.

Bei den abgesicherten Klassen (die „abgesicherten Klassen“) möchte die Gesellschaft gemäß den Bestimmungen und Auslegungen, die die Zentralbank jeweils bekannt gibt, diese gegen Schwankungen der Währungen, auf die die abgesicherten Klassen lauten, gegenüber anderen Währungen absichern. Die abgesicherten Klassen unterliegen durch diese Transaktionen keiner Hebelung. Obwohl sich die Gesellschaft bemüht, das Währungsrisiko abzusichern, besteht keine Garantie, dass sie damit Erfolg haben wird. Absicherungsstrategien sind eindeutig einer bestimmten Klasse zuzuordnen. Alle Kosten und Gewinne/(Verluste) dieser Absicherungsstrategien können den Nutzen für Anteilinhaber der betreffenden abgesicherten Anteilsklasse beträchtlich einschränken, wenn die Klassenwährung gegenüber der Funktionswährung und/oder der Währung fällt, auf die einige oder alle Vermögenswerte des betreffenden Fonds lauten und die gegenüber anderen Währungen abgesichert sind.

(e) Devisentransaktionen

Die Abschlüsse der einzelnen Fonds werden unter Zuhilfenahme der primären Wirtschaftsumgebung, in der sie ihre Geschäftstätigkeit ausüben, vorgelegt (die „Funktionswährung“). Die Funktions- und Präsentationswährungen der Fonds der Gesellschaft sind identisch.

Die Gesellschaftssummen der Fonds, die durch das irische Gesellschaftsrecht vorgeschrieben werden, lauten auf US-Dollar, da diese Währung das vorherrschende wirtschaftliche Umfeld der Gesellschaft darstellt.

Die Marktwerte der ausländischen Wertpapiere, Währungspositionen und sonstigen Aktiva und Passiva werden auf Basis der am jeweiligen Tag geltenden Umtauschkurse in die Funktionswährung des jeweiligen Fonds umgerechnet. Schwankungen im Wert der Währungsbeteiligungen und sonstigen Aktiva und Passiva aus Veränderungen der Wechselkurse werden als nicht realisierte Gewinne oder Verluste aus Fremdwährungen erfasst.

Die nicht realisierten Gewinne oder Verluste aus der Umrechnung von Wertpapieren, die auf Fremdwährungen lauten, sind in der Nettoänderung der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten erfasst, und die nicht realisierten Gewinne oder Verluste aus der Umrechnung von Finanzderivaten, die auf Fremdwährungen lauten, sind in der Nettoänderung der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten in der Betriebsergebnisrechnung enthalten.

Währungsgewinne und -verluste aus dem Verkauf von Wertpapieren, die auf Fremdwährungen lauten, sind im realisierten Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten erfasst, und die Währungsgewinne und -verluste aus dem Verkauf von Derivaten, die auf Fremdwährungen lauten, sind im realisierten Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten in der Betriebsergebnisrechnung enthalten.

Realisierte Gewinne und Verluste zwischen den Transaktions- und Abwicklungsdaten aus dem Erwerb und Verkauf von auf Fremdwährung

lautenden Wertpapieren und Finanzderivaten sind im realisierten Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen in der Betriebsergebnisrechnung enthalten.

Bestimmte Fonds verfügen über eine abgesicherte Klasse, die Devisenterminkontrakte eingeht, die dazu bestimmt sind, den Absicherungseffekt auf Fondsebene glattzustellen, damit sich die Funktionswährung weiter an anderen Währungen als der Funktionswährung beteiligen kann.

(f) Transaktionskosten

Transaktionskosten sind Kosten, die entstehen, um ergebniswirksam zum Marktwert bewertete Finanzvermögen und -verbindlichkeiten zu erwerben. Zu ihnen zählen an Mittler, Berater, Makler und Händler gezahlte Gebühren und Provisionen. Transaktionskosten werden in der Betriebsergebnisrechnung unter dem realisierten Nettogewinn/(-verlust) und der Nettoänderung der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten und dem realisierten Nettogewinn/(-verlust) und der Nettoänderung der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten erfasst. Bei Rentenwerten und bestimmten Derivaten können Transaktionskosten nicht aus dem Kaufpreis des Wertpapiers herausgezogen werden, weshalb sie nicht separat ausgewiesen werden können.

(g) Einkommensausgleich

Bei dem von der Gesellschaft angewandten Rechnungslegungsstandard handelt es sich um den sog. Einkommensausgleich. Die Einkommensausgleichsanpassung stellt sicher, dass an die in die Anteilsklassen ausschüttend und ausschüttend II anlegenden Anteilinhaber ausgeschüttetes Einkommen prozentual dem Besitzzeitraum im Ausschüttungszeitraum entspricht. Ein Betrag, der dem Teil des Kurses pro Anteil entspricht, der den etwaigen, bis zum Datum der Ausgabe der Anteile aufgelaufenen, jedoch nicht ausgeschütteten Ertrag wiedergibt, wird als Ausgleichszahlung angesehen und als an den jeweiligen Anteilinhaber zurückbezahlt behandelt, entweder bei (i) Rücknahme dieser Anteile vor der Zahlung der ersten Dividende auf dieselben oder (ii) Zahlung der ersten Dividende, zu der der Anteilinhaber im selben Berichtszeitraum, in dem die Anteile ausgegeben wurden, berechtigt war. Die Zahlung von Dividenden nach der Zahlung der ersten Dividende darauf oder die Rücknahme dieser Anteile nach Zahlung der ersten Dividende wird so ausgelegt, dass darin ein etwaiger, bis zum Datum der jeweiligen Rücknahme oder Erklärung der Dividende aufgelaufener, jedoch unbezahlter Nettoertrag enthalten ist.

(h) Kritische Schätzungen und Annahmen in der Rechnungslegung

Die Erstellung des Abschlusses gemäß FRS 102 verlangt vom Verwaltungsrat Beurteilungen, Schätzungen und Annahmen, die sich auf die Anwendung von Bilanzierungs- und Bewertungsmethoden sowie auf die ausgewiesene Höhe von Vermögenswerten, Verbindlichkeiten, Erträgen und Aufwendungen auswirken. Die tatsächlichen Ergebnisse können von diesen Schätzungen abweichen. Schätzungen und zugrunde liegende Annahmen werden laufend überprüft. Änderungen an bilanziellen Schätzungen werden in dem Berichtszeitraum ausgewiesen, in dem die Schätzungen korrigiert werden, sowie in allen davon betroffenen zukünftigen Zeiträumen.

(i) Swing Pricing

Swing Pricing kann als wirksamer Mechanismus eingesetzt werden, um die Anteilinhaber vor den Auswirkungen einer Verwässerung zu schützen, die infolge höherer transaktionsbezogener Kosten im Zusammenhang mit erheblichen Nettozuflüssen oder -abflüssen auftreten kann. Gemäß der Satzung werden die zugrunde liegenden Wertpapiere eines Fonds, die an einem geregelten Markt notiert sind oder gehandelt werden, in der Regel zum Mittelkurs oder zum letzten gehandelten Kurs bei Geschäftsschluss bewertet und bepreist, aber diese Wertpapiere werden unter Verwendung von Geld- und Briefkursen gehandelt. Je größer die Spanne zwischen diesen Geld- und Briefkursen ist, desto größer sind die Auswirkungen auf die Bewertung eines Fonds.

Das Swing Pricing wird umgesetzt, indem der Nettoinventarwert je Anteil um einen Swing-Faktor nach oben oder unten verschoben wird, je nach der Richtung der Netto-Cashflows eines bestimmten Fonds. Der Swing-Faktor ist der vom Verwaltungsrat festgelegte Betrag, um den der Nettoinventarwert je Anteil nach oben oder unten angepasst werden kann, um Handels- und Transaktionskosten (wie steuerliche und andere Kosten und Gebühren) zu berücksichtigen, die beim tatsächlichen Erwerb oder der Veräußerung von Vermögenswerten des betreffenden Fonds anfallen würden. Unter normalen Marktbedingungen beträgt der Swing-Faktor nicht mehr als 2 % des ursprünglichen Nettoinventarwerts je Anteil eines Fonds. Unter außergewöhnlichen Marktbedingungen kann dieser Höchstwert jedoch auf bis zu 5 % erhöht werden, um die Interessen der Anteilinhaber zu schützen. Dieser angepasste NIW wird dann auf alle Zeichnungen oder Rücknahmen angewendet, die an dem betreffenden Handelstag eingehen. Erhebliche Nettozuflüsse führen zu einem Anstieg des NIW je Anteil, erhebliche Nettoabflüsse zu einem Rückgang.

Swing Pricing wird von der Gesellschaft angewandt, wenn die Netto-Cashflows einen vom Verwaltungsrat festgelegten Schwellenwert überschreiten, bei dessen Überschreitung der Verwaltungsrat der Ansicht ist, dass sich die durch die Transaktionskosten verursachte Verwässerung wesentlich auf einen Fonds auswirken könnte.

Swing Pricing wird auf Fondsebene und nicht auf Klassenebene implementiert, da die transaktionsbezogenen Kosten auf Fondsebene anfallen.

Zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 wurde Swing Pricing auf den Income Fund II angewandt.

Der NIW je Anteil ist in Erläuterung 19 angegeben und kann eine Swing-Pricing-Anpassung enthalten. Swing-Pricing-Anpassungen werden im Finanzstatus, der Aufwands- und Ertragsrechnung sowie den Veränderungen des Nettovermögens erfasst.

3. ANLAGEN ZUM MARKTWERT UND MARKTBEWERTUNGSHIERARCHIE

Zu dieser Kategorie gehören zwei Unterkategorien: gemäß Bestimmung der Verwaltung bei Auflegung als ergebniswirksam zum Marktwert zu bewertende Finanzvermögen und -verbindlichkeiten und zu Handelszwecken gehaltene Finanzvermögen und -verbindlichkeiten. Bei Auflegung ergebniswirksam zum Marktwert ausgewiesene Finanzvermögen und -verbindlichkeiten sind Finanzinstrumente, die nicht als zu Handelszwecken gehalten eingestuft werden, sondern sie werden verwaltet und ihre Wertentwicklung wird auf Basis des Marktwerts in Übereinstimmung mit der dokumentierten Anlagestrategie des Fonds bewertet. Zu Handelszwecken gehaltene finanzielle Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten werden hauptsächlich zum Zweck des kurzfristigen Verkaufs oder Rückkaufs erworben oder eingegangen. Derivate fallen in die Kategorie der zu Handelszwecken gehaltenen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten.

(a) Grundsätze für die Bewertung von Anlagen

Die Fondspolitik erfordert, dass die Anlageberatungsgesellschaften („PIMCO“) und der Verwaltungsrat die Informationen über diese Finanzvermögen und -verbindlichkeiten auf Basis des Marktwerts gemeinsam mit anderen verbundenen Finanzinformationen bewerten.

Gewinne und Verluste aus Änderungen im Marktwert der Kategorie „ergebniswirksam zum Marktwert bewertete Finanzvermögen“ werden in die Betriebsergebnisrechnung in das Geschäftsjahr einbezogen, in dem sie anfallen.

Die Wertpapiere des Fonds und anderen Vermögenswerte, für die Marktkurse jederzeit zur Verfügung stehen, werden zum Marktwert bewertet. Der Marktwert wird im Allgemeinen auf der Grundlage der offiziellen Schlusskurse oder der letzten gemeldeten Verkaufspreise ermittelt, oder – falls keine Verkäufe gemeldet werden – auf der Grundlage von Kursen, die von etablierten Marktmakern bereitgestellt werden, oder von Preisen (einschließlich bewerteter Preise), die von den zugelassenen Kursbestimmungsdiensten des Fonds, Kursmeldesystemen und anderen Drittquellen (zusammen „Kursbestimmungsdienste“) bereitgestellt werden.

Anlagen, die zunächst in anderen Währungen als der Funktionswährung des Fonds bewertet wurden, werden mithilfe der Wechselkurse von Kursbestimmungsdiensten umgerechnet. Im Ergebnis kann der NIW der Fondsanteile von Änderungen des Werts der Währungen gegenüber der Fondsfunktionswährung beeinflusst werden. Der Wert von an ausländischen Märkten gehandelten oder auf andere als die Fondsfunktionswährung lautenden Wertpapieren kann an dem Tag deutlich beeinflusst werden, an dem die jeweilige Börse geschlossen ist, und der NIW kann sich an den Tagen ändern, an denen Anleger keine Anteile erwerben, zurückgeben oder tauschen können.

Hat sich der Wert eines Wertpapiers, das ausschließlich an einer ausländischen Börse gehandelt wird, nach dem Schluss der Primärbörse oder des Primärmarkts des Wertpapiers, jedoch vor dem Schluss des Handelstags wesentlich geändert, wird das Wertpapier zum Marktwert auf Grundlage von Verfahren bewertet, die der Verwaltungsrat eingeführt und zugelassen hat. Wertpapiere, die nicht gehandelt werden, wenn ein Fonds geöffnet ist, werden ebenfalls zum Marktwert bewertet. Ein Fonds kann den Marktwert von Anlagen auf Grundlage von Informationen bestimmen, die Kursbestimmungsdienste und andere Drittanbieter liefern, die Kurse zum Marktwert oder Anpassungen durch Bezug auf andere Wertpapiere, Indizes oder Vermögenswerte empfehlen können. Wenn ein Fonds erwägt, ob Marktbewertung erforderlich ist und bei der Bestimmung der Marktwerte, kann er, unter anderem, wesentliche Ereignisse berücksichtigen (bei denen anzunehmen ist, dass sie Änderungen im Wert von Wertpapieren oder Wertpapierindizes enthalten), die nach dem Schluss des betreffenden Markts und vor dem Schluss des Handelstages eintreten. Ein Fonds darf Berechnungswerkzeuge nutzen, die Drittanbieter liefern, um den Marktwert von Wertpapieren zu bestimmen, die von wesentlichen Ereignissen beeinträchtigt wurden. Ausländische Börsen erlauben eventuell den Handel mit ausländischen Wertpapieren an Tagen, an denen die Gesellschaft nicht für das Geschäft geöffnet ist, was dazu führen kann, dass das Anlageportfolio eines Fonds

betroffen ist, wenn der Fonds nicht in der Lage ist, Anteile zu kaufen oder zu verkaufen. Die Fonds haben Kursbestimmungsdienste damit beauftragt, den Marktwert ausländischer Wertpapiere zu bestimmen. Dieser Dienst setzt statistische Daten und Programme ein, die auf der vergangenen Wertentwicklung von Märkten und anderen Wirtschaftsdaten beruhen, um ihn bei der Schätzung des Marktwerts zu unterstützen. Schätzungen von Marktwerten, die ein Fonds für ausländische Wertpapiere nutzt, können vom Wert abweichen, der tatsächlich beim Verkauf dieser Wertpapiere erzielt wird, und die Differenz kann sich wesentlich auf den Abschluss auswirken. Bestimmungen des Marktwerts können subjektive Festsetzungen des Werts eines Wertpapiers oder eines Vermögenswerts erfordern, und der Marktwert, um den NIW eines Fonds zu bestimmen, kann von den notierten oder veröffentlichten Kursen oder den Kursen abweichen, die andere für die gleichen Anlagen verwenden. Darüber hinaus führt der Einsatz von Bestimmungen des Verkehrswerts eventuell nicht immer zu Kursanpassungen der Wertpapiere oder anderen Vermögenswerte, die ein Fonds hält.

(b) Marktbewertungshierarchie

Die Gesellschaft muss Angaben bezüglich der Marktbewertungshierarchie machen, in die die Bewertungen zum Marktwert für Vermögenswerte und Verbindlichkeiten eingestuft werden. Die Angaben beruhen auf einer dreistufigen Marktbewertungshierarchie für die in Bewertungsverfahren zur Bemessung des Marktwerts verwendeten Inputfaktoren.

Der Marktwert 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 und Verfahren zur Bewertung von Wertpapieren geben nicht unbedingt das Risiko wieder, das 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.

(c) Bewertungstechniken und die Marktbewertungshierarchie

Die Bewertungsmethoden (bzw. „Bewertungstechniken“) und bedeutenden Parameter, die zur Bestimmung des Marktwerts von Vermögenswerten von Finanzinstrumenten, die in die Stufe 1 und Stufe 2 der Marktbewertungshierarchie eingestuft wurden, herangezogen werden, sind wie folgt:

Festverzinsliche Wertpapiere, einschließlich Unternehmens-, Wandel- und Kommunalanleihen, Emissionen von US-Behörden, US-Treasury-Obligationen, Staatsanleihen, Bankdarlehen, wandelbare Vorzugsaktien, Nicht-US-Anleihen und kurzfristige Schuldtitel (wie Commercial Paper, Termineinlagen und Einlagezertifikate) werden normalerweise auf der Grundlage von Kursen von Brokern und Händlern oder anhand von Kursbestimmungsdiensten bewertet, die Wertpapierhändler-Kursen, berichtete Geschäftsabschlüsse oder Bewertungsschätzungen auf Basis ihrer internen Preismodelle verwenden. Die internen Modelle der Kursbestimmungsdienste nutzen beobachtbare Parameter wie Angaben zum Emittenten, Zinssätze, Renditekurven, Geschwindigkeiten der vorzeitigen Tilgung, Bonitätsrisiken/Bonitäts spreads, Ausfallquoten und notierte Preise für vergleichbare Vermögenswerte. Wertpapiere, die ähnliche Bewertungstechniken und Inputfaktoren wie zuvor beschrieben nutzen, werden in Stufe 2 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet.

Rentenwerte, die auf Basis verzögerter Lieferung oder im Rahmen einer Rückkaufverpflichtung aus Rückkaufgeschäften oder umgekehrten Pensionsgeschäften erworben werden, werden täglich bis zur Abrechnung am Terminabrechnungsdatum bewertet und in Stufe 2 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet.

Durch Hypotheken und Forderungen besicherte Wertpapiere werden bei jedem Handel gewöhnlich als einzelne Tranchen oder Klassen von Wertpapieren herausgegeben. Diese Wertpapiere werden ebenfalls normalerweise von Kursbestimmungsdiensten bewertet, die Wertpapierhändler-Kursen oder Bewertungsschätzungen auf Basis ihrer internen Preismodelle verwenden.

Die Kursbestimmungsmodelle für diese Wertpapiere berücksichtigen gewöhnlich Eigenschaften der Tranchenstufe, aktuelle Marktdaten, geschätzte Kapitalflüsse und marktbasiertere Renditespreads für jede Tranche und Börsennebengeschäfte (je nach Verfügbarkeit). Durch Hypotheken und Forderungen besicherte Wertpapiere, die ähnliche Bewertungstechniken und Inputfaktoren wie zuvor beschrieben nutzen, werden in Stufe 2 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet.

Stammaktien, ETFs, börsengehandelte Schuldverschreibungen und derivative Finanzinstrumente, wie Terminkontrakte, Rechte und Optionsscheine oder Optionen auf Futures, die an einer nationalen Wertpapierbörse gehandelt werden, werden zum letztberichteten Verkaufs- oder Abrechnungskurs am Bewertungstag angegeben. Wenn diese Wertpapiere aktiv gehandelt werden und keine Bewertungsanpassungen vorgenommen werden, werden sie in Stufe 1 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet.

Bewertungsanpassungen können für bestimmte Wertpapiere durchgeführt werden, die ausschließlich an einer ausländischen Börse gehandelt werden, um die Marktbewertungen zwischen dem Schluss des ausländischen Markts und dem Schluss der New York Stock Exchange („NYSE“) zu berücksichtigen. Diese Wertpapiere werden mithilfe von Kursbestimmungsdiensten bewertet, die den Zusammenhang von Handelsmustern des ausländischen Wertpapiers mit dem Intraday-Handel am US-Anlagemarkt berücksichtigen. Wertpapiere, die diese Bewertungsanpassungen nutzen, werden in Stufe 2 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet. Vorzugswertpapiere und andere Aktien, die an inaktiven Märkten gehandelt oder durch Bezug auf ähnliche Instrumente bewertet werden, werden ebenfalls in Stufe 2 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet.

Bei bestimmten börsengehandelten Futures und Optionen können Bewertungsanpassungen vorgenommen werden, um Marktbewertungen zwischen der Börsenabrechnung und dem Schluss der NYSE zu berücksichtigen. Diese Wertpapiere werden anhand von Kursen bewertet, die von einem Kursmeldesystem, etablierten Market Makern oder Kursbestimmungsdiensten bereitgestellt werden. Finanzderivate, bei denen solche Bewertungsanpassungen vorgenommen werden, werden in Stufe 2 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet.

Anlagen in eingetragenen offenen Investmentgesellschaften (außer ETFs) werden auf Grundlage des NIW dieser Anlagen bewertet, und sie werden in Stufe 1 der Bewertungshierarchie eingeordnet. Anlagen in nicht eingetragenen offenen Anlagegesellschaften werden auf Grundlage der NIWs dieser Anlagen bewertet und werden als Stufe 1 betrachtet, vorausgesetzt die NIWs sind beobachtbar, werden täglich berechnet und entsprechen dem Wert, zu dem sowohl Käufe als auch Verkäufe erfolgen.

Freiverkehrsfinaanzderivate, wie zum Beispiel Devisenkontrakte, Optionskontrakte oder Swaps beziehen ihren Wert aus den Kursen der zugrunde liegenden Vermögenswerte, Indizes, Referenzsätze und anderen Inputfaktoren oder einer Kombination dieser Faktoren. Diese Kontrakte werden in aller Regel auf der Basis von Wertpapierhändler-Kursen oder Kursbestimmungsdiensten bewertet. Abhängig vom Produkt und den Transaktionsbedingungen kann der Wert eines Derivatkontrakts von Kursbestimmungsdiensten mithilfe einer Reihe von Inputfaktoren aus aktiv handelnden Märkten bestimmt werden, darunter beispielsweise Emittenteninformationen, Indizes, Spreads, Zinssätze, Kurven, Dividenden und Wechselkurse. Derivate, die ähnliche Bewertungstechniken und Inputfaktoren wie zuvor beschrieben nutzen, werden in Stufe 2 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet.

Börsengehandelte Aktienoptionen und außerbörslich gehandelte derivative Finanzinstrumente wie Devisenterminkontrakte und Optionskontrakte leiten ihren Wert von den Preisen der zugrunde liegenden Vermögenswerte, Indizes, Referenzsätzen und anderen Inputfaktoren oder einer Kombination dieser Faktoren ab. Diese Kontrakte werden in der Regel auf der Grundlage von Kursen bewertet, die von einem Kursmeldesystem, etablierten Marketmakern oder Kursbestimmungsdiensten stammen (normalerweise zum Handelsschluss der NYSE ermittelt). Abhängig vom Produkt und den Bedingungen der Transaktion können derivative Finanzinstrumente von Kursbestimmungsdiensten anhand einer Reihe von Techniken bewertet werden, einschließlich Simulationspreismodellen. Die Preismodelle verwenden Inputfaktoren, die an aktiv notierten Märkten beobachtet werden, wie zum Beispiel notierte Kurse, Emittentendaten, Indizes, Geld-/Briefspannen, Zinssätze, implizite Volatilitäten, Renditekurven, Dividenden und Wechselkurse. Finanzderivate, die ähnliche Bewertungstechniken und Inputfaktoren wie zuvor beschrieben nutzen, werden in Stufe 2 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet.

Zentral geclearte Swaps und OTC-Swaps leiten ihren Wert von den Preisen der zugrunde liegenden Vermögenswerte, Indizes, Referenzsätzen und anderen Faktoren oder einer Kombination dieser Faktoren ab. Die Bewertung erfolgt auf der Grundlage von Geldkursen von Wertpapierhändlern oder von marktbasierteren Preisen, die von Kursbestimmungsdiensten bereitgestellt werden (normalerweise zum Börsenschluss der NYSE). Zentral geclearte Swaps und OTC-Swaps können von den Kursbestimmungsdiensten mithilfe einer Reihe von Techniken bewertet werden, einschließlich Simulationspreismodellen. Die Preismodelle können Inputfaktoren verwenden, die an aktiv notierten Märkten beobachtet werden, wie zum Beispiel den Overnight-Index-Swap-Satz, den LIBOR-Terminsatz, Zinssätze,

Renditekurven und Kreditspreads. Diese Wertpapiere werden in Stufe 2 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet.

Handelsaktiva und -passiva der Stufe 3 zum Marktwert Wenn von PIMCO ein Marktbewertungsverfahren angewandt wird, das wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren einsetzt, werden Anlagen anhand eines Verfahrens bewertet, von dem der Verwaltungsrat oder von diesem angewiesene Personen annehmen, dass es den angemessenen Marktwert korrekt wiedergibt, und sie werden in Stufe 3 der Bewertungshierarchie eingeordnet. Die Bewertungstechniken und wesentlichen Inputfaktoren, die verwendet werden, um den Marktwert von Anlagen der Fonds sowie von Finanzinstrumenten zu bestimmen, die in Stufe 3 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet werden, gestalten sich folgendermaßen:

Indirekte Preisbestimmungsverfahren (Proxy Pricing) bestimmen den Basispreis eines festverzinslichen Wertpapiers und passen diesen dann proportional zu Marktwertänderungen eines vorab bestimmten Wertpapiers an, das in Bezug auf die Laufzeit als vergleichbar erachtet wird. In der Regel handelt es sich hierbei um eine US-Staatsanleihe oder einen auf dem Emissionsland beruhenden staatlichen Schuldtitel. Bei dem Basispreis kann es sich um einen von einem Wertpapierhändler quotierten Preis, einen Transaktionspreis oder einen anhand einer Analyse von Marktdaten ermittelten internen Wert handeln. Der Basispreis des Wertpapiers kann in regelmäßigen Abständen auf der Grundlage der Verfügbarkeit von Marktdaten und Verfahren, die vom Valuation Oversight Committee (Ausschuss für die Bewertungsaufsicht) genehmigt wurden, neu festgesetzt werden. Erhebliche Änderungen der nicht beobachtbaren Inputfaktoren des Proxy-Pricing-Verfahrens (des Basispreises) würden zu direkten und proportionalen Änderungen des Marktwerts des Wertpapiers führen. Diese Wertpapiere werden in Stufe 3 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet.

Wenn keine von Dritten bewerteten Preise verfügbar sind oder angenommen wird, dass diese den Marktwert nicht angemessen widerspiegeln, kann sich der Anlageberater dafür entscheiden, Broker-Quotierungen direkt vom Wertpapierhändler oder von einem Drittanbieter zu beziehen. Wenn der Marktwert auf einer einzelnen bezogenen Broker-Quotierung beruht, werden diese Wertpapiere in Stufe 3 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet. Broker-Quotierungen werden in der Regel von etablierten Marktteilnehmern bezogen. Auch wenn sie unabhängig bezogen werden, verfügt der Anlageberater nicht über die erforderliche Transparenz, um die zugrundeliegenden Inputfaktoren, auf die sich die Marktquotierung stützt, zu überprüfen. Erhebliche Änderungen der Broker-Quotierung hätten direkte und proportionale Änderungen am Marktwert des Wertpapiers zur Folge.

Bei der Bewertung des Rückerlangungswerts wird davon ausgegangen, dass der Marktwert eines bestehenden Vermögenswerts nach Abzug aller Verbindlichkeiten wiedererlangt 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.

Die Bewertung auf Basis eines Referenzinstruments schätzt den Marktwert durch Verwendung der Korrelation des Wertpapiers zu einem oder mehreren breit angelegten Wertpapieren, Marktindizes und/oder anderen Finanzinstrumenten, deren Preisinformationen problemlos verfügbar sind. Zu den nicht beobachtbaren Inputfaktoren können diejenigen zählen, die in Algorithmusformeln verwendet werden, welche auf der prozentualen Änderung der Referenzinstrumente und/oder der Gewichtung der einzelnen Referenzinstrumente beruhen. Erhebliche Änderungen an den nicht beobachtbaren Inputfaktoren hätten direkte und proportionale Änderungen am Marktwert des Wertpapiers zur Folge. Diese Wertpapiere werden in Stufe 3 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet.

Kurzfristige Schuldtitel (wie Commercial Paper, Termineinlagen und Einlagenzertifikate) mit einer Restlaufzeit von 60 Tagen oder weniger können zu fortgeführten Anschaffungskosten bewertet werden, solange die fortgeführten Anschaffungskosten dieser kurzfristigen Schuldtitel annähernd dem ohne Anwendung der Methode der fortgeführten Anschaffungskosten ermittelten Marktwert des Instruments entsprechen. Diese Wertpapiere werden je nach Quelle des Basispreises der Stufe 2 oder der Stufe 3 der Marktbewertungshierarchie zugewiesen.

4. WERTPAPIERE UND ANDERE ANLAGEN

(a) Barmittel

Barmittel werden zum Nennwert, gegebenenfalls zuzüglich aufgelaufener Zinsen, bewertet. Alle Bankguthaben werden entweder von State Street Bank and Trust Co. oder direkt bei einer Unterverwahrestelle gehalten.

(b) Anlagen in zentralen Fonds

Bestimmte Fonds dürfen im Zusammenhang mit ihren Aktivitäten zum Verwalten von Barmitteln auch im PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund anlegen, einem Teilfonds von PIMCO Select Funds plc. Die Hauptanlagen des PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund erfolgen in Geldmarktinstrumenten und Renteninstrumenten mit kurzer Laufzeit. Dem PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund können Aufwendungen entstehen, die im Zusammenhang mit seinen Anlageaktivitäten stehen. Die Fonds investieren jedoch nur in die Class Z, so dass keine Verwaltungsgebühren anfallen.

(c) Anlagen in Wertpapieren

Die Fonds können die nachfolgend beschriebenen Anlagen und Strategien verwenden, soweit dies gemäß der Anlagepolitik der Fonds zulässig ist.

Transaktionen mit verzögerter Lieferung Bestimmte Fonds dürfen Wertpapiere auf Basis verzögerter Lieferung erwerben oder verkaufen. Ein Fonds geht eine Verpflichtung in Bezug auf diese Transaktionen ein, Wertpapiere zu einem vorab bestimmten Preis oder einer vorab bestimmten Rendite bei Zahlung und Lieferung außerhalb des üblichen Abrechnungszeitraums zu erwerben oder zu verkaufen. Sind Geschäfte mit verzögerter Lieferung offen, bestimmt oder erhält der entsprechende Fonds in dem Umfang liquide Mittel als Sicherheit, der ausreicht, um den Kaufpreis zu begleichen oder die entsprechenden Verpflichtungen zu erfüllen. Beim Erwerb eines Wertpapiers auf Basis verzögerter Lieferung übernimmt der Fonds die Besitzrechte und -risiken des Wertpapiers, einschließlich des Kursrisikos und der Renditeschwankungen, und berücksichtigt diese Schwankungen bei der Bestimmung seines NIW. Ein Fonds kann nach Abschluss einer Transaktion auf Basis verzögerter Lieferung diese veräußern oder neu verhandeln, was zu einem Gewinn oder Verlust führen kann. Hat ein Fonds ein Wertpapier auf Basis verzögerter Lieferung verkauft, nimmt der Fonds nicht an den zukünftigen Gewinnen und Verlusten dieses Wertpapiers teil.

Börsengehandelte Fonds Bestimmte Fonds dürfen in börsengehandelte Fonds („ETFs“) anlegen, bei denen es sich im Allgemeinen um indexbasierte Investmentgesellschaften handelt, die im Wesentlichen ihr gesamtes Vermögen in Wertpapieren halten, die in ihrem spezifischen Index geführt werden, die jedoch auch aktiv verwaltete Investmentgesellschaften sein können. Anteile an ETFs werden während des ganzen Tages an einer Börse gehandelt und repräsentieren eine Anlage in einem Portfolio von Wertpapieren und Vermögenswerten. Als Anteilhaber einer anderen Investmentgesellschaft würde der Fonds seinen prozentualen Anteil an den Aufwendungen der anderen Investmentgesellschaften, einschließlich Beratungsgebühren, zusätzlich zu den Aufwendungen tragen, die dem Fonds direkt im Zusammenhang mit seiner eigenen Geschäftstätigkeit entstehen.

Inflationsindexierte Anleihen Bestimmte Fonds können in inflationsindexierte Anleihen investieren, bei denen es sich um festverzinsliche Wertpapiere handelt, deren Kapitalwert in regelmäßigen Abständen an die Inflationsrate angepasst wird. Der Zinssatz für diese Anleihen wird im Allgemeinen bei der Ausgabe niedriger angesetzt als bei normalen Anleihen. Während der Laufzeit einer inflationsindexierten Anleihe werden jedoch Zinsen auf der Basis eines Kapitalwertes gezahlt, der inflationsbereinigt ist. Erhöhungen oder Verringerungen des Kapitalbetrags einer inflationsindexierten Anleihe sind als Zinseinkünfte in der Betriebsergebnisrechnung enthalten, obwohl Anleger ihren Kapitalbetrag nicht vor Fälligkeit erhalten. Die Rückzahlung des ursprünglichen Anleihekapsitals bei Fälligkeit (Inflationsbereinigt) ist bei bestimmten inflationsindexierten Anleihen garantiert. Bei Anleihen, die keine vergleichbare Garantie bieten, kann der bereinigte Kapitalwert der bei Fälligkeit zurückgezahlten Anleihe geringer sein als das ursprüngliche Kapital.

Kreditbeteiligungen und -abtretungen Bestimmte Fonds können in direkte Schuldinstrumente anlegen, bei denen es sich um Beteiligungen an Beträgen handelt, die Kreditgebern oder Kreditkonsortien von Industrie-, Regierungs- oder sonstigen Darlehensnehmern geschuldet werden. Die Anlagen eines Fonds in Darlehen können in Form von Darlehensbeteiligungen oder -abtretungen in sämtliche oder einige Anteile eines Darlehens von Dritten erfolgen. Ein Darlehen wird oft von einer Bank oder einem sonstigen Finanzinstitut (der „Kreditgeber“) verwaltet, der als Vertreter für alle Beteiligten agiert. Der Kreditgeber verwaltet die Darlehensbedingungen gemäß den Bestimmungen der Darlehensvereinbarung. Ein Fonds darf in mehrere Serien oder Tranchen eines Darlehens anlegen, die über unterschiedliche Bedingungen verfügen können und mit denen unterschiedliche Risiken verbunden sind. Erwirbt ein Fonds Abtretungen von Verleihern, erwirbt er direkte Rechte gegenüber dem Darlehensnehmer. Zu diesen Darlehen können Beteiligungen an „Überbrückungskrediten“ gehören. Hierbei handelt es sich um Kredite, die Kreditnehmer für einen kurzen Zeitraum (normalerweise unter einem Jahr) aufnehmen, bis eine auf lange Sicht ausgelegte Finanzierung beispielsweise durch die Ausgabe von Anleihen, häufig High-Yield-Anleihen, die für Akquisitionen emittiert werden, gesichert werden kann.

Zu den Arten von Darlehen und verbundenen Anlagen, in die ein Fonds investieren kann, zählen unter anderem vorrangige Darlehen, nachrangige Darlehen (einschließlich zweitrangiger Pfandrechte, B-Notes und Mezzanine-Darlehen), Whole Loans, gewerbliche Immobilien- und sonstige gewerbliche Darlehen und strukturierte Darlehen. Im Fall nachrangiger Darlehen können erhebliche Schulden vorliegen, die der Obligation des Schuldners gegenüber dem Inhaber eines solchen Darlehens vorrangig sind, unter anderem auch im Fall der Insolvenz des Schuldners. Mezzanine-Darlehen werden in der Regel durch eine Verpfändung einer Eigenkapitalbeteiligung am Hypothekennehmer, dem die Immobilie gehört, und nicht durch eine Beteiligung an der Hypothek besichert.

Anlagen in Darlehen können ungedeckte Darlehenszusagen umfassen. Hierbei handelt es sich um vertragliche Finanzierungsverpflichtungen. Ungedeckte Darlehenszusagen können revolvierende Kreditfazilitäten enthalten, die die Fonds verpflichten können, dem Darlehensnehmer auf Verlangen zusätzliche Barmittel zur Verfügung zu stellen. Ungedeckte Darlehenszusagen sind vollständige zukünftige Verpflichtungen, obwohl ein Prozentsatz der Nominaldarlehensbeträge vom Darlehensnehmer niemals ausgeschöpft wird. Bei Anlagen in Darlehensbeteiligungen verfügt ein Fonds über das Recht auf den Erhalt von

Kapitalzahlungen, Zinsen und Gebühren, auf die er ein Anrecht hat, und zwar ausschließlich gegenüber dem Kreditgeber, der die Darlehensvereinbarung veräußert, und ausschließlich bei Erhalt von Zahlungen des Kreditnehmers an den Kreditgeber. Ein Fonds kann für den nicht ausgeschöpften Anteil des zugrunde liegenden Kreditlinienanteils eines variabel verzinslichen Kredits Bereitstellungsgebühren erhalten. Unter bestimmten Umständen kann ein Fonds im Fall einer vorzeitigen Tilgung eines variabel verzinslichen Kredits durch einen Kreditnehmer eine Vorfälligkeitsentschädigungsgebühr erhalten. Eingenommene/gezahlte Gebühren werden als Bestandteil der Zinserträge bzw. Zinsaufwendungen in der Betriebsergebnisrechnung erfasst.

Nicht finanzierte Kreditzusagen zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 werden im Finanzstatus als Verbindlichkeit unter Verbindlichkeiten für erworbene Investitionen ausgewiesen.

Hypothekarisch gedeckte und andere forderungsbesicherte Wertpapiere

Bestimmte Fonds dürfen in hypothekarisch gedeckten und anderen forderungsbesicherten Wertpapieren anlegen, die unmittelbar oder mittelbar die Beteiligung an Hypothekendarlehen auf Immobilien darstellen oder von diesen besichert und aus diesen zahlbar sind. Hypothekarisch gedeckte Wertpapiere basieren auf Pools von privaten und gewerblichen Hypothekendarlehen, einschließlich von Spar- und Darlehensinstituten, Hypothekenbanken, Geschäftsbanken und anderen Einrichtungen begebenen Hypothekendarlehen. Diese Wertpapiere leisten monatliche Zahlungen, die sowohl aus Zins- als auch Kapitalzahlungen bestehen. Die Zinsen können durch feste bzw. flexible Zinssätze festgelegt werden. Die Höhe der vorab geleisteten Zahlungen auf zugrunde liegende Hypotheken beeinflusst den Kurs und die Volatilität von hypothekarisch besicherten Wertpapieren und kann, verglichen mit den Antizipationen zum Kaufzeitpunkt, kürzere oder längere effektive Durationen des Wertpapiers zur Folge haben. Die US-Regierung garantiert, dass Kapital und Zinsen auf bestimmte hypothekarisch besicherte Wertpapiere rechtzeitig gezahlt werden. Von nichtstaatlichen Emittenten zusammengestellte und garantierte Pools, einschließlich staatsnaher Institute, können von unterschiedlich gearteten Versicherungen oder Garantien abgesichert sein. Es kann jedoch nicht zugesichert werden, dass private Versicherer oder Garantiegeber ihre Verpflichtungen aus den Versicherungspolice bzw. Garantievereinbarungen erfüllen können. Viele dieser Risiken der Anlage in hypothekarisch gedeckten Wertpapieren, die durch gewerbliche Hypothekendarlehen gesichert werden, spiegeln die Folgen der lokalen sowie der sonstigen Wirtschaftslage für die Immobilienmärkte, die Fähigkeit der Mieter, Mietzahlungen zu leisten, sowie die Fähigkeit einer Immobilie wider, Mieter zu interessieren und zu binden. Diese Wertpapiere können weniger liquide sein und eine höhere Kursvolatilität zeigen als andere Arten von hypothekarisch oder forderungsbesicherten Wertpapieren. Andere forderungsbesicherte Wertpapiere werden aus vielen Arten von Vermögenswerten geschaffen, darunter Autokredite, Forderungen aus Lieferungen und Leistungen wie Kreditkartenforderungen und Krankenhausforderungen, Home-Equity-Darlehen, Studentendarlehen, Bootsdarlehen, Darlehen für Wohnmobile, Darlehen für Freizeitfahrzeuge, Darlehen für Fertighäuser, Flugzeugleasing, Computerleasing und Konsortialkredite.

Collateralized Debt Obligations („CDOs“) umfassen so genannte besicherte Anleiheverbindlichkeiten (Collateralized Bond Obligations, „CBOs“), besicherte Darlehensverbindlichkeiten (Collateralized Loan Obligations, „CLOs“) sowie andere ähnlich strukturierte Wertpapiere. CBOs und CLOs sind Arten forderungsbesicherter Wertpapiere. Bei einem CBO handelt es sich um einen Fonds, der durch einen diversifizierten Pool hoch riskanter Rentenpapiere mit einem Rating unterhalb von Investment Grade besichert ist. Ein CLO ist ein Fonds, der typischerweise durch einen Darlehenspool besichert ist, der unter anderem in- und ausländische, vorrangige, besicherte Darlehen, vorrangige, nicht besicherte Darlehen und nachrangige Unternehmensdarlehen, einschließlich Darlehen mit einem Rating unter Investment Grade oder äquivalente unbewertete Darlehen enthält. Die Risiken aus einer Anlage in einem CDO hängen größtenteils von der Art der als Sicherheit dienenden Wertpapiere und der Klasse des CDO ab, in die der Fonds anlegt. CBOs, CLOs und andere CDOs sind mit zusätzlichen Risiken verbunden, einschließlich insbesondere, (i) dass Ausschüttungen aus als Sicherheit dienenden Wertpapieren möglicherweise nicht ausreichen, um Zinsen oder sonstige Auszahlungen zu begleichen, (ii) die Qualität der Sicherheit im Wert nachgeben oder in Verzug geraten kann, (iii) dass der Fonds in CBOs, CLOs oder anderen CDOs anlegen kann, die nachrangig gegenüber anderen Klassen sind, und (iv) dass die komplexe Struktur des Wertpapiers zum Zeitpunkt der Anlage nicht vollständig verstanden wird und Konflikte mit dem Emittenten hervorrufen oder unerwartete Anlageergebnisse herbeiführen kann.

Collateralised Mortgage Obligations Collateralized Mortgage Obligations („CMOs“) sind Schuldtitel eines Rechtssubjekts, die von Whole Mortgage Loans oder privaten Hypothekenanleihen besichert und in Klassen gegliedert sind. CMOs sind in mehrere Klassen gegliedert, die oft als „Tranchen“ bezeichnet werden. Dabei wurde für jede Klasse eine andere Laufzeit festgelegt, und jede Klasse hat das Recht auf einen eigenen Kapital- und Zinszahlungsplan, einschließlich vorfristiger Rückzahlungen. CMOs und CMBS können weniger liquide sein und eine höhere Kursvolatilität zeigen als andere Arten von hypothekarisch oder forderungsbesicherten Wertpapieren.

Stripped Mortgage Backed Securities („SMBS“) sind derivative Hypothekensicherheiten mit mehreren Klassen. SMBS gliedern sich gewöhnlich in zwei Klassen, die Zins- und Kapitalausschüttungen aus einem Pool von Hypothekensicherheiten in unterschiedlichen Verhältnissen erhalten. Im Extremfall erhält eine Klasse die gesamten Zinsen (die „IO“ [Interest-Only]-Klasse), während die andere Klasse die gesamten Kapitalzahlungen erhält (die „PO“ [Principal-Only]-Klasse). Für IOs erhaltene Zahlungen sind in den Zinseinkünften der Betriebsergebnisrechnung enthalten. Da bei Fälligkeit eines IO kaum oder kein Kapital anfällt, wird der Buchwert des Wertpapiers monatlich bis zur Fälligkeit angepasst. Diese Anpassungen sind in den Zinseinkünften der Betriebsergebnisrechnung enthalten. Für POs erhaltene Zahlungen werden als Herabsetzung der Kosten und der Parität der Wertpapiere behandelt.

Wertpapiere mit Sachausschüttungen Bestimmte Fonds dürfen in Wertpapiere mit Sachausschüttungen (Payment In-Kind Securities, „PIKs“) anlegen. PIKs gewähren dem Emittenten ggf. die Möglichkeit, zu jedem Zinszahlungsdatum Zinszahlungen entweder bar und/oder in zusätzlichen Schuldpapieren vorzunehmen. Diese zusätzlichen Schuldpapiere verfügen gewöhnlich über die gleichen Bedingungen wie die Originalanleihen, einschließlich Fälligkeitsdaten und Zinssätzen sowie verbundenen Risiken. Die täglichen Kursnotierungen der Originalanleihen können angefallene Zinsen enthalten („Dirty Price“ [Kurs einschließlich Stückzinsen]). Diese sind als Bestandteil des zum Marktwert bewerteten Finanzvermögens aus übertragbaren Wertpapieren im Finanzstatus enthalten.

Emissionen von US-Regierungsbehörden oder staatlich geförderten Unternehmen Bestimmte Fonds dürfen in Wertpapieren von US-Regierungsbehörden oder staatlich geförderten Unternehmen anlegen. Wertpapiere von US-Regierungsbehörden sind Obligationen der US-Regierung, ihrer Behörden oder Organe und werden in bestimmten Fällen von diesen garantiert. Einige Wertpapiere der US-Regierung, wie zum Beispiel Schatztitel, Wechsel und Anleihen, sowie von der Government National Mortgage Association („GNMA“ oder „Ginnie Mae“) garantierte Wertpapiere, werden von der US-Regierung in vollem Umfang unterstützt; andere, wie zum Beispiel von Federal Home Loan Banks, sichern das Recht, dass der Emittent vom U.S. Department of the Treasury (das „US Finanzministerium“) leihen darf, und andere, wie zum Beispiel von der Federal National Mortgage Association („FNMA“ oder „Fannie Mae“), werden dadurch gesichert, dass die US-Regierung nach eigenem Ermessen Obligationen der Behörde erwerben kann. Wertpapiere der US-Regierung können Nullkuponwertpapiere umfassen. Nullkuponwertpapiere schütten keine laufenden Zinsen aus. Für sie gelten höhere Risiken als für zinszahlende Wertpapiere.

Zu den regierungsnahen Garantiegebern (d. h. ohne Schutz der vollumfänglichen Unterstützung der US-Regierung) zählen die FNMA und die Federal Home Loan Mortgage Corporation („FHLMC“ oder „Freddie Mac“). Die FNMA ist eine staatlich geförderte Gesellschaft. Die FNMA erwirbt konventionelle (d. h. nicht von einer Regierungsbehörde versicherte oder verbrieft) Immobilienhypotheken aus einem Verzeichnis zugelassener Verkäufer/Dienstleister. Zu diesen zählen staatlich und bundesstaatlich amtlich zugelassene Spar- und Darlehenskassen, Genossenschaftsbanken, Geschäftsbanken, Kreditgenossenschaften und Hypothekenbanken. Für von der FNMA begebene Durchlaufpapiere garantiert die FNMA die rechtzeitige Zahlung von Kapital und Zinsen. Sie genießen jedoch nicht die vollumfängliche Unterstützung der US-Regierung. Die FHLMC gibt Participation Certificates („PCs“) aus. Bei ihnen handelt es sich um Durchlaufpapiere. Jedes vertritt die ungeteilte Beteiligung an einem Pool von Wohnhypotheken. Die FHLMC garantiert die rechtzeitige Zahlung von Zinsen und den endgültigen Kapitaleinzug. PCs genießen jedoch nicht die vollumfängliche Unterstützung der US-Regierung.

Im Juni 2019 begannen die FNMA und die FHLMC mit der von UMBS (Uniform Mortgage-Backed Securities) anstelle ihrer derzeitigen Angebote an TBA-fähigen Wertpapieren (die „Single Security Initiative“). Die Single Security Initiative zielt darauf ab, die Liquidität des TBA-Markts insgesamt zu unterstützen und gleicht die Merkmale von FNMA- und FHLMC-Zertifikaten an. Welche Auswirkungen die Single Security Initiative auf den Markt für TBA und andere hypothekenbesicherte Wertpapiere haben wird, ist ungewiss.

Roll-Timing-Strategien können eingesetzt werden, wenn der Fonds versucht, den Ablauf oder die Fälligkeit einer Position wie etwa einer TBA-Transaktion (To Be Announced) auf einen Basiswert zu verlängern, indem er die Position vor ihrem Ablauf schließt und eine neue Position in Bezug auf denselben Basiswert eröffnet, die ein späteres Ablaufdatum hat. Ge- und verkaufte TBA-Wertpapiere werden im Finanzstatus jeweils als Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten ausgewiesen.

Börsennotierte Immobilienfonds („REITs“) Manche Fonds können in REITs investieren. Dabei handelt es sich um gepoolte Anlagevehikel, die ertragbringende Immobilien besitzen und in der Regel auch betreiben. Wenn ein REIT bestimmungsgemäß Anforderungen erfüllt, unter anderem dass er im Wesentlichen seine gesamten steuerpflichtigen Erträge (außer Nettokapitalgewinnen) an die Anteilhaber ausschüttet, ist er im Hinblick auf die an Anteilhaber

ausgeschütteten Erträge nicht steuerpflichtig. Von REITs erhaltene Ausschüttungen können als Ertrag, Kapitalgewinn oder Kapitalrückführung eingestuft werden. Eine Kapitalrückführung wird vom Fonds als Minderung der Kostenbasis seiner Anlage im REIT erfasst. Für REITs fallen Verwaltungsgebühren und andere Aufwendungen an, so dass die Fonds, soweit sie in REITs investieren, ihren jeweiligen Anteil an den Kosten für den Betrieb der REITs tragen.

Beschränkt handelbare Wertpapiere Bestimmte Fonds dürfen in Wertpapiere anlegen, die rechtlichen oder vertraglichen Weiterverkaufseinschränkungen unterliegen und im Allgemeinen privat verkauft werden können, aber vor einem öffentlichen Verkauf registriert oder von einer solchen Registrierung befreit werden müssen. Privat platzierte Wertpapiere gelten allgemein als beschränkt handelbar. Der Verkauf von eingeschränkten Wertpapieren kann zeitaufwändige Verhandlungen sowie Aufwendungen beinhalten und der sofortige Verkauf zu einem akzeptablen Kurs kann schwierig zu erzielen sein. Zum 31. Dezember 2023 von den Fonds gehaltene beschränkt handelbare Wertpapiere werden in den Erläuterungen zur Aufstellung der Wertpapieranlagen offengelegt.

Transaktionen mit Emissionstermin Bestimmte Fonds dürfen Wertpapiere „per Emissionstermin“ erwerben oder verkaufen. Diese Transaktionen finden unter Vorbehalt statt, da ein Wertpapier zwar bereits genehmigt wurde, jedoch noch nicht am Markt begeben wurde. Transaktionen zum Kauf oder Verkauf von Wertpapieren per Emissionstermin beinhalten die Zusage eines Fonds, diese Wertpapiere zu einem im Voraus festgelegten Preis oder einer im Voraus festgelegten Rendite zu kaufen oder zu verkaufen, wobei die Zahlung und die Lieferung außerhalb des üblichen Abrechnungszeitraums erfolgen. Ein Fonds darf Wertpapiere auf Basis „per Emission“ verkaufen, bevor diese ausgehändigt werden, was zu einem realisierten Kapitalgewinn oder -verlust führen kann.

Unbefristete Anleihen Bestimmte Fonds können in unbefristete Anleihen investieren. Dies sind festverzinsliche Wertpapiere ohne Fälligkeitstermin, die jedoch auf Dauer einen Kupon zahlen (ohne angegebene End- oder Fälligkeitstermin). Im Gegensatz zu typischen festverzinslichen Wertpapieren besteht für unbefristete Anleihen keine Verpflichtung, das Kapital zurückzuzahlen. Die Kuponzahlungen sind hingegen verpflichtend. Während unbefristete Anleihen keinen Fälligkeitstermin aufweisen, können sie ein Kündigungsdatum haben, an dem die Unbefristetheit wegfällt und der Emittent den erhaltenen Kapitalbetrag am angegebenen Kündigungsdatum zurückzahlen kann. Außerdem kann eine unbefristete Anleihe zusätzliche Merkmale haben, beispielsweise Zinserhöhungen an regelmäßigen Terminen oder eine Erhöhung an einem vorab festgelegten Zeitpunkt in der Zukunft.

Optionsscheine sind Wertpapiere, die in der Regel zusammen mit einer Schuldverschreibung oder einem Vorzugstitel ausgegeben werden und dem Inhaber das Recht verleihen, eine anteilige Menge an Stammaktien zu einem bestimmten Preis zu kaufen. Optionsscheine haben normalerweise eine Laufzeit, die in Jahren gemessen wird, und berechtigen den Inhaber zum Kauf von Stammaktien eines Unternehmens zu einem Preis, der in der Regel über dem Marktpreis zum Zeitpunkt der Ausgabe des Optionsscheins liegt. Optionsscheine können mit höheren Risiken verbunden sein als bestimmte andere Arten von Anlagen. Im Allgemeinen berechtigen Optionsscheine nicht zum Erhalt von Dividenden oder zur Ausübung von Stimmrechten in Bezug auf die zugrunde liegenden Wertpapiere, und sie stellen keine Rechte an den Vermögenswerten des Emittenten dar. Außerdem ändert sich ihr Wert nicht unbedingt mit dem Wert der zugrunde liegenden Wertpapiere, und sie verlieren ihren Wert, wenn sie nicht an oder vor ihrem Ablaufdatum ausgeübt werden. Übersteigt der Kurs der zugrunde liegenden Aktie während der Laufzeit des Optionsscheins nicht den Ausübungspreis, verfällt der Optionsschein wertlos. Optionsscheine können den potenziellen Gewinn oder Verlust aus der Anlage im Vergleich zu einer Anlage desselben Betrags in den zugrunde liegenden Wertpapieren erhöhen. Ebenso kann der prozentuale Anstieg oder Rückgang des Wertes eines Aktienoptionsscheins größer sein als der prozentuale Anstieg oder Rückgang des Wertes der zugrunde liegenden Stammaktie. Optionsscheine können sich auf den Kauf von Aktien oder Schuldtiteln beziehen. Schuldverschreibungen, denen Optionsscheine zum Erwerb von Aktien beigelegt sind, weisen viele Merkmale von wandelbaren Wertpapieren auf, und ihre Preise können zu einem gewissen Grad die Wertentwicklung der zugrunde liegenden Aktie widerspiegeln. Schuldverschreibungen können auch mit beigelegten Optionsscheinen ausgegeben werden, die zum Kauf weiterer Schuldverschreibungen zum gleichen Zinssatz berechtigen. Ein Rückgang der Zinssätze würde es dem Portfolio ermöglichen, solche Optionsscheine mit Gewinn zu verkaufen. Bei einem Anstieg der Zinsen verfallen diese Optionsscheine im Allgemeinen wertlos.

5. KREDITE UND ANDERE FINANZIERUNGSTRANSAKTIONEN

Die Fonds dürfen die nachfolgend beschriebenen Kredite und Finanzierungstransaktionen abschließen, sofern dies gemäß der Anlagepolitik des jeweiligen Fonds zulässig ist.

Die folgenden Angaben enthalten Informationen zur Fähigkeit der Fonds, Barmittel oder Wertpapiere gemäß den maßgeblichen Verordnungen der Zentralbank und dem Prospekt zu verleihen oder zu leihen, soweit dies gemäß ihren Anlagezielen und ihrer Anlagepolitik zulässig ist, sowie vorbehaltlich der von der Zentralbank jeweils festgelegten Grenzen und der Bestimmungen des Verkaufsprospekts. Diese können als Kredite oder Finanzierungstransaktionen der Fonds betrachtet werden. Nachfolgend ist beschrieben, wo diese Instrumente in den Abschlüssen der Fonds zu finden sind.

(a) Pensionsgeschäfte

Bestimmte Teilfonds dürfen Pensionsgeschäfte eingehen. Bei einem typischen Pensionsgeschäft nimmt der Fonds einen Basisschuldittel (Sicherheit) vorbehaltlich der Verpflichtung des Verkäufers zum Rückkauf und des Fonds zum Weiterverkauf der Verbindlichkeit zu einem vereinbarten Preis und Zeitpunkt in Besitz. Bei einem Pensionsgeschäft mit offener Fälligkeit gibt es kein im Voraus festgelegtes Rückkaufdatum, und die Vereinbarung kann vom Fonds oder vom Kontrahenten jederzeit gekündigt werden. Die zugrunde liegenden Wertpapiere für alle Pensionsgeschäfte werden von der Verwahrstelle eines Fonds oder von benannten Unterverwahrstellen (im Falle von Drei-Parteien-Pensionsgeschäften) gehalten und bleiben in bestimmten Fällen unter Verwahrung des Kontrahenten. Der Marktwert der Sicherheit muss jederzeit dem Gesamtbetrag der Rückkaufverbindlichkeiten einschließlich Zinsen entsprechen oder höher sein als dieser Gesamtbetrag. Pensionsgeschäfte, einschließlich angefallener Zinsen, sind im Finanzstatus enthalten. Zinseinkünfte werden in der Betriebsergebnisrechnung als Bestandteil der Zinserträge erfasst. In Zeiträumen mit erhöhtem Bedarf an Sicherheiten muss ein Fonds eventuell eine Gebühr für den Erhalt von Sicherheiten bezahlen, was zu Zinsaufwendungen für den Fonds führen kann.

(b) Umgekehrte Pensionsgeschäfte

Bestimmte Fonds dürfen umgekehrte Pensionsgeschäfte eingehen. Bei einem umgekehrten Pensionsgeschäft übergibt ein Fonds einem Finanzinstitut, dem Kontrahenten, ein Wertpapier im Gegenzug für Barmittel, mit einer gleichzeitigen Vereinbarung zum Rückkauf desselben oder im Wesentlichen desselben Wertpapiers zu einem vereinbarten Preis und Datum. Bei einem umgekehrten Pensionsgeschäft mit offener Fälligkeit gibt es kein im Voraus festgelegtes Rückkaufdatum, und die Vereinbarung kann vom Fonds oder des Kontrahenten jederzeit gekündigt werden. Der Fonds ist zum Erhalt etwaiger Kapital- und Zinszahlungen berechtigt, die auf das Wertpapier, das an den Kontrahenten während der Laufzeit der Vereinbarung geliefert wurde, vorgenommen wurden. Barmittel, die für gelieferte Wertpapiere ausbezahlt wurden, zusätzlich aufgelaufener Zinszahlungen, die von einem Teilfonds an Kontrahenten vorzunehmen sind, werden im Finanzstatus als Verbindlichkeit ausgewiesen. Vom Fonds an Kontrahenten vorgenommene Zinszahlungen werden in der Betriebsergebnisrechnung als Bestandteil der Zinsaufwendungen erfasst. In Zeiträumen mit erhöhtem Bedarf an Sicherheiten kann ein Fonds eventuell eine Gebühr für den Einsatz des Wertpapiers durch den Kontrahenten erhalten, was zu Zinseinkünften für den Fonds führen kann. Ein Fonds stellt von den Anlageberatungsgesellschaften oder anderweitig für liquide erklärte Vermögenswerte zurück, die dazu bestimmt sind, die Verpflichtung aus einem umgekehrten Pensionsgeschäft zu erfüllen.

(c) Leerverkäufe

Bestimmte Teilfonds dürfen Leerverkaufs-Transaktionen tätigen. Ein Leerverkauf ist eine Transaktion, bei der ein Fonds Wertpapiere, die nicht in seinem Besitz sind, im Vorgriff auf einen Rückgang des Marktwerts der Wertpapiere verkaufen kann. In einem Leerverkauf veräußerte Wertpapiere und gegebenenfalls auf diese zahlbare Zinsen werden im Finanzstatus als Verbindlichkeit wiedergegeben. Ein Fonds ist verpflichtet, die Wertpapiere zum Zeitpunkt der Glattstellung der Short Position zum Handelspreis zu liefern. Während die etwaigen Verluste aus einem Leerverkauf unbegrenzt sein können, können die Verluste aus den Käufen die Höhe des angelegten Gesamtbetrages nicht übersteigen.

(d) Sale-Buybacks

Bestimmte Teilfonds können Finanzierungsgeschäfte eingehen, die als ‚Sale-Buybacks‘ (Verkäufe-Rückkäufe) bezeichnet werden. Ein Sale-Buyback-Geschäft (Rückkauf-Finanzierung) besteht aus dem Verkauf eines Wertpapiers durch einen Fonds an ein Finanzinstitut, den Kontrahenten, mit einer gleichzeitigen Vereinbarung zum Rückkauf desselben oder im wesentlichen desselben Wertpapiers zu einem vereinbarten Preis und an einem vereinbarten Datum. Ein Fonds ist nicht zum Erhalt von Kapital- und Zinszahlungen berechtigt, die auf das Wertpapier, das an den Kontrahenten während der Laufzeit der Vereinbarung verkauft wurde, vorgenommen wurden. Die vereinbarten Erlöse für Wertpapiere, die von einem Fonds zurückzukaufen sind, werden im Finanzstatus als Verbindlichkeit ausgewiesen. Ein Fonds weist Nettoerträge aufgrund eines Preisunterschieds zwischen dem für das übertragene Wertpapier erhaltenen Preis und dem vereinbarten Rückkaufpreis aus. Dies wird allgemein als „Preisrückgang“ bezeichnet. Ein Preisrückgang besteht aus (i) den entfallenen etwaigen Zins- und inflationären Ertragsberichtigungen, die ein Fonds ansonsten erhalten hätte, wenn das Wertpapier nicht verkauft worden wäre, und (ii) den zwischen einem Fonds und dem Kontrahenten vereinbarten Finanzierungsbedingungen. Die etwaigen entfallenen Zins- und inflationären Ertragsberichtigungen werden in der Betriebsergebnisrechnung als Bestandteile des Zinsertrags ausgewiesen. Von einem Fonds an Kontrahenten aufgrund von ausgehandelten Finanzierungsbedingungen vorgenommene Zinszahlungen werden in der

Betriebsergebnisrechnung als Bestandteil der Zinsaufwendungen erfasst. In Zeiträumen mit erhöhtem Bedarf an Sicherheiten kann ein Fonds eventuell eine Gebühr für den Einsatz des Wertpapiers durch den Kontrahenten erhalten, was zu Zinseinkünften für den Fonds führen kann. Ein Fonds stellt von den Anlageberatungsgesellschaften oder anderweitig für liquide erklärte Vermögenswerte zurück, die dazu bestimmt sind, die Verpflichtung aus Sale-Buyback-Geschäften zu erfüllen.

6. FINANZDERIVATE

Die folgenden Offenlegungen enthalten Informationen darüber, wie und warum die Fonds Finanzderivate einsetzen, und wie Finanzderivate die finanzielle Lage, das Ergebnis der Geschäftstätigkeit und die Kapitalflüsse der Fonds beeinflussen. Die zum Ende des Geschäftsjahres ausstehenden Finanzderivate, wie sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen erfasst werden, und die Beträge der realisierten und die Veränderungen der nicht realisierten Gewinne und Verluste aus Finanzderivaten während des Geschäftsjahres, wie sie in der Betriebsergebnisrechnung erfasst werden, dienen als Indikatoren für den Umfang der Finanzderivataktivitäten für die Fonds.

(a) Devisenterminkontrakte

Bestimmte Fonds dürfen Devisenkontrakte in Verbindung mit der Abrechnung geplanter Käufe oder Verkäufe von Wertpapieren eingehen, um Währungsrisiken in Verbindung mit einigen oder allen Fondswertpapieren abzusichern oder als Teil der Anlagestrategie. Ein Devisenterminkontrakt ist ein Vertrag zwischen zwei Parteien über den Kauf und Verkauf einer Währung zu einem bestimmten Kurs zu einem zukünftigen Zeitpunkt. Der Marktwert eines Devisenterminkontrakts schwankt mit den Änderungen der Wechselkurse. Devisenterminkontrakte werden täglich zum letzten Börsenkurs bewertet, und die Wertänderung wird vom Fonds als nicht realisierter Gewinn oder Verlust erfasst. Realisierte Gewinne oder Verluste entsprechen dem Unterschied zwischen dem Wert des Kontrakts zum Zeitpunkt seiner Eröffnung und dem Wert zum Zeitpunkt seiner Schließung und werden mit Lieferung oder Erhalt der Währung erfasst. Diese Kontrakte können mit Marktrisiken verbunden sein, die über den nicht realisierten Gewinn oder Verlust hinausgehen, die im Finanzstatus wiedergegeben werden. Zusätzlich kann ein Fonds Risiken ausgesetzt sein, wenn die Kontrahenten nicht in der Lage sind, die Vertragsbedingungen zu erfüllen, oder wenn sich der Wert der Währung gegenüber der Funktionswährung nachteilig ändert. Um dieses Risiko zu vermindern, können Barmittel oder Wertpapiere gemäß den Bestimmungen der zugrundeliegenden Verträge als Sicherheiten ausgetauscht werden.

Bestimmte Fonds verfügen über eine abgesicherte Klasse, die Devisenterminkontrakte einget, die dazu bestimmt sind, den Absicherungseffekt auf Fondsebene glattzustellen, damit sich die abgesicherten Klassen weiter an anderen Währungen als der Funktionswährung beteiligen kann. Es kann nicht garantiert werden, dass diese klassenspezifischen Devisenterminkontrakte erfolgreich sein werden.

Bei Absicherungen von Anteilsklassen werden die realisierten und nicht realisierten Gewinne oder Verluste ausschließlich den betreffenden Anteilsklassen zugeordnet. Die nicht realisierten Gewinne oder Verluste sind als Bestandteil der Finanzderivate im Finanzstatus ausgewiesen. Im Zusammenhang mit diesen Verträgen können Wertpapiere in Übereinstimmung mit den Bedingungen der jeweiligen Verträge zu Sicherheiten bestimmt werden.

(b) Terminkontrakte

Bestimmte Fonds dürfen Terminkontrakte abschließen. Ein Fonds kann Terminkontrakte verwenden, um sein Risiko an den Wertpapiermärkten oder gegenüber Schwankungen der Zinssätze und Währungskurse zu verwalten. Die Hauptrisiken in Verbindung mit dem Einsatz von Terminkontrakten sind die unvollständige Korrelation zwischen der Veränderung des Marktwertes der von einem Fonds gehaltenen Wertpapiere und den Preisen von Terminkontrakten sowie die Möglichkeit eines illiquiden Marktes. Terminkontrakte werden auf der Basis ihrer täglich festgestellten Abrechnungskurse bewertet. Beim Abschluss eines Terminkontrakts muss ein Fonds bei seinem Terminhändler einen Geldbetrag oder US-Regierungs- und Behördenanleihen oder ausgewählte Staatsanleihen in Übereinstimmung mit den ursprünglichen erforderlichen Einschüssen des Händlers oder der Börse hinterlegen. Terminkontrakte werden täglich zum letzten Börsenkurs bewertet, und auf Basis dieser Bewegungen der Preise der Kontrakte kann der Fonds eine entsprechende Forderung oder Verbindlichkeit für die Wertänderung stellen bzw. einziehen („Marge für Finanzderivate“). Gewinne oder Verluste werden erfasst, gelten jedoch nicht als realisiert, bis die Kontrakte auslaufen oder glattgestellt werden. Terminkontrakte beinhalten in unterschiedlichem Maße Verlustrisiken, die über die im Finanzstatus ausgewiesene Marge für Finanzderivate hinausgehen.

(c) Terminkontrakte

Bestimmte Fonds können Optionen verkaufen oder kaufen, um Einkommen zu erzielen oder um eine vorhandene Position oder zukünftige Anlage abzusichern. Ein Teilfonds darf Kauf- und Verkaufsoptionen auf Wertpapiere und derivative Finanzinstrumente verkaufen, die sich in seinem Besitz befinden oder in die er anlegen darf.

Der Verkauf von Verkaufsoptionen neigt dazu, das Risiko für einen Fonds aus dem zugrunde liegenden Instrument zu erhöhen. Der Verkauf von Kaufoptionen neigt dazu, das Risiko für einen Fonds aus dem zugrunde liegenden Instrument zu senken. Veräußert ein Fonds eine Kauf- oder Verkaufsoption, dann erfasst er einen Betrag, der der erhaltenen Prämie entspricht, als Verbindlichkeit und bewertet diese zum letzten Börsenkurs, um den aktuellen Wert der verkauften Option wiederzugeben. Diese Verbindlichkeiten sind im Finanzstatus enthalten. Erhaltene Prämien aus dem Verkauf von Optionen, die auslaufen, werden als realisierte Gewinne erfasst. Erhaltene Prämien aus dem Verkauf von Optionen, die ausgeübt oder glattgestellt werden, sind den Erlösen hinzuzurechnen oder gegen die aus den zugrunde liegenden Futures, Swaps, Wertpapiere oder Währungstransaktionen gezahlten Beträge aufzurechnen, um den realisierten Gewinn oder Verlust zu bestimmen. Bestimmte Optionen dürfen mit Prämien erworben werden, die zu einem späteren Zeitpunkt festgelegt werden. Die Prämien für diese Optionen basieren auf impliziten Volatilitätsparametern unter bestimmten Bedingungen. Ein Fonds, der eine Option veräußert, hat keine Kontrolle darüber, ob das Basisinstrument verkauft („Call“) oder gekauft („Put“) wird, und im Ergebnis trägt er das Marktrisiko einer ungünstigen Kursänderung des Instruments, das der verkauften Option zugrunde liegt. Es besteht das Risiko, dass sich der Fonds aufgrund eines illiquiden Marktes eventuell nicht in der Lage sieht, die Transaktion glattzustellen.

Ein Fonds darf ebenfalls Verkaufs- und Kauf-Optionen erwerben. Der Kauf von Verkaufsoptionen neigt dazu, das Fondsrisiko gegenüber den zugrunde liegenden Instrumenten zu erhöhen. Der Kauf von Kaufoptionen neigt dazu, das Fondsrisiko gegenüber den zugrunde liegenden Instrumenten zu senken. Ein Fonds zahlt eine Prämie, die ergebniswirksam zum Marktwert als Finanzvermögen in den Finanzstatus einfließt, und später neu bewertet wird, um den aktuellen Wert der Option wiederzugeben. Gezahlte Prämien für den Kauf von Optionen, die auslaufen, werden als realisierte Verluste verbucht. Bestimmte Optionen dürfen mit Prämien gekauft werden, die zu einem zukünftigen Datum bestimmt werden. Die Prämien für diese Optionen basieren auf impliziten Volatilitätsparametern unter bestimmten Bedingungen. Das mit dem Kauf von Verkaufs- und Kaufoptionen verbundene Risiko beschränkt sich auf die gezahlte Prämie. Gezahlte Prämien aus dem Kauf von Optionen, die ausgeübt oder glattgestellt werden, sind den gezahlten Beträgen hinzuzufügen oder gegen die Erlöse aus dem Basisanlagegeschäft aufzurechnen, um den realisierten Gewinn oder Verlust bei Ausführung der zugrunde liegenden Transaktion zu bestimmen.

Credit Default Swaptions Bestimmte Teilfonds können Credit Default Swaptions kaufen oder verkaufen, um eine Absicherung des Kreditrisikos einer Anlage zu erreichen, ohne sich dem Basiswert gegenüber zu verpflichten. Eine Credit Default Swaption ist eine Option zum Verkauf oder Kauf von Kreditschutz für einen bestimmten Referenzwert durch Abschluss eines vordefinierten Swaps zu einem bestimmten zukünftigen Zeitpunkt.

Devisenoptionen Bestimmte Teilfonds können Devisenoptionen verkaufen oder kaufen. Durch den Verkauf oder Kauf von Devisenoptionen erhält ein Fonds das Recht, ist jedoch nicht verpflichtet, die festgelegten Devisenbeträge zu einem Wechselkurs zu kaufen oder zu verkaufen, der zu einem bestimmten Datum geltend gemacht werden kann. Diese Optionen können als Kauf- oder Verkaufsdeckungsgeschäft gegen mögliche Schwankungen der Wechselkurse oder zum Aufbau eines Engagements in Devisen dienen.

Inflation-Capped Options Bestimmte Teilfonds können Inflation-Capped Options kaufen oder verkaufen, um die Renditen zum Zwecke von Absicherungsmöglichkeiten zu erhöhen. Veräußert ein Fonds eine Inflation-Capped Option, dann erfasst er einen Betrag, der der erhaltenen Prämie entspricht, als Verbindlichkeit und bewertet diese zum letzten Börsenkurs, um den aktuellen Wert der verkauften Option wiederzugeben. Kauft ein Fonds eine Inflation-Capped Option, bezahlt der Fonds eine Prämie, die als Vermögenswert ausgewiesen und dann zum letzten Börsenkurs bewertet wird, um den aktuellen Wert der Option wiederzugeben. Der Kauf von Inflation-Capped Options soll einen Fonds vor Inflationserosion über einem bestimmten Satz aus einer bestimmten angenommenen Beteiligung schützen. Zum Schutz von Anlagen in inflationsgekoppelten Produkten kann eine Untergrenze (Floor) verwendet werden.

Interest Rate-Capped Options Bestimmte Teilfonds können Interest Rate-Capped Options kaufen oder verkaufen, um die Renditen zum Zwecke von Absicherungsmöglichkeiten zu erhöhen. Veräußert ein Fonds eine Interest Rate-Capped Option, dann erfasst er einen Betrag, der der erhaltenen Prämie entspricht, als Verbindlichkeit und bewertet diese zum letzten Börsenkurs, um den aktuellen Wert der verkauften Option wiederzugeben. Kauft ein Fonds eine Interest Rate-Capped Option, bezahlt der Fonds eine Prämie, die als Vermögenswert ausgewiesen und dann zum letzten Börsenkurs bewertet wird, um den aktuellen Wert der Option wiederzugeben. Der Kauf von Interest Rate-Capped Options soll einen Fonds vor dem Risiko variabler Zinssätze oberhalb eines bestimmten Satzes aus einer bestimmten angenommenen Beteiligung schützen. Zum Schutz von Anlagen in zinsgekoppelten Produkten kann eine Untergrenze (Floor) verwendet werden.

Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte Bestimmte Fonds können Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte („Futures Option“) kaufen oder verkaufen, um eine vorhandene Position oder künftige Investments abzusichern, zu Spekulationszwecken oder zur Verwaltung des Risikos im Zusammenhang mit Marktschwankungen. Eine Futures Option ist ein Optionskontrakt, dessen Basiswert ein einziger Futures-Kontrakt ist.

Optionen auf Rohstoffterminkontrakte Bestimmte Teilfonds können Optionen auf Rohstoffterminkontrakte („Rohstoffoptionen“) verkaufen oder kaufen. Der Basiswert für die Rohstoffoption ist nicht der Rohstoff selbst, sondern vielmehr ein Terminkontrakt auf den Rohstoff. Zur Ausübung einer Rohstoffoption gehört nicht die tatsächliche Lieferung des zugrunde liegenden Rohstoffs, sondern vielmehr die Zahlung des Differenzbetrags zwischen dem aktuellen Marktwert des zugrunde liegenden Terminkontrakts und dem Ausübungskurs direkt auf das Verwahrstellenkonto eines Fonds. Bei Optionen, die „im Geld“ sind, wird ein Fonds normalerweise die Position ausgleichen, anstatt die Option auszuüben, um den Restzeitwert zu wahren.

Barriere-Optionen Bestimmte Fonds können eine Vielzahl von Optionen mit nicht standardmäßigen Auszahlungsstrukturen oder anderen Merkmalen („Barriere-Optionen“) verkaufen oder kaufen. Barriere-Optionen werden allgemein außerbörslich gehandelt. Ein Fonds kann in verschiedene Arten von Barriere-Optionen investieren, unter anderem auch in Down-and-in- sowie in Up-and-in-Optionen. Down-and-in- und Up-and-in-Optionen sind standardmäßigen Optionen ähnlich. Der wesentliche Unterschied besteht darin, dass die Option für den Käufer der Option wertlos ausläuft, wenn der Kurs des zugrundeliegenden Instruments vor dem Ablaufdatum der Option einen bestimmten Barriere-Kurs erreicht bzw. nicht erreicht.

Zins-Swaptions Bestimmte Fonds können Zins-Swaptions eingehen, wobei es sich um Optionen zum Abschluss vordefinierter Swap-Vereinbarungen zu einem bestimmten zukünftigen Zeitpunkt handelt. Der Verkäufer der Swaption wird bei Ausübung durch die Käufer zum Kontrahenten des Swaps. Aus der Zinsswaption geht hervor, ob der Käufer der Swaption bei Ausübung ein Empfänger eines festen Zinssatzes ist oder einen festen Zinssatz bezahlt.

(c) Optionen auf Wertpapiere Bestimmte Fonds können Optionen auf Wertpapiere verkaufen oder kaufen, um Renditen zu erhöhen oder um eine vorhandene Position oder zukünftige Anlage abzusichern. Eine Option auf ein Wertpapier verwendet ein angegebenes Wertpapier als Basiswert für den Optionskontrakt.

Straddle-Optionen Bestimmte Fonds können verschiedene Formen von Straddle-Optionen („Straddle“) verwenden. Bei einem Straddle handelt es sich um eine Anlagestrategie, die Kombinationen aus Optionen einsetzt, die es dem Fonds ermöglichen, auf der Basis zukünftiger Preisschwankungen (nach oben oder unten) des zugrunde liegenden Wertpapiers zu profitieren. Ein verkaufter Straddle umfasst den gleichzeitigen Verkauf einer Kaufoption und einer Verkaufsoption auf dasselbe Wertpapier zum selben Ausübungskurs und mit demselben Verfallsdatum. Der verkaufte Straddle erhöht sich im Wert, wenn der Preis des Basiswerts vor dem Verfallsdatum nur geringfügig schwankt. Ein gekaufter Straddle umfasst den gleichzeitigen Kauf einer Kaufoption und einer Verkaufsoption auf dasselbe Wertpapier zum selben Ausübungskurs und mit demselben Verfallsdatum. Der gekaufte Straddle erhöht sich im Wert, wenn der Preis des Basiswerts ungeachtet der Richtung vor dem Verfallsdatum stark schwankt.

(d) Swaps

Bestimmte Teilfonds dürfen in Swaps anlegen. Swaps sind bilateral verhandelte Vereinbarungen zwischen einem Fonds und einem Kontrahenten, um Anlagekapitalflüsse, Vermögenswerte, Devisen oder marktgebundene Erträge zu bestimmten, zukünftigen Intervallen zu wechseln oder zu tauschen. Swap-Vereinbarungen werden privat im Freiverkehr ausgehandelt („OTC-Swaps“) oder können über eine dritte Partei, die als zentraler Kontrahent oder Clearingorganisation für Derivate bezeichnet wird, abgerechnet werden („zentral abgerechnete Swaps“). Ein Fonds darf Asset-Swaps, Credit Default Swaps, Cross Currency Swaps, Zinsswaps, Total Return Swaps, Variance Swaps sowie andere Arten von Swaps eingehen, um sein Kredit-, Währungs-, Zins-, Rohstoff-, Aktien- und Inflationsrisiko zu verwalten. In Verbindung mit diesen Vereinbarungen können Wertpapiere oder Barmittel in Übereinstimmung mit den Bedingungen des jeweiligen Swaps zu Sicherheiten oder Hinterlegungssummen bestimmt werden, um bei Säumnis oder Insolvenz/Zahlungsunfähigkeit auf werthaltige Vermögenswerte zurückgreifen zu können.

Zentral abgerechnete Swaps werden täglich an den Marktwert angepasst. Hierbei werden Bewertungen angesetzt, die gemäß dem zugrunde liegenden Kontrakt oder gemäß den Anforderungen des zentralen Kontrahenten bzw. der Clearingorganisation für Derivate ermittelt werden. Änderungen des Marktwerts werden, falls vorhanden, in der Betriebsergebnisrechnung als Nettoänderung der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) erfasst.

Tägliche Änderungen bei der Bewertung zentral abgerechneter Swaps („Swap Variation Margin“), falls vorhanden, werden im Finanzstatus als Forderung oder Verbindlichkeit aus Wertänderungen ausgewiesen. Zu Beginn des Berichtszeitraums geleistete oder erhaltene Zahlungen aus zentral geclearten oder OTC-Swaps werden als solche im Finanzstatus ausgewiesen und repräsentieren Prämien, die bei Abschluss des Swaps als Ausgleich für Differenzen zwischen den vereinbarten Bedingungen des Swaps und den vorherrschenden Marktbedingungen (Kreditspreads, Wechselkurse, Zinssätze und andere relevante Faktoren) gezahlt oder vereinnahmt wurden. Erhaltene (gezahlte) Abschlussprämien werden anfänglich als Verbindlichkeiten (Vermögenswerte) verbucht und anschließend zum letzten Börsenkurs bewertet, um den aktuellen Wert des Swaps wiederzugeben. Diese Abschlussprämien werden bei Beendigung oder Fälligkeit des Swaps in der Betriebsergebnisrechnung als realisierte Gewinne oder Verluste ausgewiesen. Bei Beendigung eines Swaps erhaltene oder geleistete Liquidierungszahlungen werden in der Betriebsergebnisrechnung als realisierter Gewinn oder Verlust erfasst. Vom Fonds regelmäßige erhaltene oder geleistete Nettozahlungen werden als Teil der realisierten Gewinne oder Verluste in die Betriebsergebnisrechnung einbezogen.

Zur Anwendung bestimmter Anlagerichtlinien und -beschränkungen des Fonds können Swaps wie andere derivative Instrumente vom Fonds zum Marktwert, zum Nennwert oder zum vollständigen Engagementwert bewertet werden. Im Fall eines Credit Default Swap bewertet der Fonds den Credit Default Swap bei der Anwendung bestimmter Anlagerichtlinien und -beschränkungen des Fonds zum Nennwert bzw. zum vollständigen Engagementwert (d. h. mit der Summe aus dem Nennbetrag für den Kontrakt und dem Marktwert). Für die Anwendung bestimmter sonstiger Anlagerichtlinien und -beschränkungen des Fonds kann er den Credit Default Swap jedoch zum Marktwert bewerten. So kann ein Fonds Credit Default Swaps beispielsweise für Zwecke seiner (gegebenenfalls geltenden) Richtlinien hinsichtlich der Kreditqualität zum vollständigen Engagementwert bewerten, da dieser Wert das tatsächliche wirtschaftliche Engagement des Fonds während der Laufzeit des Credit Default Swaps darstellt. In diesem Zusammenhang können sowohl der Nennbetrag als auch der Marktwert positiv oder negativ sein - je nachdem, ob der Fonds Schutz über den Credit Default Swap verkauft oder kauft. Die Art und Weise, in der bestimmte Wertpapiere oder sonstige Instrumente vom Fonds zur Anwendung von Anlagerichtlinien und -beschränkungen bewertet werden, kann von der Art und Weise abweichen, in der diese Anlagen von anderen Arten von Anlegern bewertet werden.

Der Abschluss dieser Vereinbarungen umfasst in unterschiedlichem Ausmaß Elemente von Zins-, Kredit-, Markt- und Dokumentationsrisiken enthalten, die über den im Finanzstatus enthaltenen Umfang hinausgehen. Diese Risiken beinhalten die Möglichkeit, dass kein liquider Markt für diese Vereinbarungen existiert, dass der Kontrahent dieser Vereinbarungen seinen Pflichten nicht nachkommt oder die Vertragsbedingungen anders auslegt und dass ungünstige Zinsentwicklungen auftreten können.

Das maximale Verlustrisiko eines Fonds aus dem Kontrahentenkreditrisiko entspricht dem diskontierten Nettowert der während der Vertragsrestlaufzeit vom Kontrahenten zu erhaltenden Kapitalflüsse, falls dieser Betrag positiv ist. Das Risiko wird von einer Rahmenaufrechnungsvereinbarung zwischen einem Fonds und dem Kontrahenten abgeschwächt, sowie durch die Stellung von Sicherheiten für einen Fonds, um das Kontrahentenrisiko eines Fonds abzudecken.

Korrelationswaps Bestimmte Teilfonds dürfen in Korrelationswaps anlegen, um Engagements in die Basisreferenzwerte einzugehen oder die damit verbundenen Risiken zu reduzieren. Bei Korrelationswaps vereinbaren zwei Parteien den Tausch von Kapitalflüssen auf Basis der gemessenen Korrelation bestimmter Basisreferenzwerte. Eine Partei stimmt zu, eine „feste Zinszahlung“ oder eine Zahlung zum Ausübungskurs für den „variablen Zinssatz“ oder die realisierte Kurskorrelation des Basisvermögenswerts gegenüber dem Nennbetrag zu tauschen. Bei Auflegung wird der Ausübungskurs allgemein so gewählt, dass der Marktwert des Swaps bei Null liegt. Zum Fälligkeitsdatum wird ein Nettokapitalfluss getauscht, wobei der Auszahlungsbetrag der Differenz zwischen der realisierten Kurskorrelation des Basisvermögenswerts und dem Ausübungskurs multipliziert mit dem Nennbetrag entspricht. Als Empfänger der Kurskorrelation mit fester Zinszahlung würde der Fonds den Auszahlungsbetrag erhalten, wenn die realisierte Kurskorrelation des Basisvermögenswerts unter dem Ausübungskurs liegt und würde den Auszahlungsbetrag schulden, wenn die Korrelation über dem Ausübungskurs liegt. Als Zahler der Kurskorrelation mit fester Zinszahlung würde der Fonds den Auszahlungsbetrag schulden, wenn die realisierte Kurskorrelation des Basisvermögenswerts unter dem Ausübungskurs liegt und würde den Auszahlungsbetrag erhalten, wenn die Korrelation über dem Ausübungskurs liegt. Diese Art von Vereinbarung ist im Grunde ein Terminkontrakt auf die zukünftig realisierte Kurskorrelation des Basisvermögenswerts.

Credit Default Swaps Bestimmte Fonds dürfen Credit Default Swaps auf Unternehmensanleihen, Darlehen, Staatsanleihen, US-Kommunalanleihen oder US-Schatzpapiere zur Absicherung gegen den Zahlungsausfall von Emittenten einsetzen (d. h. um das Risiko zu senken, wenn ein Fonds Beteiligungen an der Referenzobligation besitzt oder ihrem Risiko ausgesetzt ist) oder um eine aktive Long- oder Short-Position in Bezug auf die Wahrscheinlichkeit des Ausfalls eines bestimmten Emittenten einzugehen. Bei Credit Default Swaps nimmt eine Partei (der „Sicherungsnehmer“) eine Reihe von Zahlungen an eine andere Partei (der „Sicherungsgeber“) gegen das Recht vor, einen bestimmten Ertrag zu erhalten, wenn es bei der Referenzeinheit, der referenzierten Obligation oder dem referenzierten Index, wie im jeweiligen Swap angegeben, zu einem bestimmten Kreditereignis kommt. Als Sicherungsgeber in Credit Default Swaps erhält der Fonds gewöhnlich vom Sicherungsnehmer einen festen Einkommenssatz während der Laufzeit des Swaps, vorausgesetzt, es tritt kein Kreditereignis ein. Als Verkäufer würde ein Fonds seinem Portfolio effektiv Fremdfinanzierung hinzufügen, da zusätzlich zu seinen Gesamtnettovermögenswerten der Fonds dem Anlagerisiko auf den Nennbetrag des Swaps unterliegen würde.

Tritt der Fonds als Sicherungsgeber auf und tritt ein Kreditereignis ein, das in den Bedingungen dieses bestimmten Swaps festgelegt ist, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag bis zum Nominalwert des Swaps und übernimmt, in bestimmten Fällen, das Liefern der referenzierten Verbindlichkeit, einer anderen zu liefernden Obligation oder des Basiswertpapiers, das im referenzierten Index enthalten ist, oder (ii) zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln oder Wertpapieren, der dem Nominalbetrag des Swaps abzüglich des Rückerlangungswerts der referenzierten Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im referenzierten Index enthalten ist, entspricht. Tritt der Fonds als Sicherungsnehmer auf und tritt ein Kreditereignis ein, das in den Bedingungen dieses bestimmten Swaps festgelegt ist, erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nominalwert des Swaps entspricht, und übernimmt die Lieferung der referenzierten Verbindlichkeit, einer anderen zu liefernden Obligation oder des Basiswertpapiers, das im referenzierten Index enthalten ist, oder (ii) erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln oder Wertpapieren, der dem Nominalbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der referenzierten Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im dem referenzierten Index enthalten ist. Die Rückerlangungswerte werden von Marktmake unter Berücksichtigung von entweder branchenüblichen Beitragssätzen oder unternehmensspezifischen Faktoren und Erwägungen bis zum Eintreten eines Kreditereignisses geschätzt. Ist ein Kreditereignis eingetreten, wird der Rückerlangungswert durch eine vereinfachte Auktion ermittelt, wobei eine Mindestanzahl zulässiger Maklergebote zusammen mit einer festgelegten Bewertungsmethode zur Berechnung des Abrechnungswerts genutzt wird. In der Lage zu sein, andere Obligationen zu liefern, kann zu einer CTD-Option (das Recht des Sicherungsnehmers, die zu liefernde Obligation mit dem geringsten Wert nach einem Kreditereignis zu liefern) führen.

Credit Default Swaps auf Unternehmens- oder Staatsemissionen beinhalten Zahlungen der einen an die andere Partei gegen das Recht, einen bestimmten Ertrag im Falle eines Zahlungsausfalls oder eines anderen Kreditereignisses zu erhalten. Tritt ein Kreditereignis ein und es wird nicht zugunsten eines Barmittelausgleichs entschieden, kann eine Vielzahl anderer lieferbarer Obligationen anstelle der bestimmten referenzierten Obligation geliefert werden. In der Lage zu sein, andere Obligationen zu liefern, kann zu einer CTD-Option (das Recht des Sicherungsnehmers, die zu liefernde Obligation mit dem geringsten Wert nach einem Kreditereignis zu liefern) führen.

Credit Default Swaps auf Kreditindizes beinhalten, dass eine Partei einen Zahlungsfluss an eine andere Partei im Gegenzug für das Recht vornimmt, im Fall einer Wertberichtigung, von Mindereinnahmen für Kapital oder Zinsen oder Zahlungsunfähigkeit aller oder eines Teils der Referenzeinheiten, aus denen der Kreditindex besteht, einen bestimmten Ertrag zu erhalten. Bei einem Kreditindex handelt es sich um einen Korb von Kreditinstrumenten- oder Engagements, die einen Teil des Kreditmarkts als Ganzes verkörpern. Diese Indizes bestehen aus Referenzkrediten, die mittels Umfrage von Händlern von diesen als die liquidesten Titel unter den Credit Default Swaps basierend auf dem Bereich des Index bestimmt werden. Indexkomponenten können insbesondere Wertpapiere mit Investment Grade-Rating, hoch rentierliche Wertpapiere, forderungsbesicherte Wertpapiere, Schwellenmärkte und/oder unterschiedliche Kredit-Ratings innerhalb des jeweiligen Bereichs enthalten. Kreditindizes werden mithilfe von Credit Default Swaps zu standardisierten Bedingungen einschließlich eines festen Spreads und Standardfälligkeiten gehandelt. Ein Index Credit Default Swap bezieht sich auf alle Namen im Index, und bei Zahlungsverzug wird das Kreditereignis auf Basis der Gewichtung des entsprechenden Namens im Index beglichen. Die Zusammensetzung der Indizes ändert sich regelmäßig, gewöhnlich alle sechs Monate, und bei den meisten Indizes verfügt jeder Name über die gleiche Gewichtung im Index. Der Fonds darf Credit Default Swaps auf Kreditindizes einsetzen, um ein Portfolio von Credit Default Swaps oder -anleihen abzusichern, der nicht so teuer ist wie der Kauf zahlreicher Credit Default Swaps, um einen ähnlichen Effekt zu erreichen. Credit Default Swaps auf Indizes sind Instrumente, die Anleger, die Anleihen besitzen, gegen Zahlungsausfall schützen sollen. Sie werden von Wertpapierhändlern genutzt, um auf Änderungen der Kreditqualität zu spekulieren.

Auf absoluter Grundlage dargestellte, implizite Kreditspreads, die zum Ende des Geschäftsjahres zur Bestimmung des Marktwerts von Credit Default Swaps auf Unternehmenseitel, Kredite, Staatsanleihen, US-Kommunalanleihen oder US-Schatzpapiere verwendet werden, werden – soweit vorhanden – in der Aufstellung der Wertpapieranlagen ausgewiesen. Sie dienen als Indikator für den gegenwärtigen Status des Zahlungs-/Performancerisikos und stellen die Wahrscheinlichkeit oder das Risiko eines Ausfalls für das Kreditderivat dar. Der implizite Kreditspread einer bestimmten Referenzeinheit reflektiert die Kosten von Schutzkäufen/-verkäufen und kann Vorauszahlungen beinhalten, die zum Abschluss der Vereinbarung geleistet werden müssen. Größere Kreditspreads repräsentieren einen Rückgang der Bonität der Referenzeinheit und eine größere Wahrscheinlichkeit oder ein größeres Risiko für einen Ausfall oder den Eintritt eines anderen Kreditereignisses, wie in den Vereinbarungsbedingungen definiert. Bei Credit Default Swaps für forderungsbesicherte Wertpapiere und Kreditindizes dienen die notierten Marktpreise und die sich daraus ergebenden Werte als Indikator des gegenwärtigen Status des Zahlungs-/Performancerisikos. Eine Erhöhung der Marktwerte auf absoluter Basis im Vergleich mit dem nominellen Betrag des Swaps repräsentieren einen Rückgang der Bonität der Referenzeinheit und eine größere Wahrscheinlichkeit oder ein größeres Risiko für einen Ausfall oder den Eintritt eines anderen Kreditereignisses, wie in den Vereinbarungsbedingungen definiert.

Der maximal mögliche Betrag (nicht abgezinst), den ein Fonds als Sicherungsgeber/Sicherungsnehmer zukünftig unter einem Credit Default Swap eventuell zahlen muss, entspricht dem Nennbetrag der Vereinbarung. Die Nennbeträge aller zum 31. Dezember 2023 ausstehender Credit Default Swaps des Fonds als Sicherungsgeber/-nehmer werden in der Aufstellung der Wertpapieranlagen ausgewiesen. Diese potenziellen Beträge würden teilweise von vorhandenen Restwerten der jeweiligen referenzierten Obligationen, von beim Abschluss der Vereinbarung erhaltenen Vorauszahlungen oder von bei der Abwicklung von Credit Default Swaps (mit dem Fonds in der Position des Sicherungsnehmers), erhaltenen Nettobeträgen ausgeglichen, die der Fonds für die gleiche(n) Referenzeinheit(en) einget.

Währungsswaps Bestimmte Teilfonds können Währungsswap-Vereinbarungen eingehen, um Devisenengagements einzugehen oder die damit verbundenen Risiken zu reduzieren. Währungsswap-Vereinbarungen beinhalten zwei Parteien, die zwei unterschiedliche Währungen mit einer Vereinbarung tauschen, den Tausch zu einem späteren Zeitpunkt zu festgelegten Tauschsätzen umzukehren. Der Tausch von Währungen zum Auflegungsdatum des Kontrakts findet zum aktuellen Kassakurs statt. Der Rücktausch bei Fälligkeit kann zum selben Wechselkurs, zu einem bestimmten Kurs oder zu dem zu diesem Zeitpunkt aktuellen Kassakurs erfolgen. Zinszahlungen erfolgen gegebenenfalls zwischen den Parteien auf der Grundlage von bei der Auflegung des Kontrakts in den beiden Währungen verfügbaren Zinssätzen. Die Laufzeiten für Währungsswaps können sich über viele Berichtszeiträume erstrecken. Währungsswaps werden gewöhnlich mit Geschäfts- und Anlagebanken verhandelt. Einzelne Cross Currency Swaps sehen eventuell keinen Tausch von Kapitalbarmittelflüssen vor, sondern ausschließlich den Tausch von Zinsbarmittelflüssen. Der Tausch von Währungen zum Auflegungsdatum wird separat auf Bruttobasis im Finanzstatus ausgewiesen, wobei der Nennbetrag in der Hauptwährung für die fest- bzw. variabel verzinsliche Komponente jeweils als Forderung bzw. Verbindlichkeit erfasst wird.

Bei Absicherungen von Anteilsklassen werden die realisierten und nicht realisierten Gewinne oder Verluste ausschließlich den betreffenden Anteilsklassen zugeordnet. Die nicht realisierten Gewinne oder Verluste sind in den Finanzderivaten im Finanzstatus ausgewiesen. Im Zusammenhang mit diesen Verträgen können Wertpapiere in Übereinstimmung mit den Bedingungen der jeweiligen Verträge zu Sicherheiten bestimmt werden.

Zinsswaps Bestimmte Teilfonds unterliegen bei der Realisierung ihres Anlageziels einem Zinsrisiko. Da ein Fonds festverzinsliche Anleihen hält, kann der Wert dieser Anleihen sinken, wenn die Zinssätze steigen. Um die Absicherung gegen dieses Risiko zu unterstützen und seine Fähigkeit aufrecht zu erhalten, Einkünfte zu marktüblichen Zinssätzen zu erzielen, darf der Fonds Zinsswaps eingehen. Bei Zinsswaps tauscht der Fonds mit einer anderen Partei deren jeweilige Zinszahlungsverpflichtungen auf den Kapitalnennbetrag. Bestimmte Arten von Zinsswaps können Folgendes beinhalten: (i) Zinssatz-Obergrenzen, bei denen eine Partei zustimmt, gegen eine Prämie in dem Fall Zahlungen an die andere vorzunehmen, dass die Zinssätze einen bestimmten Satz oder eine bestimmte „Obergrenze“ überschreiten, (ii) Zinssatzuntergrenzen, bei denen eine Partei gegen eine Prämie zustimmt, in dem Fall Zahlungen an die andere vorzunehmen, dass die Zinssätze unter einen bestimmten Satz oder „Untergrenze“ fallen, (iii) Zinssatz-Ober- und -Untergrenzen, bei denen eine Partei eine Obergrenze veräußert und eine Untergrenze erwirbt oder umgekehrt, um sich selbst gegen Zinssatzbewegungen zu schützen, die bestimmte Mindest- oder Höchstsätze überschreiten, (iv) abrufbare Zinsswaps, bei denen der Kontrahent

die Swaptransaktion als Ganzes zu Nullkosten und zu einem bestimmten Datum und zu einem Zeitpunkt vor dem Fälligkeitsdatum beenden darf, (v) Spreadsperrn, die es dem Zinsswapverwender erlauben, das Termindifferential (oder den Spread) zwischen dem Zinsswapsatz und einem bestimmten Benchmark festzuschreiben, oder (vi) Basiswaps, bei denen zwei Parteien variable Zinssätze tauschen, die auf unterschiedlichen Geldmärkten basieren.

Total Return Swaps Bestimmte Teilfonds dürfen Total Return Swaps eingehen. Total Return Swaps auf Rohstoffe enthalten Verpflichtungen, bei denen Barmittel auf Basis von Rohstoffkursen gegen entweder feste oder variable Kurse oder Zinssätze getauscht werden. Eine Partei würde in diesem Fall Zahlungen auf Basis des Marktwerts des beteiligten Rohstoffs erhalten und einen festen Betrag zahlen. Total Return Swaps auf Indizes enthalten Verpflichtungen zur Zahlung von Zinsen im Tausch gegen einen marktgebundenen Ertrag. Ein Kontrahent zahlt den Gesamtertrag eines bestimmten Referenzvermögenswerts aus. Dabei kann es sich um eine Aktie, einen Index oder eine Anleihe handeln. Im Gegenzug erhält er regelmäßige Zahlungsflüsse. In dem Umfang, in dem der Gesamtertrag eines Basiswertpapiers oder -index die Abwicklungszinsverpflichtung übertrifft oder unterschreitet, erhält der Fonds eine Zahlung vom Kontrahenten bzw. leistet eine Zahlung an den Kontrahenten.

Bestimmte Fonds dürfen in Total Return Equity Swaps („Aktienwaps“) anlegen. Aktienwaps können eingesetzt werden, um einen Gewinn abzusichern oder um einen Verlust zu vermeiden, der aus Schwankungen im Wert oder Kurs von Aktien oder Finanzinstrumenten oder einem Index aus diesen Aktien oder Finanzinstrumenten herrührt. Bei einem Aktienwap handelt es sich um ein derivatives Instrument, das die wirtschaftliche Wertentwicklung und den Kapitalfluss einer traditionellen Aktienanlage nachbilden soll.

Das Aktienwaps eigene Risiko hängt von der Position eines Fonds bei einer Transaktion ab: wenn ein Fonds Aktien-Swaps einsetzt, kann er sich in eine Long Position zum Basiswert bringen. In diesem Fall profitiert der Fonds von allen Wertzunahmen der Basisaktie und erleidet jede Wertabnahme. Die einer Long Position eigenen Risiken gleichen den mit dem Kauf der Basisaktie einhergehenden Risiken. Umgekehrt kann sich der Fonds in eine Short Position zum Wert der Basisaktie bringen. In diesem Fall profitiert der Fonds von allen Kursverfällen der Basisaktie und erleidet Verluste aus etwaigen Kurszunahmen. Die mit einer Short Position einhergehenden Risiken sind größer als die einer Long Position: Während es bei einer Long Position einen maximalen Höchstverlust gibt, wenn die Basisaktie mit null bewertet wird, entspricht der maximale Verlust aus einer Short Position der Wertzunahme der Basisaktie. Diese Zunahme ist theoretisch unbegrenzt.

Allerdings ist anzumerken, dass die Short bzw. Long Position eines Aktienwaps auf dem Urteil der Anlageberatungsgesellschaften über die zukünftige Richtung des Basiswertpapiers beruht. Die Position könnte sich nachteilig auf die Wertentwicklung des Fonds auswirken.

Volatilitäts-Swapvereinbarungen sind auch als auch Forward-Volatility-Agreement bekannt und sind Vereinbarungen, in deren Rahmen sich die Kontrahenten zu Zahlungen im Zusammenhang mit Veränderungen der Volatilität (d. h. des Ausmaßes der Veränderungen innerhalb eines festgelegten Zeitraums) eines zugrunde liegenden referenzierten Instruments verpflichten, beispielsweise einer Währung, eines Zinssatzes, eines Index, eines Wertpapiers oder eines anderen Finanzinstruments. Volatilitätsswaps gestatten den Parteien den Versuch, das Volatilitätsrisiko abzusichern und/oder Positionen in der prognostizierten künftigen Volatilität eines zugrunde liegenden referenzierten Instruments einzugehen. Der Fonds kann beispielsweise einen Volatilitätsswap eingehen, um eine Position darauf zu bilden, dass die Volatilität des referenzierten Instruments über einen bestimmten Zeitraum steigen wird. Wenn die Volatilität des referenzierten Instruments in dem festgelegten Zeitraum steigt, erhält der Fonds von dem Kontrahenten eine Zahlung auf Basis des Betrags, um den die realisierte Volatilität des referenzierten Instruments ein zwischen den Parteien vereinbartes Volatilitätsniveau übersteigt. Wenn die Volatilität des referenzierten Instruments in dem festgelegten Zeitraum nicht steigt, leistet der Fonds an den Kontrahenten eine Zahlung auf Basis des Betrags, um den die realisierte Volatilität des referenzierten Instruments unter das zwischen den Parteien vereinbarte Volatilitätsniveau sinkt. Zum Fälligkeitsdatum wird ein Nettokapitalfluss getauscht, wobei der Auszahlungsbetrag der Differenz zwischen der realisierten Kursvolatilität des referenzierten Instruments und dem Ausübungskurs multipliziert mit dem Nennbetrag entspricht. Als Empfänger der realisierten Preisvolatilität erhält der Fonds den Auszahlungsbetrag, wenn die realisierte Kursvolatilität des referenzierten Instruments höher ist als der Strike, bzw. muss den Auszahlungsbetrag zahlen, wenn die Volatilität niedriger ist als der Strike. Als Zahler der realisierten Preisvolatilität muss der Fonds den Auszahlungsbetrag zahlen, wenn die realisierte Kursvolatilität des referenzierten Instruments höher ist als der Strike, bzw. erhält den Auszahlungsbetrag, wenn die Volatilität niedriger ist als der Strike.

Zahlungen auf einen Volatilitätsswap sind höher, wenn sie auf dem mathematischen Quadrat der Volatilität beruhen (d. h. der mit sich selbst multiplizierten gemessenen Volatilität, als „Varianz“ bezeichnet). Diese Art von Volatilitätsswap wird häufig als Varianzswap bezeichnet.

7. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG

Innerhalb der durch die Anlageziele und Anlagepolitik der Fonds und nach Maßgabe der von der Zentralbank jeweils festgesetzten Grenzen und des laut Prospektbestimmungen erlaubten Umfangs können die Finanzderivate und Anlagetechniken von allen Fonds für eine effiziente Portfolioverwaltung eingesetzt werden. Die Fonds können diese Finanzderivate und Anlagetechniken zur Absicherung gegen Zinsänderungen, Devisenkursänderungen in anderen Währungen als der Funktionswährung, gegen Änderungen in Wertpapierkursen oder als Teil ihrer allgemeinen Anlagestrategie einsetzen.

Der durch die Pensionsgeschäfte im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 entstandene Zinsertrag/(-aufwand) betrug insgesamt 429.491.320 USD/(4.038.069 USD) (31. Dezember 2022: 155.496.772 USD/(296.154 USD)).

Der durch die umgekehrten Pensionsgeschäfte im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 entstandene Zinsertrag/(-aufwand) betrug insgesamt 979.244 USD/(149.866.376 USD) (31. Dezember 2022: 9.791.008 USD/(45.026.160 USD)).

Der durch die Sale-Buyback-Geschäfte im Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 entstandene Zinsertrag/(-aufwand) betrug insgesamt 1.074 USD/(7.634.491 USD) (31. Dezember 2022: 950 USD/(6.496.889 USD)).

8. BESTEUERUNG

Nach geltendem Recht und herrschender Praxis qualifiziert sich die Gesellschaft als Investmentgesellschaft gemäß Definition in § 739B des Taxes Consolidation Act von 1997 in seiner jeweils geltenden Fassung, solange sie in Irland ansässig ist. Auf dieser Basis ist sie für ihre Erträge und Kapitalgewinne in Irland nicht steuerpflichtig. Bei Eintritt eines „steuerpflichtigen Ereignisses“ kann jedoch in Irland eine Steuer anfallen. Ein steuerpflichtiges Ereignis schließt alle Ausschüttungszahlungen an Anteilinhaber und alle Einlösungen, Rücknahmen, Stornierungen, Übertragungen oder fiktiven Veräußerungen (eine fiktive Veräußerung tritt bei Ablauf eines entsprechenden Zeitraums ein) von Anteilen sowie die Vereinnahmung oder Löschung von Anteilen eines Anteilinhabers durch die Gesellschaft, um den auf einen sich aus einer Übertragung ergebenden Gewinn zu zahlenden Steuerbetrag zu begleichen.

Die Gesellschaft unterliegt in Irland keiner Steuer bei steuerpflichtigen Ereignissen mit Bezug auf:

- Anteilinhaber, die im steuerlichen Sinne zum Zeitpunkt des steuerpflichtigen Ereignisses nicht in Irland ansässig oder gewöhnlich ansässig sind, vorausgesetzt, dass dem Fonds die erforderlichen, unterzeichneten Erklärungen gemäß den Bestimmungen des Taxes Consolidation Act, 1997 in seiner jeweils geltenden Fassung vorliegen, dem Fonds keine Informationen vorliegen, die in angemessener Weise darauf hindeuten, dass die entsprechenden darin enthaltenen Angaben sachlich nicht mehr zutreffend sind, oder der Fonds von der irischen Steuerbehörde bevollmächtigt wurde, mangels entsprechender Erklärungen Brutto-Zahlungen vorzunehmen;
- bestimmte steuerbefreite, in Irland ansässige Anleger, die der Gesellschaft die erforderlichen, unterzeichneten gesetzlichen Erklärungen vorgelegt haben.
- bei Transaktionen in Bezug auf Anteile, die in einem von den Revenue Commissioners benannten anerkannten Clearingsystem gehalten werden;
- eines Tausches von Anteilen eines Teilfonds in Anteile eines anderen Teilfonds des Fonds;
- es zu einem Austausch von Anteilen auf Grund einer qualifizierenden Verschmelzung oder Restrukturierung des Fonds mit einem anderen Fonds kommt; und
- bestimmter Formen des Anteiltausches zwischen Ehegatten und ehemaligen Ehegatten.

Wurde keine angemessene Erklärung vorgelegt, unterliegt der Fonds bei Eintritt eines Steuertatbestandes der irischen Steuer.

Die Vorschriften für Anlageorganismen sehen vor, dass die Steuerbehörden Investmentfonds, die außerhalb Irlands vermarktet werden, die Genehmigung erteilen können, Zahlungen an nicht in Irland ansässige Anteilinhaber ohne Abzug der irischen Steuer zu leisten, wenn keine maßgebliche Erklärung vorliegt, sofern die vorgeschriebenen „äquivalenten Maßnahmen“ getroffen werden. Ein Fonds, der zugelassen werden möchte, muss dies schriftlich bei den Finanzkommissaren beantragen und die Einhaltung der betreffenden Bedingungen bestätigen.

Dividenden, Zinsen und Kapitalerträge (soweit zutreffend), die der Gesellschaft hinsichtlich ihrer Anlagen (mit Ausnahme von Wertpapieren irischer Emittenten) zufließen, können in den Ländern, in denen sich die Emittenten der Anlagen befinden, steuerpflichtig sein und unter anderem der Quellensteuer unterliegen. Es ist davon auszugehen, dass die Gesellschaft keinen Anspruch auf reduzierte Quellensteuersätze nach den Doppelbesteuerungsabkommen zwischen Irland und diesen Ländern hat. Falls sich diese Rechtslage ändert und die Anwendung eines reduzierten Steuersatzes zu Steuererstattungen an die Gesellschaft führt, werden die Nettoinventarwerte nicht rückwirkend geändert. Vielmehr wird die Erstattung anteilig auf die zum Zeitpunkt der Erstattung bestehenden Anteilinhaber verteilt.

In Übereinstimmung mit dem von der britischen Steuerbehörde United Kingdom HM Revenue and Customs eingeführten, neuen Regelwerk für Reporting Funds wird jede einzelne Anteilsklasse zu Zwecken der Besteuerung in Großbritannien als eigenständiger „Offshore-Fonds“ betrachtet. Das Regelwerk für Reporting Funds lässt zu, dass ein Offshore-Fonds beim HM Revenue and Customs vorab um Zulassung für die Behandlung als „Reporting Fund“ ersuchen kann. Sobald ein Offshore-Fonds den Status eines Reporting Fund erhalten hat, behält er diesen Status, so lange er die Bedingungen für einen Reporting Fund erfüllt, ohne dass er dafür die erneute Zulassung bei der HM Revenue and Customs beantragen muss. Jede Anteilsklasse der Gesellschaft wird als Reporting Fund behandelt. Dies wurde von HM Revenue and Customs genehmigt.

Die Mindestbesteuerungsrichtlinie sieht eine EU-weite Umsetzung der Regeln der zweiten Säule des Inclusive Framework on Base Erosion Profit Shifting („BEPS“) der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung („OECD“) vor. Die Rechtsvorschriften zur zweiten Säule wurden in Irland erlassen und gelten für das am 01. Januar 2024 beginnende Geschäftsjahr. Die Gesellschaft erfüllt die Definition einer Investmentgesellschaft gemäß den Regeln der zweiten BEPS-Säule und die darin enthaltene Klausel, die die Steuerneutralität von Investmentfonds schützen soll. Damit ist die Gesellschaft von den quantitativen Offenlegungen gemäß der zweiten BEPS-Säule sowie von den Anforderungen der Qualified Domestic Minimum Top-up Tax („QDMTT“) ausgenommen.

9. DIVIDENDENAUSCHÜTTUNGSPOLITIK

Wie in der jeweiligen Fondsergänzung angegeben, können Dividendenausschüttungen festgesetzt werden auf:

- Nettokapitalerträge, die aus Zinsen und Dividenden abzüglich Aufwendungen bestehen.
- Realisierte Gewinne aus der Veräußerung von Anlagen abzüglich realisierter und nicht realisierter Verluste (einschließlich Gebühren und Aufwendungen). Für den Fall, dass die bei der Veräußerung von Anlagen realisierten Gewinne abzüglich der realisierten und nicht realisierten Verluste negativ sind, können die Fonds dennoch Dividenden aus den Nettokapitalerträgen und/oder Kapital bezahlen.
- Andere Mittel (einschließlich Kapital), die nach dem Gesetz aus dem betreffenden Fonds bzw. der betreffenden 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 Klassen Income II kann der Verwaltungsrat in seinem Ermessen entscheiden, die Gebühren aus dem Kapital zu bezahlen und das Renditedifferenzial zwischen den jeweiligen abgesicherten Anteilsklassen und den grundlegenden Anteilsklassen zu berücksichtigen (was einer Ausschüttung aus dem Kapital entspricht). Das Renditedifferenzial kann positiv oder negativ sein und wird unter Berücksichtigung des Beitrags der Anteilsklassenbesicherung aus den besicherten Klassen berechnet.

Im Fall der Anteilsklassen M Retail, des PIMCO Asia High Yield Bond Fund, des Asia Strategic Interest Bond Fund, des Euro Income Bond Fund, des Euro Short-Term Fund, des Income Fund, des Low Duration Income Fund, des Mortgage Opportunities Fund und des US Short-Term Fund werden, mit Ausnahme der Anteilsklassen G Institutional, G Retail, Class E ausschüttend Q, Class E ausschüttend II Q und Investor ausschüttend A, Dividendenausschüttungen monatlich festgesetzt und je nach Wahl des Anteilinhabers monatlich in bar ausgezahlt oder in zusätzliche Anteile reinvestiert.

Für die Administrative Classes des Diversified Income Fund, BE Retail, BM Retail, BN Retail, M Retail and N Retail, werden Dividendenausschüttungen monatlich festgesetzt und je nach Wahl des Anteilinhabers monatlich in bar ausgezahlt oder in zusätzliche Anteile reinvestiert.

Für die Klassen G Institutional, G Retail und Investor ausschüttend A werden Dividendenausschüttungen jährlich festgesetzt und je nach Wahl des Anteilinhabers jährlich in bar ausgezahlt oder in zusätzliche Anteile reinvestiert.

Im Falle aller anderen Teilfonds mit ausschüttenden Anteilklassen werden Ausschüttungen vierteljährlich festgesetzt und werden, abhängig von der Entscheidung des Anteilhabers, in bar ausgezahlt oder nach der Erklärung in zusätzliche Anteile reinvestiert.

Bei den Klassen BM Retail Decumulation und M Retail Decumulation kann der Verwaltungsrat nach eigenem Ermessen Ausschüttungen und Gebühren aus dem Kapital zahlen. Verwaltungsgebühren und andere Gebühren oder ein Teil davon können dem Kapital der BM Retail Decumulation und M Retail Decumulation Classes belastet werden, so dass es zu einer Erosion des Kapitals und zur Erzielung von Erträgen kommen kann, indem auf das Potenzial für zukünftiges Kapitalwachstum verzichtet wird.

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 Anteilhabern 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 Anteilhaber können sich entscheiden, die Dividendenausschüttungen in zusätzliche Anteile zu reinvestieren oder sich die Dividendenausschüttungen bar auszahlen zu lassen, indem sie das entsprechende Kästchen im Antragsformular auswählen. Für die nachfolgenden Fonds wurde ein Teil der Dividendenausschüttungen gemäß der Betriebsergebnisrechnung aus dem Kapital gezahlt (Angaben in Tausend):

Fonds	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2023	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022
PIMCO Balanced Income and Growth Fund	\$ 1.571	\$ 2.887
PIMCO Capital Securities Fund	311	30
PIMCO Climate Bond Fund	94	1
Diversified Income Fund	2.113	5.609
Diversified Income Duration Hedged Fund	1.240	524
Dynamic Bond Fund	811	237
Dynamic Multi-Asset Fund	€ 434	€ 4.339
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	\$ 2	\$ 0
Global Bond Fund	549	824
Global Bond ESG Fund	209	0
Global High Yield Bond Fund	501	124
Global Investment Grade Credit Fund	1.892	0
Global Investment Grade Credit ESG Fund	461	0
Global Low Duration Real Return Fund	1.172	131
Global Real Return Fund	5.083	805
Income Fund	9.861	3.564
Low Average Duration Fund	15	19
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	13	0
Low Duration Opportunities Fund	1.716	644
Strategic Income Fund	1	0
Total Return Bond Fund	0	104
UK Corporate Bond Fund	£ 363	£ 247
UK Long Term Corporate Bond Fund	9	69
US High Yield Bond Fund	1	0

10. SOFT COMMISSIONS

Die Gesellschaft bzw. ihre Anlageberatungsgesellschaft kann Transaktionen im Namen der Fonds über oder mit Unterstützung von Ausführungsmaklern durchführen, die zusätzlich zur routinemäßigen Order-Ausführung gelegentlich Güter, Dienstleistungen oder andere Vorteile wie etwa Research- und Beratungsdienste für die Gesellschaft oder ihre Beauftragten bereitstellen oder beschaffen können. Die Gesellschaft bzw. ihre Anlageberatungsgesellschaft kann diesen Brokern Full-Service-Provisionssätze zahlen, die teilweise für die Bereitstellung zulässiger Güter oder Dienstleistungen verwendet werden können. Diejenigen Anlageberatungsgesellschaften, bei denen es sich um Wertpapierfirmen handelt, die der Richtlinie über Märkte für Finanzinstrumente („MiFID“) unterliegen oder die gleichwertigen aufsichtsrechtlichen Bestimmungen unterworfen sind, müssen Research-Leistungen Dritter, die sie im Zusammenhang mit der Verwaltung des Vermögens der einzelnen Fonds kaufen, direkt aus ihren eigenen Mitteln bezahlen.

11. GETRENNTE HAFTUNG

Die Gesellschaft ist eine offene Investmentgesellschaft des Umbrella-Typs mit variablem Kapital und Haftungstrennung zwischen ihren Teilfonds. Dementsprechend sind etwaige Verbindlichkeiten, die im Namen eines Teilfonds der Gesellschaft entstanden oder diesem zuzuordnen sind, ausschließlich aus den Vermögenswerten des betreffenden Teilfonds zu begleichen, und weder die Gesellschaft noch ein Verwaltungsratsmitglied, Konkursverwalter, Revisor, Insolvenzverwalter, kommissarischer Insolvenzverwalter oder eine sonstige Personen dürfen die Vermögenswerte dieses Teilfonds zum Ausgleich von Verbindlichkeiten im Namen eines anderen Teilfonds der Gesellschaft verwenden oder sind verpflichtet, sie hierzu zu verwenden, unabhängig davon, wann diese Verbindlichkeit entstanden ist.

12. ÄNDERUNGEN AM PROSPEKT, AN DER ERGÄNZUNG, AN DER GRÜNDUNGSURKUNDE UND DER SATZUNG

Am 03. Januar 2023 wurden die Ergänzungen für den Income Fund II und den Low Duration Income Fund aktualisiert, um die Angaben zum Verzicht auf die Verwaltungsgebühr zu ändern. Am selben Tag wurden die Ergänzungen für den PIMCO Balanced Income and Growth Fund, den PIMCO Capital Securities Fund, den Dynamic Multi Asset Fund, den Euro Bond Fund, den Euro Credit Fund, den Euro Income Bond Fund, den Euro Long Average Duration Fund, den UK Corporate Bond Fund und den UK Long Term Corporate Bond Fund aktualisiert, um die Handelstage zu ändern.

Am 18. Januar 2023 wurden die Ergänzungen für den Euro Short-Term Fund und den PIMCO European Short-Term Opportunities Fund aktualisiert, um die Angaben zum Verzicht auf die Verwaltungsgebühr zu ändern.

Am 19. April 2023 wurden die Ergänzungen für den PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund, den Inflation Multi-Asset Fund und den PIMCO Balanced Income and Growth Fund aktualisiert, um die Anlagepolitik dahingehend zu ändern, dass die Fonds bis zu 20 % ihres Nettovermögens in strukturierte Schuldverschreibungen investieren können, wie in den Ergänzungen näher beschrieben. Durch die strukturierten Schuldverschreibungen wird sich die Anlagepolitik nicht wesentlich ändern. Sie sollen dazu dienen, sich in Sektoren zu engagieren, die bereits in der Anlagepolitik vorgesehen sind.

Am 16. Mai 2023 wurde die Ergänzung für den StocksPLUS™ Fund aktualisiert, um die Anlagerichtlinie zu streichen, die besagt, dass der Fonds zu mindestens 50 % in festverzinslichen Wertpapieren investiert sein soll, deren Abwicklung am selben Tag erfolgt. Am selben Datum wurde die Ergänzung für den PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund aktualisiert, um klarzustellen, dass nicht alle Energiesektoren im Anlageuniversum des Fonds für Rohstoffe vertreten sind.

Am 02. Juni 2023 wurde die Ergänzung für den PIMCO Climate Bond Fund aktualisiert, um die Angaben zum Verzicht auf die Verwaltungsgebühr zu ändern.

Am 30. Juni 2023 wurde die Ergänzung für den Euro Credit Fund aktualisiert, um die Angaben zum Verzicht auf die Verwaltungsgebühr zu ändern.

Am 01. September 2023 wurde die Ergänzung für den Euro Short-Term Fund aktualisiert, um die vom Fonds verwendete Benchmark zu ändern.

Am 11. September 2023 wurden die Ergänzungen für den Diversified Income ESG Fund, den Emerging Local Bond ESG Fund, den Emerging Markets Bond ESG Fund, den PIMCO ESG Income Fund, den Global Bond ESG Fund, den Global Investment Grade Credit ESG Fund und den Low Duration Opportunities ESG Fund aktualisiert, um die Anlagepolitik zu ändern. Die Anlagepolitik wurde aktualisiert, um vorzusehen, dass die Fonds in Indexderivate wie Credit Default Swaps investieren können, die ein indirektes Engagement in ausgeschlossenen Emittenten bieten können. Außerdem wurde sie aktualisiert, um die Ausschlussstrategie der Fonds im Einklang mit der Nachhaltigkeits-Ausschlusspolitik von PIMCO Global Advisors (Ireland) Limited (PGAIL) zu ändern, die auf der Website von PGAIL bereitgestellt wurde, und um die bestehende Offenlegung in Bezug auf das Emittentenengagement zu verdeutlichen.

Am 29. September 2023 wurden die Ergänzungen für den Euro Bond Fund, den Euro Credit Fund, den Euro Income Bond Fund, den PIMCO Capital Securities Fund, den Dynamic Multi-Asset Fund, den Euro Short-Term Fund, den Global Real Return Fund und den Global Low Duration Real Return Fund dahingehend aktualisiert, dass sie die Bewerbung sozialer Merkmale vorsehen, indem die Ausschlussliste des Fonds um den Militärwaffen Sektor und die Tabakindustrie erweitert wurde. Außerdem wurden die bestehenden Offenlegungen in Bezug auf das Emittentenengagement weiter verdeutlicht.

Am gleichen Tag wurde die Ergänzung für den PIMCO European High Yield Bond Fund aktualisiert, um ausdrücklich darauf hinzuweisen, dass der Fonds ökologische und soziale Merkmale bewerten wird, indem er verbindliche ESG-Kriterien für die Auswahl der zugrunde liegenden Vermögenswerte einführt, die mit den aktuellen Anlagestrategien des Fonds einhergehen. Die Ergänzung des Fonds wurde aktualisiert, um einen vorvertraglichen Anhang aufzunehmen, wie in der Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor vorgeschrieben.

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

Am 29. November 2023 wurde die Ergänzung für den PIMCO Global Core Asset Allocation Fund aktualisiert, um den Fonds nach Genehmigung durch die Aufsichtsbehörden in „PIMCO Balanced Income and Growth Fund“ umzubenennen. Zusätzlich zur Namensänderung und wie den Anteilhabern mitgeteilt, wurde die Ergänzung aktualisiert, um bestimmte nicht wesentliche Änderungen an der Anlagepolitik wiederzugeben.

Am selben Datum wurden die Ergänzungen für den Diversified Income Fund, den Emerging Markets Bond Fund und den Global Investment Grade Credit Fund aktualisiert, um einen neuen Anteilsklassen-Typ zu erstellen, der als „Decumulation“-Anteilsklasse bezeichnet wird. Zu den „Decumulation“-Anteilsklassen gehören auch die Anteilsklassen M Retail Decumulation und BM Retail Decumulation. Zusätzlich wurde auch die Anteilsklasse BM Retail in die Ergänzung für den Global Investment Grade Credit Fund aufgenommen.

Die Gründungsurkunde und die Satzung des Unternehmens wurden am 13. September 2023 geändert, um gemäß der Satzung die Flexibilität zu schaffen, (i) gewinnberechtigende ETF-Anteilsklassen einzurichten; dabei handelt es sich um gewinnberechtigende Anteile, die den ganzen Tag über an mindestens einem geregelten Markt oder multilateralen Handelssystem gehandelt werden, und (ii) gewinnberechtigende Nicht-ETF-Anteilsklassen einzurichten; dabei handelt es sich um gewinnberechtigende Anteile, die nicht den ganzen Tag über gehandelt werden.

13. GEBÜHREN UND KOSTEN

(a) An die Verwaltungsgesellschaft zu zahlende Gebühren

Mit Ausnahme der BN Retail-Anteile, der BM Retail-Anteile und der BE Retail-Anteile, wie in der entsprechenden Fondsergänzung offengelegt, darf die Gesamtgebühr 2,50 % p. a. des Nettoinventarwerts des jeweiligen Fonds nicht übersteigen.

(b) Verwaltungsgebühr

Die Verwaltungsgesellschaft erbringt oder beschafft für jeden Fonds, wie im Prospekt beschrieben, Anlageberatungs-, Administrations-, Verwahr- und andere Dienstleistungen, wofür jeder Fonds eine einzelne Managementgebühr an die Verwaltungsgesellschaft zahlt. Die Verwaltungsgebühr (wie im 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 Klassen E, G Retail, M Retail, N Retail, T (%)	Class R (%)	Class W (%)
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 Balanced Income and Growth Fund ⁽¹⁾	0,95	1,12	2,15	k. A.	k. A.
PIMCO Capital Securities Fund	0,79	k. A.	1,69	0,93	k. A.
PIMCO Climate Bond Fund	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⁾	0,80	k. A.	1,70	k. A.	k. A.
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	0,85	k. A.	1,75	k. A.	k. A.

	Klassen Inst'l, G Inst'l, Inv, Admin (%)	H Inst'l (%)	BE Retail BM Retail BN Retail Klassen E, G Retail, M Retail, N Retail, T (%)	Class R (%)	Class W (%)
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.	1,36	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.
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.
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	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 ⁽⁶⁾	0,45	0,62	0,85	k. A.	k. A.

- Die obige Zahl für die M Retail Class berücksichtigt nicht den Gebührenverzicht der Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,55 %, wodurch sich die Verwaltungsgebühr der M Retail Class bis zum 28. November 2028 auf 1,60 % reduziert. Die obige Zahl für die BM Retail Class berücksichtigt nicht den Gebührenverzicht der Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,55 %, wodurch sich die Verwaltungsgebühr der BM Retail Class bis zum 28. November 2028 auf 2,60 % reduziert. Der Gebührenverzicht endet am 29. November 2028.
- Diese Zahl berücksichtigt den Gebührenverzicht der Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,05 % für die Investor Class vom 31. Mai 2021 bis 31. Mai 2023. Der Gebührenverzicht endete am 1. Juni 2023.
- Bei allen Klassen wird bei dieser Zahl ein Gebührenverzicht der Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,15 % p. a. berücksichtigt (vor dem 01. Juni 2023 betrug dieser Gebührenverzicht 0,30 % p. a.). Der Gebührenverzicht läuft zum 1. Juni 2024 ab und kann sich bis zu dem Zeitpunkt verlängern, zu dem die Verwaltungsgesellschaft durch vorherige schriftliche Mitteilung an die Anteilhaber des Fonds entscheidet, diese Gebühr aufzuheben oder künftig nicht mehr anzuwenden.
- Bei der Class H Institutional wird ein Gebührenverzicht der Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,25 % p. a. berücksichtigt zum 30. Juni 2023. Der Gebührenverzicht endet am 1. Juli 2024.
- Die Sätze der Klassen Institutional und E berücksichtigen einen Gebührenverzicht der Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,11 % p. a. ab dem 31. Mai 2021. Der Gebührenverzicht endet am 19. Januar 2025.
- Die Sätze der Klassen Institutional und H Institutional berücksichtigen einen Gebührenverzicht der Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,14 % p. a. Der Satz der Class E berücksichtigt einen Gebührenverzicht der Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,54 % p. a. Der Gebührenverzicht läuft am 18. Januar 2025 ab.
- In den Gebühren für die Anteilsklassen Class E, G Retail und M Retail wird ein Gebührenverzicht des Managers in Höhe von 0,30 % p. a. berücksichtigt, der sich bis zu dem Zeitpunkt verlängert, zu dem der Manager durch vorherige schriftliche Mitteilung an die Anteilhaber des Teilfonds entscheidet, diesen Gebührenverzicht künftig nicht mehr anzuwenden oder zu reduzieren.

Die Verwaltungsgebühren aller Fonds blieben mit Ausnahme der oben angeführten Änderungen an den Gebührenverzichteten gegenüber dem 31. Dezember 2022 unverändert.

Die Verwaltungsgebühr für die Anteilsklassen H Institutional, BE Retail, BM Retail, BN Retail, E, G Retail, M Retail, N Retail and T fällt allgemein höher aus als die Verwaltungsgebühr für die anderen Anteilsklassen. Aus dieser höheren Gebühr kann die Verwaltungsgesellschaft die Kosten für Vertriebs-, Mittler- oder andere Dienste begleichen, die Vertriebsstellen, Wertpapierhändler, Banken, Finanzintermediäre oder andere Intermediäre den 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 Verwaltungsgesellschaft 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 Class Z wird in der Betriebsergebnisrechnung keine Verwaltungsgebühr ausgewiesen (die Class Z werden primär für andere Fonds der Gesellschaft oder für Direktanlagen durch institutionelle Anleger angeboten, die mit den Anlageberatungsgesellschaften oder einem verbundenen Unternehmen von PIMCO eine Anlageverwaltungsvereinbarung oder sonstige Vereinbarung abgeschlossen haben). Um doppelte Gebühren zu vermeiden, wird die Verwaltungsgebühr für die Class Z auf 0,00 % pro Jahr festgesetzt.

(c) Anlageberatungsdienste

Im Namen der Gesellschaft erbringt bzw. veranlasst die Verwaltungsgesellschaft Anlageberatungsdienstleistungen. Zu diesen Dienstleistungen gehören die Anlage und Wiederanlage der Vermögenswerte jedes Fonds. Die Gebühren der Anlageberatungsgesellschaften (zuzüglich gegebenenfalls hierauf anfallender MwSt.) werden von der Verwaltungsgesellschaft aus der Verwaltungsgebühr beglichen.

(d) Administrations-, Verwahr- sowie sonstige Dienste

Im Namen der Gesellschaft erbringt bzw. veranlasst die Verwaltungsgesellschaft Administrations-, Verwahr- und sonstige Dienste. Zu diesen Dienstleistungen gehören Administrations- und Transferstellenfunktionen, Fondsbuchhaltung sowie die Funktion als Verwahrstelle und Unterverwahrstelle in Bezug auf die einzelnen Fonds. Die Gebühren und Aufwendungen des Administrators und der Verwahrstelle (zuzüglich gegebenenfalls hierauf anfallender MwSt.) werden von der Verwaltungsgesellschaft aus der Verwaltungsgebühr bzw. von den Anlageberatungsgesellschaften gezahlt.

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 Teilfonds 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 Geschäftsjahres zum 31. Dezember 2023 Honorare in Höhe von 180.000 EUR (31. Dezember 2022: €180.000). Darüber hinaus werden jedem unabhängigen Verwaltungsratsmitglied alle angemessenen Auslagen erstattet. Nicht unabhängige Verwaltungsratsmitglieder haben keinen Anspruch auf eine gesonderte Vergütung für ihre Tätigkeit als Verwaltungsratsmitglied der Gesellschaft. Die Verwaltungsratsgehälter sind in den „Sonstigen Aufwendungen“ der Betriebsergebnisrechnung enthalten.

In der folgenden Tabelle sind die der Gesellschaft während der Geschäftsjahre zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 von den Abschlussprüfern berechneten Gebühren aufgeführt. Die Gebühren in der nachstehenden Tabelle verstehen sich zuzüglich Mehrwertsteuer.

Vergütung des Abschlussprüfers	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022
Prüfung von Gesellschaftsabschlüssen	€ 661.598	€ 636.152
Sonstige Sicherungsdienste	0	0
Steuerberatung	0	0
Dienste außerhalb der Abschlussprüfung	0	0

Servicegebühr Die Servicegebühr, die ausschließlich für die Investor Classes anfällt, ist an die Verwaltungsgesellschaft zu zahlen und darf verwendet werden, um Wertpapierhändler, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre zu vergüten, die Dienste im Zusammenhang mit dem Vertrieb und der Vermarktung von Anteilen erbringen und/oder für die Erbringung bestimmter 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 Anteilhaber der Investor Classes. Alle Anteilhaber 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 Anteilhaber sowie die Führung sonstiger Unterlagen, die für die Anlage der Anteilhaber im Fonds relevant sind.

Pläne oder Programme, die Fondsanteile als Finanzierungsmittel verwenden, können fondsgebundene Versicherungsprodukte sowie Pensions-, Altersversorgungs- oder Sparpläne von Arbeitgebern beinhalten. Alle Anteilhaber der Investor Classes erhalten Dienstleistungen entsprechend den Vereinbarungen mit den Finanzintermediären, mit denen die Anteilhaber ein Dienstleistungsverhältnis unterhalten. Die Servicegebühr errechnet sich jährlich aus 0,35 % des NIW des jeweiligen Fonds, der auf die Investor Classes entfällt. Der Satz der Servicegebühren blieb in den Geschäftsjahren zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 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 Classes ist zahlbar an die Vertriebsstelle für persönliche Dienstleistungen, die sie den Anteilhabern der Fonds erbringt, und für die Führung der Anteilhaberkonten, einschließlich der Vergütung und der Aufwendungen (einschließlich Telefonkosten und Gemeinkosten) von Finanzberatern und sonstigen Mitarbeitern beteiligter oder involvierter Händler, bestimmter Banken oder anderer Finanzintermediäre, die bei der Abwicklung von Kauf- oder Rücknahmeanträgen oder der Abwicklung von Dividendenzahlungen unterstützend tätig sind, den Anteilhabern regelmäßig Informationen über ihre Beteiligung an den Fondsanteilen liefern, Informationen von der Gesellschaft an die Anteilhaber weitergeben, laufende Beratungsleistungen in Bezug auf die Eignung bestimmter vom Fonds angebotener Anlagemöglichkeiten vor dem Hintergrund der Anteilhaberanforderungen erbringen, Anfragen der Anteilhaber zu diesen Diensten beantworten oder Mitarbeiter für die Erbringung derartiger Dienste schulen.

Die Vertriebsstelle erbringt diese Dienste direkt oder indirekt über Wertpapierhändler, Banken, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre für alle Inhaber von Administrative Classes. Die Bestandspflegegebühr wird auf der Grundlage von 0,50 % p. a. des auf die Administrative Classes entfallenden NIW der einzelnen Fonds berechnet, mit Ausnahme des StocksPLUS™ Fund, bei dem sie auf der Grundlage von 0,75 % p. a. berechnet wird. Die Bestandspflegegebühr für die einzelnen Fonds läuft an jedem Handelstag auf und ist monatlich rückwirkend zahlbar. Die Vertriebsstelle darf zu ihrer eigenen Verwendung etwaige Bestandspflegegebühren ganz oder teilweise einbehalten, die nicht an Wertpapierhändler, Banken, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre zu zahlen sind.

Der Satz für die Bestandspflegegebühren blieb in den Geschäftsjahren zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 unverändert.

(e) Vertriebsgebühr

Die Vertriebsgebühr, die für die Anteile der Klassen T, BN Retail, BM Retail und BE Retail anwendbar ist, wird an die Vertriebsstelle für Dienstleistungen bezahlt, die diese Anteilinhabern der Fonds erbracht hat.

Die Vertriebsstelle erbringt diese Dienste direkt oder indirekt über Wertpapierhändler, Banken, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre für alle Inhaber von Anteilen der Class T. Die Vertriebsgebühr errechnet sich aus 0,40 % p. a. des NIW des jeweiligen Fonds, der auf die Anteile der Class T entfällt, außer in Bezug auf den PIMCO Asia High Yield Bond Fund, den PIMCO Credit Opportunities Bond Fund, den Dynamic Bond Fund, den Euro Bond Fund, den Global Bond Fund, den Global Bond ESG Fund, den Global Bond Ex-US Fund, den Global Low Duration Real Return Fund, den Global Real Return Fund, den Low Duration Opportunities Fund, den PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund und den Total Return Bond Fund. Für diese Fonds wird eine Vertriebsgebühr in Höhe von 0,30 % p. a. des NIW bezahlt, der den Anteilen der Class T zuzurechnen ist.

Lediglich in Bezug auf die Anteilsklassen BE Retail, BM Retail und BN Retail kann die Vertriebsgebühr, sofern in der entsprechenden Ergänzung angegeben, bis zu 1 % des NIW betragen, so dass die Gesamtgebühr 2,50 % des NIW übersteigen kann.

Die Vertriebsgebühr für die einzelnen Fonds läuft an jedem Handelstag auf und ist monatlich im Nachhinein zahlbar. Die Vertriebsstelle darf zu ihrer eigenen Verwendung etwaige Vertriebsgebühren ganz oder teilweise einbehalten, die nicht an Wertpapierhändler, Banken, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre zu zahlen sind.

(f) Ausgabenbegrenzung (einschließlich Verzicht auf und Nachzahlung von Verwaltungsgebühren)

Gemäß der geltenden Fassung des Verwaltungsvertrags zwischen der Gesellschaft und der Verwaltungsgesellschaft vom 28. Januar 1998 ist die Verwaltungsgesellschaft mit der Gesellschaft übereingekommen, die gesamten jährlichen Betriebskosten eines Fonds für alle Klassen des Fonds zu verwalten, wobei sie auf ihre Verwaltungsgebühr ganz oder teilweise verzichtet bzw. diese ganz oder teilweise reduziert oder erstattet, falls (und für den Zeitraum, in dem) diese Betriebskosten aufgrund gezahlter Gründungskosten sowie anteiliger Verwaltungsratshonorare die Summe aus der Verwaltungsgebühr der Klasse dieses Fonds (vor Anrechnung eines etwa anwendbaren Verzichts auf die Verwaltungsgebühr) aus etwa anfallenden Service- und Bestandspflegegebühren sowie aus sonstigen von dieser Fondsklasse zu tragenden Kosten, die die oben beschriebene Verwaltungsgebühr nicht abdeckt, (ausgenommen Gründungskosten und anteilige Verwaltungsratshonorare) zzgl. 0,0049 % pro Jahr (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 „Erstattungsbeitrag“) während der vorangegangenen 36 Monate, vorausgesetzt dieser an die Verwaltungsgesellschaft gezahlte Betrag erfüllt folgende Bedingungen: 1) er darf pro Jahr 0,0049 % vom durchschnittlichen (täglich berechneten) Nettovermögen der Klasse des betreffenden Fonds nicht überschreiten; 2) er liegt nicht über dem Gesamterstattungsbeitrag; 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.

14. 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 13 offengelegt.

Zum 31. Dezember 2023 hielt die Verwaltungsgesellschaft 1.193.662 (31. Dezember 2022: 1.786.291) Anteile des US Short-Term Fund.

Jeder der Fonds kann in die anderen Fonds der Gesellschaft und/oder andere Organismen für gemeinsame Anlagen investieren, die von der Verwaltungsgesellschaft oder mit dieser verbundenen Unternehmen verwaltet werden („verbundene Fonds“).

Die folgenden Fonds hielten im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 Überkreuzinvestitionen innerhalb des Umbrella-Fonds. Diese Anlagen wurden zum Zweck der Darstellung der Summe der Fonds der Gesellschaft eliminiert.

	31. Dez. 2023
Fonds	Überkreuzinvestitionen innerhalb des Umbrella-Fonds
PIMCO Balanced Income and Growth Fund	PIMCO Capital Securities Fund
Diversified Income Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Diversified Income Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Diversified Income Fund	US Short-Term Fund
Diversified Income Duration Hedged Fund	US Short-Term Fund
Diversified Income ESG Fund	Emerging Markets Bond ESG Fund
Diversified Income ESG Fund	Global Investment Grade Credit ESG 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	PIMCO European High Yield Bond Fund
Global Bond Fund	Global Bond Ex-US Fund
Global Bond Fund	UK Corporate Bond Fund
Global High Yield Bond Fund	US Short-Term Fund
Global High Yield Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Global Investment Grade Credit 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
Low Average Duration Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Low Duration Opportunities Fund	US Short-Term Fund
Low Duration Opportunities Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Total Return Bond Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Total Return Bond Fund	PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund
US High Yield Bond Fund	US Short-Term Fund
US High Yield Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
US High Yield Bond Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund

Fonds	31. Dez. 2022		31. Dez. 2023	
	Überkreuzinvestitionen innerhalb des Umbrella-Fonds	Fonds	Käufe	Verkäufe
Diversified Income Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund	\$ 822.170	\$ 893.204
Diversified Income Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund	164.767	180.848
Diversified Income Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund	PIMCO Balanced Income and Growth Fund	292.138	543.791
Diversified Income Fund	US Short-Term Fund	PIMCO Capital Securities Fund	125.906	91.976
Diversified Income Duration Hedged Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund	PIMCO Climate Bond Fund	294	6.812
Diversified Income Duration Hedged Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund	Commodity Real Return Fund	553	0
Diversified Income Duration Hedged Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund	PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	30.083	36.205
Diversified Income Duration Hedged Fund	US Short-Term Fund	Diversified Income Fund	582.847	807.621
Dynamic Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund	Diversified Income Duration Hedged Fund	48.624	79.870
Dynamic Bond Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund	Diversified Income ESG Fund	6.390	1.485
Dynamic Bond Fund	US Short-Term Fund	Dynamic Bond Fund	178.210	167.588
Dynamic Multi-Asset Fund	PIMCO Capital Securities Fund	Dynamic Multi-Asset Fund	6.958	221.744
Dynamic Multi-Asset Fund	Income Fund	Emerging Local Bond Fund	2.109.019	2.011.347
Dynamic Multi-Asset Fund	PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	Emerging Markets Bond Fund	2.067.913	1.848.262
Emerging Local Bond Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund	Emerging Markets Bond ESG Fund	25.852	14.875
Emerging Local Bond Fund	Emerging Local Bond ESG Fund	Emerging Markets Corporate Bond Fund	61.273	69.280
Emerging Local Bond Fund	PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	309.974	335.553
Emerging Markets Bond Fund	PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	201	438
Euro Income Bond Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund	Euro Bond Fund	180.164	223.394
Global Bond Fund	PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	Euro Credit Fund	4.420	46.712
Global Bond Fund	Global Bond Ex-US Fund	Euro Income Bond Fund	13.601	35.617
Global Bond Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund	Euro Long Average Duration Fund	128.093	68.326
Global Bond Fund	UK Corporate Bond Fund	Euro Short-Term Fund	0	19.129
Global Bond Fund	US Short-Term Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund	38.106	6.260
Global Bond ESG Fund	Global Investment Grade Credit ESG Fund	PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	22.879	49.585
Global High Yield Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund	Global Advantage Fund	193.037	193.315
Global High Yield Bond Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund	Global Bond Fund	1.052.935	954.631
Global Investment Grade Credit Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund	Global Bond ESG Fund	16.867	7.052
Global Investment Grade Credit Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund	Global Bond Ex-US Fund	472.308	509.072
Global Investment Grade Credit Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund	Global High Yield Bond Fund	932.168	1.029.720
Low Average Duration Fund	US Short-Term Fund	Global Investment Grade Credit Fund	653.589	694.588
Low Duration Opportunities Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund	Global Investment Grade Credit ESG Fund	183.318	17.127
Low Duration Opportunities Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund	Global Low Duration Real Return Fund	440.384	452.300
Total Return Bond Fund	US Short-Term Fund	Global Real Return Fund	601.440	585.100
US High Yield Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund	Income Fund	6.903.065	7.658.041
		Income Fund II	89.181	90.800
		Inflation Multi-Asset Fund	101.542	139.282
		Low Average Duration Fund	289.291	330.729
		Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	473.839	422.997
		Low Duration Income Fund	223.766	120.527
		Low Duration Opportunities Fund	257.020	342.744
		PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	2.724	4.900
		Mortgage Opportunities Fund	1	685
		StocksPLUS™ Fund	144.724	58.500
		PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	535	400
		Strategic Income Fund	207.690	235.600
		Total Return Bond Fund	1.385.892	1.535.535
		PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	209.410	227.603
		UK Corporate Bond Fund	54.220	23.515
		UK Long Term Corporate Bond Fund	14.950	3.832
		US High Yield Bond Fund	909.930	845.525
		US Investment Grade Corporate Bond Fund	150.534	148.627
		US Short-Term Fund	100.320	128.304

Bestimmte Fonds investieren in die Class Z des PIMCO China Bond Fund, eines Fonds von PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c., und in den PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund, einen Fonds von PIMCO Select Funds plc, die als verbundene Fonds gelten. Aufgrund der Ausgestaltung des Angebots der Class Z und um doppelte Gebühren zu vermeiden, beträgt die Verwaltungsgebühr für die Class Z beider Fonds 0,00 % pro Jahr.

Bestimmte Fonds investieren in den PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF, den PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF, den PIMCO Sterling Short Maturity UCITS ETF und den PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF, allesamt Fonds von PIMCO ETFs plc, die als verbundene Fonds betrachtet werden. Da diese Fonds keine gebührenfreien Anteilsklassen haben, wird die Verwaltungsgebühr vom Dachfonds und vom zugrunde liegenden verbundenen Fonds bezahlt. Ein Verzicht auf die Anlageberatungsgebühr wird daher vor der Zahlung durch den Fonds an die Verwaltungsgesellschaft ausgeglichen, was in der Betriebsergebnisrechnung innerhalb der Erstattungen der Anlageberatungs-gesellschaft ausgewiesen wird.

Während der Geschäftsjahre zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 kauften und verkauften die unten erwähnten Fonds Wertpapiere verbundener Fonds, sie nahmen Käufe und Verkäufe in Bezug auf Überkreuzinvestitionen und Käufe und Verkäufe von Anlagen in verbundenen Fonds vor (Angaben in Tausend):

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

Fonds	31. Dez. 2022	
	Käufe	Verkäufe
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	\$ 908.623	\$ 895.972
Asia Strategic Interest Bond Fund	129.084	124.231
PIMCO Balanced Income and Growth Fund	680.984	811.602
PIMCO Capital Securities Fund	190.635	542.608
PIMCO Climate Bond Fund	449	22.179
Commodity Real Return Fund	85.291	5.900
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	5.183	8.342
Diversified Income Fund	638.902	1.645.597
Diversified Income Duration Hedged Fund	75.129	141.980
Diversified Income ESG Fund	200	200
Dynamic Bond Fund	441.881	264.103
Dynamic Multi-Asset Fund	104.045	26.348
Emerging Local Bond Fund	1.837.395	1.892.204
Emerging Markets Bond Fund	1.462.642	1.981.418
Emerging Markets Bond ESG Fund	210.705	83.931
Emerging Markets Corporate Bond Fund	92.941	88.297
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	119.731	128.393
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	1.000	1.438
Euro Bond Fund	265.381	223.907
Euro Credit Fund	80.580	117.241
Euro Income Bond Fund	254.310	373.646
Euro Long Average Duration Fund	19.622	16.672
Euro Short-Term Fund	71.651	76.393
PIMCO European High Yield Bond Fund	12.406	8.873
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	39.660	47.565
Global Advantage Fund	153.288	145.735
Global Bond Fund	1.056.550	1.129.083
Global Bond ESG Fund	9.751	15.801
Global Bond Ex-US Fund	641.210	604.043
Global High Yield Bond Fund	727.445	1.125.258
Global Investment Grade Credit Fund	3.785.028	4.629.158
Global Investment Grade Credit ESG Fund	87.522	194.414
Global Low Duration Real Return Fund	232.291	226.698
Global Real Return Fund	837.486	812.145
Income Fund	1.603.346	2.928.690
Income Fund II	15.740	16.700
Inflation Multi-Asset Fund	87.463	56.410
Low Average Duration Fund	552.743	550.289
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	359.824	340.371
Low Duration Income Fund	181.275	178.894
Low Duration Opportunities Fund	491.198	704.279
Low Duration Opportunities ESG Fund	100	100
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	21.008	18.700
Mortgage Opportunities Fund	1.108.810	1.242.395
StocksPLUS™ Fund	150.012	544.833
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	410	600
Strategic Income Fund	339.690	329.066
Total Return Bond Fund	447.487	642.290
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	116.658	79.650
UK Corporate Bond Fund	12.034	18.983
UK Long Term Corporate Bond Fund	33.666	11.074
US High Yield Bond Fund	909.401	1.318.576
US Investment Grade Corporate Bond Fund	344.028	348.295
US Short-Term Fund	498.555	563.279

Die folgende Tabelle zeigt den 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. Dabei handelt es sich zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 um über 20 % des Nettovermögens des Fonds.

Fonds	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022
	% Gehalten	% Gehalten
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	k. A.	21,53
Asia Strategic Interest Bond Fund	59,45	49,24
PIMCO Balanced Income and Growth Fund	66,02	65,44
PIMCO Capital Securities Fund	20,61	23,94
PIMCO Climate Bond Fund	k. A.	21,78
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	28,67	25,65
Diversified Income ESG Fund	100,00	100,00
Dynamic Multi-Asset Fund	36,16	25,10
Emerging Local Bond ESG Fund	k. A.	100,00
Emerging Markets Bond Fund	26,97	22,87
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	54,67	57,57
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	28,10	26,22
Euro Credit Fund	24,54	30,16
Euro Income Bond Fund	26,70	21,29
Euro Short-Term Fund	36,04	k. A.
PIMCO European High Yield Bond Fund	70,58	98,78
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	27,59	31,55
Global Bond Ex-US Fund	21,50	k. A.
Global Low Duration Real Return Fund	23,27	k. A.
Income Fund II	20,21	40,67
Inflation Multi-Asset Fund	26,11	29,48
Low Duration Opportunities Fund	35,72	k. A.
Low Duration Opportunities ESG Fund	100,00	100,00
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	56,87	50,65
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	79,44	84,86
Strategic Income Fund	46,69	47,13
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	25,56	k. A.
US Short-Term Fund	35,03	31,95

Fonds, bei denen Anteilinhaber mehr als 20 % des Nettovermögens des Fonds besitzen, werden in Erläuterung 16 gesondert ausgewiesen; davon ausgenommen sind die Allianz-Gruppe, Fonds der Gesellschaft, mit der Gesellschaft verbundene Fonds und Mitarbeiter der Anlageberatungsgesellschaften.

Während des Geschäftsjahres zum 31. Dezember 2023 verkaufte der Income Fund Wertpapiere im Wert von 119.273 USD (31. Dezember 2022: 136.931 USD) an Repack Bond Collateral Ltd. (die „Körperschaft“), eine nach dem Recht der Kaimaninseln gegründete befreite Gesellschaft mit beschränkter Haftung, die eine verbundene Partei der Anlageberatungsgesellschaften ist. Es wurden keine Gebühren von der Körperschaft an die Anlageberatungsgesellschaft gezahlt. Zum 31. Dezember 2023 hielt der Income Fund 9.694 Schuldverschreibungen (31. Dezember 2022: 9.694 Schuldverschreibungen) von BNP Paribas Issuance BV., die durch von der Körperschaft begebene Schuldverschreibungen besichert sind. Während des Geschäftsjahres zahlte die Körperschaft dem Income Fund Ausschüttungen in Höhe von insgesamt 73.836 USD (31. Dezember 2022: 43.624 USD).

Während des Geschäftsjahres zum 31. Dezember 2023 investierte der PIMCO Trends Managed Futures Strategy Fund in zwei strukturierte Schuldverschreibungen, Aries Capital DAC und Greenleaves Capital Designated Activity Co, begeben wurden und deren Erlöse zur Ausgabe von rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteilen an PIMCO Commodities Diversified SP, einem gesonderten Portfolio von PIMCO Diversified Strategies SPC, verwendet wurden. PIMCO Diversified Strategies SPC, eine nach dem Recht der Kaimaninseln gegründete befreite Gesellschaft mit beschränkter Haftung, ist eine mit den Anlageberatungsgesellschaften verbundene Partei. PIMCO Diversified Strategies SPC zahlte keine Gebühren an die Anlageberatungsgesellschaften. Zum 31. Dezember 2023 betrug der Wert der durch den PIMCO Trends Managed Futures Strategy Fund gehaltenen strukturierten Schuldverschreibungen 31.276 USD.

Beteiligungen der Verwaltungsratsmitglieder und des Sekretärs an Anteilen und Verträgen

Zum 31. Dezember 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, null (31. Dezember 2022: 8.757,87) Anteile des Dynamic Multi-Asset Fund, 3.619,69 (31. Dezember 2022: 3.619,69) Anteile des Emerging Markets 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 31. Dezember 2023 hielt Ryan P. Blute keine (31. Dezember 2022: 5.387,93) Anteile des PIMCO Asia High Yield Bond Fund, 28.827,68 (31. Dezember 2022: 24.131,27) Anteile des Low Average Duration Fund und 50.751,14 (31. Dezember 2022: 82.494,63) Anteile des Low Duration Income Fund, wobei es sich jeweils um Fonds der Gesellschaft handelt.

Zum 31. Dezember 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 Duration Income Fund und 92.850,51 (31. Dezember 2022: 92.850,51) Anteile des Low Duration Opportunities Fund, wobei es sich jeweils um Fonds der Gesellschaft handelt.

Zum 31. Dezember 2023 hielt David M. Kennedy 16.786,79 (31. Dezember 2022: 16.786,79) Anteile des PIMCO Balanced Income and Growth Fund und 4.186,59 (31. Dezember 2022: 4.449,56) Anteile des Emerging Markets Bond Fund, wobei es sich jeweils um Fonds der Gesellschaft handelt.

Während der zum 31. Dezember 2023 bzw. 31. Dezember 2022 endenden Geschäftsjahre hielt kein anderes Verwaltungsratsmitglied eine Beteiligung an Anteilen der Gesellschaft.

Während der zum 31. Dezember 2023 bzw. zum 31. Dezember 2022 endenden Geschäftsjahre hielt der Sekretär keine Beteiligung an Anteilen der Gesellschaft.

Die Gesellschaft hatte während der Geschäftsjahre zum 31. Dezember 2023 oder 31. Dezember 2022 keine Mitarbeiter.

15. WECHSELKURSE

Um einen gemeinsamen Abschluss für die Fonds und Finanzdaten für die Gesellschaft zu erhalten (was nach irischem Gesellschaftsrecht erforderlich ist), wurden die Beträge im Finanzstatus zu dem am 31. Dezember 2023 geltenden Wechselkurs von Euro in US-Dollar (USD/EUR 0,90526) umgerechnet (31. Dezember 2022: USD/EUR 0,93699) und von Pfund Sterling in US-Dollar (USD/GBP 0,78444) (31. Dezember 2022: USD/GBP 0,83132) umgerechnet. Die Beträge in der Betriebsergebnisrechnung und im Ausweis der Nettovermögensänderungen wurden zu einem durchschnittlichen während des am 31. Dezember 2023 endenden Geschäftsjahres geltenden Wechselkurs von Euro in US-Dollar (USD/EUR 0,92495) (31. Dezember 2022: USD/EUR 0,95111) und von Pfund Sterling in US-Dollar (USD/GBP 0,80449) (31. Dezember 2022: USD/GBP 0,81159) umgerechnet.

Die folgende Tabelle gibt die für die Umrechnung der Anlagen und sonstigen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die auf von der Funktionswährung des jeweiligen Fonds abweichende Währungen lauten, in Pfund Sterling, Euro und US-Dollar, die Funktionswährungen von Fonds der Gesellschaft, verwendeten Wechselkurse wieder.

Der Wechselkurs für den Argentinischen Peso („ARS“) zum 31. Dezember 2023 enthält einen 21%igen Abschlag (31. Dezember 2022: 83 %) aufgrund der Abweichung zwischen dem offiziellen und dem inoffiziellen Wechselkurs Argentiniens.

Fremd-währung	31. Dez. 2023 Präsentationswährung		
	EUR	GBP	USD
AED	k. A.	k. A.	3,67275
ARS	1.077,45365	k. A.	975,38000
AUD	1,61889	1,66825	1,46552
BRL	5,36595	k. A.	4,85760
CAD	1,45659	1,68095	1,31860
CHF	0,92973	1,07294	0,84165
CLP	964,67439	k. A.	873,28500
CNH	7,86577	9,07734	7,12060
CNY	7,83440	k. A.	7,09220
COP	4.279,41462	k. A.	3.874,00000
CZK	24,68849	k. A.	22,34960
DKK	7,45457	8,60279	6,74835
DOP	k. A.	k. A.	58,06000
EGP	k. A.	k. A.	30,92500
EUR (oder €)	1,00000	1,15403	0,90526
GBP (oder £)	0,86653	1,00000	0,78444
GHS	k. A.	k. A.	11,91500
HKD	8,62572	k. A.	7,80855
HUF	382,21508	441,08775	346,00555
IDR	17.008,29813	k. A.	15.397,00000
ILS	3,97773	k. A.	3,60090
INR	91,92208	k. A.	83,21375
JPY (oder ¥)	155,73358	179,72125	140,98000
KES	k. A.	k. A.	157,00000
KRW	1.422,67891	k. A.	1.287,90000
KZT	k. A.	k. A.	455,89000
MXN	18,70670	21,58809	16,93450
MYR	k. A.	k. A.	4,59500
NGN	k. A.	k. A.	897,50000
NOK	11,21850	12,94648	10,15570

Fremd-währung	31. Dez. 2023 Präsentationswährung		
	EUR	GBP	USD
NZD	1,74469	2,01342	1,57941
PEN	4,09008	k. A.	3,70260
PHP	k. A.	k. A.	55,37500
PLN	4,34376	k. A.	3,93225
QAR	k. A.	k. A.	3,64100
RON	k. A.	k. A.	4,50360
RSD	k. A.	k. A.	106,13000
RUB	98,75572	k. A.	89,40000
SEK	11,13250	12,84724	10,07785
SGD	1,45714	1,68159	1,31910
THB	k. A.	k. A.	34,13250
TRY	32,62474	37,64993	29,53400
TWD	33,90226	k. A.	30,69050
UGX	k. A.	k. A.	3.780,00000
USD (oder \$)	1,10465	1,27480	1,00000
UYU	k. A.	k. A.	39,04000
VND	k. A.	k. A.	24.262,00000
ZAR	20,20129	23,31290	18,28750
ZMW	k. A.	k. A.	25,71030

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 (oder €)	1,00000	1,12710	0,93699
GBP (oder £)	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 (oder ¥)	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
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 (oder \$)	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

16. FINANZIELLE RISIKEN

Die Hauptrisiken, die sich aus den Finanzinstrumenten der Gesellschaft ergeben, sind das Marktpreis-, Devisen-, Zinssatz-, Liquiditäts-, Kredit- und Kontrahentenrisiko.

(a) Marktpreisrisiko

Das Marktrisiko ergibt sich hauptsächlich aus der Unsicherheit der künftigen Kurse der gehaltenen Finanzinstrumente. Es stellt den potenziellen Verlust dar, der jedem Fonds entstehen könnte, wenn Marktpositionen bei nachteiligen Kursbewegungen gehalten werden. Die Anlageberatungsgesellschaften prüfen die Vermögensstrukturierung des Portfolios, um das mit bestimmten Ländern oder Industriezweigen verbundene Risiko zu minimieren, während sie weiterhin die Anlageziele der Fonds verfolgen.

Die Anlageberatungsgesellschaften verwenden eine Reihe quantitativer Techniken, um die Auswirkungen von Marktrisiken, einschließlich Kreditereignisse, Zinssatzänderungen, Kreditrisikos und Rückkehrerwartungen, auf das Anlageportfolio der Fonds zu bewerten.

Die Anlageberatungsgesellschaften verwendeten die Risikopotenzialanalyse (Value at Risk, „VaR“), eine von Finanzinstituten weitgehend eingesetzte Technik zur Messung, Bewertung und Darstellung des Marktrisikos. Der VaR ist ein statistischer Rahmen, der die Quantifizierung des Marktrisikos in einem Portfolio mit einem bestimmten Konfidenzintervall in einem festgelegten Haltezeitraum unterstützt. Bestimmte Fonds dürfen das relative VaR-Modell oder das absolute VaR-Modell verwenden. Bei Einsatz des relativen VaR-Modells darf das Risikopotenzial eines Fondsportfolios das doppelte Risikopotenzial eines vergleichbaren Benchmark-Portfolios oder Referenzportfolios (d. h. eines ähnlichen Portfolios ohne Derivate) nicht überschreiten und die Haltedauer beträgt 20 Tage, wobei die Datenhistorie mindestens ein Jahr beträgt. Der VaR soll die erwarteten maximalen Verluste in Dollar messen, die aus dem interaktiven Verhalten aller wesentlichen Marktkurse, Spreads, Schwankungen, Zinssätze sowie anderer Risiken, einschließlich des Devisen-, Zinssatz-, Schwellenmarkt- und Konvexitätsrisikos, die aus den historisch beobachteten Verhältnissen zwischen diesen Märkten resultieren können.

Obwohl der Einsatz von Derivaten zu zusätzlichen Fremdkapitalrisiken führen kann, wird jedes derartige zusätzliche Risiko mithilfe der VaR-Methode in Übereinstimmung mit den Anforderungen der Zentralbank gesichert und gesteuert. Die Anlageberatungsgesellschaften überwachen das Portfoliorisiko täglich mithilfe von Marktfaktoranalysen. Mögliche Marktrisiken werden mit dem parametrischen delta-normalen oder Faktormodellansatz berechnet. Der VaR wird automatisch jeden Tag anhand der Schlusskurse und Marktinformationen des vorhergehenden Geschäftstags berechnet und berichtet. In Abhängigkeit von der Anwendung der Risikostatistiken könnten verschiedene Konfidenzniveaus (z. B. 99 %) und Zeithorizonte (Wochen oder Monate) ausgewählt werden.

In den folgenden Tabellen werden der minimale, maximale, durchschnittliche VaR und der VaR zum Geschäftsjahresende der einzelnen Teilfonds zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 aufgeführt:

Fonds	Methode	Vergleichsindex	31. Dez. 2023			
			Min.	Max.	Durchschnitt	Jahresende
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	Relativ	JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index	88,07 %	105,72 %	96,15 %	90,32 %
Asia Strategic Interest Bond Fund	Relativ	JPMorgan Asia Credit Index	94,58 %	109,74 %	102,04 %	98,53 %
PIMCO Balanced Income and Growth Fund	Relativ	60 % MSCI All Country World Index / 40 % Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index	91,37 %	111,74 %	101,12 %	100,27 %
PIMCO Capital Securities Fund	Absolut	k. A.	2,95 %	10,88 %	6,50 %	5,53 %
PIMCO Climate Bond Fund	Absolut	k. A.	2,99 %	4,51 %	3,51 %	3,53 %
Commodity Real Return Fund	Relativ	Bloomberg Commodity Index Total Return	100,62 %	112,87 %	110,08 %	110,54 %
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	Absolut	k. A.	3,13 %	6,49 %	3,94 %	3,82 %
Diversified Income Fund	Relativ	jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (USD Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (USD Hedged) und JPMorgan EMBI Global (USD Hedged).	94,91 %	108,65 %	101,06 %	100,63 %
Diversified Income Duration Hedged Fund	Absolut	k. A.	3,49 %	6,90 %	4,97 %	4,29 %
Diversified Income ESG Fund	Relativ	1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, ICE BofAML BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained ESG Tilt Index und JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index Global Diversified	97,58 %	112,32 %	103,74 %	102,47 %
Dynamic Bond Fund	Absolut	k. A.	2,54 %	6,10 %	3,88 %	4,07 %
Dynamic Multi-Asset Fund	Absolut	k. A.	3,63 %	7,24 %	5,31 %	6,84 %
Emerging Local Bond Fund	Relativ	JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (Unhedged)	101,51 %	113,57 %	107,23 %	109,65 %
Emerging Local Bond ESG Fund	Relativ	JPMorgan ESG Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index	98,66 %	112,88 %	104,84 %	110,12 %
Emerging Markets Bond Fund	Relativ	JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global	102,04 %	111,88 %	105,82 %	108,20 %
Emerging Markets Bond ESG Fund	Relativ	JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified	100,33 %	112,08 %	106,06 %	107,41 %
Emerging Markets Corporate Bond Fund	Relativ	JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified (CEMBI)	97,59 %	112,78 %	103,64 %	108,05 %

Stresstests werden in Bezug auf das VaR-Modell für jeden Fonds monatlich durchgeführt. Die PIMCO Risk Group überwacht die Zusammensetzung der Stresstests und nimmt die entsprechenden Änderungen vor, wenn dies aufgrund der Marktbedingungen und Zusammensetzung des jeweiligen Fonds angebracht ist. Mit den Stresstests werden potenzielle Gewinne oder Verluste aufgrund von Schocks bei finanziellen Variablen geschätzt, wie unter anderem Nominalzinsen für Staatsanleihen, Nominalzinsen für Swaps, Realzinsen, Credit-Spreads, Aktienbewertungen, Rohstoffwerten, Wechselkurse und implizierte Volatilitäten. Abgesehen von den monatlich durchgeführten Stresstests werden drei zusätzliche Arten von Stresstests durchgeführt, von denen einige täglich und einige interaktiv für Analysen verwendet werden. Der erste Test umfasst einen Szenario-Auswirkungs-Test, der die Auswirkungen von unerwarteten Ertragsbewegungen im Markt auf den Wert des Portfolios ermittelt. Diese Durationen werden an jedem Geschäftstag berechnet. Der zweite Test legt eine Datenbank historischer Krisenszenarios zugrunde und untersucht die Reaktionen auf solche Krisen. Die historischen Krisenszenarios enthalten viele unerwartete Veränderungen der Marktbedingungen und Korrelationsmatrizen. Der dritte Test enthält Korrelationsmatrizen, die manuell verändert werden können, um in der Zukunft mögliche Bedingungen zu simulieren, die bisher allerdings noch nicht eingetreten sind.

Berechnungen werden allgemein mithilfe automatischer Simulationsmethoden durchgeführt. Allerdings sind auch Methoden zur manuellen Überprüfung von Änderungen an den Korrelationsmatrizen vorhanden, die sich auf die Portfolios in erheblichem Umfang negativ auswirken würden. Diese Korrelationsänderungen können dann analysiert werden und mögliche, tatsächlich vorkommende Ereignisse, durch die solche Änderungen verursacht werden, können zugeordnet werden.

Natürlich kann nicht ausgeschlossen werden, dass sich tatsächliche wirtschaftliche Ergebnisse von den manuellen und automatischen Szenarios unterscheiden.

Die täglich ermittelten VaR-Kennzahlen sind eine Schätzung des Portfolioverlustes innerhalb des nächsten Einmonatszeitraums, der in 99 % der Zeit nicht überschritten wird, abhängig von den Annahmen des VaR-Modells.

Nicht alle Risiken, denen das Portfolio ausgesetzt sein konnte, sollen durch den VaR wiedergegeben werden; vor allem beabsichtigt das Rahmenkonzept nicht, Liquiditätsrisiken, Kontrahentenrisiken oder extreme Kreditereignisse wie den Ausfall eines Emittenten zu berücksichtigen. In der Praxis werden die tatsächlichen Handelsergebnisse vom VaR abweichen und bieten unter Umständen keinen aussagekräftigen Hinweis auf die Gewinne und Verluste unter angespannten Marktbedingungen. Um die Zuverlässigkeit der VaR-Modelle zu bestimmen, werden tatsächliche Ergebnisse überwacht, um die Gültigkeit der für die VaR-Berechnung verwendeten Annahmen und Parameter zu prüfen. Marktrisikopositionen werden ebenfalls regelmäßigen Stresstests unterzogen, um sicherzustellen, dass die einzelnen Fonds einem extremen Marktereignis standhalten können.

Fonds	Methode	Vergleichsindex	31. Dez. 2023			
			Min.	Max.	Durchschnitt	Jahresende
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	Relativ	50 % JPMorgan EMBI Global Index / 50 % JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (USD Unhedged)	43,33 %	104,86 %	69,48 %	88,91 %
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	Relativ	JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (Unhedged)	100,20 %	120,45 %	110,81 %	115,94 %
PIMCO ESG Income Fund	Absolut	k. A.	3,07 %	5,00 %	3,68 %	3,20 %
Euro Bond Fund	Relativ	FTSE Euro Broad Investment-Grade Index	91,91 %	107,33 %	99,13 %	100,03 %
Euro Credit Fund	Relativ	Bloomberg Euro-Aggregate Credit Index	98,90 %	114,22 %	103,70 %	104,64 %
Euro Income Bond Fund	Absolut	k. A.	4,64 %	7,59 %	5,67 %	5,68 %
Euro Long Average Duration Fund	Relativ	Bloomberg Euro Government (Germany, France, Netherlands) over 15 years Index	1,13 %	101,75 %	98,89 %	100,04 %
Euro Short-Term Fund	Absolut	k. A.	0,73 %	1,75 %	1,19 %	0,73 %
PIMCO European High Yield Bond Fund	Relativ	ICE BofA Merrill Lynch BB-B European Currency High Yield Constrained Index	96,20 %	118,47 %	103,91 %	102,03 %
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	Absolut	k. A.	0,02 %	3,31 %	2,49 %	2,07 %
Global Advantage Fund	Relativ	PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (London Close)	101,21 %	115,89 %	108,24 %	103,64 %
Global Bond Fund	Relativ	Bloomberg Global Aggregate (USD Hedged) Index	93,30 %	117,72 %	106,32 %	105,78 %
Global Bond ESG Fund	Relativ	Bloomberg Global Aggregate (USD Hedged) Index	93,79 %	119,10 %	106,57 %	104,94 %
Global Bond Ex-US Fund	Relativ	Bloomberg Global Aggregate ex-USD (USD Hedged) Index	92,42 %	117,07 %	106,62 %	106,44 %
Global High Yield Bond Fund	Relativ	ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into USD	53,99 %	110,74 %	102,89 %	105,10 %
Global Investment Grade Credit Fund	Relativ	Bloomberg Global Aggregate Credit Index (USD Hedged)	85,12 %	117,09 %	102,94 %	100,81 %
Global Investment Grade Credit ESG Fund	Relativ	Bloomberg Global Aggregate Credit Index (USD Hedged)	98,08 %	114,86 %	104,25 %	102,09 %
Global Low Duration Real Return Fund	Relativ	Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (USD Hedged)	100,72 %	266,63 %	109,50 %	107,11 %
Global Real Return Fund	Relativ	Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond USD Hedged Index	97,02 %	120,62 %	101,63 %	101,30 %
Income Fund	Absolut	k. A.	4,77 %	7,88 %	5,96 %	5,12 %
Income Fund II	Absolut	k. A.	3,66 %	6,34 %	4,52 %	4,08 %
Inflation Multi-Asset Fund	Absolut	k. A.	5,90 %	8,28 %	7,14 %	7,13 %
Low Average Duration Fund	Absolut	k. A.	2,55 %	4,05 %	2,94 %	2,87 %
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	Relativ	Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (USD Hedged)	91,75 %	123,35 %	106,87 %	113,39 %
Low Duration Income Fund	Absolut	k. A.	3,41 %	5,75 %	4,60 %	3,53 %
Low Duration Opportunities Fund	Absolut	k. A.	2,04 %	8,79 %	3,12 %	2,98 %
Low Duration Opportunities ESG Fund	Absolut	k. A.	1,26 %	2,67 %	1,83 %	1,58 %
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	Relativ	Alerian MLP Index	98,02 %	109,97 %	104,87 %	98,02 %
Mortgage Opportunities Fund	Absolut	k. A.	4,34 %	7,09 %	5,68 %	6,36 %
StocksPLUS™ Fund	Relativ	S&P 500 Index (Nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden)	99,66 %	104,59 %	102,15 %	101,89 %
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	Relativ	S&P 500 Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden)	105,20 %	111,02 %	106,91 %	106,86 %
Strategic Income Fund	Relativ	75 % Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index/25 % MSCI ACWI High Dividend Yield Index	105,46 %	127,84 %	117,47 %	105,46 %
Total Return Bond Fund	Relativ	Bloomberg U.S. Aggregate Index	94,74 %	116,39 %	103,12 %	99,26 %
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	Absolut	k. A.	1,71 %	11,63 %	6,06 %	8,88 %
UK Corporate Bond Fund	Relativ	ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts Index	100,97 %	107,90 %	104,53 %	101,51 %
UK Long Term Corporate Bond Fund	Relativ	ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts 10+ Index	99,65 %	104,66 %	101,90 %	102,62 %
US High Yield Bond Fund	Relativ	ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index	56,30 %	109,71 %	101,47 %	103,73 %
US Investment Grade Corporate Bond Fund	Relativ	Bloomberg U.S. Credit Index	91,71 %	110,47 %	98,40 %	95,25 %
US Short-Term Fund	Absolut	k. A.	0,52 %	1,11 %	0,80 %	0,52 %

Fonds	Methode	Vergleichsindex	31. Dez. 2022			
			Min.	Max.	Durchschnitt	Jahresende
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	Relativ	JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index	86,03 %	109,37 %	96,86 %	88,69 %
Asia Strategic Interest Bond Fund	Relativ	JPMorgan Asia Credit Index	91,44 %	106,49 %	99,71 %	94,95 %
PIMCO Balanced Income and Growth Fund	Relativ	60 % MSCI All Country World Index / 40 % Bloomberg U.S. Aggregate Bond USD Hedged	90,26 %	127,43 %	103,81 %	93,05 %
PIMCO Capital Securities Fund	Absolut	k. A.	4,38 %	11,46 %	8,28 %	8,49 %

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

Fonds	Methode	Vergleichsindex	31. Dez. 2022			
			Min.	Max.	Durchschnitt	Jahresende
PIMCO Climate Bond Fund	Absolut	k. A.	2,13 %	4,93 %	3,81 %	4,03 %
Commodity Real Return Fund	Relativ	Bloomberg Commodity Index Total Return	100,90 %	112,80 %	105,31 %	108,93 %
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	Absolut	k. A.	2,06 %	5,50 %	3,99 %	4,51 %
Diversified Income Fund	Relativ	jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (USD Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (USD Hedged) und JPMorgan EMBI Global (USD Hedged).	96,68 %	132,63 %	110,21 %	98,82 %
Diversified Income Duration Hedged Fund	Absolut	k. A.	5,07 %	9,35 %	7,23 %	5,76 %
Diversified Income ESG Fund	Relativ	1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets, ICE BofAML BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained ESG Tilt Index und JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index Global Diversified	101,85 %	109,31 %	104,88 %	102,63 %
Dynamic Bond Fund	Absolut	k. A.	2,61 %	5,75 %	4,52 %	4,17 %
Dynamic Multi-Asset Fund	Absolut	k. A.	3,85 %	7,74 %	5,08 %	5,84 %
Emerging Local Bond Fund	Relativ	JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (Unhedged)	94,06 %	106,90 %	102,72 %	102,61 %
Emerging Local Bond ESG Fund	Relativ	JPMorgan ESG Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index	92,69 %	108,54 %	97,67 %	99,38 %
Emerging Markets Bond Fund	Relativ	JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global	97,07 %	110,86 %	104,27 %	102,74 %
Emerging Markets Bond ESG Fund	Relativ	JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified	98,21 %	112,18 %	105,42 %	100,17 %
Emerging Markets Corporate Bond Fund	Relativ	JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified (CEMBI)	94,77 %	125,73 %	109,89 %	98,72 %
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	Relativ	50 % JPMorgan EMBI Global Index/50 % JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (USD Unhedged)	35,81 %	87,96 %	56,92 %	55,69 %
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	Relativ	JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (Unhedged)	84,87 %	113,34 %	104,07 %	109,06 %
PIMCO ESG Income Fund	Absolut	k. A.	1,77 %	4,63 %	3,24 %	3,81 %
Euro Bond Fund	Relativ	FTSE Euro Broad Investment-Grade Index	91,45 %	107,79 %	101,40 %	102,69 %
Euro Credit Fund	Relativ	Bloomberg Euro-Aggregate Credit Index	102,32 %	122,65 %	110,14 %	104,97 %
Euro Income Bond Fund	Absolut	k. A.	2,86 %	7,88 %	5,99 %	5,55 %
Euro Long Average Duration Fund	Relativ	Bloomberg Euro Government (Germany, France, Netherlands) over 15 years Index	94,30 %	102,20 %	99,42 %	100,39 %
Euro Short-Term Fund	Absolut	k. A.	0,66 %	2,13 %	1,56 %	1,43 %
PIMCO European High Yield Bond Fund	Relativ	ICE BofA Merrill Lynch BB-B European Currency High Yield Constrained Index	90,65 %	106,11 %	99,81 %	101,48 %
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	Absolut	k. A.	2,42 %	4,11 %	3,18 %	3,32 %
Global Advantage Fund	Relativ	PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (London Close)	98,46 %	115,01 %	106,86 %	102,35 %
Global Bond Fund	Relativ	Bloomberg Global Aggregate (USD Hedged) Index	86,07 %	112,02 %	101,52 %	102,14 %
Global Bond ESG Fund	Relativ	Bloomberg Global Aggregate (USD Hedged) Index	86,26 %	111,08 %	101,39 %	101,93 %
Global Bond Ex-US Fund	Relativ	Bloomberg Global Aggregate ex-USD (USD Hedged) Index	82,61 %	114,31 %	102,72 %	103,34 %
Global High Yield Bond Fund	Relativ	ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into USD	96,87 %	122,97 %	105,69 %	100,40 %
Global Investment Grade Credit Fund	Relativ	Bloomberg Global Aggregate Credit Index (USD Hedged)	97,59 %	116,74 %	105,84 %	101,83 %
Global Investment Grade Credit ESG Fund	Relativ	Bloomberg Global Aggregate Credit Index (USD Hedged)	97,83 %	113,48 %	105,86 %	101,23 %
Global Low Duration Real Return Fund	Relativ	Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (USD Hedged)	89,75 %	119,66 %	104,44 %	110,21 %
Global Real Return Fund	Relativ	Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond USD Hedged Index	92,16 %	107,84 %	100,44 %	103,88 %
Income Fund	Absolut	k. A.	3,83 %	8,45 %	6,51 %	7,34 %
Income Fund II	Absolut	k. A.	1,92 %	5,97 %	4,25 %	5,62 %
Inflation Multi-Asset Fund	Absolut	k. A.	6,06 %	9,75 %	7,46 %	8,71 %
Low Average Duration Fund	Absolut	k. A.	1,57 %	3,31 %	2,68 %	3,00 %
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	Relativ	Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (USD Hedged)	82,83 %	112,84 %	101,24 %	102,69 %
Low Duration Income Fund	Absolut	k. A.	2,98 %	6,99 %	5,29 %	5,80 %
Low Duration Opportunities Fund	Absolut	k. A.	1,82 %	5,47 %	3,70 %	3,23 %
Low Duration Opportunities ESG Fund	Absolut	k. A.	0,96 %	2,14 %	1,77 %	1,76 %

Fonds	Methode	Vergleichsindex	31. Dez. 2022			
			Min.	Max.	Durchschnitt	Jahresende
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	Relativ	Alerian MLP Index	92,23 %	109,76 %	102,35 %	108,22 %
Mortgage Opportunities Fund	Absolut	k. A.	2,75 %	8,49 %	6,19 %	6,01 %
StocksPLUS™ Fund	Relativ	S&P 500 Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden)	97,48 %	106,40 %	101,95 %	101,54 %
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	Relativ	S&P 500 Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden)	101,28 %	112,10 %	107,00 %	107,82 %
Strategic Income Fund	Relativ	75 % Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index/25 % MSCI ACWI High Dividend Yield Index	106,90 %	144,99 %	119,86 %	125,90 %
Total Return Bond Fund	Relativ	Bloomberg U.S. Aggregate Index	95,33 %	113,77 %	103,98 %	100,51 %
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	Absolut	k. A.	1,91 %	11,57 %	6,10 %	2,57 %
UK Corporate Bond Fund	Relativ	ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts Index	97,22 %	110,46 %	104,62 %	105,19 %
UK Long Term Corporate Bond Fund	Relativ	ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts 10+ Index	95,87 %	110,22 %	100,56 %	102,14 %
US High Yield Bond Fund	Relativ	ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index	96,48 %	122,58 %	104,73 %	100,25 %
US Investment Grade Corporate Bond Fund	Relativ	Bloomberg U.S. Credit Index	94,56 %	112,79 %	102,51 %	95,83 %
US Short-Term Fund	Absolut	k. A.	0,67 %	1,58 %	1,13 %	1,08 %

Die Zentralbank verlangt, dass alle Teilfonds ein Maß für die Fremdfinanzierung offenlegen, das aufgrund eines nominellen Brutto-Engagements berechnet wird. Die Höhe des nominellen Bruttoengagements wird, wie von der Zentralbank gefordert, mithilfe der Summe der absoluten Werte der Nominalwerte der eingesetzten Derivate berechnet (wobei davon ausgegangen wird, dass bestimmte Terminkontrakte enthalten sind) und berücksichtigt daher keine vom Fonds eingegangenen Netting- und Absicherungsvereinbarungen. Der Einsatz von Derivaten (ob für Absicherungs- oder Anlagezwecke) kann zu einem höheren nominellen Brutto-Engagement führen. Es wird erwartet, dass das nominelle Brutto-Engagement der Fonds auf höhere Werte ansteigt, wenn es die Anlageberatungsgesellschaften beispielsweise für angemessen halten, Derivate zur Änderung des Zinssatzes, des Währungs- oder Kreditengagements des Fonds einzusetzen.

In der folgenden Tabelle werden die durchschnittlichen nominellen Brutto-Engagements für die Fonds für die Geschäftsjahre zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 aufgeführt:

Fonds	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	44 %	46 %
Asia Strategic Interest Bond Fund	41 %	47 %
PIMCO Balanced Income and Growth Fund	137 %	267 %
PIMCO Capital Securities Fund	102 %	104 %
PIMCO Climate Bond Fund	115 %	81 %
Commodity Real Return Fund	311 %	258 %
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	92 %	145 %
Diversified Income Fund	117 %	118 %
Diversified Income Duration Hedged Fund	174 %	119 %
Diversified Income ESG Fund	74 %	79 % ⁽¹⁾
Dynamic Bond Fund	214 %	232 %
Dynamic Multi-Asset Fund	279 %	229 %
Emerging Local Bond Fund	330 %	500 %
Emerging Local Bond ESG Fund	163 %	123 % ⁽¹⁾
Emerging Markets Bond Fund	95 %	80 %
Emerging Markets Bond ESG Fund	86 %	61 %
Emerging Markets Corporate Bond Fund	64 %	46 %
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	566 %	461 %
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	349 %	465 %
PIMCO ESG Income Fund	214 %	120 %
Euro Bond Fund	224 %	227 %
Euro Credit Fund	95 %	118 %
Euro Income Bond Fund	278 %	177 %
Euro Long Average Duration Fund	215 %	265 %
Euro Short-Term Fund	124 %	124 %
PIMCO European High Yield Bond Fund	73 %	58 %
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	276 %	302 %
Global Advantage Fund	445 %	398 %
Global Bond Fund	411 %	404 %

Fonds	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022
Global Bond ESG Fund	323 %	321 %
Global Bond Ex-US Fund	458 %	454 %
Global High Yield Bond Fund	39 %	30 %
Global Investment Grade Credit Fund	86 %	127 %
Global Investment Grade Credit ESG Fund	95 %	76 %
Global Low Duration Real Return Fund	182 %	198 %
Global Real Return Fund	214 %	232 %
Income Fund	343 %	243 %
Income Fund II	100 %	84 %
Inflation Multi-Asset Fund	274 %	185 %
Low Average Duration Fund	165 %	147 %
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	82 %	105 %
Low Duration Income Fund	299 %	249 %
Low Duration Opportunities Fund	299 %	252 %
Low Duration Opportunities ESG Fund	98 %	87 % ⁽¹⁾
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	53 %	49 %
Mortgage Opportunities Fund	562 %	569 %
StocksPLUS™ Fund	179 %	201 %
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	301 %	262 %
Strategic Income Fund	353 %	264 %
Total Return Bond Fund	177 %	181 %
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	1101 %	818 %
UK Corporate Bond Fund	68 %	79 %
UK Long Term Corporate Bond Fund	49 %	90 %
US High Yield Bond Fund	13 %	6 %
US Investment Grade Corporate Bond Fund	77 %	111 %
US Short-Term Fund	55 %	87 %

⁽¹⁾ Die Fonds wurden während des Geschäftsjahres zum 31. Dezember 2022 aufgelegt.

(b) Devisenrisiko

Legen die Fonds direkt in Fremdwährungen oder Wertpapiere an, die in Fremdwährungen gehandelt werden und Einnahmen davon erhalten, oder in Finanzderivaten, die Beteiligungen an Fremdwährungen bieten, unterliegen sie dem Risiko, dass der Wert dieser Währungen im Verhältnis zur Funktionswährung der Fonds fällt, oder, im Fall von Absicherungspositionen, dass der Wert der Funktionswährung der Fonds im Verhältnis zur abgesicherten Währung fällt. Devisenkurse im Ausland können innerhalb kurzer Zeiträume aus einer Reihe von Gründen erheblich schwanken. Dazu zählen Änderungen der Zinssätze, Interventionen (oder das verpasste Intervenieren) seitens der US- oder ausländischer Regierungen, Zentralbanken oder supranationaler Organisationen wie dem Internationalen Währungsfonds, oder auferlegte Währungskontrollen oder sonstige politische Entwicklungen in oder außerhalb der USA. Im Ergebnis können die Anlagen der Fonds in auf ausländische Währungen lautenden Wertpapieren die Erträge der Fonds schmälern.

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

Der PIMCO Capital Securities Fund, der PIMCO Climate Bond Fund, der Commodity Real Return Fund, der PIMCO Credit Opportunities Bond Fund, der Diversified Income Fund, der Diversified Income ESG Fund, der Emerging Markets Bond Fund, der Emerging Markets Bond ESG Fund, der Emerging Markets Corporate Bond Fund, der PIMCO ESG Income Fund, der Euro Short-Term Fund, der PIMCO European High Yield Bond Fund, der Global High Yield Bond Fund, der Global Investment Grade Credit Fund, der Global Investment Grade Credit ESG Fund, der Global Low Duration Real Return Fund, der Global Real Return Fund, der Low Average Duration Fund, der Low Duration Global Investment Grade Credit Fund, der Low Duration Opportunities ESG Fund, der PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund, der Mortgage Opportunities Fund, der StocksPLUS™ Fund, der Total Return Bond Fund, der US High Yield Bond Fund, der US Investment Grade Corporate Bond Fund und der US Short-Term Fund hatten zum 31. Dezember 2023 bzw. 31. Dezember 2022 kein wesentliches Fremdwährungsengagement. Die folgenden Tabellen zeigen das Gesamtengagement des Fremdwährungsrisikos bei Währungen, bei denen das Fremdwährungsengagement für wesentlich gehalten wird (d. h. bei denen unter Konstanthaltung aller anderen Variablen die Auswirkungen einer vernünftigerweise möglichen Entwicklung des Wechselkurses zu einer deutlichen Schwankung des Nettovermögens führen würden) (Angaben in Tausend):

PIMCO Asia High Yield Bond Fund						
	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Philippinischer Peso	\$ (59.706)	\$ (13.937)	\$ (73.643)	\$ 0	\$ (14.417)	\$ (14.417)
Asia Strategic Interest Bond Fund						
	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Philippinischer Peso	\$ (4.617)	\$ (1.035)	\$ (5.652)	\$ 0	\$ (1.595)	\$ (1.595)
PIMCO Balanced Income and Growth Fund						
	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Australischer Dollar	\$ 1.007	\$ 1.719	\$ 2.726	\$ 1.028	\$ 15.689	\$ 16.717
Britisches Pfund Sterling	13.565	(159)	13.406	4.933	(8.625)	(3.692)
Chinesischer Renminbi (Festland)	1.673	760	2.433	21.768	117	21.885
Chinesischer Renminbi (Offshore)	39	(325)	(286)	0	(22.761)	(22.761)
Euro	57.118	(13.525)	43.593	20.531	49.355	69.886
Hongkong-Dollar	14.390	882	15.272	453	1.635	2.088
Japanischer Yen	31.782	6.203	37.985	161.033	(134.205)	26.828
Schweizer Franken	15.133	1.046	16.179	916	1.317	2.233
Taiwan-Dollar	14.734	(1.293)	13.441	0	(3.773)	(3.773)
	\$ 149.441	\$ (4.692)	\$ 144.749	\$ 210.662	\$ (101.251)	\$ 109.411
Diversified Income Duration Hedged Fund						
	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Euro	\$ 76.096	\$ (76.930)	\$ (834)	\$ 126.256	\$ (132.486)	\$ (6.230)
Dynamic Bond Fund						
	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Kanadischer Dollar	\$ 2.247	\$ (84.082)	\$ (81.835)	\$ 2.710	\$ (624)	\$ 2.086
Japanischer Yen	154	88.908	89.062	221.727	(186.589)	35.138
	\$ 2.401	\$ 4.826	\$ 7.227	\$ 224.437	\$ (187.213)	\$ 37.224
Dynamic Multi-Asset Fund						
	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Brasilianischer Real	€ 0	€ 70.583	€ 70.583	€ 0	€ 114.243	€ 114.243
Britisches Pfund Sterling	295.400	(398.257)	(102.857)	72.902	(195.150)	(122.248)
Kanadischer Dollar	19.126	(90.199)	(71.073)	68.142	42.315	110.457
Chilenischer Peso	0	78.216	78.216	0	119.441	119.441
Kolumbianischer Peso	0	73.312	73.312	0	65.018	65.018
Ungarischer Forint	0	65.958	65.958	0	144.948	144.948
Indische Rupie	0	98.221	98.221	0	123.814	123.814
Israelischer Schekel	0	(109.588)	(109.588)	25.085	(170.811)	(145.726)
Norwegische Krone	12.193	39.552	51.745	25.356	110.729	136.085
Peruanischer Nuevo Sol	0	73.633	73.633	0	73.740	73.740
Taiwan-Dollar	42.004	(191.353)	(149.349)	172.004	(366.954)	(194.950)
US-Dollar	2.059.425	(897.289)	1.162.136	1.313.859	(1.521.877)	(208.018)
	€ 2.428.148	€ (1.187.211)	€ 1.240.937	€ 1.677.348	€ (1.460.544)	€ 216.804

Emerging Local Bond Fund

	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Brasilianischer Real	\$ 47.416	\$ 308.936	\$ 356.352	\$ 72.605	\$ 116.650	\$ 189.255
Chilenischer Peso	108.258	(61.784)	46.474	48.276	(5.534)	42.742
Chinesischer Renminbi (Festland)	151.215	110.209	261.424	111.344	54.864	166.208
Kolumbianischer Peso	160.432	19.884	180.316	92.165	(2.600)	89.565
Tschechische Krone	124.618	43.798	168.416	56.636	47.780	104.416
Euro	79.847	(180.286)	(100.439)	65.535	(36.905)	28.630
Ungarischer Forint	64.408	67.181	131.589	61.026	(734)	60.292
Indonesische Rupiah	275.641	(35.844)	239.797	166.739	39.786	206.525
Malaysischer Ringgit	244.416	50.578	294.994	176.652	11.634	188.286
Mexikanischer Peso	245.488	66.863	312.351	144.527	33.144	177.671
Peruanischer Nuevo Sol	55.001	19.709	74.710	46.699	(3.191)	43.508
Philippinischer Peso	(175.483)	(2.913)	(178.396)	855	447	1.302
Polnischer Zloty	14.575	191.428	206.003	8.441	107.423	115.864
Rumänischer Leu	75.514	30.448	105.962	76.773	(15.089)	61.684
Südafrikanischer Rand	370.121	(114.894)	255.227	257.451	(84.444)	173.007
Thailändischer Baht	240.767	28.346	269.113	80.943	110.257	191.200
Türkische Lira	8.487	126.238	134.725	0	1.326	1.326
	\$ 2.090.721	\$ 667.897	\$ 2.758.618	\$ 1.466.667	\$ 374.814	\$ 1.841.481

Emerging Local Bond ESG Fund

	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Brasilianischer Real	\$ 429	\$ 11.111	\$ 11.540	\$ 251	\$ 361	\$ 612
Chilenischer Peso	4.290	(2.034)	2.256	140	54	194
Kolumbianischer Peso	4.731	(88)	4.643	233	(20)	213
Tschechische Krone	6.641	1.176	7.817	453	128	581
Euro	(123)	(4.617)	(4.740)	37	66	103
Ungarischer Forint	4.201	1.364	5.565	260	(13)	247
Indonesische Rupiah	7.998	1.862	9.860	671	4	675
Malaysischer Ringgit	6.112	6.041	12.153	588	159	747
Mexikanischer Peso	8.666	1.982	10.648	545	96	641
Peruanischer Nuevo Sol	1.977	535	2.512	146	3	149
Philippinischer Peso	(10.143)	(19)	(10.162)	0	3	3
Polnischer Zloty	8.460	2.152	10.612	371	168	539
Rumänischer Leu	3.714	1.280	4.994	290	(15)	275
Südafrikanischer Rand	12.163	(3.386)	8.777	823	(230)	593
Thailändischer Baht	8.172	1.121	9.293	283	346	629
Türkische Lira	11	4.209	4.220	0	(20)	(20)
	\$ 67.299	\$ 22.689	\$ 89.988	\$ 5.091	\$ 1.090	\$ 6.181

PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund

	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Brasilianischer Real	\$ 5.349	\$ 20.716	\$ 26.065	\$ 5.017	\$ 5.180	\$ 10.197
Britisches Pfund Sterling	1.681	(12.906)	(11.225)	2.581	(1.942)	639
Chilenischer Peso	10.599	(7.974)	2.625	208	5.420	5.628
Chinesischer Renminbi (Festland)	19	4.544	4.563	377	8.175	8.552
Kolumbianischer Peso	6.900	9.067	15.967	438	1.203	1.641
Euro	28.577	(47.783)	(19.206)	11.804	(15.001)	(3.197)
Ungarischer Forint	8.150	17.326	25.476	11.388	(10.979)	409
Indische Rupie	18.346	7.202	25.548	0	0	0
Indonesische Rupiah	0	15.048	15.048	0	15.191	15.191
Malaysischer Ringgit	22	5.160	5.182	(37)	7.337	7.300
Mexikanischer Peso	18.579	2.103	20.682	2.101	723	2.824
Rumänischer Leu	571	5.092	5.663	0	(53)	(53)
Singapur-Dollar	3	(7.658)	(7.655)	105	165	270
Südafrikanischer Rand	18.248	(9.838)	8.410	10.393	(4.989)	5.404
Thailändischer Baht	79	2.906	2.985	246	4.183	4.429
Türkische Lira	0	19.096	19.096	2	(5.829)	(5.827)
	\$ 117.123	\$ 22.101	\$ 139.224	\$ 44.623	\$ 8.784	\$ 53.407

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

		Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund					
		Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
		Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Brasilianischer Real	\$	154	\$ 1.276	\$ 1.430	\$ 577	\$ 558	\$ 1.135
Chinesischer Renminbi (Festland)		94	1.606	1.700	24	1.897	1.921
Kolumbianischer Peso		804	(300)	504	758	(444)	314
Tschechische Krone		101	647	748	193	702	895
Euro		710	(1.439)	(729)	582	(306)	276
Ungarischer Forint		2.031	(1.215)	816	648	(22)	626
Indische Rupie		(1)	1.864	1.863	0	1.657	1.657
Indonesische Rupiah		0	747	747	1	945	946
Malaysischer Ringgit		985	(22)	963	76	926	1.002
Mexikanischer Peso		617	1.438	2.055	361	1.674	2.035
Polnischer Zloty		439	811	1.250	82	1.074	1.156
Rumänischer Leu		19	361	380	0	425	425
Singapur-Dollar		4	1.534	1.538	1	1.580	1.581
Südafrikanischer Rand		1.531	(746)	785	819	(440)	379
Südkoreanischer Won		4	2.043	2.047	5	2.240	2.245
Taiwan-Dollar		0	1.487	1.487	0	1.325	1.325
Thailändischer Baht		2	930	932	(1)	1.084	1.083
Türkische Lira		0	1.674	1.674	0	766	766
	\$	7.494	\$ 12.696	\$ 20.190	\$ 4.126	\$ 15.641	\$ 19.767
		Euro Bond Fund					
		Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
		Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
US-Dollar	€	370.646	€ (188.216)	€ 182.430	€ 271.900	€ (176.499)	€ 95.401
		Euro Credit Fund					
		Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
		Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
US-Dollar	€	53.596	€ (29.784)	€ 23.812	€ 89.377	€ (81.174)	€ 8.203
		Euro Income Bond Fund					
		Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
		Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
US-Dollar	€	1.028.106	€ (402.089)	€ 626.017	€ 292.182	€ (272.298)	€ 19.884
		Euro Long Average Duration Fund					
		Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
		Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
US-Dollar	€	107.873	€ (32.196)	€ 75.677	€ 9.930	€ (6.060)	€ 3.870
		PIMCO European Short-Term Opportunities Fund					
		Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
		Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
US-Dollar	€	27.342	€ (12.915)	€ 14.427	€ 26.301	€ (15.271)	€ 11.030
		Global Advantage Fund					
		Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
		Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Australischer Dollar	\$	16.478	\$ 1.438	\$ 17.916	\$ 17.341	\$ 2.048	\$ 19.389
Brasilianischer Real		83	10.466	10.549	2.687	5.312	7.999
Britisches Pfund Sterling		25.058	(11.051)	14.007	32.405	(19.088)	13.317
Kanadischer Dollar		5.346	(3.704)	1.642	2.065	6.250	8.315
Chinesischer Renminbi (Festland)		251	32.792	33.043	443	35.354	35.797
Chinesischer Renminbi (Offshore)		0	2.669	2.669	2	9.188	9.190
Euro		106.734	(27.740)	78.994	100.213	(17.702)	82.511
Indische Rupie		2.924	16.429	19.353	2.953	11.479	14.432
Japanischer Yen		38.301	(8.871)	29.430	13.430	17.993	31.423
Mexikanischer Peso		125	9.259	9.384	143	4.037	4.180
	\$	195.300	\$ 21.687	\$ 216.987	\$ 171.682	\$ 54.871	\$ 226.553

Global Bond Fund						
Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Australischer Dollar	\$ 530.678	\$ (200.364)	\$ 330.314	\$ 493.730	\$ (113.174)	\$ 380.556
Chinesischer Renminbi (Offshore)	0	(328.466)	(328.466)	1	(7.989)	(7.988)
	\$ 530.678	\$ (528.830)	\$ 1.848	\$ 493.731	\$ (121.163)	\$ 372.568
Global Bond ESG Fund						
Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Chinesischer Renminbi (Offshore)	\$ 0	\$ (86.753)	\$ (86.753)	\$ 0	\$ 2.180	\$ 2.180
Global Bond Ex-US Fund						
Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Australischer Dollar	\$ 34.294	\$ (15.133)	\$ 19.161	\$ 34.822	\$ (13.053)	\$ 21.769
Chinesischer Renminbi (Festland)	32.483	0	32.483	15.260	0	15.260
Chinesischer Renminbi (Offshore)	0	(57.267)	(57.267)	0	(21.272)	(21.272)
	\$ 66.777	\$ (72.400)	\$ (5.623)	\$ 50.082	\$ (34.325)	\$ 15.757
Income Fund						
Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Brasilianischer Real	\$ 648	\$ 2.606.334	\$ 2.606.982	\$ (7.405)	\$ 977.922	\$ 970.517
Kanadischer Dollar	317.982	(2.673.187)	(2.355.205)	35.234	(39.351)	(4.117)
Chinesischer Renminbi (Offshore)	0	(1.951.254)	(1.951.254)	0	(3.531)	(3.531)
Japanischer Yen	2.532.381	(971.099)	1.561.282	2.979.968	(1.651.362)	1.328.606
Taiwan-Dollar	0	(1.497.865)	(1.497.865)	0	(313.972)	(313.972)
	\$ 2.851.011	\$ (4.487.071)	\$ (1.636.060)	\$ 3.007.797	\$ (1.030.294)	\$ 1.977.503
Income Fund II						
Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Australischer Dollar	\$ 11	\$ (2.852)	\$ (2.841)	\$ 0	\$ 1.031	\$ 1.031
Brasilianischer Real	0	3.316	3.316	176	583	759
	\$ 11	\$ 464	\$ 475	\$ 176	\$ 1.614	\$ 1.790
Inflation Multi-Asset Fund						
Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Indische Rupie	\$ 0	\$ 5.340	\$ 5.340	\$ 0	\$ 5.063	\$ 5.063
Mexikanischer Peso	0	5.582	5.582	0	5.993	5.993
	\$ 0	\$ 10.922	\$ 10.922	\$ 0	\$ 11.056	\$ 11.056
Low Duration Income Fund						
Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Kanadischer Dollar	\$ 373.193	\$ (237.305)	\$ 135.888	\$ 1	\$ (1)	\$ 0
Low Duration Opportunities Fund						
Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Euro	\$ 187.178	\$ (201.645)	\$ (14.467)	\$ 197.537	\$ (226.587)	\$ (29.050)
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund						
Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Kanadischer Dollar	\$ 151	\$ (430)	\$ (279)	\$ 2	\$ 0	\$ 2
Chinesischer Renminbi (Offshore)	0	(231)	(231)	0	0	0
	\$ 151	\$ (661)	\$ (510)	\$ 2	\$ 0	\$ 2

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Strategic Income Fund					
	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Australischer Dollar	\$ 2.444	\$ (850)	\$ 1.594	\$ 5.676	\$ 6.403	\$ 12.079
Brasilianischer Real	3.988	12.325	16.313	2.987	6.021	9.008
Euro	45.625	(30.235)	15.390	15.965	(9.432)	6.533
Japanischer Yen	6.598	\$ 6.604	13.202	6.770	7.884	14.654
	\$ 58.655	\$ (12.156)	\$ 46.499	\$ 31.398	\$ 10.876	\$ 42.274
	PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund					
	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Brasilianischer Real	\$ 2.827	\$ 11.051	\$ 13.878	\$ 264	\$ 13.022	\$ 13.286
Britisches Pfund Sterling	(52)	15.640	15.588	123	5.593	5.716
Kanadischer Dollar	338	21.931	22.269	16.561	(23.692)	(7.131)
Chilenischer Peso	(2.719)	(4.767)	(7.486)	(737)	14.132	13.395
Chinesischer Renminbi (Offshore)	0	5.842	5.842	0	(2.252)	(2.252)
Kolumbianischer Peso	(2.626)	10.442	7.816	25	(5.782)	(5.757)
Euro	1.747	3.266	5.013	398	15	413
Ungarischer Forint	6.682	(2.902)	3.780	564	10.036	10.600
Indische Rupie	(10)	(655)	(665)	(1.228)	(31.304)	(32.532)
Indonesische Rupiah	0	(7.857)	(7.857)	0	(20.219)	(20.219)
Israelischer Schekel	(736)	2.361	1.625	8.144	(35.304)	(27.160)
Malaysischer Ringgit	(508)	(5.482)	(5.990)	348	3.776	4.124
Mexikanischer Peso	(186)	8.156	7.970	(52)	7.371	7.319
Neuseeland-Dollar	0	11.777	11.777	0	10.948	10.948
Peruanischer Nuevo Sol	0	6.887	6.887	0	15.806	15.806
Philippinischer Peso	0	7.253	7.253	0	5.033	5.033
Rumänischer Leu	0	(29)	(29)	0	17.909	17.909
Singapur-Dollar	44	(3.051)	(3.007)	(482)	9.478	8.996
Schwedische Krone	185	5.038	5.223	98	852	950
Schweizer Franken	0	12.005	12.005	45	9.471	9.516
Taiwan-Dollar	3	(14.078)	(14.075)	(707)	0	(707)
Thailändischer Baht	331	(7.195)	(6.864)	116	(18.208)	(18.092)
	\$ 5.320	\$ 75.633	\$ 80.953	\$ 23.480	\$ (13.319)	\$ 10.161
	UK Corporate Bond Fund					
	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
US-Dollar	£ 18.144	£ (6.033)	£ 12.111	£ 14.318	£ (14.729)	£ (411)
	UK Long Term Corporate Bond Fund					
	Zum 31. Dez. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
US-Dollar	£ 20.341	£ (1.951)	£ 18.390	£ 22.661	£ (21.868)	£ 793

(c) Zinsrisiko

Das Zinsrisiko ist das Risiko, dass der Wert von Rentenwerten aufgrund veränderter Zinssätze sinkt. Bei einem Anstieg des Nominalzinssatzes sinkt voraussichtlich der Wert bestimmter, von den Fonds gehaltener Rentenwerte. Der Nominalzinssatz lässt sich als Summe des realen Zinssatzes und der voraussichtlichen Inflationsrate beschreiben. Rentenwerte mit längeren Laufzeiten reagieren eher empfindlich auf Änderungen der Zinssätze, was sie volatil macht als Wertpapiere mit kürzeren Laufzeiten. Die Duration dient hauptsächlich als Maß für die Sensitivität des Marktpreises eines Rentenpapiers gegenüber Zinssatzschwankungen (d. h. Renditeschwankungen).

Alle übrigen Fonds sind vornehmlich in Rentenwerten investiert und somit den Risiken ausgesetzt, die mit den Auswirkungen der Schwankungen der geltenden Marktzinsen auf ihre Finanzpositionen und Cashflows zusammenhängen. Diese Anlagen sind in der Aufstellung der Wertpapieranlagen ausgewiesen. Überschüssige Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente werden zu kurzfristigen Marktzinsen investiert.

Die Sensitivität der Exponierung der Gesellschaft gegenüber dem Zinsrisiko ist in den VaR-Gesamtberechnungen in Erläuterung 16 (a) angegeben.

(d) Liquiditätsrisiko

Das Liquiditätsrisiko eines Fonds wird hauptsächlich durch die Rücknahme von Anteilen beeinflusst. Inhaber gewinnberechtigter Anteile können einen Teil oder die Gesamtheit ihrer im Umlauf befindlichen Anteile gemäß den Bestimmungen des Prospekts zurückgeben. Rückgabeberechtigte Anteile werden auf Ansuchen des Anteilnehmers zurückgenommen und im Finanzstatus ausgewiesen. Die

Vermögenswerte des Fonds bestehen hauptsächlich aus jederzeit veräußerbaren Wertpapieren, die umgehend verkauft werden können, um Rücknahmen von Anteilhabern in Übereinstimmung mit dem Prospekt ausführen zu können. Ein Liquiditätsrisiko liegt vor, wenn sich bestimmte Anlagen schwer kaufen oder verkaufen lassen. Auch kann es bei illiquiden Wertpapieren die Bewertung schwieriger werden, insbesondere bei wechselhaften Märkten. Die Anlagen eines Fonds in illiquiden Wertpapieren können die Erträge des Fonds schmälern, da dieser eventuell nicht in der Lage ist, die illiquiden Wertpapiere zu einer günstigen Zeit oder einem günstigen Kurs zu veräußern. Fonds mit Kapitalanlagestrategien, die Devisen, Derivate oder Wertpapiere mit beträchtlichen Markt- und/oder Kreditrisiken enthalten, neigen dazu, am anfälligsten für Liquiditätsrisiken zu sein.

Darüber hinaus kann der Markt für bestimmte Anlagen bei widrigen Markt- oder Wirtschaftsbedingungen illiquide werden, unabhängig von individuellen ungünstigen Veränderungen der Lage eines bestimmten Emittenten. In diesen Fällen kann ein Fonds aufgrund von Beschränkungen bei der Anlage in illiquiden Wertpapieren und der Schwierigkeit, solche Wertpapiere oder Instrumente zu kaufen und zu verkaufen, nicht in der Lage sein, das gewünschte Maß an Engagement in einem bestimmten Sektor zu erreichen. Soweit die Hauptanlagestrategien eines Fonds Wertpapiere von Unternehmen mit geringeren Marktkapitalisierungen, ausländischen Wertpapieren, illiquiden Sektoren festverzinslicher Wertpapiere oder Wertpapiere mit erheblichem Markt- und/oder Kreditrisiko umfassen, weist der Fonds tendenziell ein höheres Engagement im Liquiditätsrisiko auf. Ferner könnten festverzinsliche Wertpapiere mit längeren Laufzeiten einem erhöhten Liquiditätsrisiko im Vergleich zu festverzinslichen Wertpapieren mit kürzeren Laufzeiten ausgesetzt sein.

Und schließlich bezieht sich das Liquiditätsrisiko auch auf das Risiko ungewöhnlich umfangreicher Rücknahmeanträge oder sonstiger ungewöhnlicher Marktbedingungen, die es einem Fonds erschweren können, Rücknahmeanträge innerhalb des zulässigen Zeitraums vollständig auszuführen. Die Erfüllung solcher Rücknahmeanträge könnte es erforderlich machen, dass ein Fonds Wertpapiere zu niedrigeren Kursen oder unter ungünstigen Bedingungen verkauft, was den Wert des Fonds verringern würde. Es kann auch der Fall sein, dass andere Marktteilnehmer versuchen, festverzinsliche Positionen zur gleichen Zeit wie ein Fonds zu liquidieren, was zu einem erhöhten Angebot auf dem Markt führen und zu Liquiditätsrisiko und Abwärtspreisdruck beitragen kann.

Für alle Fonds ist die Gesellschaft berechtigt, die Anzahl der Anteile eines Fonds, die an einem Geschäftstag zurückgegeben werden können, auf 10 % der Gesamtzahl der ausgegebenen Anteile dieses Fonds zu beschränken. In diesem Fall wird die Gesellschaft alle Rücknahmeanträge an diesem Handelstag anteilig verringern und die Rücknahmeanträge so behandeln, als wären sie am jeweils nächsten Handelstag eingegangen, bis alle Anteile, auf die sich der ursprüngliche Antrag bezog, zurückgenommen wurden.

Die Satzung enthält besondere Bestimmungen für den Fall, dass infolge des Rücknahmeantrags eines Anteilnehmers Anteile in Höhe von mehr als 5 % des NÜW der Anteile eines Fonds an einem Handelstag durch die Gesellschaft zurückgenommen würden. In einem solchen Fall kann die Gesellschaft in ihrem alleinigen Ermessen (soweit nicht anders in der maßgeblichen Fondsergänzung beschrieben) den Rücknahmeantrag durch die Übertragung von Vermögenswerten des jeweiligen Fonds an den Anteilhaber in Sachwerten (in Wertpapieren) erfüllen, deren Wert dem Rücknahmepreis der zurückgenommenen Anteile entspricht, als würden die Rücknahmeerlöse in bar abzüglich etwaiger Rücknahmegebühren und sonstiger Übertragungskosten gezahlt, sofern eine solche Auszahlung den Interessen der verbleibenden Anteilhaber dieses Fonds nicht abträglich ist. Wenn der Anteilhaber, der eine solche Rücknahme beantragt, über die Absicht der Gesellschaft benachrichtigt wird, den Rücknahmeantrag durch eine solche Auszahlung von Vermögenswerten zu erfüllen, kann dieser Anteilhaber von der Gesellschaft verlangen, anstelle der Übertragung dieser Vermögenswerte deren Verkauf zu arrangieren und die Erlöse des Verkaufs an diesen Anteilhaber zu zahlen, wobei die anfallenden Kosten durch den jeweiligen Anteilhaber getragen werden.

Um die Auswirkungen der Verwässerung zu verringern, kann der Verwaltungsrat nach eigenem Ermessen eine Swing-Pricing-Anpassung des Nettoinventarwerts je Anteil vornehmen.

Die derzeit bekannten Verbindlichkeiten der Fonds sind im Finanzstatus ausgewiesen. Der Großteil dieser Verbindlichkeiten ist innerhalb von drei Monaten zahlbar. Hiervon ausgenommen sind Verbindlichkeiten aus Finanzderivaten und leerverkauften Wertpapieren. Die frühesten vertraglichen Fälligkeitstermine für Verbindlichkeiten aus Finanzderivaten sind in der Aufstellung der Wertpapieranlagen angegeben.

Derivative Finanzinstrumente bestehen aus dem Marktwert von Devisenterminkontrakten, Terminkontrakten, Optionskontrakten und Swaps zum Ende des Geschäftsjahres. Derivative Finanzinstrumente sind finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die zu Handelszwecken gehalten werden, und werden hauptsächlich zur kurzfristigen Veräußerung erworben. Da nicht davon auszugehen ist, dass die Instrumente bis zur Fälligkeit oder Beendigung gehalten werden, stellt der aktuelle Marktwert den geschätzten Kapitalfluss dar, der erforderlich sein kann, um die Positionen zu veräußern. Zukünftige Kapitalflüsse der Fonds und realisierte Verbindlichkeiten können von den kurzfristigen Verbindlichkeiten aufgrund veränderter Marktbedingungen abweichen.

Die Anlageberatungsgesellschaften verwalten das Liquiditätsrisiko, indem sie die Portfolios überwachen und Anlagen prüfen, die als illiquide oder nicht jederzeit und sofort verkäuflich gelten, um sicherzustellen, dass ausreichend liquide Vermögenswerte vorhanden sind, um die ausstehenden Verbindlichkeiten der Fonds zu begleichen.

Einige Fonds können eine konzentrierte Anteilhaberbasis aufweisen, wenn große institutionelle Anteilhaber einen erheblichen Anteil am Nettovermögen eines Fonds halten. Dies setzt die anderen Anteilhaber des Fonds gewissen Risiken aus. Zu diesen Risiken zählt das Risiko, dass an einem beliebigen Tag ein großer Teil der Vermögenswerte eines Fonds zurückgenommen werden kann, was die allgemeine Wirtschaftlichkeit des Fonds oder die Fähigkeit anderer Anteilhaber beeinträchtigen könnte, die an diesem Tag keine Rücknahmeanträge gestellt haben, Rücknahmen beim Fonds zu beantragen, wenn es beispielsweise erforderlich werden kann, eine eingeschränkte Bearbeitung der Rücknahmeanträge zu veranlassen. Die nachfolgend aufgeführten Fonds sind einem erheblichen Konzentrationsrisiko ausgesetzt, da sie Anteilhaber haben, die mehr als 20 % des Nettovermögens des Fonds halten. Eine solche Konzentration der Anteilhaberbeteiligungen könnte wesentliche Auswirkungen auf den Fonds haben, sollte einer dieser Anteilhaber die Rückzahlung erheblicher Kapitalbeträge beantragen. Der prozentuale Anteilsbesitz der Allianz-Gruppe, von Fonds der Gesellschaft, von mit der Gesellschaft verbundenen Fonds und von Mitarbeitern der Anlageberatungsgesellschaften wird nachstehend nicht angegeben, da dieser separat in Erläuterung 14 ausgewiesen wird.

Fondsbezeichnung

PIMCO Balanced Income and Growth Fund
Commodity Real Return Fund
Diversified Income Duration Hedged Fund
Dynamic Bond Fund
Emerging Local Bond ESG Fund
Emerging Markets Corporate Bond Fund
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund
Euro Bond Fund
Euro Credit Fund
Euro Long Average Duration Fund
Euro Long Average Duration Fund
Euro Short-Term Fund
Euro Short-Term Fund
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund
Global Advantage Fund
Global Bond ESG Fund
Global Investment Grade Credit ESG Fund
Global Investment Grade Credit ESG Fund
Global Low Duration Real Return Fund
Income Fund II
Income Fund II
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund
Low Duration Income Fund
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund
UK Corporate Bond Fund
UK Corporate Bond Fund
UK Long Term Corporate Bond Fund

31. Dez. 2023		31. Dez. 2022	
Name des Anteilhabers	Beteiligung in %	Name des Anteilhabers	Beteiligung in %
Anteilhaber T	k. A.	Anteilhaber T	30,91
Anteilhaber A	k. A.	Anteilhaber A	21,10
Anteilhaber B	24,00	Anteilhaber B	22,79
Anteilhaber F	40,05	Anteilhaber F	34,98
Anteilhaber V	91,84	Anteilhaber V	k. A.
Anteilhaber O	62,78	Anteilhaber O	54,14
Anteilhaber R	22,69	Anteilhaber R	31,08
Anteilhaber J	k. A.	Anteilhaber J	22,29
Anteilhaber K	26,31	Anteilhaber K	20,35
Anteilhaber J	83,92	Anteilhaber J	k. A.
Anteilhabern M	k. A.	Anteilhabern M	36,92
Anteilhaber L	k. A.	Anteilhaber L	20,79
Anteilhaber W	k. A.	Anteilhaber W	24,59
Anteilhaber D	29,10	Anteilhaber D	27,37
Anteilhaber N	29,85	Anteilhaber N	29,19
Anteilhaber P	21,43	Anteilhaber P	k. A.
Anteilhaber Q	20,53	Anteilhaber Q	k. A.
Anteilhaber S	k. A.	Anteilhaber S	20,85
Anteilhaber E	37,92	Anteilhaber E	k. A.
Anteilhaber U	52,36	Anteilhaber U	46,97
Anteilhaber X	24,05	Anteilhaber X	k. A.
Anteilhaber Y	34,30	Anteilhaber Y	46,86
Anteilhaber Y	31,49	Anteilhaber Y	54,34
Anteilhaber AA	k. A.	Anteilhaber AA	34,76
Anteilhaber C	23,23	Anteilhaber C	k. A.
Anteilhaber G	24,75	Anteilhaber G	k. A.
Anteilhaber H	48,26	Anteilhaber H	44,00

(e) Kredit- und Kontrahentenrisiken

Die Fonds setzen sich gegenüber Parteien, mit denen sie Geschäfte tätigen, einem Kreditrisiko aus. Hinzu kommt das Risiko eines Zahlungsausfalls. Die Fonds handeln mit Kontrahenten, die derzeit ein Mindestrating von BBB/Baa2 halten. Die Fonds minimieren die Konzentration des Kreditrisikos, indem sie Transaktionen gegebenenfalls mit einer Vielzahl von Kunden und Kontrahenten an anerkannten und renommierten Börsen durchführen. OTC-Derivatgeschäfte sind dem Risiko ausgesetzt, dass der Kontrahent der Transaktion seinen vertraglichen Verpflichtungen gegenüber der jeweils anderen Partei nicht nachkommt, da viele der im Rahmen zentral abgerechneter Derivattransaktionen geltenden Schutzmechanismen für OTC-Derivatgeschäfte gegebenenfalls nicht zur Verfügung stehen. Für derivative Finanzinstrumente, die an Börsen oder über Clearingstellen gehandelt werden, betrifft das primäre Kreditrisiko die Bonität des Clearing-Brokers des Fonds bzw. der Börse oder Clearingstelle selbst. Die Fonds können Geld verlieren, wenn der Emittent oder Garant eines Rentenwerts oder der Kontrahent eines Finanzderivats, Pensionsgeschäfts oder eines Darlehens von Portfoliowertpapieren nicht in der Lage oder nicht bereit ist, Kapital- und/oder Zinszahlungen rechtzeitig vorzunehmen oder anderweitig seinen Verpflichtungen nachzukommen. Wertpapiere und Finanzderivate unterliegen Kreditrisiken unterschiedlichen Grades, die sich oft in den Bonitätsbewertungen widerspiegeln.

Ähnlich wie beim Kreditrisiko können die Fonds einem Kontrahentenrisiko ausgesetzt sein, d. h. dem Risiko, dass eine Partei einer Transaktion mit einem Fonds eine Verpflichtung gegenüber dem Fonds nicht erfüllt oder dieser nicht nachkommt. PIMCO und die Anlageberatungsgesellschaften minimieren die Kontrahentenrisiken der Fonds auf mehrere Arten. Vor Abschluss einer Transaktion mit einem neuen Kontrahenten führt das Counterparty Risk Committee (Ausschuss für Kontrahentenrisiken) von PIMCO eine umfassende Bonitätsprüfung des Kontrahenten durch und muss die Verwendung des betreffenden vorab Kontrahenten genehmigen. Darüber hinaus gilt gemäß den Bestimmungen des zugrundeliegenden Vertrags: wenn nicht eingezahlte Beträge, die einem Fonds geschuldet werden, eine vorab festgelegte Schwelle überschreiten, muss dieser Kontrahent dem Fonds Sicherheiten in Form von Barmitteln oder Wertpapieren in der Höhe vorschließen, die dem Wert des nicht eingezahlten und dem Fonds geschuldeten Betrags entsprechen. Der Fonds darf diese Sicherheiten in Wertpapiere oder andere Instrumente anlegen und zahlt dem Kontrahenten gewöhnlich Zinsen auf die erhaltenen Sicherheiten. Verringert sich der einem jeden Fonds geschuldete Betrag später, wäre der Fonds verpflichtet, die zuvor gestellten Sicherheiten ganz oder teilweise an den Kontrahenten zurückzugeben.

Alle Geschäfte mit notierten Wertpapieren werden bei Lieferung durch zugelassene Kontrahenten abgewickelt/bezahlt. Das Zahlungsfähigkeitsrisiko gilt als minimal, da die Lieferung der verkauften Wertpapiere ausschließlich erfolgt, wenn die Fonds die Zahlung erhalten haben. Die Zahlung für einen Kauf erfolgt, sobald der Kontrahent die Wertpapiere geliefert hat. Das Geschäft schlägt fehl, wenn eine der Parteien ihre Verpflichtungen nicht erfüllt.

Rahmenaufrechnungsverträge Bestimmte Fonds unterliegen gegebenenfalls unterschiedlichen Rahmenaufrechnungsvereinbarungen („Rahmenverträge“) mit ausgewählten Kontrahenten. Die Rahmenverträge legen die Bedingungen bestimmter Transaktionen fest und verringern das Kontrahentenrisiko, das mit den jeweiligen Transaktionen verbunden ist, indem Schutzmechanismen für die Kreditsicherheit sowie Standardisierungen eingesetzt werden, die die rechtliche Sicherheit erhöhen. Jede Art von Rahmenvertrag regelt bestimmte Arten von Transaktionen. Verschiedene Arten von Transaktionen können von verschiedenen Körperschaften oder verbundenen Parteien einer bestimmten Organisation gehandelt werden, was zur Folge hat, dass mit ein und demselben Kontrahenten mehrere Vereinbarungen notwendig sind. Da die Rahmenverträge für individuelle Aspekte unterschiedlicher Vermögensarten spezifisch sind, ist den Fonds im Verzugsfall hinsichtlich aller einem einzigen Rahmenvertrag mit einem Kontrahenten unterliegenden Transaktionen eine Gattstellung und Aufrechnung des Gesamtengagement bei einem Kontrahenten möglich. Für Zwecke der Finanzberichterstattung werden derivative Vermögenswerte und Verbindlichkeiten im Finanzstatus grundsätzlich auf Bruttobasis ausgewiesen, was die vollständigen Risiken und Engagements vor Saldierung abbildet.

Rahmenverträge können zu einer Verringerung des Kontrahentenrisikos beitragen, indem Vereinbarungen über das Stellen von Sicherheiten bei vorher festgelegten Risikoniveaus vorgegeben werden. Laut den meisten Rahmenverträgen werden Sicherheiten routinemäßig übertragen, wenn das

Nettoengagement insgesamt bei bestimmten Transaktionen (ohne die bereits bestehenden Sicherheiten), die dem betreffenden Rahmenvertrag mit einem Kontrahenten unterliegen, in einem bestimmten Konto über eine bestimmte Schwelle hinausgeht, die normalerweise zwischen null bis 250.000 USD (oder in einer anderen maßgeblichen Währung) liegt, je nach dem Kontrahenten und der Art des Rahmenvertrags. Gegenwärtig sind U.S. Treasury Bills und US-Dollar-Barmittel im Allgemeinen die bevorzugten Sicherheiten, obwohl auch andere Formen von leicht handelbaren Wertpapieren mit hohem Rating zulässig sind, je nach Rahmenvertrag oder dessen Sicherheitenanhang. Wertpapiere und Barmittel, die als Sicherheiten verwendet werden, werden im Finanzstatus als Vermögenswerte entweder als eine Komponente in dem ergebniswirksam zum Marktwert bewerteten Finanzvermögen (übertragbare Wertpapiere) oder als Einlagen bei Kontrahenten (Barmittel) ausgewiesen. Erhaltene Barsicherheiten werden üblicherweise nicht in einem gesonderten Konto gehalten und werden somit im Finanzstatus als Verbindlichkeit als Einlagen von Kontrahenten ausgewiesen. Der Marktwert von als Sicherheiten erhaltener Wertpapiere wird nicht als Komponente des NIW ausgewiesen. Das allgemeine Kontrahentenrisiko für die Fonds kann sich innerhalb kurzer Zeit erheblich ändern, da es sich mit jeder Transaktion gemäß dem jeweiligen Rahmenvertrag ändert.

Rahmenverträge für Pensionsgeschäfte und globale Rahmenverträge für Pensionsgeschäfte (einzeln und zusammen „Rahmenverträge für Pensionsgeschäfte“) regeln Pensionsgeschäfte, umgekehrte Pensionsgeschäfte und Sale-Buyback-Geschäfte zwischen den Fonds und ausgewählten Kontrahenten. Die Rahmenverträge für Pensionsgeschäfte enthalten unter anderem Bestimmungen für den Abschluss, Ertragszahlungen, Verzugsereignisse sowie die Bereitstellung von Sicherheiten. Der Marktwert von Transaktionen gemäß dem Rahmenvertrag für Pensionsgeschäfte, die verpfändeten oder erhaltenen Sicherheiten und das Nettoengagement je Kontrahent zum Ende des Geschäftsjahres sind in den Erläuterungen zur Aufstellung der Wertpapieranlagen ausgewiesen.

Rahmenverträge für Wertpapier-Termingeschäfte („Rahmenverträge für Termingeschäfte“) regeln bestimmte in der Zukunft liegende Abwicklungen, wie TBA-, Delayed-Delivery- oder Sale-Buyback-Geschäfte zwischen den Fonds und ausgewählten Kontrahenten. Die Rahmenverträge für Wertpapier-Termingeschäfte enthalten unter anderem Bestimmungen für den Abschluss und die Bestätigung, die Zahlung und Übertragung, Säumigkeit, die Beendigung sowie die Aufrechterhaltung von Sicherheiten. Der Marktwert von Transaktionen mit in der Zukunft liegender Abwicklungen, die verpfändeten oder erhaltenen Sicherheiten und das Nettoengagement je Kontrahent zum Ende des Geschäftsjahres sind in den Erläuterungen zur Aufstellung der Wertpapieranlagen ausgewiesen.

Die Rahmenverträge und Besicherungsanhänge (Credit Support Annexes) der International Swaps and Derivatives Association, Inc. („ISDA-Rahmenverträge“) regeln OTC-Derivatgeschäfte zwischen den Fonds und ausgewählten Kontrahenten. Die ISDA-Rahmenverträge enthalten Bestimmungen zu allgemeinen Verpflichtungen, Zusicherungen, Vereinbarungen, Sicherheiten und Säumigkeit bzw. Auflösung. Ereignisse, die zur Kündigung des Vertrags führen, umfassen Umstände, die Kontrahenten dazu ermächtigen können, den Vertrag vorzeitig zu beenden und die Begleichung aller ausstehenden Transaktionen nach dem geltenden ISDA-Rahmenvertrag einzuleiten. Eine Entscheidung, den Vertrag vorzeitig zu beenden, könnte sich wesentlich auf den Abschluss auswirken. Unter bestimmten Umständen kann der ISDA-Rahmenvertrag weitere Bestimmungen enthalten, wodurch zusätzlicher Kontrahentenschutz entsteht, der über den Schutz des täglich vorhandenen Risikos hinausgeht, wenn sich die Kreditqualität des Kontrahenten unter ein vorab festgelegtes Niveau verringert. Diese etwaigen Beträge können (oder müssen, falls gesetzlich vorgeschrieben) bei einer dritten Verwahrstelle gesondert gehalten werden. Der Marktwert von OTC-Finanzderivaten, die erhaltenen oder verpfändeten Sicherheiten und das Nettoengagement je Kontrahent zum Ende des Geschäftsjahres sind in den Erläuterungen zur Aufstellung der Wertpapieranlagen ausgewiesen. Die Anlageberatungsgesellschaft führt umfangreiche Recherchen und Analysen durch, um das Kreditrisiko der Fonds zu bestimmen und zu messen. Die Anlageberatungsgesellschaft überprüft ständig das Kreditrisiko der Fonds, um Erträge zu erzielen, indem Anlagen entweder vorgenommen oder gemieden werden. Wertpapiere unterliegen Kreditrisiken unterschiedlichen Grades, die sich oft in den Bonitätsbewertungen widerspiegeln. Die Tabelle unten fasst die Gestaltung der Bonität des Nettovermögens der einzelnen Fonds zusammen.

	PIMCO Asia High Yield Bond Fund		Asia Strategic Interest Bond Fund		PIMCO Balanced Income and Growth Fund	
	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022
Investment Grade	39 %	34 %	73 %	70 %	85 %	93 %
Non-Investment Grade	61 %	66 %	27 %	30 %	15 %	7 %
Nicht bewertet	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %
	PIMCO Capital Securities Fund		PIMCO Climate Bond Fund		Commodity Real Return Fund	
	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022
Investment Grade	79 %	76 %	95 %	91 %	99 %	99 %
Non-Investment Grade	21 %	24 %	5 %	9 %	1 %	1 %
Nicht bewertet	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %
	PIMCO Credit Opportunities Bond Fund		Diversified Income Fund		Diversified Income Duration Hedged Fund	
	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022
Investment Grade	70 %	68 %	75 %	79 %	73 %	71 %
Non-Investment Grade	30 %	32 %	25 %	21 %	27 %	29 %
Nicht bewertet	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %
	Diversified Income ESG Fund		Dynamic Bond Fund		Dynamic Multi-Asset Fund	
	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022
Investment Grade	67 %	69 %	86 %	87 %	99 %	96 %
Non-Investment Grade	33 %	31 %	14 %	13 %	1 %	4 %
Nicht bewertet	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %
	Emerging Local Bond Fund		Emerging Local Bond ESG Fund		Emerging Markets Bond Fund	
	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022
Investment Grade	78 %	75 %	85 %	87 %	69 %	67 %
Non-Investment Grade	22 %	25 %	15 %	13 %	31 %	33 %
Nicht bewertet	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %
	Emerging Markets Bond ESG Fund		Emerging Markets Corporate Bond Fund		PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	
	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022
Investment Grade	66 %	66 %	74 %	75 %	77 %	84 %
Non-Investment Grade	34 %	34 %	26 %	25 %	23 %	16 %
Nicht bewertet	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %
	Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund		PIMCO ESG Income Fund		Euro Bond Fund	
	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022
Investment Grade	84 %	83 %	88 %	88 %	97 %	97 %
Non-Investment Grade	16 %	17 %	12 %	12 %	3 %	3 %
Nicht bewertet	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %
	Euro Credit Fund		Euro Income Bond Fund		Euro Long Average Duration Fund	
	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022
Investment Grade	99 %	97 %	92 %	82 %	100 %	100 %
Non-Investment Grade	1 %	3 %	8 %	18 %	0 %	0 %
Nicht bewertet	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %
	Euro Short-Term Fund		PIMCO European High Yield Bond Fund		PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	
	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022
Investment Grade	100 %	97 %	47 %	44 %	97 %	95 %
Non-Investment Grade	0 %	3 %	53 %	56 %	3 %	5 %
Nicht bewertet	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %
	Global Advantage Fund		Global Bond Fund		Global Bond ESG Fund	
	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022
Investment Grade	94 %	90 %	97 %	96 %	98 %	97 %
Non-Investment Grade	6 %	10 %	3 %	4 %	2 %	3 %
Nicht bewertet	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Global Bond Ex-US Fund		Global High Yield Bond Fund		Global Investment Grade Credit Fund	
	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022
	Investment Grade	96 %	93 %	17 %	22 %	94 %
Non-Investment Grade	4 %	7 %	83 %	78 %	6 %	10 %
Nicht bewertet	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %

	Global Investment Grade Credit ESG Fund		Global Low Duration Real Return Fund		Global Real Return Fund	
	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022
	Investment Grade	97 %	94 %	100 %	100 %	99 %
Non-Investment Grade	3 %	6 %	0 %	0 %	1 %	1 %
Nicht bewertet	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %

	Income Fund		Income Fund II		Inflation Multi-Asset Fund	
	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022
	Investment Grade	86 %	77 %	82 %	70 %	96 %
Non-Investment Grade	14 %	23 %	18 %	30 %	4 %	3 %
Nicht bewertet	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %

	Low Average Duration Fund		Low Duration Global Investment Grade Credit Fund		Low Duration Income Fund	
	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022
	Investment Grade	97 %	99 %	96 %	93 %	89 %
Non-Investment Grade	3 %	1 %	4 %	7 %	11 %	20 %
Nicht bewertet	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %

	Low Duration Opportunities Fund		Low Duration Opportunities ESG Fund		PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	
	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022
	Investment Grade	84 %	87 %	97 %	97 %	100 %
Non-Investment Grade	16 %	13 %	3 %	3 %	0 %	0 %
Nicht bewertet	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %

	Mortgage Opportunities Fund		StocksPLUS™ Fund		PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	
	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022
	Investment Grade	87 %	71 %	95 %	85 %	95 %
Non-Investment Grade	13 %	29 %	5 %	15 %	5 %	6 %
Nicht bewertet	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %

	Strategic Income Fund		Total Return Bond Fund		PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	
	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022
	Investment Grade	81 %	76 %	96 %	96 %	94 %
Non-Investment Grade	19 %	24 %	4 %	4 %	6 %	5 %
Nicht bewertet	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %

	UK Corporate Bond Fund		UK Long Term Corporate Bond Fund		US High Yield Bond Fund	
	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022
	Investment Grade	98 %	98 %	98 %	97 %	14 %
Non-Investment Grade	2 %	2 %	2 %	3 %	86 %	80 %
Nicht bewertet	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %

	US Investment Grade Corporate Bond Fund		US Short-Term Fund	
	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022
	Investment Grade	96 %	95 %	100 %
Non-Investment Grade	4 %	5 %	0 %	1 %
Nicht bewertet??	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %

Im Wesentlichen werden alle Wertpapiere der Gesellschaft zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 von State Street Custodial Services (Ireland) Limited (die „Verwahrstelle“) treuhänderisch gehalten. Diese Vermögenswerte werden in gesonderten Konten für jeden Fonds (in Übereinstimmung mit den OGAW-Richtlinien der Zentralbank) gehalten, was das Ausfallrisiko für den Besitz der aufbewahrten Vermögenswerte reduziert. Die Gesellschaft ist jedoch dem Kreditrisiko eines Kreditinstituts ausgesetzt, das ihre Einlagen hält.

Das langfristige Bonitätsrating der State Street Corporation, der obersten Muttergesellschaft der Verwahrstelle, war zum 31. Dezember 2023 AA- (31. Dezember 2022: AA-), ausgestellt von der Ratingagentur Fitch.

Folgende Transaktionen wurden in den Geschäftsjahren zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 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	31. Dez. 2023		31. Dez. 2022	
	Summe Käufe und Verkäufe (Tsd.)	% Summe Käufe und Verkäufe	Summe Käufe und Verkäufe (Tsd.)	% Summe Käufe und Verkäufe
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	\$ 9.568.971	28,83	\$ 22.258.882	32,25
Asia Strategic Interest Bond Fund	468.546	16,12	730.951	15,06
PIMCO Balanced Income and Growth Fund	1.990.170	6,84	k. A.	k. A.
Commodity Real Return Fund	822.266	1,92	3.040.615	4,33
Diversified Income Fund	17.415.773	2,97	17.399.378	4,21
Emerging Local Bond Fund	1.941.990	2,19	1.659.744	2,12
Emerging Markets Bond Fund	1.720.658	4,79	3.169.131	7,60
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	90.540	3,47	74.306	4,64
Global Bond Fund	10.278.565	1,54	9.557.901	1,81
Global High Yield Bond Fund	1.236.160	3,56	4.538.756	6,31
Global Investment Grade Credit Fund	7.383.647	2,15	3.450.967	2,04
Global Real Return Fund	11.655.391	10,87	1.300.718	1,03
Income Fund	269.554.565	8,92	349.874.783	11,02
Income Fund II	11.085	0,77	644	0,07
Low Average Duration Fund	8.790.073	18,73	2.519.168	3,60
Total Return Bond Fund	2.507.856	2,35	9.037.904	5,40
US High Yield Bond Fund	1.581.144	14,46	5.136.959	14,37

Es wurde in den Geschäftsjahren zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 keine Provision für die Transaktionen in der vorstehenden Tabelle erhoben.

Einzelheiten zu Aktien, die in den Geschäftsjahren zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 durch Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft in durch die SFC zugelassenen Fonds gehalten wurden, sind Erläuterung 14 zu entnehmen. Einzelheiten zu Gebühren, die in den Geschäftsjahren zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 an Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft gezahlt wurden, sind Erläuterung 13 zu entnehmen.

Einzelheiten zum Wert der umlaufenden Anteile, die in den Geschäftsjahren zum 31. Dezember 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 14 zu entnehmen. Einzelheiten zu Gebühren, die an die Verwaltungsgesellschaft, die Anlageberatungsgesellschaften und/oder Unter-Anlageberatungsgesellschaften gezahlt wurden, sind Erläuterung 13 und der Betriebsergebnisrechnung zu entnehmen.

Verwaltungsratsmitglieder und leitende Angestellte der Verwahrstelle hielten in den Geschäftsjahren zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 keine Anteile der durch die SFC zugelassenen Fonds. Wie in Erläuterung 13 angegeben, wurden die Gebühren und Aufwendungen der Verwahrstelle durch

17. TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PERSONEN FÜR DIE IN HONGKONG VERTRIEBENEN FONDS

Verbundene Personen der Verwaltungsgesellschaft, der Anlageberatungsgesellschaften und/oder der Unter-Anlageberatungsgesellschaften, der Verwahrstelle und der Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft sind jene, die im Code on Unit Trusts and Mutual Funds der Securities and Futures Commission of Hong Kong (der „SFC-Code“) definiert sind. Alle Transaktionen, die während des Geschäftsjahres zwischen den durch die SFC zugelassenen Fonds („durch die SFC zugelassene Fonds“), wie im Abschnitt zu den allgemeinen Merkmalen des Jahresberichts beschrieben, und der Verwaltungsgesellschaft, den Anlageberatungsgesellschaften und/oder den Unter-Anlageberatungsgesellschaften, der Verwahrstelle und den Verwaltungsratsmitgliedern der Gesellschaft sowie deren jeweiligen verbundenen Personen eingegangen wurden, wurden im Rahmen der normalen Geschäftstätigkeit und zu den üblichen Geschäftsbedingungen abgeschlossen.

die Verwaltungsgesellschaft aus der Verwaltungsgebühr oder durch die Anlageberatungsgesellschaften gezahlt. Wie in Erläuterung 4 angegeben, wurden alle Bankguthaben der durch die SFC zugelassenen Fonds entweder von State Street Bank and Trust Co. in ihrer Eigenschaft als Vertreterin der Verwahrstelle oder direkt bei einer Unterverwahrstelle gehalten. Gegebenenfalls wurden den durch die SFC zugelassenen Fonds durch die Verwahrstelle Zinsen auf diese Barsalden gezahlt oder berechnet.

18. GRUNDKAPITAL

(a) Genehmigte Anteile

Das genehmigte Grundkapital der Gesellschaft beträgt 38.092 EUR und ist in 30.000 Zeichneranteile zu je 1,27 EUR und 500.000.000.000 gewinnberechtigten Anteile ohne Nennwert aufgeteilt, die ursprünglich als „nicht klassifizierte Anteile“ bezeichnet wurden.

(b) Zeichneranteile

Bis auf sieben sind die ursprünglichen 30.000 Zeichneranteile zurückgenommen worden. Die Zeichneranteile sind nicht Bestandteil des NIW der Gesellschaft und werden daher im Abschluss nur in Form dieser Erläuterung erwähnt. Diese Offenlegung spiegelt nach Ansicht des Verwaltungsrats das Wesen der Geschäftstätigkeit der Gesellschaft als Investmentfonds wider.

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

(c) Rückgabe- und gewinnberechtigte Anteile

Das ausgegebene gewinnberechtigte Grundkapital entspricht jederzeit dem NIW der Fonds. Rückgabe- und gewinnberechtigte Anteile werden auf Antrag des Anteilnehmers zurückgenommen und sind als Finanzverbindlichkeiten klassifiziert. Die Anzahl der gewinnberechtigten Anteile hat sich während der zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 endenden Geschäftsjahre wie folgt verändert (Angaben in Tausend):

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
PIMCO Asia High Yield Bond Fund		
Institutional:		
thesaurierend		
Begeben	51.764	147.409
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(61.598)	(90.909)
	(9.834)	56.500
Erträge		
Begeben	6.997	2.322
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	22	26
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.978)	(14.441)
	3.041	(12.093)
Institutional AUD (Hedged):		
Erträge		
Begeben	34	26.623
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	361	1.749
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(28.747)	(1)
	(28.352)	28.371
Institutional CHF (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	33	56
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(195)	(3.326)
	(162)	(3.270)
Erträge		
Begeben	24	64
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(43)	(374)
	(19)	(310)
Institutional EUR (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	8.032	42.800
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(35.936)	(49.261)
	(27.904)	(6.461)
Erträge		
Begeben	335	10.911
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	2	50
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.092)	(15.600)
	(755)	(4.639)
Institutional GBP (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	166	942
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(317)	(1.102)
	(151)	(160)
Erträge		
Begeben	1.026	1.996
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.274)	(5.990)
	(248)	(3.993)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
PIMCO Asia High Yield Bond Fund (Fortsetzung)		
Institutional RMB (Hedged):		
Erträge		
Begeben	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(1)
	k. A.	(1)
Institutional SGD (Hedged):		
Erträge		
Begeben	930	52
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(25)	(9)
	906	44
Investor:		
thesaurierend		
Begeben	133	471
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(435)	(1.508)
	(302)	(1.037)
Erträge		
Begeben	308	1.782
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.140)	(23.044)
	(2.832)	(21.262)
Investor AUD (Hedged):		
Erträge		
Begeben	18	14
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	3	3
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	(39)
	21	(22)
Investor EUR (Hedged):		
Erträge		
Begeben	29	36
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	5	4
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	(20)
	34	20
Investor RMB (Hedged):		
Erträge		
Begeben	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	2	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(158)	(94)
	(156)	(93)
Investor SGD (Hedged):		
Erträge		
Begeben	56	94
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(180)	(256)
	(124)	(162)
Administrative:		
Erträge		
Begeben	0	1.522
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(549)	(2.214)
	(549)	(692)
Class E:		
thesaurierend		
Begeben	454	2.822
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.704)	(3.457)
	(1.250)	(635)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
PIMCO Asia High Yield Bond Fund (Fortsetzung)		
Erträge		
Begeben	1.462	1.198
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	81	74
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.236)	(4.616)
	(693)	(3.344)
Class E CHF (Hedged): thesaurierend		
Begeben	16	143
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(54)	(148)
	(38)	(5)
Erträge		
Begeben	2	4
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5)	0
	(3)	4
Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	432	1.933
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.192)	(2.255)
	(760)	(322)
Erträge		
Begeben	449	384
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	15	12
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(369)	(333)
	95	63
Class E HKD (Unhedged): Erträge		
Begeben	23	408
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	4	3
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(112)	(30)
	(85)	381
Class E SGD (Hedged): Erträge		
Begeben	289	283
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	29	26
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(567)	(1.065)
	(249)	(756)
H Institutional: thesaurierend		
Begeben	0	152
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	0	152
Erträge		
Begeben	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	6	5
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(34)	(6)
	(28)	(1)
M Retail: ausschüttend II		
Begeben	1.020	403
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	32	27
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(690)	(477)
	362	(47)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
PIMCO Asia High Yield Bond Fund (Fortsetzung)		
M Retail HKD (Unhedged): ausschüttend II		
Begeben	400	339
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	3	2
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(385)	(842)
	18	(501)
M Retail SGD (Hedged): ausschüttend II		
Begeben	43	43
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	20	16
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(206)	(89)
	(143)	(30)
Class Z: thesaurierend		
Begeben	0	1.622
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.959)	(4.918)
	(4.959)	(3.296)
Asia Strategic Interest Bond Fund		
Institutional: thesaurierend		
Begeben	6	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	6	k. A.
Erträge		
Begeben	6.874	6.037
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	129	90
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(9.473)	(6.309)
	(2.470)	(182)
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.
Erträge		
Begeben	2.569	4.068
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(13.619)	(2.641)
	(11.050)	1.427
Institutional GBP (Hedged): Erträge		
Begeben	19	6
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2)	0
	18	7
Institutional SGD (Hedged): Erträge		
Begeben	1.481	2
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(14)	(101)
	1.467	(99)

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Asia Strategic Interest Bond Fund (Fortsetzung)		
Investor:		
thesaurierend		
Begeben	26	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	26	k. A.
Erträge		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.
Investor EUR (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.
Erträge		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.
Class E:		
thesaurierend		
Begeben	321	97
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(138)	(4)
	183	93
Erträge		
Begeben	446	1.119
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	3
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.386)	(687)
	(939)	435
Class E EUR (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	85	217
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(57)	(69)
	28	148
Class E EUR (Unhedged):		
thesaurierend		
Begeben	45	146
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(270)	(349)
	(225)	(203)
Class E HKD (Unhedged):		
Erträge		
Begeben	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	10	5
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	10	5
Class E SGD (Hedged):		
Erträge		
Begeben	397	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	5	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(20)	0
	382	1

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Asia Strategic Interest Bond Fund (Fortsetzung)		
M Retail HKD (Unhedged):		
Erträge		
Begeben	38	66
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(382)	(432)
	(344)	(366)
Class Z:		
thesaurierend		
Begeben	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.548)	(609)
	(3.548)	(609)
PIMCO Balanced Income and Growth Fund		
Institutional:		
thesaurierend		
Begeben	13	49
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(126)	(94)
	(113)	(45)
Institutional EUR (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	674	3.042
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.550)	(7.884)
	(3.876)	(4.842)
Institutional GBP (Hedged):		
Erträge		
Begeben	35	10
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(321)	(24)
	(286)	(14)
Institutional RMB (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	73	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	73	k. A.
Erträge		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.
Institutional RMB (Unhedged):		
thesaurierend		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.
Erträge		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
PIMCO Balanced Income and Growth Fund (Fortsetzung)		
Investor:		
thesaurierend		
Begeben	0	135
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(9)	(2)
	(9)	133
Class E:		
thesaurierend		
Begeben	143	254
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(399)	(278)
	(256)	(24)
Erträge		
Begeben	120	520
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(267)	(245)
	(146)	276
Class E EUR (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	4.389	5.168
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.614)	(3.215)
	(225)	1.953
Erträge		
Begeben	1.008	1.520
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.471)	(1.000)
	(463)	520
H Institutional:		
thesaurierend		
Begeben	0	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	0	1
Erträge		
Begeben	0	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	0	1
M Retail:		
thesaurierend		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.
Erträge		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.
ausschüttend II		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
PIMCO Balanced Income and Growth Fund (Fortsetzung)		
M Retail HKD (Unhedged):		
thesaurierend		
Begeben	8	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	8	k. A.
Erträge		
Begeben	8	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	8	k. A.
ausschüttend II		
Begeben	8	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	8	k. A.
M Retail SGD (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	137	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	137	k. A.
Erträge		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.
ausschüttend II		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.
Class Z:		
thesaurierend		
Begeben	496	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.471)	(711)
	(3.975)	(711)
PIMCO Capital Securities Fund		
Institutional:		
thesaurierend		
Begeben	24.877	26.728
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(34.467)	(61.431)
	(9.590)	(34.703)
Erträge		
Begeben	5.121	7.801
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	16	18
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(25.954)	(30.396)
	(20.817)	(22.577)
Institutional AUD (Hedged):		
Erträge		
Begeben	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(1)
	k. A.	(1)

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022		Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
	PIMCO Capital Securities Fund (Fortsetzung)			PIMCO Capital Securities Fund (Fortsetzung)	
Institutional BRL (Hedged): thesaurierend			Erträge		
Begeben	353	626	Begeben	728	1.282
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.121)	(3.441)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.190)	(15.075)
	(1.768)	(2.815)		(2.462)	(13.793)
Institutional CHF (Hedged): thesaurierend			Investor AUD (Hedged): Erträge		
Begeben	292	862	Begeben	193	1.565
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.444)	(4.292)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(62)	(2.624)
	(1.152)	(3.430)		131	(1.059)
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend			Investor CAD (Hedged): Erträge		
Begeben	30.167	40.278	Begeben	8	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	2	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(48.188)	(71.053)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	(18.021)	(30.775)		10	1
Erträge			Investor EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	11.212	796	Begeben	195	397
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	35	20	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(11.801)	(2.261)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(310)	(2.020)
	(554)	(1.445)		(115)	(1.623)
ausschüttend II			Investor GBP (Hedged): Erträge		
Begeben	395	134	Begeben	74	61
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.687)	(489)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(50)	(86)
	(3.292)	(355)		24	(25)
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend			Investor RMB (Hedged): Erträge		
Begeben	2.079	743	Begeben	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.478)	(921)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(313)	(17)
	601	(178)		(313)	(17)
Erträge			Investor SGD (Hedged): Erträge		
Begeben	1.424	1.859	Begeben	154	320
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	6	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.875)	(3.868)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(367)	(174)
	(450)	(2.003)		(213)	146
Institutional RMB (Hedged): Erträge			Administrative: thesaurierend		
Begeben	k. A.	0	Begeben	1.131	2.926
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(1)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.771)	(2.384)
	k. A.	(1)		(640)	542
Institutional SGD (Hedged): Erträge			Erträge		
Begeben	283	17	Begeben	465	527
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	5	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	20	13
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(14)	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.421)	(2.116)
	274	17		(1.936)	(1.576)
Investor: thesaurierend			ausschüttend II		
Begeben	2.959	1.648	Begeben	0	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5.986)	(8.354)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	(3.027)	(6.706)		0	1

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
PIMCO Capital Securities Fund (Fortsetzung)		
Administrative EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	278	62
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(467)	(243)
	(189)	(181)
Administrative SGD (Hedged): ausschüttend II		
Begeben	0	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	0	1
Class E: thesaurierend		
Begeben	3.758	4.440
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(8.866)	(7.660)
	(5.108)	(3.220)
Erträge		
Begeben	1.004	1.173
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	11	15
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.671)	(3.171)
	(656)	(1.983)
Class E CHF (Hedged): thesaurierend		
Begeben	58	100
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(324)	(247)
	(266)	(147)
Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	8.103	4.671
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(9.010)	(6.757)
	(907)	(2.086)
Erträge		
Begeben	1.322	1.329
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	2
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.352)	(1.068)
	(29)	263
M Retail: ausschüttend II		
Begeben	3.457	6.498
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	38	43
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5.448)	(10.686)
	(1.953)	(4.145)
M Retail HKD (Unhedged): Erträge		
Begeben	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(45)	(1.913)
	(45)	(1.913)
M Retail SGD (Hedged): ausschüttend II		
Begeben	2.605	2.290
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	27	23
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.843)	(4.641)
	(211)	(2.328)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
PIMCO Capital Securities Fund (Fortsetzung)		
Class R: Erträge		
Begeben	108	64
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(120)	(89)
	(12)	(25)
Class R EUR (Hedged): Erträge		
Begeben	13	23
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(196)	(811)
	(183)	(788)
Class R GBP (Hedged): Erträge		
Begeben	20	29
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	2
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(56)	(280)
	(36)	(249)
Class T: Erträge		
Begeben	47	199
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	8	7
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(107)	(333)
	(52)	(127)
Class T EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	736	641
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.236)	(1.335)
	(500)	(694)
Class Z: Erträge		
Begeben	2.213	95
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	462	463
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.323)	(3.061)
	(648)	(2.503)
Class Z AUD (Hedged): Erträge		
Begeben	1.524	1.779
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	485	578
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.634)	(2.578)
	(2.625)	(221)
PIMCO Climate Bond Fund		
Institutional: thesaurierend		
Begeben	1.358	1.367
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.715)	(359)
	(357)	1.008
Institutional AUD (Hedged): Erträge		
Begeben	245	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(30)	k. A.
	216	k. A.

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
PIMCO Climate Bond Fund (Fortsetzung)		
Institutional CHF (Hedged): thesaurierend		
Begeben	11	7
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(29)	(6)
	(18)	1
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	1.064	4.564
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.975)	(5.279)
	(2.911)	(715)
Erträge		
Begeben	5.036	154
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5.106)	(1.564)
	(70)	(1.410)
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend		
Begeben	1.502	1.673
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.218)	(752)
	(716)	921
Erträge		
Begeben	1.982	4.497
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	11
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.005)	(1.602)
	977	2.906
Institutional SEK (Hedged): thesaurierend		
Begeben	356	496
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.554)	(29)
	(3.198)	467
Institutional SGD (Hedged): thesaurierend		
Begeben	139	203
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(172)	(109)
	(33)	94
Investor: thesaurierend		
Begeben	k. A.	5
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(326)
	k. A.	(321)
thesaurierend		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.
Investor EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(1)
	k. A.	(1)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
PIMCO Climate Bond Fund (Fortsetzung)		
Administrative SEK (Hedged): thesaurierend		
Begeben	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	0	0
Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	390	629
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(422)	(438)
	(32)	191
Class Z: thesaurierend		
Begeben	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	0	0
Commodity Real Return Fund		
Institutional: thesaurierend		
Begeben	17.518	40.486
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(23.728)	(66.747)
	(6.210)	(26.261)
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	11.718	27.911
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(22.376)	(20.593)
	(10.658)	7.318
Institutional EUR (Unhedged): thesaurierend		
Begeben	1.128	3.509
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.016)	(1.319)
	(1.888)	2.190
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend		
Begeben	894	2.237
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.320)	(2.286)
	(1.426)	(49)
Institutional GBP (Unhedged): Erträge		
Begeben	872	1.888
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(413)	(7)
	459	1.881
Investor: thesaurierend		
Begeben	124	5.082
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.273)	(7.606)
	(3.149)	(2.524)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
	Commodity Real Return Fund (Fortsetzung)		Diversified Income Fund	
Class E:				
thesaurierend				
Begeben	2.515	25.761	2.164	3.884
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(13.233)	(28.579)	(12.981)	(13.073)
	(10.718)	(2.818)	(10.817)	(9.189)
Class E EUR (Hedged):				
thesaurierend				
Begeben	3.150	38.450	1.030	1.885
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	674	574
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(19.021)	(40.323)	(6.990)	(18.694)
	(15.871)	(1.873)	(5.286)	(16.235)
Class E SGD (Hedged):				
thesaurierend				
Begeben	73	1.644	2.367	1.524
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(137)	(1.495)	(3.651)	(5.130)
	(64)	149	(1.284)	(3.606)
H Institutional:				
thesaurierend				
Begeben	521	428	150	212
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(162)	(1)	(384)	(284)
	359	427	(234)	(72)
	PIMCO Credit Opportunities Bond Fund			
Institutional:				
thesaurierend				
Begeben	201	191	36	193
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(238)	(218)	(423)	(494)
	(37)	(27)	(387)	(301)
Institutional CHF (Hedged):				
thesaurierend				
Begeben	0	0	10.183	15.813
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0	(21.072)	(41.537)
	(395)	(560)	(10.889)	(25.724)
	(395)	(560)		
Institutional EUR (Hedged):				
thesaurierend				
Begeben	150	235	442	25.908
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	110	342
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(206)	(2.059)	(17.729)	(69.909)
	(56)	(1.824)	(17.177)	(43.659)
Institutional GBP (Hedged):				
thesaurierend				
Begeben			1.534	1.458
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen			0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres			(8.883)	(37.733)
			(7.349)	(36.275)
thesaurierend				
Begeben	122	231	9.937	16.091
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	407	512
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(185)	(259)	(32.986)	(30.848)
	(63)	(28)	(22.642)	(14.245)
Class E EUR (Hedged):				
thesaurierend				
Begeben	104	65	3.239	3.007
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(85)	(248)	(2.406)	(2.975)
	19	(183)	833	32
Institutional MXN (Hedged):				
thesaurierend				
Begeben				
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen				
Rücknahmen während des Geschäftsjahres				

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022		Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
	Diversified Income Fund (Fortsetzung)			Diversified Income Fund (Fortsetzung)	
Institutional SEK (Hedged): thesaurierend			Administrative JPY (Hedged): thesaurierend		
Begeben	16	1	Begeben	27	391
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(16)	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(24)	0
	0	1		3	391
Institutional SGD (Hedged): Erträge			Administrative SEK (Hedged): thesaurierend		
Begeben	423	1.322	Begeben	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.807)	(3.829)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	(4.384)	(2.507)		0	0
Investor: thesaurierend			Administrative SGD (Hedged): Erträge		
Begeben	154	1.949	Begeben	2.496	640
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	29	23
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.774)	(3.263)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.796)	(3.780)
	(1.620)	(1.314)		729	(3.117)
Erträge			BM Retail: Dekumulation		
Begeben	1.879	9.350	Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	18	16	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.389)	(5.393)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	508	3.973		1	k. A.
Investor EUR (Hedged): thesaurierend			ausschüttend II		
Begeben	203	177	Begeben	4.067	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(509)	(660)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(440)	0
	(306)	(483)		3.627	1
Erträge			BN Retail: ausschüttend II		
Begeben	1	317	Begeben	0	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(160)	(202)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1)	0
	(159)	115		(1)	1
Administrative: Erträge			Class E: thesaurierend		
Begeben	314	1.604	Begeben	2.399	4.099
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	29	25	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.566)	(4.583)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(8.495)	(17.311)
	(2.223)	(2.954)		(6.096)	(13.212)
Administrative AUD (Hedged): Erträge			Erträge		
Begeben	6	14	Begeben	2.160	5.389
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	107	93
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(347)	(43)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(9.742)	(17.485)
	(341)	(29)		(7.475)	(12.003)
Administrative EUR (Hedged): thesaurierend			Class E CHF (Hedged): thesaurierend		
Begeben	20	46	Begeben	24	65
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(109)	(315)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(279)	(86)
	(89)	(269)		(255)	(21)
Administrative GBP (Hedged): Erträge			Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	12	50	Begeben	7.949	15.932
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(114)	(246)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(37.557)	(33.142)
	(102)	(196)		(29.608)	(17.210)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Diversified Income Fund (Fortsetzung)		
Erträge		
Begeben	3.943	4.672
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	3	2
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(23.603)	(37.797)
	(19.657)	(33.123)
Class E SGD (Hedged):		
Erträge		
Begeben	262	22
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	2	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(943)	(1.940)
	(679)	(1.917)
H Institutional:		
thesaurierend		
Begeben	30.370	17.461
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(28.561)	(66.418)
	1.809	(48.957)
Erträge		
Begeben	8	13
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	(1)
	8	12
M Retail:		
Dekumulation		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.
Erträge		
Begeben	1.300	1.664
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	46	38
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.061)	(6.706)
	(2.715)	(5.004)
ausschüttend II		
Begeben	5.300	9.583
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	2	2
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(8.314)	(17.798)
	(3.012)	(8.213)
M Retail AUD (Hedged):		
Erträge		
Begeben	577	942
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	2	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.360)	(2.811)
	(781)	(1.868)
M Retail SGD (Hedged):		
ausschüttend II		
Begeben	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(1)
	k. A.	(1)
N Retail:		
ausschüttend II		
Begeben	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	0	0

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Diversified Income Fund (Fortsetzung)		
Class T:		
thesaurierend		
Begeben	78	175
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(357)	(943)
	(279)	(768)
Erträge		
Begeben	51	44
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	7	5
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(150)	(154)
	(92)	(105)
Class T EUR (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	444	337
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(645)	(1.070)
	(201)	(733)
Erträge		
Begeben	288	129
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(401)	(490)
	(113)	(361)
W Class:		
thesaurierend		
Begeben	94	1.342
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.357)	(5.541)
	(4.263)	(4.199)
Erträge		
Begeben	98	393
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.418)	(8.527)
	(4.320)	(8.134)
W Class CAD (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(1)
	k. A.	(1)
W Class CHF (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	32	456
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.175)	(478)
	(1.143)	(22)
Erträge		
Begeben	9	82
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(44)	(153)
	(35)	(71)
W Class EUR (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	22	607
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(890)	(675)
	(868)	(68)

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Diversified Income Fund (Fortsetzung)		
Erträge		
Begeben	10	146
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(311)	(393)
	(301)	(247)
W Class GBP (Hedged): thesaurierend		
Begeben	0	82
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(213)	(68)
	(213)	14
Erträge		
Begeben	61	109
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(387)	(100)
	(326)	9
W Class SGD (Hedged): Erträge		
Begeben	0	165
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(193)	(257)
	(193)	(92)
Diversified Income Duration Hedged Fund		
Institutional: thesaurierend		
Begeben	235	129
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(655)	(2.800)
	(420)	(2.671)
Erträge		
Begeben	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(326)
	k. A.	(326)
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	760	2.538
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(6.619)	(7.903)
	(5.859)	(5.365)
ausschüttend II		
Begeben	6	22
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(112)	(3.662)
	(106)	(3.640)
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend		
Begeben	161	272
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.121)	(8.534)
	(2.960)	(8.262)
Erträge		
Begeben	72	92
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.758)	(12.053)
	(2.686)	(11.961)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Diversified Income Duration Hedged Fund (Fortsetzung)		
Investor: thesaurierend		
Begeben	0	4
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(39)	(454)
	(39)	(450)
Class E: thesaurierend		
Begeben	147	632
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(726)	(2.383)
	(579)	(1.751)
Erträge		
Begeben	103	436
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	5	4
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(426)	(669)
	(318)	(229)
Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	371	1.162
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.783)	(11.254)
	(1.412)	(10.092)
Erträge		
Begeben	375	99
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(523)	(1.054)
	(148)	(955)
Diversified Income ESG Fund		
Institutional: thesaurierend		
Begeben	0	947
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	0	947
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	4.610	23
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(577)	0
	4.033	23
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend		
Begeben	0	19
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	0	19
Class E: thesaurierend		
Begeben	0	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	0	1
Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	0	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	0	1

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Dynamic Bond Fund		
Institutional: thesaurierend		
Begeben	7.291	3.696
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(18.596)	(11.498)
	(11.305)	(7.802)
Erträge		
Begeben	153	229
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	4	3
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(151)	(1.057)
	6	(825)
Institutional CAD (Hedged): thesaurierend		
Begeben	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(187)	(212)
	(187)	(212)
Institutional CHF (Hedged): thesaurierend		
Begeben	10	1.034
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(6.804)	(1.834)
	(6.794)	(800)
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	2.249	11.147
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(10.648)	(21.791)
	(8.399)	(10.644)
Erträge		
Begeben	57	570
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(693)	(559)
	(635)	11
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend		
Begeben	18.097	100.815
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(20.444)	(15.420)
	(2.347)	85.395
Erträge		
Begeben	416	1.066
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	42	56
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(550)	(16.302)
	(92)	(15.180)
Institutional NOK (Hedged): thesaurierend		
Begeben	0	6
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(64)	(9.634)
	(64)	(9.628)
Institutional SEK (Hedged): thesaurierend		
Begeben	k. A.	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(238)
	k. A.	(237)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Dynamic Bond Fund (Fortsetzung)		
Investor: thesaurierend		
Begeben	257	483
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(678)	(951)
	(421)	(468)
Erträge		
Begeben	2	11
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	5	6
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(183)	(94)
	(176)	(77)
Investor EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	5	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(10)	(312)
	(5)	(312)
Administrative: thesaurierend		
Begeben	31	61
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(569)	(530)
	(538)	(469)
Administrative EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	46	7
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(68)	(197)
	(22)	(190)
Administrative SEK (Hedged): thesaurierend		
Begeben	17	18
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(99)	(139)
	(82)	(121)
Class E: thesaurierend		
Begeben	1.040	1.408
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.587)	(2.734)
	(547)	(1.326)
Erträge		
Begeben	105	218
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	12	8
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(281)	(473)
	(164)	(247)
Class E CHF (Hedged): thesaurierend		
Begeben	28	99
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(178)	(177)
	(150)	(78)
Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	456	412
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.298)	(5.226)
	(842)	(4.814)

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022		Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
			Dynamic Bond Fund (Fortsetzung)		
Class E GBP (Hedged): thesaurierend					
Begeben	7	21			
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0			
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(156)	(31)			
	(149)	(10)			
G Retail EUR (Hedged): Erträge					
Begeben	14	12			
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0			
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(174)	(108)			
	(160)	(96)			
H Institutional: thesaurierend					
Begeben	4.672	730			
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0			
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.749)	(1.272)			
	2.923	(542)			
Erträge					
Begeben	0	0			
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0			
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1)	0			
	(1)	0			
Class R: thesaurierend					
Begeben	9	38			
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0			
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(178)	(103)			
	(169)	(65)			
Class Z: thesaurierend					
Begeben	1.575	0			
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0			
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(724)	(276)			
	851	(276)			
Class Z AUD (Hedged): Erträge					
Begeben	111	145			
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	97	101			
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.379)	(821)			
	(1.171)	(575)			
			Dynamic Multi-Asset Fund		
Institutional: thesaurierend					
Begeben	10.113	16.762			
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0			
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(61.089)	(78.040)			
	(50.976)	(61.278)			
ausschüttend II					
Begeben	774	971			
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0			
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.964)	(4.764)			
	(3.190)	(3.793)			
Institutional CHF (Hedged): thesaurierend					
Begeben	0	4			
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0			
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(52)	(145)			
	(52)	(141)			
			Dynamic Multi-Asset Fund (Fortsetzung)		
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend					
Begeben	9.976	13.616			
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0			
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(21.764)	(9.604)			
	(11.788)	4.012			
Erträge					
Begeben	66	2.347			
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0			
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.136)	(659)			
	(2.070)	1.688			
Institutional ILS (Hedged): thesaurierend					
Begeben	1.438	423			
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0			
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(193)	0			
	1.245	423			
Institutional SGD (Hedged): thesaurierend					
Begeben	52	9.784			
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0			
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.235)	0			
	(3.183)	9.784			
Institutional USD (Hedged): thesaurierend					
Begeben	695	2.374			
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0			
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.969)	(9.023)			
	(3.274)	(6.649)			
ausschüttend II					
Begeben	0	20			
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0			
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	(1)			
	0	19			
Investor: thesaurierend					
Begeben	23	131			
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0			
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(149)	(4)			
	(126)	127			
Investor USD (Hedged): thesaurierend					
Begeben	0	0			
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0			
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1)	0			
	(1)	0			
BM Retail AUD (Hedged): ausschüttend II					
Begeben	39	1			
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0			
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(22)	0			
	17	1			
BM Retail USD (Hedged): ausschüttend II					
Begeben	162	1			
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0			
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(96)	0			
	66	1			

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Dynamic Multi-Asset Fund (Fortsetzung)		
Class E: thesaurierend		
Begeben	7.284	17.931
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(78.046)	(71.978)
	(70.762)	(54.047)
Erträge		
Begeben	1	67
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(146)	(78)
	(145)	(11)
Class E USD (Hedged): thesaurierend		
Begeben	646	2.719
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(6.514)	(6.818)
	(5.868)	(4.099)
Erträge		
Begeben	0	3
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4)	0
	(4)	3
ausschüttend II		
Begeben	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1)	0
	(1)	0
H Institutional USD (Hedged): thesaurierend		
Begeben	0	1.976
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(173)	(2.546)
	(173)	(570)
M Retail AUD (Hedged): ausschüttend II		
Begeben	24	13
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(23)	(32)
	2	(18)
M Retail SGD (Hedged): ausschüttend II		
Begeben	53	93
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	4	6
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(437)	(234)
	(380)	(135)
M Retail USD (Hedged): ausschüttend II		
Begeben	88	1.806
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	3	5
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.215)	(5.705)
	(2.124)	(3.894)
Class T: thesaurierend		
Begeben	504	616
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.986)	(2.236)
	(1.482)	(1.620)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Dynamic Multi-Asset Fund (Fortsetzung)		
Class T USD (Hedged): thesaurierend		
Begeben	38	349
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(84)	(13)
	(46)	336
Class Z: thesaurierend		
Begeben	40	17
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.450)	(1.434)
	(4.410)	(1.417)
Emerging Local Bond Fund		
Institutional: thesaurierend		
Begeben	38.848	44.501
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(19.232)	(46.912)
	19.616	(2.411)
Erträge		
Begeben	2.085	152
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(186)	(456)
	1.899	(304)
Institutional CHF (Unhedged): thesaurierend		
Begeben	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(44)
	k. A.	(44)
Institutional EUR (Unhedged): thesaurierend		
Begeben	23.946	7.070
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(9.118)	(12.977)
	14.828	(5.907)
Erträge		
Begeben	5.342	6.133
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.538)	(3.859)
	2.804	2.274
Institutional GBP (Unhedged): thesaurierend		
Begeben	241	141
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(144)	(78)
	97	63
Investor: thesaurierend		
Begeben	542	232
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.796)	(2.010)
	(1.254)	(1.778)
Investor EUR (Unhedged): thesaurierend		
Begeben	2	21
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(13)	(276)
	(11)	(255)

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Emerging Local Bond Fund (Fortsetzung)		
Class E: thesaurierend		
Begeben	3.988	2.431
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.951)	(2.501)
	37	(70)
Erträge		
Begeben	405	191
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	2	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(278)	(418)
	129	(226)
Class E EUR (Unhedged): thesaurierend		
Begeben	2.285	625
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.011)	(1.405)
	274	(780)
Erträge		
Begeben	9	7
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(10)	(28)
	(1)	(21)
H Institutional: thesaurierend		
Begeben	67.149	5.708
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(54.102)	(293)
	13.047	5.415
Class Z: Erträge		
Begeben	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	252	277
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.093)	0
	(1.841)	277
Emerging Local Bond ESG Fund		
Institutional: thesaurierend		
Begeben	0	489
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	0	489
Erträge		
Begeben	0	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	0	1
Institutional EUR (Unhedged): thesaurierend		
Begeben	7.663	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	7.663	1
Erträge		
Begeben	0	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	0	1

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Emerging Local Bond ESG Fund (Fortsetzung)		
Institutional GBP (Unhedged): Erträge		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.
Investor: thesaurierend		
Begeben	0	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	0	1
Erträge		
Begeben	0	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	0	1
Investor EUR (Unhedged): thesaurierend		
Begeben	0	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	0	1
Erträge		
Begeben	0	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	0	1
Class E: thesaurierend		
Begeben	0	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	0	1
Erträge		
Begeben	0	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	0	1
Class E EUR (Unhedged): thesaurierend		
Begeben	0	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	0	1
Erträge		
Begeben	0	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	0	1
Class Z: thesaurierend		
Begeben	0	123
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	0	123

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Emerging Markets Bond Fund		
Institutional: thesaurierend		
Begeben	8.371	10.925
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(7.515)	(15.619)
	856	(4.694)
Erträge		
Begeben	2.723	688
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	76	85
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(750)	(1.874)
	2.049	(1.101)
Institutional CHF (Hedged): Erträge		
Begeben	271	232
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(314)	(57)
	(43)	175
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	4.709	12.568
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(6.109)	(8.822)
	(1.400)	3.746
Erträge		
Begeben	11.405	31.500
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	20	90
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(7.785)	(68.483)
	3.640	(36.893)
Institutional EUR (Unhedged): thesaurierend		
Begeben	6.372	5.590
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.603)	(6.467)
	2.768	(877)
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend		
Begeben	42	235
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(239)	(160)
	(197)	75
Erträge		
Begeben	3.380	2.143
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	169	133
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.378)	(3.367)
	(829)	(1.091)
Institutional PLN (Hedged): Erträge		
Begeben	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(9.928)
	k. A.	(9.927)
Institutional SGD (Hedged): thesaurierend		
Begeben	658	1.303
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.619)	(828)
	(961)	475

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Emerging Markets Bond Fund (Fortsetzung)		
Investor: thesaurierend		
Begeben	15	7
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(14)	(54)
	1	(47)
Investor EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	(8)
	0	(8)
Administrative: thesaurierend		
Begeben	165	82
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(66)	(215)
	99	(133)
BM Retail: Dekumulation		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.
ausschüttend II		
Begeben	138	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(47)	0
	91	1
Class E: thesaurierend		
Begeben	1.290	847
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.092)	(1.406)
	198	(559)
Erträge		
Begeben	5.539	7.933
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	13	12
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5.348)	(10.704)
	204	(2.759)
Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	827	541
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(857)	(1.372)
	(30)	(831)
Class E SGD (Hedged): thesaurierend		
Begeben	87	79
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(109)	(70)
	(22)	9
H Institutional: thesaurierend		
Begeben	6.142	7.545
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.510)	(6.018)
	1.632	1.527

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Emerging Markets Bond Fund (Fortsetzung)		
Erträge		
Begeben	5	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	5	0
M Retail:		
Dekumulation		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.
Erträge		
Begeben	213	112
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	6	5
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(298)	(246)
	(79)	(129)
ausschüttend II		
Begeben	9.169	16.994
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(9.036)	(16.949)
	133	45
M Retail AUD (Hedged):		
Erträge		
Begeben	662	12
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(169)	(587)
	493	(575)
Class Z:		
Erträge		
Begeben	1.264	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	72	31
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	1.336	31
Emerging Markets Bond ESG Fund		
Institutional:		
thesaurierend		
Begeben	9.063	19.358
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(8.642)	(11.060)
	421	8.298
Erträge		
Begeben	6.614	13.168
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	70	178
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(12.399)	(3.833)
	(5.715)	9.513
Institutional CHF (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	31.006	1.769
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(6.689)	(11)
	24.317	1.758
Institutional EUR (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	16.806	56.354
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(33.770)	(32.858)
	(16.964)	23.496

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Emerging Markets Bond ESG Fund (Fortsetzung)		
Erträge		
Begeben	15.413	30.800
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	77	114
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(13.847)	(32.730)
	1.643	(1.816)
Institutional GBP (Hedged):		
Erträge		
Begeben	4.924	16.488
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	2	2
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(13.019)	(2.491)
	(8.093)	13.999
Institutional GBP (Unhedged):		
Erträge		
Begeben	410	239
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(217)	(138)
	193	101
Investor NOK (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(10)	0
	(10)	0
Investor SEK (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	159	308
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(180)	(105)
	(21)	203
Administrative:		
thesaurierend		
Begeben	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	(22)
	0	(22)
Erträge		
Begeben	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	(6)
	0	(6)
Administrative SEK (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	3	4
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1)	(4)
	2	0
Class E:		
thesaurierend		
Begeben	354	27
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(67)	(65)
	287	(38)
Erträge		
Begeben	8	32
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(35)	(30)
	(27)	2

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Emerging Markets Bond ESG Fund (Fortsetzung)		
Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	1.801	4.801
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.163)	(9.874)
	(362)	(5.073)
Class Z: thesaurierend		
Begeben	467	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(114)	k. A.
	353	k. A.
Emerging Markets Corporate Bond Fund		
Institutional: thesaurierend		
Begeben	267	792
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(69)	(789)
	198	3
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	28	814
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.229)	(325)
	(1.201)	489
Class E: thesaurierend		
Begeben	26	192
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(438)	(518)
	(412)	(326)
Class E CHF (Hedged): thesaurierend		
Begeben	10	2
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(163)	(189)
	(153)	(187)
Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	87	59
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(335)	(352)
	(248)	(293)
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund		
Institutional: thesaurierend		
Begeben	4.184	2.229
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.045)	(4.163)
	3.139	(1.934)
Institutional EUR (Partially Hedged): thesaurierend		
Begeben	743	1.044
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(888)	(13.456)
	(145)	(12.412)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (Fortsetzung)		
Institutional GBP (Partially Hedged): Erträge		
Begeben	0	79
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	4	2
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	4	81
Class E: thesaurierend		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.
Erträge		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.
Class E EUR (Partially Hedged): thesaurierend		
Begeben	74	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	74	1
Class Z: thesaurierend		
Begeben	2.385	13.622
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(853)	(3.520)
	1.532	10.102
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund		
Institutional: thesaurierend		
Begeben	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(8)
	k. A.	(8)
Institutional EUR (Unhedged): thesaurierend		
Begeben	170	451
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(199)	(757)
	(29)	(306)
Class E: thesaurierend		
Begeben	30	36
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(86)	(82)
	(56)	(46)
Class E EUR (Unhedged): thesaurierend		
Begeben	56	63
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(170)	(215)
	(114)	(152)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Euro Bond Fund (Fortsetzung)		
Investor: thesaurierend		
Begeben	147	85
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(61)	(200)
	86	(115)
Erträge		
Begeben	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(15)
	k. A.	(15)
Administrative: thesaurierend		
Begeben	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(110)
	k. A.	(110)
Class E: thesaurierend		
Begeben	1.693	486
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.050)	(1.701)
	643	(1.215)
Erträge		
Begeben	415	120
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(410)	(929)
	5	(809)
Euro Credit Fund		
Institutional: thesaurierend		
Begeben	4.028	14.117
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(6.155)	(33.114)
	(2.127)	(18.997)
ausschüttend II		
Begeben	520	9.070
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	34
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.680)	(14.528)
	(1.160)	(5.424)
Class E: thesaurierend		
Begeben	4.761	47
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.416)	(399)
	2.345	(352)
H Institutional: thesaurierend		
Begeben	1.439	12.991
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(13.470)	(2.658)
	(12.031)	10.333
ausschüttend II		
Begeben	0	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(9)	(167)
	(9)	(166)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Euro Income Bond Fund		
Institutional: thesaurierend		
Begeben	7.409	8.116
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(9.964)	(40.863)
	(2.555)	(32.747)
Erträge		
Begeben	1.293	25.489
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	118
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.121)	(28.907)
	(1.828)	(3.300)
Investor: thesaurierend		
Begeben	579	31
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(179)	(283)
	400	(252)
Erträge		
Begeben	61	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	2	2
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(151)	(90)
	(88)	(88)
Class E: thesaurierend		
Begeben	10.067	2.777
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(10.698)	(19.331)
	(631)	(16.554)
Erträge		
Begeben	6.657	1.837
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(6.952)	(13.945)
	(295)	(12.108)
Ausschüttend Q		
Begeben	k. A.	19
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(425)
	k. A.	(406)
Class T: thesaurierend		
Begeben	905	268
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(532)	(638)
	373	(370)
Erträge		
Begeben	612	122
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(226)	(370)
	386	(248)
Euro Long Average Duration Fund		
Institutional: thesaurierend		
Begeben	41.030	1.625
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.711)	(1.265)
	38.319	360

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Euro Long Average Duration Fund (Fortsetzung)		
Class E:		
thesaurierend		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.
Euro Short-Term Fund		
Institutional:		
thesaurierend		
Begeben	5.508	20.374
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(20.793)	(43.243)
	(15.285)	(22.869)
Class E:		
thesaurierend		
Begeben	2.077	920
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(819)	(809)
	1.258	111
PIMCO European High Yield Bond Fund		
Institutional:		
thesaurierend		
Begeben	20.217	3.858
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.749)	(1.638)
	16.468	2.220
Class E:		
thesaurierend		
Begeben	389	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(30)	0
	359	1
Erträge		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.
Class Z:		
thesaurierend		
Begeben	2.602	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.176)	(200)
	(1.574)	(200)
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund		
Institutional:		
thesaurierend		
Begeben	1.510	5.027
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(7.240)	(15.856)
	(5.730)	(10.829)
Class E:		
thesaurierend		
Begeben	715	520
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund (Fortsetzung)		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(366)	(141)
	349	379
H Institutional:		
thesaurierend		
Begeben	1.399	903
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.122)	(6.802)
	(2.723)	(5.899)
Global Advantage Fund		
Institutional:		
thesaurierend		
Begeben	41	36
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(83)	(1.084)
	(42)	(1.048)
Institutional CHF (Partially Hedged):		
Erträge		
Begeben	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(44)	(336)
	(44)	(336)
Institutional EUR (Partially Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	627	1.723
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.187)	(2.551)
	(560)	(828)
Institutional GBP (Partially Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(14)
	k. A.	(14)
Institutional NOK (Partially Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	7	6
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	7	6
Class E EUR (Partially Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	31	47
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(98)	(100)
	(67)	(53)
Global Bond Fund		
Institutional:		
thesaurierend		
Begeben	52.900	20.005
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(25.562)	(24.316)
	27.338	(4.311)
Erträge		
Begeben	3.821	1.853
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	59	52
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.358)	(2.143)
	1.522	(238)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022		Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Global Bond Fund (Fortsetzung)			Global Bond Fund (Fortsetzung)		
Institutional (Currency Exposure): thesaurierend			Erträge		
Begeben	6.845	3.622	Begeben	2.512	2.663
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	35	44
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(8.166)	(1.873)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.163)	(5.377)
	(1.321)	1.749		(1.616)	(2.670)
Erträge			Institutional ILS (Hedged): thesaurierend		
Begeben	11	29	Begeben	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(80)	(127)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(18)
	(69)	(98)		k. A.	(18)
Institutional CAD (Hedged): thesaurierend			Institutional NOK (Hedged): thesaurierend		
Begeben	43	0	Begeben	3.086	1.514
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(742)	(914)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5.880)	(4.987)
	(699)	(914)		(2.794)	(3.473)
Institutional CHF (Hedged): thesaurierend			Institutional NZD (Hedged): Erträge		
Begeben	730	1.018	Begeben	413	179
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	39	42
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.652)	(2.240)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.127)	(2.702)
	(2.922)	(1.222)		(675)	(2.481)
Erträge			Institutional SEK (Hedged): thesaurierend		
Begeben	94	190	Begeben	484	1.489
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	1	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.086)	(741)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.984)	(1.203)
	(1.991)	(550)		(3.500)	286
Institutional EUR (Currency Exposure): thesaurierend			Institutional SGD (Hedged): thesaurierend		
Begeben	7.439	10.455	Begeben	4.910	4.901
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(7.838)	(5.337)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.983)	(1.266)
	(399)	5.118		(73)	3.635
Erträge			Erträge		
Begeben	20.966	19.257	Begeben	12	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(24.690)	(25.423)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1)	k. A.
	(3.724)	(6.166)		11	k. A.
Erträge			Investor: thesaurierend		
Begeben	11.765	1.488	Begeben	4.534	654
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	23	20	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(7.707)	(2.934)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.361)	(1.502)
	4.081	(1.426)		3.173	(848)
Institutional GBP (Currency Exposure): thesaurierend			Erträge		
Begeben	42	16	Begeben	3.170	1.669
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(152)	(22)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.590)	(184)
	(110)	(6)		1.581	1.486
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend			Investor (Currency Exposure): thesaurierend		
Begeben	3.570	2.464	Begeben	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.904)	(3.014)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(71)
	666	(550)		k. A.	(71)

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
	Global Bond Fund (Fortsetzung)	
Investor CHF (Hedged): thesaurierend		
Begeben	409	195
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.456)	(1.649)
	(2.047)	(1.454)
Investor EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	852	410
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(648)	(603)
	204	(193)
Investor GBP (Hedged): thesaurierend		
Begeben	57	25
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(12)	(9)
	45	16
Investor NOK (Hedged): thesaurierend		
Begeben	207	22
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(23)	(30)
	184	(8)
Administrative: thesaurierend		
Begeben	198	255
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(96)	(413)
	102	(158)
Administrative SEK (Hedged): thesaurierend		
Begeben	889	1.474
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(838)	(169)
	51	1.305
Class E: thesaurierend		
Begeben	4.444	2.644
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.754)	(5.612)
	690	(2.968)
Erträge		
Begeben	9.364	7.456
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	8	6
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(6.684)	(7.519)
	2.688	(57)
Class E (Currency Exposure): thesaurierend		
Begeben	1.297	386
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.161)	(1.781)
	136	(1.395)
Erträge		
Begeben	884	256
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(283)	(306)
	601	(50)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
	Global Bond Fund (Fortsetzung)	
Class E CHF (Hedged): thesaurierend		
Begeben	171	26
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(124)	(37)
	47	(11)
Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	7.397	5.158
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(8.217)	(11.634)
	(820)	(6.476)
Erträge		
Begeben	1.706	741
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(788)	(1.225)
	918	(484)
Class E NOK (Hedged): thesaurierend		
Begeben	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(1)
	k. A.	(1)
G Retail EUR (Hedged): Erträge		
Begeben	1.467	191
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.442)	(4.603)
	25	(4.412)
H Institutional: thesaurierend		
Begeben	19.106	34.334
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(21.135)	(33.907)
	(2.029)	427
Erträge		
Begeben	14	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(6)	(30)
	8	(30)
H Institutional (Currency Exposure): thesaurierend		
Begeben	40.012	71.651
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(60.616)	(33.844)
	(20.604)	37.807
M Retail: ausschüttend II		
Begeben	1.349	33
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.411)	(48)
	(61)	(15)
M Retail HKD (Unhedged): ausschüttend II		
Begeben	1.451	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(13)	(227)
	1.438	(227)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
	Global Bond Fund (Fortsetzung)	
M Retail SEK (Hedged): thesaurierend		
Begeben	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(1)
	k. A.	(1)
M Retail SGD (Hedged): ausschüttend II		
Begeben	1.470	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(100)	k. A.
	1.370	k. A.
Class R EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	106	161
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(89)	(159)
	17	2
Class T: thesaurierend		
Begeben	289	187
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(265)	(863)
	24	(676)
Erträge		
Begeben	236	14
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(34)	(74)
	203	(59)
Class T EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	1.431	283
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(432)	(480)
	999	(197)
W Class: thesaurierend		
Begeben	10.994	1.762
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.518)	(2.003)
	9.476	(241)
Erträge		
Begeben	5.155	645
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(297)	(458)
	4.858	187
ausschüttend II		
Begeben	51	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	51	k. A.
Class W (Currency Exposure): thesaurierend		
Begeben	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(1)
	k. A.	(1)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
	Global Bond Fund (Fortsetzung)	
Erträge		
Begeben	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(1)
	k. A.	(1)
W Class CHF (Hedged): thesaurierend		
Begeben	1.336	502
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(529)	(970)
	807	(468)
Erträge		
Begeben	476	36
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(36)	(26)
	440	10
W Class EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	1.766	805
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(337)	(1.199)
	1.429	(394)
Erträge		
Begeben	394	159
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(184)	(107)
	210	52
W Class GBP (Hedged): thesaurierend		
Begeben	1.526	206
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(51)	(64)
	1.475	142
Erträge		
Begeben	546	249
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(281)	(478)
	265	(229)
W Class NOK (Hedged): thesaurierend		
Begeben	77	8
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1)	0
	76	8
W Class SEK (Hedged): thesaurierend		
Begeben	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(1)
	k. A.	(1)
W Class SGD (Hedged): ausschüttend II		
Begeben	1.135	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(86)	k. A.
	1.049	k. A.

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
	Global Bond ESG Fund	
Institutional: thesaurierend		
Begeben	14.597	19.756
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(17.039)	(10.249)
	(2.442)	9.507
Erträge		
Begeben	651	6.056
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	7	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.915)	(1.272)
	(2.257)	4.785
Institutional CHF (Hedged): thesaurierend		
Begeben	23.218	51.831
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(9.352)	(4.396)
	13.866	47.435
Institutional EUR (Currency Exposure): thesaurierend		
Begeben	23	1.418
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(467)	(1.060)
	(444)	358
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	44.250	71.834
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(52.147)	(27.284)
	(7.897)	44.550
Erträge		
Begeben	1.224	3.526
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(6.593)	(3.843)
	(5.369)	(317)
Institutional GBP (Currency Exposure): Erträge		
Begeben	72	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	72	1
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend		
Begeben	13.566	670
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.331)	(2.038)
	10.235	(1.368)
Erträge		
Begeben	28.417	4.565
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	7	3
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(29.333)	(2.443)
	(909)	2.125
Institutional GBP (Unhedged): Erträge		
Begeben	701	422
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.013)	(630)
	(1.312)	(208)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
	Global Bond ESG Fund (Fortsetzung)	
Institutional NOK (Hedged): thesaurierend		
Begeben	101.027	106.405
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(36.508)	(25.926)
	64.519	80.479
Institutional NZD (Hedged): Erträge		
Begeben	107	152
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	122	79
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	(208)
	229	23
Institutional SEK (Hedged): thesaurierend		
Begeben	4.166	1.625
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(6.064)	(1.496)
	(1.898)	129
Investor: thesaurierend		
Begeben	582	569
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(198)	(813)
	384	(244)
Administrative: thesaurierend		
Begeben	k. A.	5
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(213)
	k. A.	(208)
Erträge		
Begeben	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(1)
	k. A.	(1)
Administrative SEK (Hedged): thesaurierend		
Begeben	900	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(29)	k. A.
	871	k. A.
Class E: Erträge		
Begeben	98	251
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(39)	(39)
	59	212
Class E CHF (Hedged): thesaurierend		
Begeben	168	8
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4)	0
	164	8
Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	1.093	744
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(869)	(1.144)
	224	(400)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Global Bond ESG Fund (Fortsetzung)		
Class Z AUD (Hedged): Erträge		
Begeben	14.196	18.505
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1.041	557
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.947)	(4.344)
	12.290	14.718
Global Bond Ex-US Fund		
Institutional: thesaurierend		
Begeben	3.030	2.995
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.974)	(5.454)
	56	(2.459)
Erträge		
Begeben	408	31
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	43	36
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(229)	(978)
	222	(911)
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	776	1.935
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.263)	(434)
	(1.487)	1.501
Investor: thesaurierend		
Begeben	0	11
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(21)	(427)
	(21)	(416)
Administrative: thesaurierend		
Begeben	14	14
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(79)	(35)
	(65)	(21)
Class E: Erträge		
Begeben	4.164	6.630
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	18	8
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.066)	(8.332)
	1.116	(1.694)
Class E (Currency Exposure): Erträge		
Begeben	187	1.441
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.583)	(1.725)
	(1.395)	(284)
H Institutional: thesaurierend		
Begeben	10.646	8.239
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(7.106)	(7.676)
	3.540	563
Class Z: thesaurierend		
Begeben	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	(2.092)
	0	(2.092)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Global High Yield Bond Fund		
Institutional: thesaurierend		
Begeben	5.375	6.545
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(6.119)	(13.417)
	(744)	(6.872)
Erträge		
Begeben	1.357	966
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	58	51
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.852)	(14.027)
	(1.437)	(13.010)
Institutional CHF (Hedged): thesaurierend		
Begeben	23	31
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(34)	(681)
	(11)	(650)
Erträge		
Begeben	124	133
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(106)	(1.560)
	18	(1.427)
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	6.295	7.994
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(10.488)	(24.025)
	(4.193)	(16.031)
Erträge		
Begeben	3.949	9.520
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	145	159
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(6.642)	(4.069)
	(2.548)	5.610
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend		
Begeben	1.736	1.473
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.117)	(13.780)
	619	(12.307)
Erträge		
Begeben	14.947	22.851
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	53	46
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(33.322)	(59.227)
	(18.322)	(36.330)
Investor: thesaurierend		
Begeben	39	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(32)	(753)
	7	(753)
Erträge		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Global High Yield Bond Fund (Fortsetzung)		
Investor EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	62	899
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(413)	(550)
	(351)	349
Administrative: thesaurierend		
Begeben	19	105
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(477)	(710)
	(458)	(605)
Erträge		
Begeben	20	49
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(624)	(780)
	(604)	(731)
Administrative EUR (Hedged): Erträge		
Begeben	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(197)
	k. A.	(196)
Administrative GBP (Hedged): Erträge		
Begeben	k. A.	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(107)
	k. A.	(106)
BM Retail: ausschüttend II		
Begeben	407	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(84)	0
	323	1
Class E: thesaurierend		
Begeben	771	1.171
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.608)	(2.802)
	(837)	(1.631)
Erträge		
Begeben	9.437	14.617
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	23	22
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(11.547)	(16.703)
	(2.087)	(2.064)
Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	1.838	3.171
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.761)	(4.821)
	(923)	(1.650)
Erträge		
Begeben	411	290
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(581)	(810)
	(169)	(520)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Global High Yield Bond Fund (Fortsetzung)		
Class E GBP (Hedged): Erträge		
Begeben	7	6
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(261)	(29)
	(254)	(23)
Class E SGD (Hedged): Erträge		
Begeben	392	193
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	15	9
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(253)	(607)
	154	(405)
H Institutional: thesaurierend		
Begeben	6.200	11.210
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(10.385)	(5.391)
	(4.185)	5.819
Erträge		
Begeben	1.326	165
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(980)	(767)
	347	(602)
M Retail: Erträge		
Begeben	101	326
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	3	2
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(302)	(769)
	(198)	(441)
ausschüttend II		
Begeben	16.140	23.666
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(16.524)	(30.871)
	(384)	(7.205)
Class R: thesaurierend		
Begeben	7	834
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(39)	(5.248)
	(32)	(4.414)
Class T: thesaurierend		
Begeben	57	15
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(72)	(121)
	(15)	(106)
Erträge		
Begeben	101	15
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(24)	(42)
	77	(27)
Class T EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(130)
	k. A.	(130)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
	Global Investment Grade Credit Fund	
Institutional: thesaurierend		
Begeben	63.058	44.338
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(55.616)	(76.437)
	7.442	(32.099)
Erträge		
Begeben	21.079	7.013
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	132	125
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(13.586)	(16.764)
	7.625	(9.626)
Institutional (Currency Exposure): thesaurierend		
Begeben	703	3.744
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(230)	(1.549)
	473	2.195
Erträge		
Begeben	459	221
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.031)	(735)
	(572)	(514)
Institutional AUD (Hedged): Erträge		
Begeben	170	95
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(326)	(7.762)
	(156)	(7.667)
Institutional CAD (Hedged): Erträge		
Begeben	k. A.	35
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(37)
	k. A.	(1)
Institutional CHF (Hedged): thesaurierend		
Begeben	4.712	6.544
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(14.828)	(7.451)
	(10.116)	(907)
Erträge		
Begeben	888	521
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.219)	(1.364)
	(330)	(842)
Institutional CZK (Hedged): Erträge		
Begeben	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	1.556
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(19.074)	(176.854)
	(19.074)	(175.298)
Institutional EUR (Currency Exposure): thesaurierend		
Begeben	890	1.445
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(830)	(741)
	60	704

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
	Global Investment Grade Credit Fund (Fortsetzung)	
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	22.662	28.528
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(46.697)	(58.533)
	(24.035)	(30.005)
Erträge		
Begeben	6.707	7.044
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	13
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(16.660)	(27.790)
	(9.953)	(20.733)
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend		
Begeben	5.236	1.218
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5.086)	(6.780)
	150	(5.562)
Erträge		
Begeben	26.883	12.235
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	46	31
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(41.147)	(66.400)
	(14.218)	(54.134)
Institutional HUF (Hedged): Erträge		
Begeben	k. A.	509
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	3.701
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(1.029.911)
	k. A.	(1.025.701)
Institutional ILS (Hedged): thesaurierend		
Begeben	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(531)
	k. A.	(531)
Institutional NOK (Hedged): thesaurierend		
Begeben	386	146
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(308)	(898)
	78	(752)
Institutional PLN (Hedged): Erträge		
Begeben	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(11.435)
	k. A.	(11.435)
Institutional SEK (Hedged): thesaurierend		
Begeben	13.501	1.808
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5.706)	(37.339)
	7.795	(35.531)
Institutional SGD (Hedged): Erträge		
Begeben	10.377	938
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(884)	(396)
	9.494	542

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
	Global Investment Grade Credit Fund (Fortsetzung)	
Investor:		
thesaurierend		
Begeben	10.514	24.529
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(16.970)	(43.856)
	(6.456)	(19.327)
Erträge		
Begeben	4.619	7.701
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	20	18
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.216)	(2.854)
	423	4.865
Investor AUD (Hedged):		
Erträge		
Begeben	49	824
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(344)	(133)
	(295)	691
Investor CAD (Hedged):		
Erträge		
Begeben	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(175)
	k. A.	(175)
Investor CHF (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	4	11
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(63)	(94)
	(59)	(83)
Erträge		
Begeben	39	16
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(156)	(145)
	(117)	(129)
Investor EUR (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	956	672
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(759)	(1.603)
	197	(931)
Erträge		
Begeben	34	18
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	3	2
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(172)	(218)
	(135)	(198)
Investor GBP (Hedged):		
Erträge		
Begeben	7	17
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(17)	(61)
	(10)	(44)
Investor RMB (Hedged):		
Erträge		
Begeben	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(30)
	k. A.	(30)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
	Global Investment Grade Credit Fund (Fortsetzung)	
Investor SGD (Hedged):		
Erträge		
Begeben	176	288
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(226)	(151)
	(50)	137
Administrative:		
thesaurierend		
Begeben	1.260	272
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(998)	(6.285)
	262	(6.013)
Erträge		
Begeben	3.001	651
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	9	9
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.235)	(3.753)
	1.775	(3.093)
Administrative CHF (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	3	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(27)	(13)
	(24)	(13)
Administrative EUR (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	490	215
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(361)	(235)
	129	(20)
Erträge		
Begeben	269	220
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(177)	(180)
	92	40
Administrative GBP (Hedged):		
Erträge		
Begeben	199	71
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(10)	(176)
	190	(104)
Administrative HKD (Unhedged):		
Erträge		
Begeben	2.789	4.427
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	(4.427)
	2.789	0
Administrative SEK (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	64.371	72.625
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(147.507)	(59.977)
	(83.136)	12.648
Administrative SGD (Hedged):		
Erträge		
Begeben	1.998	9
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(76)	(197)
	1.922	(188)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022		Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
	Global Investment Grade Credit Fund (Fortsetzung)			Global Investment Grade Credit Fund (Fortsetzung)	
BM Retail:			Erträge		
Dekumulation			Begeben	720	1.741
Begeben	1	k. A.	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	36	33
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(766)	(1.125)
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.		(10)	649
	1	k. A.	H Institutional (Currency Exposure): thesaurierend		
Class E:			Begeben	38.276	22.933
thesaurierend			Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Begeben	13.621	9.251	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(51.448)	(84)
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		(13.172)	22.849
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(9.666)	(13.142)	M Retail:		
	3.955	(3.891)	Dekumulation		
Erträge			Begeben	1	k. A.
Begeben	10.825	5.108	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	69	73	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(9.159)	(10.629)		1	k. A.
	1.735	(5.448)	Erträge		
Class E CHF (Hedged): thesaurierend			Begeben	724	326
Begeben	187	265	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	3	2
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(475)	(2.065)
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(743)	(1.399)		252	(1.737)
	(556)	(1.134)	ausschüttend II		
E Class EUR (Currency Exposure): Erträge			Begeben	10.209	5.726
Begeben	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	2	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(10.336)	(7.045)
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	(140)		(125)	(1.318)
	0	(140)	M Retail HKD (Unhedged): Erträge		
Class E EUR (Hedged): thesaurierend			Begeben	116	103
Begeben	14.345	12.147	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(87)	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(22.720)	(16.618)		29	103
	(8.375)	(4.471)	Class R: thesaurierend		
Erträge			Begeben	29	143
Begeben	945	946	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	1	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(534)	(790)
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.371)	(3.458)		(505)	(647)
	(1.425)	(2.511)	Erträge		
Class E GBP (Hedged): Erträge			Begeben	92	30
Begeben	336	134	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	3	3	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(149)	(122)
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(425)	(535)		(56)	(92)
	(86)	(398)	Class R EUR (Hedged): Erträge		
Class E SGD (Hedged): Erträge			Begeben	0	3
Begeben	2.589	862	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	14	4	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(86)	(275)
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(723)	(875)		(86)	(272)
	1.880	(9)	Class R GBP (Hedged): Erträge		
H Institutional: thesaurierend			Begeben	170	285
Begeben	37.906	21.140	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(450)	(428)
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(29.500)	(13.895)		(280)	(143)
	8.406	7.245			

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Global Investment Grade Credit Fund (Fortsetzung)		
Class T:		
thesaurierend		
Begeben	396	333
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(807)	(985)
	(411)	(652)
Class T EUR (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	234	58
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(160)	(111)
	74	(53)
W Class:		
thesaurierend		
Begeben	3.701	802
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.903)	(3.534)
	798	(2.732)
Erträge		
Begeben	1.506	600
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(522)	(1.279)
	984	(679)
W Class CHF (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	301	55
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(379)	(893)
	(78)	(838)
W Class EUR (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	1.164	3.284
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.172)	(16.428)
	(8)	(13.144)
Erträge		
Begeben	454	32
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(47)	(116)
	407	(84)
W Class GBP (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	193	378
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(182)	(44)
	11	334
Erträge		
Begeben	848	94
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(133)	(881)
	715	(787)
W Class SGD (Hedged):		
Erträge		
Begeben	1.282	561
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(65)	(81)
	1.217	480

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Global Investment Grade Credit ESG Fund		
Institutional:		
thesaurierend		
Begeben	1.995	3.548
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.224)	(835)
	(229)	2.713
Erträge		
Begeben	13.051	582
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	2	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.188)	(1.240)
	11.865	(658)
Institutional CHF (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	2.323	5.476
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.109)	(1.599)
	(786)	3.877
Erträge		
Begeben	130	3
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(9)	(54)
	121	(51)
Institutional EUR (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	37.792	15.414
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(7.755)	(12.338)
	30.037	3.076
Erträge		
Begeben	7.132	46.158
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	40
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(17.617)	(10.802)
	(10.485)	35.396
Institutional GBP (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	4.418	2.854
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(8.761)	(2.656)
	(4.343)	198
Erträge		
Begeben	20.237	452
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(564)	(5.089)
	19.673	(4.637)
Institutional SEK (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	292	106
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(99)	0
	193	106
Investor:		
thesaurierend		
Begeben	0	11
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(11)	0
	(11)	11

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Global Investment Grade Credit ESG Fund (Fortsetzung)		
Investor EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.
Erträge		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.
Administrative SEK (Hedged): thesaurierend		
Begeben	26.799	30.800
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(11.000)	(17.723)
	15.799	13.077
Class E:		
thesaurierend		
Begeben	913	44
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(27)	(216)
	886	(172)
Erträge		
Begeben	374	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(8)	(29)
	366	(29)
Class E CHF (Hedged): thesaurierend		
Begeben	5	47
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(17)	(6)
	(12)	41
Erträge		
Begeben	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	0	0
Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	3.233	60
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.733)	(363)
	1.500	(303)
Erträge		
Begeben	38	13
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(33)	(29)
	5	(16)
Class E GBP (Hedged): thesaurierend		
Begeben	26	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	26	0

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Global Investment Grade Credit ESG Fund (Fortsetzung)		
Erträge		
Begeben	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(10)
	k. A.	(10)
Class Z:		
thesaurierend		
Begeben	148	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.700)	0
	(1.552)	0
Global Low Duration Real Return Fund		
Institutional:		
thesaurierend		
Begeben	807	17.233
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(7.582)	(18.259)
	(6.775)	(1.026)
Institutional CHF (Hedged): thesaurierend		
Begeben	3.137	282
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.693)	(1.169)
	1.444	(887)
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	1.792	37.827
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(25.072)	(38.154)
	(23.280)	(327)
Erträge		
Begeben	9	67
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.117)	(841)
	(1.108)	(774)
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend		
Begeben	940	3.306
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.058)	(3.949)
	(2.118)	(643)
Erträge		
Begeben	3.915	3.506
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.437)	(2.465)
	479	1.041
Institutional SGD (Hedged): thesaurierend		
Begeben	23.484	34.943
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	23.484	34.943
Investor:		
thesaurierend		
Begeben	0	344
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(227)	(196)
	(227)	148

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Global Low Duration Real Return Fund (Fortsetzung)		
Class E:		
thesaurierend		
Begeben	354	2.786
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.415)	(1.966)
	(1.061)	820
Class E EUR (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	1.544	10.191
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(8.064)	(7.015)
	(6.520)	3.176
Global Real Return Fund		
Institutional:		
thesaurierend		
Begeben	2.223	4.831
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.194)	(6.987)
	29	(2.156)
Erträge		
Begeben	151	129
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	2	5
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(576)	(474)
	(423)	(340)
Institutional (Currency Exposure):		
thesaurierend		
Begeben	33	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(102)	(715)
	(69)	(715)
Institutional CHF (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	833	761
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.127)	(401)
	(294)	360
Erträge		
Begeben	119	634
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(769)	(174)
	(650)	460
Institutional EUR (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	8.162	19.760
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(17.902)	(22.869)
	(9.740)	(3.109)
Erträge		
Begeben	196	400
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	95	187
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.351)	(1.252)
	(1.060)	(665)
Institutional GBP (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	604	1.338
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.113)	(1.217)
	(509)	121

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Global Real Return Fund (Fortsetzung)		
Erträge		
Begeben	7.497	5.537
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	36	49
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(9.732)	(6.352)
	(2.199)	(766)
Institutional SGD (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	61	152
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(140)	(1.418)
	(79)	(1.266)
Investor:		
thesaurierend		
Begeben	73	900
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.668)	(1.580)
	(1.595)	(680)
Erträge		
Begeben	234	2
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	25	43
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(30)	(1.171)
	229	(1.126)
Investor CHF (Hedged):		
Erträge		
Begeben	0	7
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(80)	(135)
	(80)	(128)
Investor EUR (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	83	84
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(270)	(489)
	(187)	(405)
Administrative:		
thesaurierend		
Begeben	42	382
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(460)	(1.192)
	(418)	(810)
Class E:		
thesaurierend		
Begeben	1.272	3.430
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.092)	(5.529)
	(1.820)	(2.099)
Erträge		
Begeben	166	1.089
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	19	57
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(988)	(1.375)
	(803)	(229)
Class E EUR (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	3.851	3.812
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5.233)	(5.495)
	(1.382)	(1.683)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Global Real Return Fund (Fortsetzung)		
Class E GBP (Hedged): Erträge		
Begeben	k. A.	53
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(336)
	k. A.	(282)
H Institutional: thesaurierend		
Begeben	3.138	2.482
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(806)	(4.207)
	2.332	(1.725)
Class R: thesaurierend		
Begeben	11	13
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(70)	(395)
	(59)	(382)
Class R GBP (Hedged): thesaurierend		
Begeben	62	178
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(226)	(375)
	(164)	(197)
Income Fund		
Institutional: thesaurierend		
Begeben	235.764	205.515
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(183.589)	(266.612)
	52.175	(61.097)
Erträge		
Begeben	140.047	134.393
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	2.778	2.459
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(113.756)	(143.512)
	29.069	(6.660)
Institutional AUD (Hedged): thesaurierend		
Begeben	1.483	200
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(230)	(918)
	1.253	(718)
Erträge		
Begeben	k. A.	123
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(124)
	k. A.	(1)
Erträge		
Begeben	24	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	24	k. A.
Institutional BRL (Hedged): thesaurierend		
Begeben	5.336	1.312
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.695)	(24.928)
	641	(23.616)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Income Fund (Fortsetzung)		
Institutional CAD (Hedged): thesaurierend		
Begeben	1.075	352
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(688)	(937)
	387	(585)
Erträge		
Begeben	739	95
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	9	7
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(416)	(492)
	332	(390)
Institutional CHF (Hedged): thesaurierend		
Begeben	8.128	4.888
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(6.506)	(4.933)
	1.622	(45)
Erträge		
Begeben	6.370	2.143
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.083)	(4.171)
	3.287	(2.028)
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	237.892	305.996
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(223.868)	(373.923)
	14.024	(67.927)
Erträge		
Begeben	21.017	28.529
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	31	264
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(27.440)	(49.457)
	(6.392)	(20.664)
ausschüttend II		
Begeben	1.623	768
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(558)	(1.351)
	1.065	(583)
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend		
Begeben	7.842	2.926
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.816)	(5.345)
	5.026	(2.419)
Erträge		
Begeben	27.957	8.905
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	37	38
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(12.646)	(5.318)
	15.348	3.625
Institutional HKD (Unhedged): Erträge		
Begeben	19.180	7.384
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	28	17
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(35.150)	(33.765)
	(15.942)	(26.364)

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022		Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
	Income Fund (Fortsetzung)			Income Fund (Fortsetzung)	
Institutional JPY (Hedged): thesaurierend			Investor EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	k. A.	123	Begeben	21.322	57.324
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(352)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(21.229)	(79.974)
	k. A.	(229)		93	(22.650)
thesaurierend			Erträge		
Begeben	3.007	k. A.	Begeben	3.417	1.522
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(910)	k. A.	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.985)	(3.390)
	2.097	k. A.		1.432	(1.868)
Institutional NOK (Hedged): thesaurierend			ausschüttend A		
Begeben	2.788	4.029	Begeben	150	161
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.084)	(2.602)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(754)	(540)
	704	1.427		(604)	(379)
Institutional RMB (Hedged): thesaurierend			Investor GBP (Hedged): Erträge		
Begeben	k. A.	0	Begeben	234	1.302
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(1)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(82)	(272)
	k. A.	(1)		152	1.030
Erträge			Investor HKD (Unhedged): Erträge		
Begeben	1	k. A.	Begeben	8	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.		8	k. A.
Institutional SGD (Hedged): thesaurierend			Investor JPY (Hedged): thesaurierend		
Begeben	5.080	3.501	Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.560)	(2.109)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	3.520	1.392		1	k. A.
Erträge			Investor RMB (Hedged): thesaurierend		
Begeben	27.618	7.373	Begeben	428	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	150	65	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(9.147)	(8.523)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(136)	(415)
	18.621	(1.085)		292	(415)
Investor: thesaurierend			Investor SGD (Hedged): thesaurierend		
Begeben	33.434	21.157	Begeben	1.031	508
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(40.309)	(74.160)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	(68)
	(6.875)	(53.003)		1.031	440
Erträge			Erträge		
Begeben	41.977	36.086	Begeben	3.988	2.208
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	169	161	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	4	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(41.974)	(44.046)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.521)	(3.473)
	172	(7.799)		2.471	(1.265)
Investor AUD (Hedged): Erträge			Administrative: thesaurierend		
Begeben	2.862	1.063	Begeben	26.278	8.620
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(542)	(1.007)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(17.485)	(16.949)
	2.320	56		8.793	(8.329)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
	Income Fund (Fortsetzung)	
Erträge		
Begeben	105.546	66.046
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	550	410
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(47.552)	(96.953)
	58.544	(30.497)
Administrative AUD (Hedged):		
Erträge		
Begeben	15.948	5.920
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	118	74
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.454)	(4.398)
	13.612	1.596
Administrative EUR (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	5.959	16.413
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(7.365)	(23.680)
	(1.406)	(7.267)
Erträge		
Begeben	10.041	9.626
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.650)	(9.123)
	5.392	503
Administrative GBP (Hedged):		
Erträge		
Begeben	4.526	2.145
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	78	58
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.096)	(3.252)
	3.508	(1.049)
Administrative HKD (Unhedged):		
Erträge		
Begeben	193.297	102.825
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	153	36
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(49.337)	(201.758)
	144.113	(98.897)
Administrative JPY (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	k. A.	713
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(714)
	k. A.	(1)
Administrative SGD (Hedged):		
Erträge		
Begeben	98.323	19.561
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	577	312
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(11.233)	(16.816)
	87.667	3.057
Class E:		
thesaurierend		
Begeben	119.582	72.634
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(82.321)	(124.100)
	37.261	(51.466)
Erträge		
Begeben	326.240	129.484
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	2.985	2.095
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(140.923)	(212.567)
	188.302	(80.988)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
	Income Fund (Fortsetzung)	
Ausschüttend Q		
Begeben	k. A.	142
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(345)
	k. A.	(203)
Class E AUD (Hedged):		
Erträge		
Begeben	31.546	9.508
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	578	317
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(6.850)	(10.371)
	25.274	(546)
Class E CHF (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	1.042	659
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.353)	(1.563)
	(1.311)	(904)
Erträge		
Begeben	24.880	2.434
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	4	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.889)	(4.987)
	22.995	(2.553)
Class E EUR (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	108.725	69.869
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(81.381)	(84.120)
	27.344	(14.251)
Erträge		
Begeben	97.760	58.606
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	134	67
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(89.926)	(90.970)
	7.968	(32.297)
ausschüttend II		
Begeben	6.406	3.524
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.361)	(2.127)
	4.046	1.397
Ausschüttend II Q		
Begeben	822	911
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.445)	(1.774)
	(623)	(863)
Class E GBP (Hedged):		
Erträge		
Begeben	8.061	5.514
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	74	46
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5.197)	(4.932)
	2.938	628
Class E HKD (Unhedged):		
Erträge		
Begeben	169.278	68.787
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	356	267
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(100.430)	(142.484)
	69.204	(73.430)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Income Fund II (Fortsetzung)		
Erträge		
Begeben	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(1)
	k. A.	(1)
Erträge		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.
Class E:		
Erträge		
Begeben	6.709	2.007
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.648)	(113)
	3.061	1.895
Class E AUD (Hedged):		
Erträge		
Begeben	2.670	210
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	2	2
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.350)	0
	1.322	212
Class E EUR (Hedged):		
Erträge		
Begeben	655	362
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(383)	(28)
	273	335
Class E GBP (Hedged):		
Erträge		
Begeben	1.660	332
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(594)	(24)
	1.067	309
Class E HKD (Unhedged):		
Erträge		
Begeben	33.686	8.423
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	11
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(19.174)	(1.455)
	14.513	6.979
Class E JPY (Hedged):		
Erträge		
Begeben	38	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	38	k. A.
Class E SGD (Hedged):		
Erträge		
Begeben	k. A.	3
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(38)
	k. A.	(34)
Inflation Multi-Asset Fund		
Institutional:		
thesaurierend		
Begeben	659	3.039
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(716)	(1.334)
	(57)	1.705

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Inflation Multi-Asset Fund (Fortsetzung)		
Institutional EUR (Partially Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	48	11.234
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5.864)	(2.993)
	(5.816)	8.241
Institutional GBP (Partially Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	155	2.046
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(197)	(3.662)
	(42)	(1.616)
Administrative:		
ausschüttend II		
Begeben	0	334
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	7	5
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(122)	(1)
	(115)	338
Administrative SGD (Hedged):		
ausschüttend II		
Begeben	38	3.086
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	12	28
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(662)	(1.917)
	(612)	1.197
Class E:		
thesaurierend		
Begeben	512	10.246
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.917)	(2.978)
	(4.405)	7.268
ausschüttend II		
Begeben	0	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	0	1
Class E AUD (Partially Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	0	36
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	0	36
Class E EUR (Partially Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	190	12.001
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5.353)	(3.471)
	(5.163)	8.530
Erträge		
Begeben	89	1.435
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(568)	(731)
	(479)	704
Class E GBP (Partially Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	0	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	0	1

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Inflation Multi-Asset Fund (Fortsetzung)		
Class E SGD (Partially Hedged): thesaurierend		
Begeben	0	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	0	1
H Institutional: thesaurierend		
Begeben	0	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	0	1
M Retail: ausschüttend II		
Begeben	22	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	22	1
Low Average Duration Fund		
Institutional: thesaurierend		
Begeben	3.685	17.557
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(12.944)	(22.086)
	(9.259)	(4.529)
Erträge		
Begeben	52	3.385
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	48	24
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.127)	(1.191)
	(2.027)	2.218
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	112	3.251
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.638)	(2.789)
	(1.526)	462
Erträge		
Begeben	269	416
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.066)	(449)
	(796)	(32)
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend		
Begeben	2.158	534
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.176)	(133)
	(18)	401
Erträge		
Begeben	7	11
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	4	2
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(114)	(85)
	(103)	(72)
Investor: thesaurierend		
Begeben	31	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(459)	(229)
	(428)	(228)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Low Average Duration Fund (Fortsetzung)		
Erträge		
Begeben	0	33
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(61)	(590)
	(60)	(556)
Administrative: thesaurierend		
Begeben	43	203
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(211)	(181)
	(168)	22
Class E: thesaurierend		
Begeben	562	9.196
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.521)	(9.321)
	(959)	(125)
Erträge		
Begeben	48	60
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	2	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(185)	(154)
	(135)	(93)
Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	576	1.475
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.848)	(446)
	(1.272)	1.029
H Institutional: thesaurierend		
Begeben	11.786	77.194
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(18.432)	(76.411)
	(6.646)	783
Erträge		
Begeben	1	97
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	3	3
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(32)	(686)
	(28)	(586)
Class R: thesaurierend		
Begeben	91	250
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(308)	(228)
	(217)	22
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund		
Institutional: thesaurierend		
Begeben	14.773	8.468
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.098)	(5.711)
	10.675	2.757
Erträge		
Begeben	75	1.830
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	39	28
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(109)	0
	5	1.858

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022		Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
	Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (Fortsetzung)			Low Duration Income Fund (Fortsetzung)	
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend			thesaurierend		
Begeben	14.067	3.012	Begeben	5.917	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.709)	(9.445)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	10.358	(6.433)		5.917	k. A.
Erträge			Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	0	2	Begeben	8.107	7.973
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(6)	(82)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.903)	(7.357)
	(6)	(80)		4.204	616
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend			Erträge		
Begeben	280	263	Begeben	0	5
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(535)	(166)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	(6.040)
	(255)	97		0	(6.035)
Erträge			Institutional GBP (Hedged): thesaurierend		
Begeben	15	153	Begeben	19.164	10
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(43)	(1.570)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(165)	(169)
	(28)	(1.417)		18.999	(159)
Institutional NOK (Hedged): thesaurierend			Erträge		
Begeben	99	1.345	Begeben	13.462	51
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.404)	(3.883)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(6.296)	(7.884)
	(1.305)	(2.538)		7.166	(7.833)
Institutional SEK (Hedged): thesaurierend			Institutional SGD (Hedged): thesaurierend		
Begeben	3.016	k. A.	Begeben	2.108	836
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.885)	(1.153)
	3.016	k. A.		223	(317)
Class E EUR (Hedged): thesaurierend			Investor EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	2.533	1.820	Begeben	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.518)	(771)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(61)
	15	1.049		k. A.	(61)
	Low Duration Income Fund		Erträge		
Institutional: thesaurierend			Begeben	k. A.	0
Begeben	8.543	17.232	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(48)
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5.740)	(24.502)		k. A.	(48)
	2.803	(7.270)	Class E: thesaurierend		
Erträge			Begeben	4.023	9.022
Begeben	30.340	401	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	2	2	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.594)	(7.895)
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(815)	(479)		2.429	1.127
	29.527	(76)	Erträge		
Institutional CHF (Hedged): thesaurierend			Begeben	248	496
Begeben	k. A.	16	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	9	4
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(340)	(519)
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(194)		(83)	(19)
	k. A.	(178)			

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Low Duration Income Fund (Fortsetzung)		
Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	7.759	5.036
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.485)	(3.364)
	5.274	1.672
Erträge		
Begeben	973	291
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(107)	(78)
	866	213
Class E SGD (Hedged): Erträge		
Begeben	k. A.	4
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(78)
	k. A.	(73)
H Institutional: thesaurierend		
Begeben	914	14.535
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5.463)	(8.743)
	(4.549)	5.792
Erträge		
Begeben	322	164
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	2	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(45)	(119)
	279	45
Class Z EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1)	0
	(1)	0
Low Duration Opportunities Fund		
Institutional: thesaurierend		
Begeben	9.801	15.819
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(7.363)	(22.277)
	2.438	(6.458)
Erträge		
Begeben	2	9
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(938)	(505)
	(936)	(496)
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	109	1.940
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(950)	(3.402)
	(841)	(1.462)
Erträge		
Begeben	18	1.502
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	3	10
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.240)	(1.565)
	(1.219)	(53)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Low Duration Opportunities Fund (Fortsetzung)		
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend		
Begeben	951	39.578
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(48.798)	(125.565)
	(47.847)	(85.987)
Erträge		
Begeben	17.378	7.687
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	197	71
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(21.050)	(20.525)
	(3.475)	(12.767)
Investor EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	7	15
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(176)	(336)
	(169)	(321)
Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	51	67
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(94)	(160)
	(43)	(93)
Class Z: thesaurierend		
Begeben	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(165)	(135)
	(165)	(135)
Low Duration Opportunities ESG Fund		
Institutional: thesaurierend		
Begeben	0	446
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	1	446
Erträge		
Begeben	0	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	0	1
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	0	23
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	0	23
Erträge		
Begeben	0	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	0	1
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend		
Begeben	0	20
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	0	20

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022		Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
	Low Duration Opportunities ESG Fund (Fortsetzung)			Mortgage Opportunities Fund	
Erträge			Institutional: thesaurierend		
Begeben	0	1	Begeben	16.015	25.921
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(17.693)	(35.398)
	0	1		(1.678)	(9.477)
	PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund		Erträge		
Institutional: thesaurierend			Begeben	1.398	1.777
Begeben	27	1.904	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	15	447
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(8.116)	(26.696)
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(947)	(2.448)		(6.703)	(24.472)
	(920)	(544)	Institutional CAD (Hedged): thesaurierend		
Erträge			Begeben	1.674	0
Begeben	5	81	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(409)	(4.100)		1.674	0
	(404)	(4.019)	Institutional CHF (Hedged): thesaurierend		
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend			Begeben	87	53
Begeben	527	3.125	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(134)	(263)
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.461)	(995)		(47)	(210)
	(934)	2.130	Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Erträge			Begeben	16.534	12.444
Begeben	17	351	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(11.638)	(22.004)
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(327)	(181)		4.896	(9.560)
	(310)	170	Erträge		
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend			Begeben	278	134
Begeben	1	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	32	43
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(981)	(1.207)
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(20)	(31)		(671)	(1.030)
	(19)	(31)	Institutional GBP (Hedged): thesaurierend		
Erträge			Begeben	147	35.235
Begeben	k. A.	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(425)	(36.241)
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(5)		(278)	(1.006)
	k. A.	(5)	Erträge		
Investor: thesaurierend			Begeben	922	615
Begeben	k. A.	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(373)	(484)
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(117)		549	131
	k. A.	(117)	Investor: thesaurierend		
Class E: Erträge			Begeben	455	155
Begeben	1.116	5.241	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	1	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(614)	(1.077)
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.046)	(3.306)		(159)	(922)
	(929)	1.936	Erträge		
Class Z: thesaurierend			Begeben	169	29
Begeben	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	2	3
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(48)	(1.403)
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(439)	0		123	(1.371)
	(439)	0			

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Mortgage Opportunities Fund (Fortsetzung)		
Administrative: Erträge		
Begeben	623	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(628)	(49)
	(5)	(49)
Class E: thesaurierend		
Begeben	2.708	1.235
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.527)	(2.163)
	1.181	(928)
Erträge		
Begeben	853	51
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	5	3
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(83)	(575)
	775	(521)
Class E CHF (Hedged): Erträge		
Begeben	10	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(32)	(14)
	(22)	(14)
Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	408	270
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(741)	(446)
	(333)	(176)
Erträge		
Begeben	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(17)
	k. A.	(17)
Class E SGD (Hedged): Erträge		
Begeben	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(169)
	k. A.	(168)
H Institutional: thesaurierend		
Begeben	298	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(7)	(3)
	291	(3)
Erträge		
Begeben	90	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	91	k. A.
Class Z: thesaurierend		
Begeben	1.496	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	(19.628)
	1.496	(19.627)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Mortgage Opportunities Fund (Fortsetzung)		
Class Z GBP (Hedged): thesaurierend		
Begeben	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(34.658)
	k. A.	(34.658)
StocksPLUS™ Fund		
Institutional: thesaurierend		
Begeben	16.148	7.763
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5.962)	(34.505)
	10.186	(26.742)
Erträge		
Begeben	122	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	27	6
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(72)	(186)
	77	(179)
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	3.742	5.360
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.545)	(16.644)
	(803)	(11.284)
Erträge		
Begeben	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(68)
	k. A.	(68)
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend		
Begeben	25	461
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(481)	(23)
	(456)	438
Institutional SGD (Hedged): thesaurierend		
Begeben	23	41
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(61)	(3)
	(38)	38
Investor: thesaurierend		
Begeben	198	260
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(162)	(191)
	36	69
BE Retail: thesaurierend		
Begeben	1.475	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(888)	0
	587	1
Class E: thesaurierend		
Begeben	1.399	1.702
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.261)	(970)
	138	732

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
StocksPLUS™ Fund (Forts.)		
Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben	4.883	4.253
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.338)	(2.398)
	3.545	1.855
H Institutional:		
thesaurierend		
Ausgegeben	24.409	16.223
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(21.621)	(46.974)
	2.788	(30.751)
Class T:		
thesaurierend		
Ausgegeben	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(124)
	k. A.	(124)
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund		
Institutional:		
thesaurierend		
Ausgegeben	75	89
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(113)	(29)
	(38)	60
Institutional EUR (Hedged):		
thesaurierend		
Ausgegeben	k. A.	2
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(26)
	k. A.	(24)
Institutional GBP (Hedged):		
thesaurierend		
Ausgegeben	59	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(78)	0
	(19)	1
Class E:		
thesaurierend		
Ausgegeben	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(2)
	k. A.	(2)
Strategic Income Fund		
Institutional:		
thesaurierend		
Ausgegeben	16	74
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(299)	(889)
	(283)	(815)
Institutional EUR (Hedged):		
thesaurierend		
Ausgegeben	1.029	5.539
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.683)	(7.311)
	(2.654)	(1.772)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Strategic Income Fund (Forts.)		
Institutional GBP (Hedged):		
Erträge		
Ausgegeben	0	21
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	1	21
Class E:		
thesaurierend		
Ausgegeben	280	1.152
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(752)	(875)
	(472)	277
ausschüttend II		
Ausgegeben	244	760
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(396)	(600)
	(151)	161
Class E EUR (Hedged):		
thesaurierend		
Ausgegeben	592	4.473
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.080)	(3.943)
	(2.488)	530
ausschüttend II		
Ausgegeben	668	1.437
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.000)	(2.014)
	(1.332)	(577)
Class T EUR (Hedged):		
thesaurierend		
Ausgegeben	59	210
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(325)	(264)
	(266)	(54)
Erträge		
Ausgegeben	122	217
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(241)	(126)
	(119)	91
Total Return Bond Fund		
Institutional:		
thesaurierend		
Ausgegeben	14.082	14.515
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(10.612)	(12.236)
	3.470	2.279
Erträge		
Ausgegeben	2.187	1.043
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	181	144
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.719)	(3.382)
	649	(2.195)
Institutional CAD (Hedged):		
Erträge		
Ausgegeben	347	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	8	7
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(494)	(960)
	(139)	(953)

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
	Total Return Bond Fund (Forts.)	
Institutional CHF (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben	348	110
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(60)	(901)
	288	(791)
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben	8.679	11.822
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(9.151)	(7.110)
	(472)	4.712
Erträge		
Ausgegeben	317	214
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	557	398
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(692)	(423)
	182	189
Institutional EUR (Unhedged): thesaurierend		
Ausgegeben	24	1.047
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(491)	(799)
	(467)	248
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben	521	89
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(212)	(172)
	309	(83)
Erträge		
Ausgegeben	750	1.008
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	21	20
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.967)	(1.840)
	(1.196)	(812)
Institutional ILS (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(13)
	k. A.	(13)
Institutional SGD (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben	79	425
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(113)	(1.297)
	(34)	(872)
Investor: thesaurierend		
Ausgegeben	3.154	6.860
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(6.043)	(3.170)
	(2.889)	3.690
Erträge		
Ausgegeben	411	4.075
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	7	6
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.658)	(1.523)
	(1.240)	2.558

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
	Total Return Bond Fund (Forts.)	
Investor CHF (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben	62	28
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(123)	(138)
	(61)	(110)
Investor EUR (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben	86	441
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(215)	(277)
	(129)	164
Administrative: thesaurierend		
Ausgegeben	541	1.321
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(886)	(1.487)
	(345)	(166)
Erträge		
Ausgegeben	4.905	2.212
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(124)	(1.730)
	4.781	482
Administrative EUR (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben	9	154
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(36)	(29)
	(27)	125
Administrative SGD (Hedged): Erträge		
Ausgegeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.
Class E: thesaurierend		
Ausgegeben	3.590	2.883
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.323)	(3.718)
	267	(835)
Erträge		
Ausgegeben	1.023	1.010
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	44	33
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.492)	(2.318)
	(1.425)	(1.275)
Class E CHF (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben	508	744
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(424)	(131)
	84	613
Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben	1.737	2.661
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.728)	(5.090)
	(2.991)	(2.429)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Total Return Bond Fund (Forts.)		
Erträge		
Ausgegeben	191	431
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(925)	(909)
	(734)	(478)
Class E EUR (Unhedged): thesaurierend		
Ausgegeben	21	19
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(72)	(35)
	(51)	(16)
Class E HKD (Unhedged): thesaurierend		
Ausgegeben	10	82
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(165)	(186)
	(155)	(104)
Class E SGD (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben	221	97
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(175)	(163)
	46	(66)
H Institutional: thesaurierend		
Ausgegeben	4.562	8.179
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.035)	(10.096)
	2.527	(1.917)
Erträge		
Ausgegeben	344	182
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	12	9
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(173)	(822)
	183	(631)
M Retail HKD (Unhedged): Erträge		
Ausgegeben	658	99
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(10)	(29)
	648	70
Class R EUR (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben	3	128
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(75)	(355)
	(72)	(227)
Class T: thesaurierend		
Ausgegeben	22	96
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(107)	(616)
	(85)	(520)
Class T EUR (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben	121	200
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(90)	(119)
	31	81

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund		
Institutional: thesaurierend		
Ausgegeben	3.086	12.457
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(9.946)	(4.248)
	(6.860)	8.209
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben	393	10.855
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(10.603)	(1.198)
	(10.210)	9.657
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben	31	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(6)	0
	25	1
Erträge		
Ausgegeben	5.546	3.333
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.502)	0
	2.045	3.333
Investor: thesaurierend		
Ausgegeben	556	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(34)	0
	522	1
Investor EUR (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben	0	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	0	1
Class E: thesaurierend		
Ausgegeben	719	3.403
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(582)	(2.731)
	137	672
Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben	402	1.900
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(777)	(402)
	(375)	1.498
H Institutional: thesaurierend		
Ausgegeben	100	4
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(14)	0
	86	4
Class Z: thesaurierend		
Ausgegeben	474	3.659
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(898)	0
	(424)	3.659

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
UK Corporate Bond Fund		
Institutional: thesaurierend		
Ausgegeben	400	653
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(722)	(1.469)
	(322)	(816)
Erträge		
Ausgegeben	8.171	8.201
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(13.386)	(16.638)
	(5.215)	(8.437)
Class Z:		
thesaurierend		
Ausgegeben	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	0	0
UK Long Term Corporate Bond Fund		
Institutional: thesaurierend		
Ausgegeben	351	5.022
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.486)	(3.722)
	(1.135)	1.300
Erträge		
Ausgegeben	80	183
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(508)	(105)
	(428)	78
US High Yield Bond Fund		
Institutional: thesaurierend		
Ausgegeben	2.581	4.125
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(7.506)	(23.143)
	(4.925)	(19.018)
Erträge		
Ausgegeben	1.626	1.227
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	127	158
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5.453)	(13.176)
	(3.700)	(11.791)
Institutional CHF (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben	k. A.	22
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(244)
	k. A.	(222)
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben	1.357	2.175
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.883)	(8.534)
	(1.526)	(6.359)
Erträge		
Ausgegeben	122	669
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	138	303
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.636)	(9.203)
	(1.376)	(8.231)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
US High Yield Bond Fund (Forts.)		
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben	288	196
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(907)	(292)
	(619)	(96)
Erträge		
Ausgegeben	213	63
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(82)	(447)
	131	(384)
Institutional SGD (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben	k. A.	15
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(52)
	k. A.	(37)
Investor:		
thesaurierend		
Ausgegeben	582	485
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.306)	(4.966)
	(724)	(4.481)
Erträge		
Ausgegeben	135	448
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	21	31
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(873)	(1.987)
	(717)	(1.508)
Investor EUR (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben	14	495
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(20)	(495)
	(6)	0
Class E:		
thesaurierend		
Ausgegeben	658	853
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.163)	(2.926)
	(505)	(2.073)
Erträge		
Ausgegeben	6.012	5.181
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	79	70
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5.501)	(10.275)
	590	(5.024)
Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben	169	1.163
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(607)	(1.564)
	(438)	(401)
H Institutional: thesaurierend		
Ausgegeben	3.014	6.232
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.636)	(7.216)
	378	(984)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
US High Yield Bond Fund (Forts.)		
Erträge		
Ausgegeben	342	31
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(17)	(70)
	326	(38)
M Retail:		
Erträge		
Ausgegeben	6.557	12.039
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(6.222)	(11.070)
	336	970
Class R:		
thesaurierend		
Ausgegeben	4	319
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(133)	(236)
	(129)	83
Class Z:		
thesaurierend		
Ausgegeben	218	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	218	0
US Investment Grade Corporate Bond Fund		
Institutional:		
thesaurierend		
Ausgegeben	12.595	10.490
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(6.673)	(6.644)
	5.922	3.846
Erträge		
Ausgegeben	3.527	2.630
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	5	3
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.341)	(1.431)
	191	1.202
Institutional EUR (Hedged):		
thesaurierend		
Ausgegeben	2.845	6.790
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(8.104)	(12.251)
	(5.259)	(5.461)
Institutional GBP (Hedged):		
ausschüttend II		
Ausgegeben	3.019	840
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	283
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.337)	(30.818)
	1.683	(29.695)
Class E:		
thesaurierend		
Ausgegeben	3.380	1.086
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(641)	(249)
	2.739	837
Erträge		
Ausgegeben	313	111
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(46)	(279)
	268	(167)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
US Investment Grade Corporate Bond Fund (Forts.)		
H Institutional:		
thesaurierend		
Ausgegeben	204	6
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(6)	0
	198	6
US Short-Term Fund		
Institutional:		
thesaurierend		
Ausgegeben	20.663	73.837
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(49.119)	(71.198)
	(28.456)	2.639
Erträge		
Ausgegeben	330	3.299
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.235)	(264)
	(905)	3.035
Institutional EUR (Hedged):		
thesaurierend		
Ausgegeben	3.114	16.072
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(16.925)	(18.694)
	(13.811)	(2.622)
Institutional GBP (Hedged):		
Erträge		
Ausgegeben	22	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2)	k. A.
	21	k. A.
Investor:		
thesaurierend		
Ausgegeben	310	174
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(841)	(681)
	(531)	(507)
Class E:		
thesaurierend		
Ausgegeben	20.879	15.967
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(22.829)	(20.780)
	(1.950)	(4.813)
Class E EUR (Hedged):		
thesaurierend		
Ausgegeben	2.965	4.393
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5.797)	(681)
	(2.832)	3.712
H Institutional:		
thesaurierend		
Ausgegeben	517	840
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.030)	(1.943)
	(513)	(1.103)
Class Z:		
Erträge		
Ausgegeben	500	690
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	2.896	1.338
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.172)	(32.194)
	1.224	(30.166)

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

19. NETTOINVENTARWERTE

Im Folgenden sind das rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhabern zuzuschreibende Nettovermögen der einzelnen Teilfonds, die ausgegebenen und umlaufenden Anteile und der NIW je Anteil der vergangenen drei Geschäftsjahre (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 NIWs oder Gesamterträge 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 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
PIMCO Asia High Yield Bond Fund			
Nettovermögen	\$ 2.434.728	\$ 2.981.392	\$ 3.411.923
Institutional:			
thesaurierend	\$ 1.472.296	\$ 1.552.047	\$ 1.221.240
ausgegebene und umlaufende Anteile	164.619	174.453	117.953
NIW je Anteil	\$ 8,94	\$ 8,90	\$ 10,35
Erträge	\$ 125.117	\$ 113.734	\$ 248.734
ausgegebene und umlaufende Anteile	19.073	16.032	28.125
NIW je Anteil	\$ 6,56	\$ 7,09	\$ 8,84
Institutional AUD (Hedged):			
Erträge	AUD 128	AUD 203.422	AUD 12
ausgegebene und umlaufende Anteile	20	28.372	1
NIW je Anteil	AUD 6,50	AUD 7,17	AUD 9,00
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 2.735	CHF 4.094	CHF 35.166
ausgegebene und umlaufende Anteile	365	527	3.797
NIW je Anteil	CHF 7,49	CHF 7,77	CHF 9,26
Erträge	CHF 1.582	CHF 1.912	CHF 5.135
ausgegebene und umlaufende Anteile	262	281	591
NIW je Anteil	CHF 6,04	CHF 6,81	CHF 8,69
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 275.717	€ 498.977	€ 653.189
ausgegebene und umlaufende Anteile	35.835	63.739	70.200
NIW je Anteil	€ 7,69	€ 7,83	€ 9,30
Erträge	€ 20.415	€ 27.728	€ 75.650
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.301	4.056	8.695
NIW je Anteil	€ 6,18	€ 6,84	€ 8,70
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 13.169	£ 14.369	£ 18.246
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.685	1.836	1.996
NIW je Anteil	£ 7,82	£ 7,83	£ 9,14
Erträge	£ 17.555	£ 20.785	£ 59.979
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.820	3.068	7.061
NIW je Anteil	£ 6,22	£ 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 6.313	SGD 385	SGD 85
ausgegebene und umlaufende Anteile	959	53	9
NIW je Anteil	SGD 6,58	SGD 7,23	SGD 9,01
Investor:			
thesaurierend	\$ 6.472	\$ 8.727	\$ 19.282
ausgegebene und umlaufende Anteile	862	1.164	2.201
NIW je Anteil	\$ 7,51	\$ 7,50	\$ 8,76

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
PIMCO Asia High Yield Bond Fund (Forts.)			
Erträge	\$ 48.069	\$ 71.688	\$ 273.632
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.472	10.304	31.566
NIW je Anteil	\$ 6,43	\$ 6,96	\$ 8,67
Investor AUD (Hedged):			
Erträge	AUD 3.657	AUD 3.889	AUD 5.081
ausgegebene und umlaufende Anteile	578	557	579
NIW je Anteil	AUD 6,33	AUD 6,99	AUD 8,77
Investor EUR (Hedged):			
Erträge	€ 996	€ 873	€ 935
ausgegebene und umlaufende Anteile	164	130	110
NIW je Anteil	€ 6,05	€ 6,69	€ 8,52
Investor RMB (Hedged):			
Erträge	CNH 1.683	CNH 13.234	CNH 24.873
ausgegebene und umlaufende Anteile	26	182	275
NIW je Anteil	CNH 65,29	CNH 72,74	CNH 90,46
Investor SGD (Hedged):			
Erträge	SGD 2.963	SGD 4.112	SGD 6.528
ausgegebene und umlaufende Anteile	467	591	753
NIW je Anteil	SGD 6,34	SGD 6,96	SGD 8,67
Administrative:			
Erträge	\$ 22.518	\$ 28.245	\$ 41.320
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.431	3.980	4.672
NIW je Anteil	\$ 6,56	\$ 7,10	\$ 8,84
Class E:			
thesaurierend	\$ 51.171	\$ 61.585	\$ 78.405
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.290	7.540	8.175
NIW je Anteil	\$ 8,14	\$ 8,17	\$ 9,59
Erträge	\$ 47.824	\$ 56.633	\$ 100.159
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.288	7.981	11.325
NIW je Anteil	\$ 6,56	\$ 7,10	\$ 8,84
Class E CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 690	CHF 1.012	CHF 1.263
ausgegebene und umlaufende Anteile	95	133	138
NIW je Anteil	CHF 7,28	CHF 7,63	CHF 9,16
Erträge	CHF 198	CHF 245	CHF 280
ausgegebene und umlaufende Anteile	33	36	32
NIW je Anteil	CHF 6,04	CHF 6,81	CHF 8,69
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 41.927	€ 48.877	€ 61.580
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.605	6.365	6.687
NIW je Anteil	€ 7,48	€ 7,68	€ 9,21
Erträge	€ 8.111	€ 8.314	€ 10.041
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.312	1.217	1.154
NIW je Anteil	€ 6,18	€ 6,83	€ 8,70
Class E HKD (Unhedged):			
Erträge	HKD 5.306	HKD 6.334	HKD 4.540
ausgegebene und umlaufende Anteile	812	897	516
NIW je Anteil	HKD 6,54	HKD 7,06	HKD 8,79
Class E SGD (Hedged):			
Erträge	SGD 12.291	SGD 15.239	SGD 25.623
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.919	2.168	2.924
NIW je Anteil	SGD 6,40	SGD 7,03	SGD 8,76
H Institutional:			
thesaurierend	\$ 1.327	\$ 1.323	\$ 182
ausgegebene und umlaufende Anteile	172	172	20
NIW je Anteil	\$ 7,71	\$ 7,69	\$ 8,96
Erträge	\$ 328	\$ 547	\$ 686
ausgegebene und umlaufende Anteile	51	79	80
NIW je Anteil	\$ 6,38	\$ 6,90	\$ 8,60
M Retail:			
ausschüttend II	\$ 18.245	\$ 17.613	\$ 22.700
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.999	2.637	2.684
NIW je Anteil	\$ 6,08	\$ 6,68	\$ 8,46

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
PIMCO Asia High Yield Bond Fund (Forts.)			
M Retail HKD (Unhedged): ausschüttend II	HKD 1.741	HKD 1.797	HKD 6.482
ausgegebene und umlaufende Anteile	288	270	771
NIW je Anteil	HKD 6,05	HKD 6,65	HKD 8,41
M Retail SGD (Hedged): ausschüttend II	SGD 7.118	SGD 8.881	SGD 11.492
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.199	1.342	1.372
NIW je Anteil	SGD 5,94	SGD 6,62	SGD 8,38
Class Z: thesaurierend	\$ 187.047	\$ 230.136	\$ 300.885
ausgegebene und umlaufende Anteile	20.248	25.207	28.503
NIW je Anteil	\$ 9,24	\$ 9,13	\$ 10,56
Asia Strategic Interest Bond Fund			
Nettovermögen	\$ 177.208	\$ 313.987	\$ 361.011
Institutional: thesaurierend	\$ 64	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	6	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,26	k. A.	k. A.
Erträge	\$ 34.211	\$ 54.459	\$ 64.997
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.306	6.776	6.958
NIW je Anteil	\$ 7,94	\$ 8,04	\$ 9,34
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend	€ 10	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,13	k. A.	k. A.
Erträge	€ 10.955	€ 97.916	€ 102.975
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.445	12.495	11.068
NIW je Anteil	€ 7,58	€ 7,84	€ 9,30
Institutional GBP (Hedged): Erträge	£ 351	£ 205	£ 174
ausgegebene und umlaufende Anteile	44	26	19
NIW je Anteil	£ 7,89	£ 8,04	£ 9,41
Institutional SGD (Hedged): Erträge	SGD 15.313	SGD 3.799	SGD 5.354
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.934	467	566
NIW je Anteil	SGD 7,92	SGD 8,13	SGD 9,46
Investor: thesaurierend	\$ 265	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	26	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,25	k. A.	k. A.
Erträge	\$ 10	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,11	k. A.	k. A.
Investor EUR (Hedged): thesaurierend	€ 10	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,11	k. A.	k. A.
Erträge	€ 9	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,03	k. A.	k. A.
Class E: thesaurierend	\$ 2.472	\$ 806	\$ 12
ausgegebene und umlaufende Anteile	277	94	1
NIW je Anteil	\$ 8,93	\$ 8,62	\$ 9,69
Erträge	\$ 17.469	\$ 24.409	\$ 24.934
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.511	3.450	3.015
NIW je Anteil	\$ 6,96	\$ 7,08	\$ 8,27
Class E EUR (Hedged): thesaurierend	€ 5.955	€ 5.640	€ 5.060
ausgegebene und umlaufende Anteile	708	680	532
NIW je Anteil	€ 8,41	€ 8,29	€ 9,51

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Asia Strategic Interest Bond Fund (Forts.)			
Class E EUR (Unhedged): thesaurierend	€ 18.078	€ 21.244	€ 25.443
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.275	1.500	1.703
NIW je Anteil	€ 14,18	€ 14,17	€ 14,94
Class E HKD (Unhedged): Erträge	HKD 2.994	HKD 2.973	HKD 3.401
ausgegebene und umlaufende Anteile	377	367	362
NIW je Anteil	HKD 7,95	HKD 8,09	HKD 9,40
Class E SGD (Hedged): Erträge	SGD 3.298	SGD 300	SGD 337
ausgegebene und umlaufende Anteile	419	37	36
NIW je Anteil	SGD 7,87	SGD 8,13	SGD 9,46
M Retail HKD (Unhedged): Erträge	HKD 29.265	HKD 31.879	HKD 39.857
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.830	5.174	5.540
NIW je Anteil	HKD 6,06	HKD 6,16	HKD 7,19
Class Z: thesaurierend	\$ 65.348	\$ 93.351	\$ 109.270
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.062	10.610	11.219
NIW je Anteil	\$ 9,25	\$ 8,80	\$ 9,74
PIMCO Balanced Income and Growth Fund			
Nettovermögen	\$ 670.116	\$ 750.076	\$ 1.035.021
Institutional: thesaurierend	\$ 31.079	\$ 30.140	\$ 37.389
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.413	1.526	1.571
NIW je Anteil	\$ 22,00	\$ 19,74	\$ 23,80
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend	€ 148.956	€ 204.979	€ 352.099
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.756	11.632	16.474
NIW je Anteil	€ 19,21	€ 17,62	€ 21,37
Institutional GBP (Hedged): Erträge	£ 477	£ 3.301	£ 4.301
ausgegebene und umlaufende Anteile	45	331	345
NIW je Anteil	£ 10,60	£ 9,99	£ 12,45
Institutional RMB (Hedged): thesaurierend	CNH 7.574	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	73	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	CNH 103,47	k. A.	k. A.
Erträge	CNH 76	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	CNH 102,34	k. A.	k. A.
Institutional RMB (Unhedged): thesaurierend	CNH 76	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	CNH 103,83	k. A.	k. A.
Erträge	CNH 76	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	CNH 102,71	k. A.	k. A.
Investor: thesaurierend	\$ 11.288	\$ 10.303	\$ 10.116
ausgegebene und umlaufende Anteile	695	704	571
NIW je Anteil	\$ 16,24	\$ 14,63	\$ 17,70
Class E: thesaurierend	\$ 31.174	\$ 32.627	\$ 40.303
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.686	1.942	1.966
NIW je Anteil	\$ 18,49	\$ 16,80	\$ 20,50
Erträge	\$ 12.347	\$ 13.011	\$ 13.372
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.302	1.448	1.172
NIW je Anteil	\$ 9,48	\$ 8,98	\$ 11,41

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum			Zum		
	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021
PIMCO Balanced Income and Growth Fund (Forts.)						
Class E EUR (Hedged):						
thesaurierend	€ 230.322	€ 217.239	€ 230.733			
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.269	14.494	12.541			
NIW je Anteil	€ 16,14	€ 14,99	€ 18,40			
Erträge	€ 47.057	€ 49.389	€ 57.708			
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.608	6.071	5.551			
NIW je Anteil	€ 8,39	€ 8,14	€ 10,40			
H Institutional:						
thesaurierend	\$ 10	\$ 9	k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.			
NIW je Anteil	\$ 10,49	\$ 9,43	k. A.			
Erträge	\$ 10	\$ 9	k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.			
NIW je Anteil	\$ 9,79	\$ 9,18	k. A.			
M Retail:						
thesaurierend	\$ 10	k. A.	k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.			
NIW je Anteil	\$ 10,41	k. A.	k. A.			
Erträge	\$ 10	k. A.	k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.			
NIW je Anteil	\$ 10,37	k. A.	k. A.			
ausschüttend II	\$ 10	k. A.	k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.			
NIW je Anteil	\$ 10,35	k. A.	k. A.			
M Retail HKD (Unhedged):						
thesaurierend	HKD 81	k. A.	k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile	8	k. A.	k. A.			
NIW je Anteil	HKD 10,40	k. A.	k. A.			
Erträge	HKD 81	k. A.	k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile	8	k. A.	k. A.			
NIW je Anteil	HKD 10,37	k. A.	k. A.			
ausschüttend II	HKD 81	k. A.	k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile	8	k. A.	k. A.			
NIW je Anteil	HKD 10,34	k. A.	k. A.			
M Retail SGD (Hedged):						
thesaurierend	SGD 1.420	k. A.	k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile	137	k. A.	k. A.			
NIW je Anteil	SGD 10,37	k. A.	k. A.			
Erträge	SGD 14	k. A.	k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.			
NIW je Anteil	SGD 10,33	k. A.	k. A.			
ausschüttend II	SGD 14	k. A.	k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.			
NIW je Anteil	SGD 10,31	k. A.	k. A.			
Class Z:						
thesaurierend	\$ 110.390	\$ 156.684	\$ 199.594			
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.669	10.644	11.355			
NIW je Anteil	\$ 16,55	\$ 14,72	\$ 17,58			
PIMCO Capital Securities Fund						
Nettovermögen	\$ 5.137.886	\$ 5.721.591	\$ 9.110.409			
Institutional:						
thesaurierend	\$ 1.271.099	\$ 1.352.729	\$ 2.296.596			
ausgegebene und umlaufende Anteile	59.553	69.143	103.846			
NIW je Anteil	\$ 21,34	\$ 19,56	\$ 22,12			
Erträge	\$ 194.714	\$ 393.584	\$ 728.260			
ausgegebene und umlaufende Anteile	19.008	39.825	62.402			
NIW je Anteil	\$ 10,24	\$ 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			
PIMCO Capital Securities Fund (Forts.)						
Institutional BRL (Hedged):						
thesaurierend	\$ 13.282	\$ 25.163	\$ 47.342			
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.272	3.040	5.855			
NIW je Anteil	\$ 10,44	\$ 8,28	\$ 8,09			
Institutional CHF (Hedged):						
thesaurierend	CHF 36.703	CHF 52.485	CHF 120.911			
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.326	3.478	6.908			
NIW je Anteil	CHF 15,78	CHF 15,09	CHF 17,50			
Institutional EUR (Hedged):						
thesaurierend	€ 1.018.876	€ 1.198.101	€ 1.868.333			
ausgegebene und umlaufende Anteile	70.150	88.171	118.946			
NIW je Anteil	€ 14,52	€ 13,59	€ 15,71			
Erträge	€ 384.027	€ 383.951	€ 481.884			
ausgegebene und umlaufende Anteile	36.374	36.928	38.373			
NIW je Anteil	€ 10,56	€ 10,40	€ 12,56			
ausschüttend II	€ 5.467	€ 31.417	€ 41.671			
ausgegebene und umlaufende Anteile	687	3.979	4.334			
NIW je Anteil	€ 7,96	€ 7,89	€ 9,61			
Institutional GBP (Hedged):						
thesaurierend	£ 47.691	£ 35.494	£ 43.301			
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.119	2.518	2.696			
NIW je Anteil	£ 15,29	£ 14,10	£ 16,06			
Erträge	£ 64.345	£ 67.663	£ 106.976			
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.682	6.132	8.135			
NIW je Anteil	£ 11,32	£ 11,03	£ 13,15			
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 2.530	SGD 178	SGD 39			
ausgegebene und umlaufende Anteile	295	21	4			
NIW je Anteil	SGD 8,56	SGD 8,38	SGD 9,91			
Investor:						
thesaurierend	\$ 190.106	\$ 215.127	\$ 345.234			
ausgegebene und umlaufende Anteile	13.146	16.173	22.879			
NIW je Anteil	\$ 14,46	\$ 13,30	\$ 15,09			
Erträge	\$ 50.228	\$ 72.649	\$ 245.968			
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.925	7.387	21.180			
NIW je Anteil	\$ 10,20	\$ 9,84	\$ 11,61			
Investor AUD (Hedged):						
Erträge	AUD 14.433	AUD 12.971	AUD 26.915			
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.568	1.437	2.496			
NIW je Anteil	AUD 9,21	AUD 9,03	AUD 10,79			
Investor CAD (Hedged):						
Erträge	CAD 4.254	CAD 4.043	CAD 4.771			
ausgegebene und umlaufende Anteile	442	432	431			
NIW je Anteil	CAD 9,63	CAD 9,35	CAD 11,08			
Investor EUR (Hedged):						
thesaurierend	€ 23.439	€ 23.367	€ 49.337			
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.863	1.978	3.601			
NIW je Anteil	€ 12,58	€ 11,81	€ 13,70			

		Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
PIMCO Capital Securities Fund (Forts.)				
Investor GBP (Hedged):				
Erträge	£	2.992	£ 2.695	£ 3.470
ausgegebene und umlaufende Anteile		343	319	344
NIW je Anteil	£	8,72	£ 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	3.958	SGD 5.849	SGD 5.321
ausgegebene und umlaufende Anteile		417	630	484
NIW je Anteil	SGD	9,49	SGD 9,29	SGD 10,99
Administrative:				
thesaurierend	\$	140.565	\$ 141.400	\$ 149.168
ausgegebene und umlaufende Anteile		6.959	7.599	7.057
NIW je Anteil	\$	20,20	\$ 18,61	\$ 21,14
Erträge	\$	75.290	\$ 98.383	\$ 140.861
ausgegebene und umlaufende Anteile		5.466	7.402	8.978
NIW je Anteil	\$	13,77	\$ 13,29	\$ 15,69
ausschüttend II	\$	11	10	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		1	1	k. A.
NIW je Anteil	\$	9,82	\$ 9,60	k. A.
Administrative EUR (Hedged):				
thesaurierend	€	11.090	€ 13.449	€ 18.966
ausgegebene und umlaufende Anteile		654	843	1.024
NIW je Anteil	€	16,96	€ 15,95	€ 18,53
Administrative SGD (Hedged):				
ausschüttend II	SGD	15	SGD 14	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		1	1	k. A.
NIW je Anteil	SGD	9,67	SGD 9,59	k. A.
Class E:				
thesaurierend	\$	305.773	\$ 352.622	\$ 452.418
ausgegebene und umlaufende Anteile		20.690	25.798	29.018
NIW je Anteil	\$	14,78	\$ 13,67	\$ 15,59
Erträge	\$	60.223	\$ 64.556	\$ 99.264
ausgegebene und umlaufende Anteile		5.900	6.556	8.539
NIW je Anteil	\$	10,21	\$ 9,85	\$ 11,62
Class E CHF (Hedged):				
thesaurierend	CHF	5.686	CHF 8.252	CHF 11.446
ausgegebene und umlaufende Anteile		527	793	940
NIW je Anteil	CHF	10,78	CHF 10,41	CHF 12,18
Class E EUR (Hedged):				
thesaurierend	€	414.817	€ 402.295	€ 497.935
ausgegebene und umlaufende Anteile		33.239	34.146	36.232
NIW je Anteil	€	12,48	€ 11,78	€ 13,74
Erträge	€	63.510	€ 62.789	€ 73.090
ausgegebene und umlaufende Anteile		7.303	7.332	7.069
NIW je Anteil	€	8,70	€ 8,56	€ 10,34
M Retail:				
ausschüttend II	\$	205.669	\$ 218.883	\$ 306.306
ausgegebene und umlaufende Anteile		22.969	24.922	29.067
NIW je Anteil	\$	8,95	\$ 8,78	\$ 10,54
M Retail HKD (Unhedged):				
Erträge	HKD	2.466	HKD 2.801	HKD 24.499
ausgegebene und umlaufende Anteile		253	298	2.211
NIW je Anteil	HKD	9,76	HKD 9,40	HKD 11,08
M Retail SGD (Hedged):				
ausschüttend II	SGD	99.440	SGD 100.715	SGD 145.278
ausgegebene und umlaufende Anteile		11.442	11.653	13.981
NIW je Anteil	SGD	8,69	SGD 8,64	SGD 10,39

		Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
PIMCO Capital Securities Fund (Forts.)				
Class R:				
Erträge	\$	5.033	\$ 4.980	\$ 6.177
ausgegebene und umlaufende Anteile		489	501	526
NIW je Anteil	\$	10,30	\$ 9,94	\$ 11,73
Class R EUR (Hedged):				
Erträge	€	2.214	€ 3.708	€ 12.422
ausgegebene und umlaufende Anteile		262	445	1.233
NIW je Anteil	€	8,47	€ 8,33	€ 10,07
Class R GBP (Hedged):				
Erträge	£	2.544	£ 2.795	£ 5.957
ausgegebene und umlaufende Anteile		279	315	564
NIW je Anteil	£	9,13	£ 8,86	£ 10,56
Class T:				
Erträge	\$	8.281	\$ 8.517	\$ 11.570
ausgegebene und umlaufende Anteile		787	839	966
NIW je Anteil	\$	10,52	\$ 10,15	\$ 11,98
Class T EUR (Hedged):				
thesaurierend	€	63.046	€ 65.092	€ 84.896
ausgegebene und umlaufende Anteile		5.606	6.106	6.800
NIW je Anteil	€	11,25	€ 10,66	€ 12,48
Class Z:				
Erträge	\$	73.778	\$ 78.203	\$ 124.585
ausgegebene und umlaufende Anteile		6.554	7.202	9.705
NIW je Anteil	\$	11,26	\$ 10,86	\$ 12,84
Class Z AUD (Hedged):				
Erträge	AUD	81.358	AUD 104.790	AUD 127.724
ausgegebene und umlaufende Anteile		8.377	11.002	11.223
NIW je Anteil	AUD	9,71	AUD 9,52	AUD 11,38
PIMCO Climate Bond Fund				
Nettovermögen	\$	262.316	\$ 292.655	\$ 328.081
Institutional:				
thesaurierend	\$	26.436	\$ 27.502	\$ 21.317
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.759	3.116	2.108
NIW je Anteil	\$	9,58	\$ 8,83	\$ 10,11
Institutional AUD (Hedged):				
Erträge	AUD	2.219	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		216	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	AUD	10,28	k. A.	k. A.
Institutional CHF (Hedged):				
thesaurierend	CHF	819	CHF 940	CHF 1.103
ausgegebene und umlaufende Anteile		94	112	111
NIW je Anteil	CHF	8,76	CHF 8,42	CHF 9,91
Institutional EUR (Hedged):				
thesaurierend	€	40.309	€ 62.757	€ 80.658
ausgegebene und umlaufende Anteile		4.440	7.351	8.066
NIW je Anteil	€	9,08	€ 8,54	€ 10,00
Erträge	€	75.831	€ 73.780	€ 101.819
ausgegebene und umlaufende Anteile		8.881	8.951	10.361
NIW je Anteil	€	8,54	€ 8,24	€ 9,83
Institutional GBP (Hedged):				
thesaurierend	£	28.218	£ 32.441	£ 28.217
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.004	3.720	2.799
NIW je Anteil	£	9,39	£ 8,72	£ 10,08
Erträge	£	35.033	£ 25.204	£ 715
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.955	2.978	72
NIW je Anteil	£	8,86	£ 8,46	£ 9,97
Institutional SEK (Hedged):				
thesaurierend	SEK	18.846	SEK 290.215	SEK 292.047
ausgegebene und umlaufende Anteile		208	3.406	2.939
NIW je Anteil	SEK	90,57	SEK 85,22	SEK 99,36

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021		Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
PIMCO Climate Bond Fund (Forts.)				Commodity Real Return Fund (Forts.)			
Institutional SGD (Hedged): thesaurierend	SGD 5.652	SGD 5.576	SGD 5.453	Class E: thesaurierend	\$ 162.379	\$ 260.353	\$ 256.747
ausgegebene und umlaufende Anteile	602	635	541	ausgegebene und umlaufende Anteile	23.016	33.734	36.552
NIW je Anteil	SGD 9,39	SGD 8,78	SGD 10,08	NIW je Anteil	\$ 7,06	\$ 7,72	\$ 7,02
Investor: thesaurierend	k. A.	k. A.	\$ 3.214	Class E EUR (Hedged): thesaurierend	€ 111.508	€ 238.920	€ 234.570
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	321	ausgegebene und umlaufende Anteile	17.383	33.254	35.127
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	\$ 10,00	NIW je Anteil	€ 6,41	€ 7,18	€ 6,68
thesaurierend	\$ 11	k. A.	k. A.	Class E SGD (Hedged): thesaurierend	SGD 1.207	SGD 2.069	SGD 352
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.	ausgegebene und umlaufende Anteile	119	183	34
NIW je Anteil	\$ 10,72	k. A.	k. A.	NIW je Anteil	SGD 10,18	SGD 11,30	SGD 10,32
Investor EUR (Hedged): thesaurierend	k. A.	k. A.	€ 8	H Institutional: thesaurierend	\$ 6.125	\$ 3.614	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	1	ausgegebene und umlaufende Anteile	786	427	k. A.
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	€ 9,92	NIW je Anteil	\$ 7,79	\$ 8,46	k. A.
Administrative SEK (Hedged): thesaurierend	SEK 77	SEK 73	SEK 86	PIMCO Credit Opportunities Bond Fund			
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	1	Nettovermögen	\$ 100.063	\$ 97.153	\$ 139.704
NIW je Anteil	SEK 89,71	SEK 84,84	SEK 99,39	Institutional: thesaurierend	\$ 48.421	\$ 44.986	\$ 47.099
Class E EUR (Hedged): thesaurierend	€ 16.552	€ 15.976	€ 16.979	ausgegebene und umlaufende Anteile	3.281	3.318	3.345
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.877	1.909	1.718	NIW je Anteil	\$ 14,76	\$ 13,56	\$ 14,07
NIW je Anteil	€ 8,82	€ 8,37	€ 9,88	Institutional CHF (Hedged): thesaurierend	CHF 11.825	CHF 15.367	CHF 22.488
Class Z: thesaurierend	\$ 10	\$ 9	\$ 10	ausgegebene und umlaufende Anteile	1.105	1.500	2.060
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	1	NIW je Anteil	CHF 10,71	CHF 10,24	CHF 10,92
NIW je Anteil	\$ 9,75	\$ 8,93	\$ 10,18	Institutional EUR (Hedged): thesaurierend	€ 15.758	€ 15.443	€ 39.139
Commodity Real Return Fund				ausgegebene und umlaufende Anteile	1.256	1.312	3.136
Nettovermögen	\$ 858.902	\$ 1.369.877	\$ 1.444.182	NIW je Anteil	€ 12,54	€ 11,77	€ 12,48
Institutional: thesaurierend	\$ 311.581	\$ 397.781	\$ 587.333	Class E: thesaurierend	\$ 8.932	\$ 8.985	\$ 9.740
ausgegebene und umlaufende Anteile	35.010	41.220	67.481	ausgegebene und umlaufende Anteile	740	803	831
NIW je Anteil	\$ 8,90	\$ 9,65	\$ 8,70	NIW je Anteil	\$ 12,08	\$ 11,20	\$ 11,73
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend	€ 112.842	€ 225.302	€ 144.220	Class E EUR (Hedged): thesaurierend	€ 10.187	€ 9.455	€ 12.026
ausgegebene und umlaufende Anteile	13.338	23.996	16.678	ausgegebene und umlaufende Anteile	990	971	1.154
NIW je Anteil	€ 8,46	€ 9,39	€ 8,65	NIW je Anteil	€ 10,29	€ 9,74	€ 10,42
Institutional EUR (Unhedged): thesaurierend	€ 55.160	€ 87.086	€ 48.990	Diversified Income Fund			
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.639	6.527	4.337	Nettovermögen	\$ 7.439.798	\$ 8.751.796	\$ 16.447.733
NIW je Anteil	€ 11,89	€ 13,34	€ 11,29	Institutional: thesaurierend	\$ 624.037	\$ 824.847	\$ 1.243.637
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend	£ 18.532	£ 39.019	£ 36.172	ausgegebene und umlaufende Anteile	24.230	35.047	44.236
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.537	2.963	3.012	NIW je Anteil	\$ 25,76	\$ 23,54	\$ 28,11
NIW je Anteil	£ 12,06	£ 13,17	£ 12,01	Erträge	\$ 297.569	\$ 352.231	\$ 692.397
Institutional GBP (Unhedged): Erträge	£ 18.467	£ 17.587	k. A.	ausgegebene und umlaufende Anteile	22.611	27.897	44.132
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.340	1.881	k. A.	NIW je Anteil	\$ 13,16	\$ 12,63	\$ 15,69
NIW je Anteil	£ 7,89	£ 9,35	k. A.	Institutional CAD (Hedged): thesaurierend	CAD 465.402	CAD 441.412	CAD 571.190
Investor: thesaurierend	\$ 21.974	\$ 50.111	\$ 64.377	ausgegebene und umlaufende Anteile	43.934	45.218	48.824
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.873	6.022	8.546	NIW je Anteil	CAD 10,59	CAD 9,76	CAD 11,70
NIW je Anteil	\$ 7,65	\$ 8,32	\$ 7,53				

	Diversified Income Fund (Forts.)			Diversified Income Fund (Forts.)		
	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Institutional CHF (Hedged):						
thesaurierend	CHF 13.431	CHF 15.646	CHF 20.277			
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.065	1.299	1.371			
NIW je Anteil	CHF 12,61	CHF 12,04	CHF 14,79			
Erträge	CHF 5.215	CHF 8.022	CHF 13.028			
ausgegebene und umlaufende Anteile	724	1.111	1.412			
NIW je Anteil	CHF 7,20	CHF 7,22	CHF 9,23			
Institutional EUR (Hedged):						
thesaurierend	€ 889.868	€ 998.452	€ 1.703.682			
ausgegebene und umlaufende Anteile	54.327	65.216	90.940			
NIW je Anteil	€ 16,38	€ 15,31	€ 18,73			
Erträge	€ 201.004	€ 330.342	€ 852.032			
ausgegebene und umlaufende Anteile	25.470	42.647	86.306			
NIW je Anteil	€ 7,89	€ 7,75	€ 9,87			
Institutional GBP (Hedged):						
thesaurierend	£ 519.724	£ 572.158	£ 1.248.141			
ausgegebene und umlaufende Anteile	37.644	44.993	81.268			
NIW je Anteil	£ 13,81	£ 12,72	£ 15,36			
Erträge	£ 267.079	£ 391.080	£ 601.893			
ausgegebene und umlaufende Anteile	44.733	67.375	81.620			
NIW je Anteil	£ 5,97	£ 5,80	£ 7,37			
Institutional MXN (Hedged):						
thesaurierend	MXN 407.573	MXN 270.310	MXN 299.232			
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.696	2.863	2.831			
NIW je Anteil	MXN 110,27	MXN 94,40	MXN 105,70			
Institutional SEK (Hedged):						
thesaurierend	SEK 180.061	SEK 168.340	SEK 205.009			
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.058	1.058	1.057			
NIW je Anteil	SEK 170,25	SEK 159,10	SEK 193,88			
Institutional SGD (Hedged):						
Erträge	SGD 8.210	SGD 43.716	SGD 79.938			
ausgegebene und umlaufende Anteile	982	5.366	7.873			
NIW je Anteil	SGD 8,36	SGD 8,15	SGD 10,15			
Investor:						
thesaurierend	\$ 37.372	\$ 53.597	\$ 83.045			
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.872	4.492	5.806			
NIW je Anteil	\$ 13,01	\$ 11,93	\$ 14,30			
Erträge	\$ 97.875	\$ 89.559	\$ 69.026			
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.003	10.495	6.522			
NIW je Anteil	\$ 8,89	\$ 8,53	\$ 10,58			
Investor EUR (Hedged):						
thesaurierend	€ 18.112	€ 21.418	€ 34.903			
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.171	1.477	1.960			
NIW je Anteil	€ 15,46	€ 14,50	€ 17,81			
Erträge	€ 9.072	€ 10.066	€ 11.743			
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.216	1.375	1.260			
NIW je Anteil	€ 7,46	€ 7,32	€ 9,32			
Administrative:						
Erträge	\$ 70.001	\$ 87.885	\$ 143.334			
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.208	9.431	12.385			
NIW je Anteil	\$ 9,71	\$ 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	€ 3.265	€ 4.330	€ 10.014			
ausgegebene und umlaufende Anteile	217	306	575			
NIW je Anteil	€ 15,08	€ 14,16	€ 17,42			
Administrative GBP (Hedged):						
Erträge	£ 7.739	£ 8.358	£ 12.610			
ausgegebene und umlaufende Anteile	870	972	1.168			
NIW je Anteil	£ 8,89	£ 8,60	£ 10,80			
Administrative JPY (Hedged):						
thesaurierend	¥ 367.541	¥ 354.957	¥ 47.222			
ausgegebene und umlaufende Anteile	441	438	47			
NIW je Anteil	¥ 833,00	¥ 811,00	¥ 1.002,00			
Administrative SEK (Hedged):						
thesaurierend	SEK 73	SEK 78	SEK 84			
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	1			
NIW je Anteil	SEK 86,00	SEK 80,78	SEK 98,94			
Administrative SGD (Hedged):						
Erträge	SGD 63.405	SGD 55.693	SGD 101.850			
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.369	6.640	9.757			
NIW je Anteil	SGD 8,60	SGD 8,39	SGD 10,44			
BM Retail:						
Decumulation	\$ 10	k. A.	k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.			
NIW je Anteil	\$ 9,95	k. A.	k. A.			
ausschüttend II	\$ 33.787	\$ 9	k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.628	1	k. A.			
NIW je Anteil	\$ 9,31	\$ 9,17	k. A.			
BN Retail:						
ausschüttend II	k. A.	\$ 9	k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	1	k. A.			
NIW je Anteil	k. A.	\$ 9,17	k. A.			
Class E:						
thesaurierend	\$ 577.044	\$ 655.637	\$ 1.113.069			
ausgegebene und umlaufende Anteile	26.246	32.342	45.554			
NIW je Anteil	\$ 21,99	\$ 20,27	\$ 24,43			
Erträge	\$ 300.411	\$ 372.507	\$ 630.798			
ausgegebene und umlaufende Anteile	25.563	33.038	45.041			
NIW je Anteil	\$ 11,75	\$ 11,28	\$ 14,01			
Class E CHF (Hedged):						
thesaurierend	CHF 5.734	CHF 7.655	CHF 9.701			
ausgegebene und umlaufende Anteile	663	918	939			
NIW je Anteil	CHF 8,65	CHF 8,34	CHF 10,33			
Class E EUR (Hedged):						
thesaurierend	€ 949.425	€ 1.292.425	€ 1.880.735			
ausgegebene und umlaufende Anteile	66.761	96.369	113.579			
NIW je Anteil	€ 14,22	€ 13,41	€ 16,56			
Erträge	€ 618.912	€ 781.155	€ 1.366.978			
ausgegebene und umlaufende Anteile	68.720	88.377	121.500			
NIW je Anteil	€ 9,01	€ 8,84	€ 11,25			
Class E SGD (Hedged):						
Erträge	SGD 17.307	SGD 22.377	SGD 47.272			
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.078	2.757	4.674			
NIW je Anteil	SGD 8,33	SGD 8,12	SGD 10,11			
H Institutional:						
thesaurierend	\$ 456.350	\$ 385.630	\$ 1.501.526			
ausgegebene und umlaufende Anteile	23.526	21.717	70.674			
NIW je Anteil	\$ 19,40	\$ 17,76	\$ 21,25			
Erträge	\$ 197	\$ 118	\$ 26			
ausgegebene und umlaufende Anteile	22	14	2			
NIW je Anteil	\$ 8,98	\$ 8,61	\$ 10,70			

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Diversified Income Fund (Forts.)			
M Retail:			
Decumulation	\$ 10	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 9,95	k. A.	k. A.
Erträge	\$ 129.257	\$ 150.260	\$ 246.412
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.858	15.573	20.577
NIW je Anteil	\$ 10,05	\$ 9,65	\$ 11,98
ausschüttend II	\$ 164.458	\$ 183.635	\$ 311.977
ausgegebene und umlaufende Anteile	20.705	23.717	31.930
NIW je Anteil	\$ 7,94	\$ 7,74	\$ 9,77
M Retail AUD (Hedged):			
Erträge	AUD 43.631	AUD 49.591	AUD 83.307
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.793	5.574	7.442
NIW je Anteil	AUD 9,10	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	\$ 9,34	\$ 8,61	\$ 10,38
Class T:			
thesaurierend	\$ 24.098	\$ 25.356	\$ 40.854
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.039	2.318	3.086
NIW je Anteil	\$ 11,82	\$ 10,94	\$ 13,24
Erträge	\$ 6.268	\$ 6.829	\$ 9.630
ausgegebene und umlaufende Anteile	679	771	876
NIW je Anteil	\$ 9,23	\$ 8,85	\$ 11,00
Class T EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 36.498	€ 36.445	€ 53.705
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.682	3.883	4.616
NIW je Anteil	€ 9,91	€ 9,38	€ 11,63
Erträge	€ 18.999	€ 19.507	€ 28.295
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.463	2.576	2.937
NIW je Anteil	€ 7,71	€ 7,57	€ 9,63
W Class:			
thesaurierend	\$ 29.812	\$ 64.400	\$ 120.525
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.117	7.380	11.579
NIW je Anteil	\$ 9,56	\$ 8,73	\$ 10,41
Erträge	\$ 11.290	\$ 45.458	\$ 137.527
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.352	5.672	13.806
NIW je Anteil	\$ 8,35	\$ 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 1.522	CHF 10.994	CHF 13.719
ausgegebene und umlaufende Anteile	174	1.317	1.339
NIW je Anteil	CHF 8,76	CHF 8,35	CHF 10,24
Erträge	CHF 428	CHF 699	CHF 1.588
ausgegebene und umlaufende Anteile	56	91	162
NIW je Anteil	CHF 7,65	CHF 7,67	CHF 9,80
W Class EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 4.968	€ 11.937	€ 15.286
ausgegebene und umlaufende Anteile	552	1.420	1.488
NIW je Anteil	€ 9,01	€ 8,40	€ 10,27
Erträge	€ 1.078	€ 3.382	€ 6.737
ausgegebene und umlaufende Anteile	137	438	685
NIW je Anteil	€ 7,87	€ 7,72	€ 9,83

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Diversified Income Fund (Forts.)			
W Class GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 281	£ 2.089	£ 2.371
ausgegebene und umlaufende Anteile	30	243	229
NIW je Anteil	£ 9,34	£ 8,59	£ 10,36
Erträge	£ 334	£ 2.895	£ 3.547
ausgegebene und umlaufende Anteile	41	367	358
NIW je Anteil	£ 8,16	£ 7,89	£ 9,92
W Class SGD (Hedged):			
Erträge	SGD 1.574	SGD 3.079	SGD 4.762
ausgegebene und umlaufende Anteile	192	385	477
NIW je Anteil	SGD 8,21	SGD 8,00	SGD 9,97
Diversified Income Duration Hedged Fund			
Nettovermögen	\$ 412.839	\$ 564.684	\$ 1.305.365
Institutional:			
thesaurierend	\$ 18.800	\$ 23.243	\$ 64.311
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.197	1.617	4.288
NIW je Anteil	\$ 15,70	\$ 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	€ 13.663	€ 87.225	€ 165.664
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.004	6.863	12.228
NIW je Anteil	€ 13,61	€ 12,71	€ 13,55
ausschüttend II	€ 9.164	€ 9.995	€ 40.816
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.266	1.372	5.012
NIW je Anteil	€ 7,24	€ 7,29	€ 8,14
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 153.980	£ 182.935	£ 312.905
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.174	13.134	21.396
NIW je Anteil	£ 15,14	£ 13,93	£ 14,62
Erträge	£ 41.868	£ 63.760	£ 176.678
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.208	7.894	19.855
NIW je Anteil	£ 8,04	£ 8,08	£ 8,90
Investor:			
thesaurierend	\$ 5.078	\$ 5.125	\$ 11.010
ausgegebene und umlaufende Anteile	389	428	878
NIW je Anteil	\$ 13,04	\$ 11,98	\$ 12,54
Class E:			
thesaurierend	\$ 18.689	\$ 24.033	\$ 46.891
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.475	2.054	3.805
NIW je Anteil	\$ 12,67	\$ 11,70	\$ 12,32
Erträge	\$ 30.961	\$ 33.306	\$ 38.488
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.261	3.579	3.808
NIW je Anteil	\$ 9,49	\$ 9,30	\$ 10,11
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 40.505	€ 54.593	€ 184.920
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.284	4.696	14.788
NIW je Anteil	€ 12,34	€ 11,63	€ 12,50
Erträge	€ 17.818	€ 18.931	€ 29.006
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.363	2.511	3.466
NIW je Anteil	€ 7,54	€ 7,54	€ 8,37
Diversified Income ESG Fund			
Nettovermögen	\$ 57.563	\$ 9.854	
Institutional:			
thesaurierend	\$ 10.289	\$ 9.367	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	947	947	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,87	\$ 9,89	k. A.

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	
Diversified Income ESG Fund (Forts.)				
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend	€ 42.539	€ 226	k. A.	
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.056	23	k. A.	
NIW je Anteil	€ 10,49	€ 9,76	k. A.	
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend	£ 205	£ 188	k. A.	
ausgegebene und umlaufende Anteile	19	19	k. A.	
NIW je Anteil	£ 10,71	£ 9,83	k. A.	
Class E: thesaurierend	\$ 11	\$ 10	k. A.	
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.	
NIW je Anteil	\$ 10,73	\$ 9,85	k. A.	
Class E EUR (Hedged): thesaurierend	€ 10	€ 9	k. A.	
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.	
NIW je Anteil	€ 10,36	€ 9,73	k. A.	
Dynamic Bond Fund				
Nettovermögen	\$ 3.445.573	\$ 3.483.601	\$ 3.277.997	
Institutional: thesaurierend	\$ 339.706	\$ 470.460	\$ 626.628	
ausgegebene und umlaufende Anteile	23.366	34.671	42.473	
NIW je Anteil	\$ 14,54	\$ 13,57	\$ 14,75	
Erträge	\$ 84.564	\$ 81.771	\$ 100.397	
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.063	8.057	8.882	
NIW je Anteil	\$ 10,49	\$ 10,15	\$ 11,30	
Institutional CAD (Hedged): thesaurierend	CAD 10.727	CAD 11.952	CAD 15.351	
ausgegebene und umlaufende Anteile	999	1.186	1.398	
NIW je Anteil	CAD 10,73	CAD 10,08	CAD 10,98	
Institutional CHF (Hedged): thesaurierend	CHF 2.845	CHF 70.173	CHF 87.168	
ausgegebene und umlaufende Anteile	279	7.073	7.873	
NIW je Anteil	CHF 10,20	CHF 9,92	CHF 11,07	
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend	€ 92.451	€ 187.622	€ 348.406	
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.438	15.837	26.481	
NIW je Anteil	€ 12,43	€ 11,85	€ 13,16	
Erträge	€ 5.783	€ 11.318	€ 12.768	
ausgegebene und umlaufende Anteile	648	1.283	1.272	
NIW je Anteil	€ 8,93	€ 8,82	€ 10,04	
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend	£ 1.929.593	£ 1.840.373	£ 887.562	
ausgegebene und umlaufende Anteile	150.264	152.611	67.216	
NIW je Anteil	£ 12,84	£ 12,06	£ 13,20	
Erträge	£ 95.339	£ 94.155	£ 253.262	
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.814	10.906	26.086	
NIW je Anteil	£ 8,82	£ 8,63	£ 9,71	
Institutional NOK (Hedged): thesaurierend	NOK 3.465	NOK 4.066	NOK 131.604	
ausgegebene und umlaufende Anteile	273	337	9.965	
NIW je Anteil	NOK 12,72	NOK 12,07	NOK 13,21	

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	
Dynamic Bond Fund (Forts.)				
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	\$ 44.681	\$ 46.677	\$ 56.790	
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.648	4.069	4.537	
NIW je Anteil	\$ 12,25	\$ 11,47	\$ 12,52	
Erträge	\$ 1.272	\$ 2.830	\$ 3.932	
ausgegebene und umlaufende Anteile	136	312	389	
NIW je Anteil	\$ 9,38	\$ 9,08	\$ 10,11	
Investor EUR (Hedged): thesaurierend	€ 2.053	€ 2.013	€ 5.744	
ausgegebene und umlaufende Anteile	195	200	512	
NIW je Anteil	€ 10,54	€ 10,08	€ 11,23	
Administrative: thesaurierend	\$ 15.191	\$ 21.094	\$ 29.563	
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.121	1.659	2.128	
NIW je Anteil	\$ 13,56	\$ 12,72	\$ 13,90	
Administrative EUR (Hedged): thesaurierend	€ 959	€ 1.170	€ 3.659	
ausgegebene und umlaufende Anteile	83	105	295	
NIW je Anteil	€ 11,60	€ 11,11	€ 12,40	
Administrative SEK (Hedged): thesaurierend	SEK 55.239	SEK 61.257	SEK 81.744	
ausgegebene und umlaufende Anteile	515	597	718	
NIW je Anteil	SEK 107,23	SEK 102,58	SEK 113,88	
Class E: thesaurierend	\$ 67.914	\$ 69.989	\$ 92.812	
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.807	6.354	7.680	
NIW je Anteil	\$ 11,70	\$ 11,01	\$ 12,08	
Erträge	\$ 13.906	\$ 14.979	\$ 19.242	
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.451	1.615	1.862	
NIW je Anteil	\$ 9,59	\$ 9,28	\$ 10,33	
Class E CHF (Hedged): thesaurierend	CHF 7.671	CHF 8.868	CHF 10.761	
ausgegebene und umlaufende Anteile	850	1.000	1.078	
NIW je Anteil	CHF 9,03	CHF 8,86	CHF 9,98	
Class E EUR (Hedged): thesaurierend	€ 66.769	€ 73.068	€ 138.697	
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.094	6.936	11.750	
NIW je Anteil	€ 10,96	€ 10,54	€ 11,80	
Class E GBP (Hedged): thesaurierend	£ 1.882	£ 3.354	£ 3.820	
ausgegebene und umlaufende Anteile	169	318	328	
NIW je Anteil	£ 11,13	£ 10,55	£ 11,65	
G Retail EUR (Hedged): Erträge	€ 5.890	€ 7.061	€ 8.905	
ausgegebene und umlaufende Anteile	736	896	992	
NIW je Anteil	€ 8,00	€ 7,88	€ 8,98	
H Institutional: thesaurierend	\$ 44.168	\$ 11.541	\$ 18.571	
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.058	1.135	1.677	
NIW je Anteil	\$ 10,88	\$ 10,17	\$ 11,08	
Erträge	k. A.	\$ 10	\$ 11	
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	1	1	
NIW je Anteil	k. A.	\$ 9,12	\$ 10,16	
Class R: thesaurierend	\$ 4.839	\$ 6.385	\$ 7.736	
ausgegebene und umlaufende Anteile	408	577	642	
NIW je Anteil	\$ 11,85	\$ 11,07	\$ 12,05	

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Dynamic Bond Fund (Forts.)			
Class Z:			
thesaurierend	\$ 15.699	\$ 6.683	\$ 9.940
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.576	725	1.001
NIW je Anteil	\$ 9,96	\$ 9,22	\$ 9,93
Class Z AUD (Hedged):			
Erträge	AUD 16.551	AUD 27.023	AUD 36.313
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.767	2.938	3.513
NIW je Anteil	AUD 9,36	AUD 9,20	AUD 10,34
Dynamic Multi-Asset Fund			
Nettovermögen	€ 3.262.045	€ 5.115.170	€ 7.635.950
Institutional:			
thesaurierend	€ 1.030.988	€ 1.644.656	€ 2.765.020
ausgegebene und umlaufende Anteile	86.743	137.719	198.997
NIW je Anteil	€ 11,89	€ 11,94	€ 13,89
ausschüttend II	€ 120.582	€ 158.729	€ 238.007
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.229	14.419	18.212
NIW je Anteil	€ 10,74	€ 11,01	€ 13,07
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 2.459	CHF 3.063	CHF 5.282
ausgegebene und umlaufende Anteile	245	297	438
NIW je Anteil	CHF 10,04	CHF 10,31	CHF 12,06
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 407.097	£ 552.226	£ 576.557
ausgegebene und umlaufende Anteile	31.957	43.745	39.733
NIW je Anteil	£ 12,74	£ 12,62	£ 14,51
Erträge	£ 10.386	£ 33.675	£ 17.109
ausgegebene und umlaufende Anteile	955	3.025	1.337
NIW je Anteil	£ 10,88	£ 11,13	£ 12,79
Institutional ILS (Hedged):			
thesaurierend	ILS 16.594	ILS 4.206	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.668	423	k. A.
NIW je Anteil	ILS 9,95	ILS 9,93	k. A.
Institutional SGD (Hedged):			
thesaurierend	SGD 81.668	SGD 109.428	SGD 27.017
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.303	12.486	2.702
NIW je Anteil	SGD 8,78	SGD 8,76	SGD 10,00
Institutional USD (Hedged):			
thesaurierend	\$ 113.739	\$ 156.343	\$ 281.670
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.164	11.438	18.087
NIW je Anteil	\$ 13,93	\$ 13,67	\$ 15,57
ausschüttend II	\$ 4.415	\$ 4.450	\$ 5.074
ausgegebene und umlaufende Anteile	531	531	512
NIW je Anteil	\$ 8,31	\$ 8,38	\$ 9,92
Investor:			
thesaurierend	€ 9.375	€ 10.626	€ 11.030
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.014	1.140	1.013
NIW je Anteil	€ 9,25	€ 9,32	€ 10,89
Investor USD (Hedged):			
thesaurierend	k. A.	\$ 9	\$ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	1	1
NIW je Anteil	k. A.	\$ 8,94	\$ 10,22

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Dynamic Multi-Asset Fund (Forts.)			
BM Retail AUD (Hedged):			
ausschüttend II	AUD 161	AUD 12	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	18	1	k. A.
NIW je Anteil	AUD 8,75	AUD 9,19	k. A.
BM Retail USD (Hedged):			
ausschüttend II	\$ 604	\$ 9	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	67	1	k. A.
NIW je Anteil	\$ 8,97	\$ 9,25	k. A.
Class E:			
thesaurierend	€ 1.109.492	€ 1.913.579	€ 2.955.626
ausgegebene und umlaufende Anteile	101.172	171.934	225.981
NIW je Anteil	€ 10,97	€ 11,13	€ 13,08
Erträge	€ 3.256	€ 4.679	€ 5.627
ausgegebene und umlaufende Anteile	361	506	517
NIW je Anteil	€ 9,02	€ 9,25	€ 10,87
Class E USD (Hedged):			
thesaurierend	\$ 125.652	\$ 192.230	\$ 275.658
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.789	16.657	20.756
NIW je Anteil	\$ 11,65	\$ 11,54	\$ 13,28
Erträge	k. A.	\$ 32	\$ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	4	1
NIW je Anteil	k. A.	\$ 8,84	\$ 10,18
ausschüttend II	k. A.	\$ 9	\$ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	1	1
NIW je Anteil	k. A.	\$ 8,27	\$ 9,80
H Institutional USD (Hedged):			
thesaurierend	\$ 656	\$ 2.298	\$ 8.850
ausgegebene und umlaufende Anteile	67	240	810
NIW je Anteil	\$ 9,74	\$ 9,58	\$ 10,93
M Retail AUD (Hedged):			
ausschüttend II	AUD 325	AUD 321	AUD 563
ausgegebene und umlaufende Anteile	41	39	57
NIW je Anteil	AUD 7,85	AUD 8,17	AUD 9,87
M Retail SGD (Hedged):			
ausschüttend II	SGD 9.292	SGD 12.812	SGD 16.539
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.158	1.538	1.673
NIW je Anteil	SGD 8,02	SGD 8,33	SGD 9,89
M Retail USD (Hedged):			
ausschüttend II	\$ 45.217	\$ 65.622	\$ 120.842
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.059	7.183	11.077
NIW je Anteil	\$ 8,94	\$ 9,14	\$ 10,91
Class T:			
thesaurierend	€ 67.018	€ 83.511	€ 118.172
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.648	8.130	9.750
NIW je Anteil	€ 10,08	€ 10,27	€ 12,12
Class T USD (Hedged):			
thesaurierend	\$ 3.019	\$ 3.396	\$ 618
ausgegebene und umlaufende Anteile	353	399	63
NIW je Anteil	\$ 8,56	\$ 8,51	\$ 9,83
Class Z:			
thesaurierend	€ 104.488	€ 151.534	€ 192.397
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.677	14.087	15.504
NIW je Anteil	€ 10,80	€ 10,76	€ 12,41

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Emerging Local Bond Fund			
Nettovermögen	\$ 2.880.941	\$ 1.919.668	\$ 2.151.129
Institutional:			
thesaurierend	\$ 1.787.853	\$ 1.295.760	\$ 1.416.960
ausgegebene und umlaufende Anteile	122.115	102.499	104.910
NIW je Anteil	\$ 14,64	\$ 12,64	\$ 13,51
Erträge	\$ 86.891	\$ 67.645	\$ 77.715
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.960	11.061	11.365
NIW je Anteil	\$ 6,70	\$ 6,12	\$ 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	€ 409.418	€ 172.199	€ 250.076
ausgegebene und umlaufende Anteile	28.009	13.181	19.088
NIW je Anteil	€ 14,62	€ 13,06	€ 13,10
Erträge	€ 160.464	€ 133.001	€ 123.817
ausgegebene und umlaufende Anteile	22.947	20.143	17.869
NIW je Anteil	€ 6,99	€ 6,60	€ 6,93
Institutional GBP (Unhedged):			
thesaurierend	£ 6.345	£ 3.791	£ 2.364
ausgegebene und umlaufende Anteile	280	183	120
NIW je Anteil	£ 22,69	£ 20,76	£ 19,70
Investor:			
thesaurierend	\$ 8.219	\$ 19.075	\$ 38.617
ausgegebene und umlaufende Anteile	747	2.001	3.779
NIW je Anteil	\$ 11,00	\$ 9,53	\$ 10,22
Investor EUR (Unhedged):			
thesaurierend	€ 664	€ 698	€ 3.081
ausgegebene und umlaufende Anteile	64	75	330
NIW je Anteil	€ 10,34	€ 9,28	€ 9,33
Class E:			
thesaurierend	\$ 41.451	\$ 35.736	\$ 39.398
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.286	3.249	3.319
NIW je Anteil	\$ 12,61	\$ 11,00	\$ 11,87
Erträge	\$ 15.039	\$ 12.985	\$ 15.964
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.395	2.266	2.492
NIW je Anteil	\$ 6,28	\$ 5,73	\$ 6,41
Class E EUR (Unhedged):			
thesaurierend	€ 76.314	€ 65.014	€ 77.057
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.853	4.579	5.359
NIW je Anteil	€ 15,73	€ 14,20	€ 14,38
Erträge	€ 1.590	€ 1.510	€ 1.782
ausgegebene und umlaufende Anteile	167	168	189
NIW je Anteil	€ 9,50	€ 8,97	€ 9,41
H Institutional:			
thesaurierend	\$ 189.970	\$ 48.210	\$ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	18.463	5.416	1
NIW je Anteil	\$ 10,29	\$ 8,90	\$ 9,52
Class Z:			
Erträge	\$ 27.121	\$ 38.228	\$ 40.482
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.377	5.218	4.941
NIW je Anteil	\$ 8,03	\$ 7,33	\$ 8,19

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Emerging Local Bond ESG Fund			
Nettovermögen	\$ 102.408	\$ 6.609	
Institutional:			
thesaurierend	\$ 5.975	\$ 5.169	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	489	489	k. A.
NIW je Anteil	\$ 12,22	\$ 10,57	k. A.
Erträge	\$ 12	\$ 11	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	\$ 11,26	\$ 10,34	k. A.

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Emerging Markets Bond ESG Fund (Forts.)			
Institutional EUR (Unhedged):			
thesaurierend	€ 85.778	€ 9	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.664	1	k. A.
NIW je Anteil	€ 11,19	€ 10,02	k. A.
Erträge	€ 10	€ 9	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,31	€ 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	£ 10,13	k. A.	k. A.
Investor:			
thesaurierend	\$ 12	\$ 11	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	\$ 12,16	\$ 10,56	k. A.
Erträge	\$ 12	\$ 11	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	\$ 11,26	\$ 10,34	k. A.
Investor EUR (Unhedged):			
thesaurierend	€ 10	€ 9	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	€ 11,14	€ 10,01	k. A.
Erträge	€ 10	€ 9	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,31	€ 9,81	k. A.
Class E:			
thesaurierend	\$ 12	\$ 11	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	\$ 12,05	\$ 10,53	k. A.
Erträge	\$ 12	\$ 11	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	\$ 11,25	\$ 10,34	k. A.
Class E EUR (Unhedged):			
thesaurierend	€ 10	€ 9	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	€ 11,03	€ 9,98	k. A.
Erträge	€ 10	€ 9	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,31	€ 9,80	k. A.
Class Z:			
thesaurierend	\$ 1.550	\$ 1.329	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	123	123	k. A.
NIW je Anteil	\$ 12,57	\$ 10,77	k. A.

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Emerging Markets Bond Fund			
Nettovermögen	\$ 3.846.285	\$ 3.305.979	\$ 4.714.744
Institutional:			
thesaurierend	\$ 1.269.939	\$ 1.097.175	\$ 1.578.727
ausgegebene und umlaufende Anteile	25.159	24.303	28.997
NIW je Anteil	\$ 50,48	\$ 45,15	\$ 54,45
Erträge	\$ 91.725	\$ 56.849	\$ 92.620
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.909	3.860	4.961
NIW je Anteil	\$ 15,52	\$ 14,73	\$ 18,67
Institutional CHF (Hedged):			
Erträge	CHF 77.520	CHF 77.505	CHF 97.681
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.347	5.390	5.215
NIW je Anteil	CHF 14,50	CHF 14,38	CHF 18,73
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 705.340	€ 694.951	€ 695.028
ausgegebene und umlaufende Anteile	18.243	19.643	15.897
NIW je Anteil	€ 38,66	€ 35,38	€ 43,72

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Emerging Markets Bond Fund (Forts.)			
Erträge	€ 438.978	€ 401.157	€ 847.991
ausgegebene und umlaufende Anteile	62.494	58.854	95.747
NIW je Anteil	€ 7,02	€ 6,82	€ 8,86
Institutional EUR (Unhedged): thesaurierend	€ 179.735	€ 135.251	€ 164.246
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.796	12.028	12.905
NIW je Anteil	€ 12,15	€ 11,24	€ 12,73
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend	£ 20.841	£ 23.424	£ 26.418
ausgegebene und umlaufende Anteile	800	997	922
NIW je Anteil	£ 26,06	£ 23,50	£ 28,67
Erträge	£ 26.761	£ 28.487	£ 41.458
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.338	8.167	9.258
NIW je Anteil	£ 3,65	£ 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 24.108	SGD 31.394	SGD 32.296
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.217	3.178	2.703
NIW je Anteil	SGD 10,87	SGD 9,88	SGD 11,95
Investor: thesaurierend	\$ 4.491	\$ 3.988	\$ 7.210
ausgegebene und umlaufende Anteile	96	95	142
NIW je Anteil	\$ 46,80	\$ 42,01	\$ 50,84
Investor EUR (Hedged): thesaurierend	€ 3.537	€ 3.248	€ 4.103
ausgegebene und umlaufende Anteile	398	398	406
NIW je Anteil	€ 8,88	€ 8,16	€ 10,11
Administrative: thesaurierend	\$ 30.109	\$ 22.981	\$ 34.503
ausgegebene und umlaufende Anteile	659	560	693
NIW je Anteil	\$ 45,68	\$ 41,06	\$ 49,77
BM Retail: Decumulation	\$ 10	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 9,94	k. A.	k. A.
ausschüttend II	\$ 862	\$ 9	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	92	1	k. A.
NIW je Anteil	\$ 9,35	\$ 9,11	k. A.
Class E: thesaurierend	\$ 135.062	\$ 114.186	\$ 165.453
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.131	2.933	3.492
NIW je Anteil	\$ 43,14	\$ 38,93	\$ 47,38
Erträge	\$ 66.773	\$ 61.547	\$ 109.051
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.136	6.932	9.691
NIW je Anteil	\$ 9,36	\$ 8,88	\$ 11,25
Class E EUR (Hedged): thesaurierend	€ 134.655	€ 125.229	€ 187.716
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.082	4.112	4.943
NIW je Anteil	€ 32,99	€ 30,46	€ 37,98
Class E SGD (Hedged): thesaurierend	SGD 9.601	SGD 10.020	SGD 11.604
ausgegebene und umlaufende Anteile	159	181	172
NIW je Anteil	SGD 60,26	SGD 55,23	SGD 67,40
H Institutional: thesaurierend	\$ 417.764	\$ 302.479	\$ 284.247
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.507	6.875	5.348
NIW je Anteil	\$ 49,11	\$ 44,00	\$ 53,15
Erträge	\$ 272	\$ 217	\$ 275
ausgegebene und umlaufende Anteile	34	29	29
NIW je Anteil	\$ 7,96	\$ 7,55	\$ 9,57

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Emerging Markets Bond Fund (Forts.)			
M Retail: Decumulation	\$ 10	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 9,94	k. A.	k. A.
Erträge	\$ 8.479	\$ 8.675	\$ 12.295
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.006	1.085	1.214
NIW je Anteil	\$ 8,43	\$ 8,00	\$ 10,13
ausschüttend II	\$ 4.243	\$ 3.190	\$ 3.720
ausgegebene und umlaufende Anteile	606	473	428
NIW je Anteil	\$ 7,00	\$ 6,75	\$ 8,68
M Retail AUD (Hedged): Erträge	AUD 5.240	AUD 1.510	AUD 7.264
ausgegebene und umlaufende Anteile	702	209	784
NIW je Anteil	AUD 7,47	AUD 7,22	AUD 9,27
Class Z: Erträge	\$ 19.360	\$ 5.279	\$ 6.317
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.876	540	509
NIW je Anteil	\$ 10,32	\$ 9,78	\$ 12,41
Emerging Markets Bond ESG Fund			
Nettovermögen	\$ 2.693.921	\$ 2.492.475	\$ 2.635.769
Institutional: thesaurierend	\$ 714.848	\$ 640.128	\$ 650.604
ausgegebene und umlaufende Anteile	45.724	45.303	37.005
NIW je Anteil	\$ 15,63	\$ 14,13	\$ 17,58
Erträge	\$ 276.510	\$ 306.128	\$ 305.572
ausgegebene und umlaufende Anteile	34.964	40.679	31.166
NIW je Anteil	\$ 7,91	\$ 7,53	\$ 9,80
Institutional CHF (Hedged): thesaurierend	CHF 257.904	CHF 53.384	CHF 50.716
ausgegebene und umlaufende Anteile	31.142	6.825	5.067
NIW je Anteil	CHF 8,28	CHF 7,82	CHF 10,01
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend	€ 915.574	€ 1.011.465	€ 999.329
ausgegebene und umlaufende Anteile	87.099	104.063	80.567
NIW je Anteil	€ 10,51	€ 9,72	€ 12,40
Erträge	€ 146.989	€ 132.184	€ 192.797
ausgegebene und umlaufende Anteile	21.564	19.921	21.737
NIW je Anteil	€ 6,82	€ 6,64	€ 8,87
Institutional GBP (Hedged): Erträge	£ 108.520	£ 162.630	£ 80.974
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.385	22.478	8.479
NIW je Anteil	£ 7,54	£ 7,24	£ 9,55
Institutional GBP (Unhedged): Erträge	£ 5.452	£ 3.960	£ 3.657
ausgegebene und umlaufende Anteile	692	499	398
NIW je Anteil	£ 7,88	£ 7,94	£ 9,19
Investor NOK (Hedged): thesaurierend	NOK 4.544	NOK 5.222	NOK 6.610
ausgegebene und umlaufende Anteile	40	50	50
NIW je Anteil	NOK 112,37	NOK 103,95	NOK 131,59

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Emerging Markets Bond ESG Fund (Forts.)			
Investor SEK (Hedged): thesaurierend	SEK 27.789	SEK 27.736	SEK 10.725
ausgegebene und umlaufende Anteile	271	292	89
NIW je Anteil	SEK 102,52	SEK 95,02	SEK 121,06
Administrative: thesaurierend	\$ 345	\$ 314	\$ 632
ausgegebene und umlaufende Anteile	37	37	59
NIW je Anteil	\$ 9,39	\$ 8,53	\$ 10,67
Erträge	\$ 755	\$ 718	\$ 992
ausgegebene und umlaufende Anteile	95	95	101
NIW je Anteil	\$ 7,91	\$ 7,53	\$ 9,81
Administrative SEK (Hedged): thesaurierend	SEK 250	SEK 105	SEK 85
ausgegebene und umlaufende Anteile	3	1	1
NIW je Anteil	SEK 83,60	SEK 77,61	SEK 99,05
Class E: thesaurierend	\$ 3.444	\$ 924	\$ 1.531
ausgegebene und umlaufende Anteile	407	120	158
NIW je Anteil	\$ 8,46	\$ 7,71	\$ 9,68
Erträge	\$ 512	\$ 676	\$ 868
ausgegebene und umlaufende Anteile	67	94	92
NIW je Anteil	\$ 7,59	\$ 7,23	\$ 9,41
Class E EUR (Hedged): thesaurierend	€ 58.741	€ 57.844	€ 129.837
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.460	6.822	11.895
NIW je Anteil	€ 9,09	€ 8,48	€ 10,92
Class Z: thesaurierend	\$ 3.909	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	353	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 11,06	k. A.	k. A.
Emerging Markets Corporate Bond Fund			
Nettovermögen	\$ 157.713	\$ 168.986	\$ 212.894
Institutional: thesaurierend	\$ 12.120	\$ 8.279	\$ 9.507
ausgegebene und umlaufende Anteile	733	535	532
NIW je Anteil	\$ 16,54	\$ 15,48	\$ 17,88
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend	€ 90.459	€ 102.077	€ 113.058
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.680	7.881	7.392
NIW je Anteil	€ 13,54	€ 12,95	€ 15,29
Class E: thesaurierend	\$ 11.521	\$ 15.703	\$ 22.756
ausgegebene und umlaufende Anteile	930	1.342	1.668
NIW je Anteil	\$ 12,39	\$ 11,70	\$ 13,64
Class E CHF (Hedged): thesaurierend	CHF 8.772	CHF 10.121	CHF 14.255
ausgegebene und umlaufende Anteile	895	1.048	1.235
NIW je Anteil	CHF 9,80	CHF 9,66	CHF 11,54
Class E EUR (Hedged): thesaurierend	€ 21.477	€ 23.540	€ 32.022
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.824	2.072	2.365
NIW je Anteil	€ 11,78	€ 11,36	€ 13,54
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund			
Nettovermögen	\$ 282.790	\$ 205.131	\$ 290.475
Institutional: thesaurierend	\$ 64.011	\$ 25.166	\$ 48.615
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.588	2.449	4.383
NIW je Anteil	\$ 11,46	\$ 10,28	\$ 11,09

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (Forts.)			
Institutional EUR (Partially Hedged): thesaurierend	€ 77.402	€ 72.560	€ 212.680
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.282	7.427	19.839
NIW je Anteil	€ 10,63	€ 9,77	€ 10,72
Institutional GBP (Partially Hedged): Erträge	£ 829	£ 760	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	85	81	k. A.
NIW je Anteil	£ 9,70	£ 9,37	k. A.
Class E: thesaurierend	\$ 11	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,78	k. A.	k. A.
Erträge	\$ 11	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,65	k. A.	k. A.
Class E EUR (Partially Hedged): thesaurierend	€ 759	€ 9	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	75	1	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,12	€ 9,38	k. A.
Class Z: thesaurierend	\$ 131.360	\$ 101.602	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.634	10.102	k. A.
NIW je Anteil	\$ 11,29	\$ 10,06	k. A.
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund			
Nettovermögen	\$ 19.946	\$ 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	€ 6.118	€ 6.154	€ 10.250
ausgegebene und umlaufende Anteile	408	437	743
NIW je Anteil	€ 14,99	€ 14,08	€ 13,80
Class E: thesaurierend	\$ 4.075	\$ 4.388	\$ 5.195
ausgegebene und umlaufende Anteile	315	371	417
NIW je Anteil	\$ 12,93	\$ 11,84	\$ 12,47
Class E EUR (Unhedged): thesaurierend	€ 8.249	€ 9.351	€ 11.252
ausgegebene und umlaufende Anteile	586	700	852
NIW je Anteil	€ 14,09	€ 13,36	€ 13,20
PIMCO ESG Income Fund			
Nettovermögen	\$ 271.208	\$ 237.961	\$ 125.087
Institutional: thesaurierend	\$ 44.067	\$ 23.414	\$ 5.465
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.416	2.486	541
NIW je Anteil	\$ 9,98	\$ 9,42	\$ 10,10
Erträge	\$ 6	\$ 3.575	\$ 3.756
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	393	375
NIW je Anteil	\$ 9,28	\$ 9,10	\$ 10,02
Institutional AUD (Hedged): Erträge	AUD 71.681	AUD 57.036	AUD 14
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.954	6.338	1
NIW je Anteil	AUD 9,01	AUD 9,00	AUD 10,00
Institutional CHF (Hedged): thesaurierend	CHF 1.264	CHF 7.316	CHF 692
ausgegebene und umlaufende Anteile	137	803	69
NIW je Anteil	CHF 9,24	CHF 9,11	CHF 10,02

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
PIMCO ESG Income Fund (Forts.)			
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend	€ 43.366	€ 105.509	€ 72.025
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.567	11.509	7.175
NIW je Anteil	€ 9,50	€ 9,17	€ 10,04
Erträge	€ 42.423	€ 1.925	€ 223
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.808	217	22
NIW je Anteil	€ 8,82	€ 8,85	€ 9,95
Institutional GBP (Hedged): Erträge	£ 382	£ 405	£ 482
ausgegebene und umlaufende Anteile	42	44	48
NIW je Anteil	£ 9,10	£ 9,00	£ 9,98
Institutional NOK (Hedged): thesaurierend	NOK 286.985	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.768	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	NOK 103,69	k. A.	k. A.
Institutional SEK (Hedged): thesaurierend	SEK 177.546	SEK 122.486	SEK 77.208
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.868	1.335	772
NIW je Anteil	SEK 95,05	SEK 91,73	SEK 99,96
Institutional SGD (Hedged): Erträge	SGD 411	SGD 367	SGD 366
ausgegebene und umlaufende Anteile	45	40	36
NIW je Anteil	SGD 9,13	SGD 9,09	SGD 10,02
Administrative SEK (Hedged): thesaurierend	SEK 52.396	SEK 79.369	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	523	816	k. A.
NIW je Anteil	SEK 100,24	SEK 97,22	k. A.
Class E: thesaurierend	\$ 2.429	\$ 1.433	\$ 285
ausgegebene und umlaufende Anteile	249	155	28
NIW je Anteil	\$ 9,74	\$ 9,28	\$ 10,04
Erträge	\$ 444	\$ 387	\$ 20
ausgegebene und umlaufende Anteile	48	43	2
NIW je Anteil	\$ 9,25	\$ 9,10	\$ 10,01
Class E CHF (Hedged): Erträge	CHF 9	CHF 9	CHF 9
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	1
NIW je Anteil	CHF 8,57	CHF 8,81	CHF 9,94
Class E EUR (Hedged): thesaurierend	€ 6.379	€ 4.811	€ 1.113
ausgegebene und umlaufende Anteile	691	535	112
NIW je Anteil	€ 9,23	€ 8,99	€ 9,94
Erträge	€ 1.798	€ 1.016	€ 256
ausgegebene und umlaufende Anteile	204	115	26
NIW je Anteil	€ 8,81	€ 8,86	€ 9,96
Class R AUD (Hedged): Erträge	AUD 26.623	AUD 31.770	AUD 29.726
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.955	3.530	2.973
NIW je Anteil	AUD 9,01	AUD 9,00	AUD 10,00
Euro Bond Fund			
Nettovermögen	€ 1.671.713	€ 1.913.275	€ 2.574.129
Institutional: thesaurierend	€ 1.122.219	€ 1.386.127	€ 1.926.406
ausgegebene und umlaufende Anteile	48.219	64.252	73.731
NIW je Anteil	€ 23,27	€ 21,57	€ 26,13
Erträge	€ 31.807	€ 68.589	€ 92.872
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.175	4.956	5.474
NIW je Anteil	€ 14,63	€ 13,84	€ 16,97

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Euro Bond Fund (Forts.)			
Institutional CHF (Hedged): thesaurierend	CHF 327.426	CHF 313.292	CHF 351.467
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.517	10.631	9.789
NIW je Anteil	CHF 31,13	CHF 29,47	CHF 35,91
Investor: thesaurierend	€ 20.023	€ 16.885	€ 23.320
ausgegebene und umlaufende Anteile	927	841	956
NIW je Anteil	€ 21,59	€ 20,01	€ 24,41
Erträge	k. A.	k. A.	€ 236
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	15
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	€ 16,2
Administrative: thesaurierend	k. A.	k. A.	€ 2.579
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	110
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	€ 23,4
Class E: thesaurierend	€ 120.775	€ 101.050	€ 151.006
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.094	5.451	6.666
NIW je Anteil	€ 19,82	€ 18,51	€ 22,6
Erträge	€ 24.717	€ 23.340	€ 38.508
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.342	2.337	3.146
NIW je Anteil	€ 10,55	€ 9,91	€ 12,2
Euro Credit Fund			
Nettovermögen	€ 537.186	€ 610.008	€ 1.017.163
Institutional: thesaurierend	€ 347.915	€ 348.784	€ 743.335
ausgegebene und umlaufende Anteile	22.389	24.516	43.513
NIW je Anteil	€ 15,51	€ 14,21	€ 17,01
ausschüttend II ausgegebene und umlaufende Anteile	€ 6.860	€ 16.940	€ 80.562
NIW je Anteil	€ 719	€ 1.879	€ 7.303
NIW je Anteil	€ 9,51	€ 9,01	€ 11,01
Class E: thesaurierend	€ 40.494	€ 11.194	€ 18.325
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.346	1.001	1.353
NIW je Anteil	€ 12,11	€ 11,11	€ 13,51
H Institutional: thesaurierend	€ 141.817	€ 232.926	€ 173.091
ausgegebene und umlaufende Anteile	15.125	27.156	16.823
NIW je Anteil	€ 9,31	€ 8,58	€ 10,29
ausschüttend II ausgegebene und umlaufende Anteile	€ 100	€ 164	€ 1.850
NIW je Anteil	€ 11	€ 20	€ 186
NIW je Anteil	€ 8,68	€ 8,14	€ 9,93
Euro Income Bond Fund			
Nettovermögen	€ 1.387.227	€ 1.352.980	€ 2.482.304
Institutional: thesaurierend	€ 323.024	€ 332.727	€ 895.043
ausgegebene und umlaufende Anteile	21.389	23.944	56.691
NIW je Anteil	€ 15,10	€ 13,90	€ 15,79
Erträge	€ 65.612	€ 79.523	€ 128.548
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.705	8.533	11.833
NIW je Anteil	€ 9,79	€ 9,32	€ 10,86
Investor: thesaurierend	€ 14.845	€ 10.138	€ 14.129
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.536	1.136	1.388
NIW je Anteil	€ 9,67	€ 8,93	€ 10,18
Erträge	€ 8.086	€ 8.520	€ 10.907
ausgegebene und umlaufende Anteile	851	939	1.027
NIW je Anteil	€ 9,50	€ 9,08	€ 10,62

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Euro Income Bond Fund (Forts.)			
Class E:			
thesaurierend	€ 573.864	€ 540.713	€ 856.874
ausgegebene und umlaufende Anteile	42.654	43.285	59.839
NIW je Anteil	€ 13,45	€ 12,49	€ 14,32
Erträge	€ 359.021	€ 347.514	€ 527.452
ausgegebene und umlaufende Anteile	41.468	41.763	53.871
NIW je Anteil	€ 8,66	€ 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
Class T:			
thesaurierend	€ 30.390	€ 24.746	€ 32.571
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.946	2.573	2.943
NIW je Anteil	€ 10,32	€ 9,62	€ 11,07
Erträge	€ 12.385	€ 9.099	€ 12.914
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.620	1.234	1.482
NIW je Anteil	€ 7,64	€ 7,38	€ 8,72
Euro Long Average Duration Fund			
Nettvermögen	€ 923.969	€ 110.048	€ 160.601
Institutional:			
thesaurierend	€ 923.958	€ 110.048	€ 160.601
ausgegebene und umlaufende Anteile	44.105	5.786	5.426
NIW je Anteil	€ 20,95	€ 19,02	€ 29,60
Class E:			
thesaurierend	€ 11	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 11,33	k. A.	k. A.
Euro Short-Term Fund			
Nettvermögen	€ 193.514	€ 353.095	€ 629.859
Institutional:			
thesaurierend	€ 165.347	€ 339.031	€ 616.693
ausgegebene und umlaufende Anteile	13.404	28.689	51.558
NIW je Anteil	€ 12,34	€ 11,82	€ 11,96
Class E:			
thesaurierend	€ 28.167	€ 14.064	€ 13.166
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.608	1.350	1.239
NIW je Anteil	€ 10,80	€ 10,42	€ 10,63
PIMCO European High Yield Bond Fund			
Nettvermögen	€ 367.767	€ 174.162	€ 170.489
Institutional:			
thesaurierend	€ 219.781	€ 32.875	€ 12.500
ausgegebene und umlaufende Anteile	19.847	3.379	1.159
NIW je Anteil	€ 11,07	€ 9,73	€ 10,79
Class E:			
thesaurierend	€ 4.061	€ 10	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	360	1	k. A.
NIW je Anteil	€ 11,28	€ 10,00	k. A.
Erträge	€ 10	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,61	k. A.	k. A.
Class Z:			
thesaurierend	€ 143.915	€ 141.277	€ 157.989
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.727	14.301	14.501
NIW je Anteil	€ 11,31	€ 9,88	€ 10,90

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund			
Nettvermögen	€ 130.610	€ 211.172	€ 395.491
Institutional:			
thesaurierend	€ 67.680	€ 127.942	€ 254.925
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.907	11.637	22.466
NIW je Anteil	€ 11,46	€ 10,99	€ 11,35
Class E:			
thesaurierend	€ 11.471	€ 7.775	€ 4.368
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.175	826	447
NIW je Anteil	€ 9,77	€ 9,42	€ 9,77
H Institutional:			
thesaurierend	€ 51.459	€ 75.455	€ 136.198
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.184	7.907	13.806
NIW je Anteil	€ 9,93	€ 9,54	€ 9,87
Global Advantage Fund			
Nettvermögen	\$ 432.290	\$ 410.459	\$ 521.067
Institutional:			
thesaurierend	\$ 7.698	\$ 7.716	\$ 24.968
ausgegebene und umlaufende Anteile	540	582	1.630
NIW je Anteil	\$ 14,26	\$ 13,28	\$ 15,32
Institutional CHF (Partially Hedged):			
Erträge	CHF 108.735	CHF 111.046	CHF 132.681
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.443	12.487	12.823
NIW je Anteil	CHF 8,74	CHF 8,89	CHF 10,35
Institutional EUR (Partially Hedged):			
thesaurierend	€ 206.079	€ 203.446	€ 237.602
ausgegebene und umlaufende Anteile	15.268	15.828	16.656
NIW je Anteil	€ 13,50	€ 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 620.678	NOK 577.381	NOK 625.501
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.106	4.099	4.093
NIW je Anteil	NOK 151,18	NOK 140,84	NOK 152,81
Class E EUR (Partially Hedged):			
thesaurierend	€ 6.009	€ 6.540	€ 8.002
ausgegebene und umlaufende Anteile	509	576	629
NIW je Anteil	€ 11,80	€ 11,36	€ 12,73
Global Bond Fund			
Nettvermögen	\$ 13.077.262	\$ 11.420.112	\$ 14.038.846
Institutional:			
thesaurierend	\$ 4.616.460	\$ 3.410.090	\$ 3.999.850
ausgegebene und umlaufende Anteile	134.931	107.593	111.904
NIW je Anteil	\$ 34,21	\$ 31,69	\$ 35,74
Erträge	\$ 210.566	\$ 172.513	\$ 203.191
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.420	9.898	10.136
NIW je Anteil	\$ 18,44	\$ 17,43	\$ 20,05

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Global Bond Fund (Forts.)			
Institutional (Currency Exposure):			
thesaurierend	\$ 307.999	\$ 326.665	\$ 328.710
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.940	11.261	9.512
NIW je Anteil	\$ 30,99	\$ 29,01	\$ 34,56
Erträge	\$ 19.480	\$ 19.875	\$ 26.341
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.011	1.080	1.178
NIW je Anteil	\$ 19,27	\$ 18,41	\$ 22,37
Institutional CAD (Hedged):			
thesaurierend	CAD 50.875	CAD 54.563	CAD 72.089
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.696	5.395	6.309
NIW je Anteil	CAD 10,83	CAD 10,11	CAD 11,43
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 365.291	CHF 440.925	CHF 552.547
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.784	14.706	15.928
NIW je Anteil	CHF 31,00	CHF 29,98	CHF 34,69
Erträge	CHF 142.984	CHF 175.781	CHF 218.701
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.104	10.095	10.645
NIW je Anteil	CHF 17,64	CHF 17,41	CHF 20,54
Institutional EUR (Currency Exposure):			
thesaurierend	€ 191.275	€ 190.480	€ 139.337
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.411	14.810	9.692
NIW je Anteil	€ 13,27	€ 12,86	€ 14,38
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 1.986.158	€ 1.974.600	€ 2.453.258
ausgegebene und umlaufende Anteile	74.563	78.287	84.453
NIW je Anteil	€ 26,64	€ 25,22	€ 29,05
Erträge	€ 597.513	€ 512.652	€ 628.774
ausgegebene und umlaufende Anteile	36.436	32.355	33.781
NIW je Anteil	€ 16,40	€ 15,84	€ 18,61
Institutional GBP (Currency Exposure):			
thesaurierend	£ 2.186	£ 3.343	£ 3.600
ausgegebene und umlaufende Anteile	203	313	319
NIW je Anteil	£ 10,76	£ 10,68	£ 11,30
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 189.318	£ 162.896	£ 198.000
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.545	7.879	8.429
NIW je Anteil	£ 22,16	£ 20,68	£ 23,49
Erträge	£ 117.923	£ 132.242	£ 191.729
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.288	10.904	13.574
NIW je Anteil	£ 12,70	£ 12,13	£ 14,13
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 2.483.411	NOK 2.918.045	NOK 4.130.842
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.421	14.215	17.688
NIW je Anteil	NOK 217,44	NOK 205,28	NOK 233,55

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Global Bond Fund (Forts.)			
Institutional NZD (Hedged):			
Erträge	NZD 148.154	NZD 167.929	NZD 309.397
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.487	4.162	6.643
NIW je Anteil	NZD 42,48	NZD 40,35	NZD 46,57
Institutional SEK (Hedged):			
thesaurierend	SEK 458.269	SEK 1.120.588	SEK 1.219.998
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.212	5.712	5.426
NIW je Anteil	SEK 207,22	SEK 196,17	SEK 224,86
Institutional SGD (Hedged):			
thesaurierend	SGD 229.722	SGD 217.237	SGD 174.944
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.592	12.665	9.030
NIW je Anteil	SGD 18,24	SGD 17,15	SGD 19,37
Erträge	SGD 115	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	11	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	SGD 10,33	k. A.	k. A.
Investor:			
thesaurierend	\$ 201.431	\$ 94.643	\$ 135.136
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.417	3.244	4.092
NIW je Anteil	\$ 31,39	\$ 29,18	\$ 33,02
Erträge	\$ 54.670	\$ 28.517	\$ 7.773
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.529	1.948	462
NIW je Anteil	\$ 15,49	\$ 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 125.907	CHF 145.814	CHF 188.770
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.594	12.641	14.095
NIW je Anteil	CHF 11,88	CHF 11,53	CHF 13,39
Investor EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 84.542	€ 75.495	€ 92.541
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.393	3.189	3.382
NIW je Anteil	€ 24,92	€ 23,68	€ 27,36
Investor GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 6.747	£ 5.437	£ 5.846
ausgegebene und umlaufende Anteile	325	280	264
NIW je Anteil	£ 20,77	£ 19,45	£ 22,17
Investor NOK (Hedged):			
thesaurierend	NOK 62.521	NOK 23.662	NOK 28.765
ausgegebene und umlaufende Anteile	306	122	130
NIW je Anteil	NOK 204,47	NOK 193,71	NOK 221,16
Administrative:			
thesaurierend	\$ 13.375	\$ 9.565	\$ 15.922
ausgegebene und umlaufende Anteile	439	337	495
NIW je Anteil	\$ 30,48	\$ 28,38	\$ 32,16
Administrative SEK (Hedged):			
thesaurierend	SEK 124.505	SEK 114.069	SEK 1.941
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.376	1.325	20
NIW je Anteil	SEK 90,48	SEK 86,08	SEK 99,17

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Global Bond Fund (Forts.)			
Class E:			
thesaurierend	\$ 369.607	\$ 326.703	\$ 463.700
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.696	12.006	14.974
NIW je Anteil	\$ 29,11	\$ 27,21	\$ 30,97
Erträge	\$ 143.056	\$ 101.393	\$ 117.421
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.742	8.054	8.111
NIW je Anteil	\$ 13,32	\$ 12,59	\$ 14,48
Class E (Currency Exposure):			
thesaurierend	\$ 38.405	\$ 34.705	\$ 61.145
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.130	2.994	4.389
NIW je Anteil	\$ 12,27	\$ 11,59	\$ 13,93
Erträge	\$ 19.849	\$ 13.040	\$ 16.440
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.925	1.324	1.374
NIW je Anteil	\$ 10,31	\$ 9,85	\$ 11,97
Class E CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 2.398	CHF 1.921	CHF 2.358
ausgegebene und umlaufende Anteile	262	215	226
NIW je Anteil	CHF 9,14	CHF 8,92	CHF 10,41
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 698.781	€ 685.427	€ 959.543
ausgegebene und umlaufende Anteile	30.821	31.641	38.117
NIW je Anteil	€ 22,67	€ 21,66	€ 25,17
Erträge	€ 40.788	€ 31.423	€ 41.846
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.531	3.613	4.097
NIW je Anteil	€ 9,00	€ 8,70	€ 10,22
Class E 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	€ 68.720	€ 66.161	€ 123.034
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.568	7.543	11.955
NIW je Anteil	€ 9,08	€ 8,77	€ 10,29
H Institutional:			
thesaurierend	\$ 743.816	\$ 752.379	\$ 835.136
ausgegebene und umlaufende Anteile	22.522	24.551	24.124
NIW je Anteil	\$ 33,03	\$ 30,65	\$ 34,62
Erträge	\$ 2.227	\$ 2.035	\$ 2.643
ausgegebene und umlaufende Anteile	239	231	261
NIW je Anteil	\$ 9,30	\$ 8,79	\$ 10,11
H Institutional (Currency Exposure):			
thesaurierend	\$ 150.642	\$ 309.569	\$ 756
ausgegebene und umlaufende Anteile	17.281	37.885	78
NIW je Anteil	\$ 8,72	\$ 8,17	\$ 9,75
M Retail:			
ausschüttend II	\$ 854	\$ 1.358	\$ 1.742
ausgegebene und umlaufende Anteile	92	153	168
NIW je Anteil	\$ 9,27	\$ 8,89	\$ 10,34
M Retail HKD (Unhedged):			
ausschüttend II	HKD 18.703	HKD 5.118	HKD 8.307
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.013	575	802
NIW je Anteil	HKD 9,29	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
M Retail SGD (Hedged):			
ausschüttend II	SGD 13.975	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.370	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	SGD 10,20	k. A.	k. A.
Class R EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 6.081	€ 5.591	€ 6.442
ausgegebene und umlaufende Anteile	547	530	528
NIW je Anteil	€ 11,12	€ 10,56	€ 12,19

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Global Bond Fund (Forts.)			
Class T:			
thesaurierend	\$ 17.137	\$ 15.814	\$ 26.245
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.511	1.487	2.163
NIW je Anteil	\$ 11,34	\$ 10,63	\$ 12,14
Erträge	\$ 5.367	\$ 3.040	\$ 4.183
ausgegebene und umlaufende Anteile	506	303	362
NIW je Anteil	\$ 10,61	\$ 10,04	\$ 11,54
Class T EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 24.878	€ 14.560	€ 19.104
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.566	1.567	1.764
NIW je Anteil	€ 9,70	€ 9,29	€ 10,83
W Class:			
thesaurierend	\$ 118.273	\$ 24.415	\$ 29.951
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.197	2.721	2.962
NIW je Anteil	\$ 9,70	\$ 8,97	\$ 10,11
Erträge	\$ 54.179	\$ 9.498	\$ 9.066
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.964	1.106	919
NIW je Anteil	\$ 9,08	\$ 8,59	\$ 9,87
ausschüttend II	\$ 529	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	51	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,43	k. A.	k. A.
Class W (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 32.887	CHF 24.828	CHF 33.361
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.691	2.884	3.352
NIW je Anteil	CHF 8,91	CHF 8,61	CHF 9,95
Erträge	CHF 4.389	CHF 705	CHF 740
ausgegebene und umlaufende Anteile	526	86	76
NIW je Anteil	CHF 8,34	CHF 8,24	CHF 9,72
W Class EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 23.248	€ 9.594	€ 14.976
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.535	1.106	1.500
NIW je Anteil	€ 9,17	€ 8,68	€ 9,98
Erträge	€ 4.237	€ 2.352	€ 2.251
ausgegebene und umlaufende Anteile	493	283	231
NIW je Anteil	€ 8,59	€ 8,30	€ 9,75
W Class GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 16.595	£ 2.383	£ 1.265
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.743	268	126
NIW je Anteil	£ 9,52	£ 8,88	£ 10,08
Erträge	£ 8.538	£ 5.877	£ 9.060
ausgegebene und umlaufende Anteile	957	692	921
NIW je Anteil	£ 8,92	£ 8,49	£ 9,84
W Class NOK (Hedged):			
thesaurierend	NOK 11.384	NOK 4.083	NOK 3.799
ausgegebene und umlaufende Anteile	122	46	38
NIW je Anteil	NOK 93,68	NOK 88,35	NOK 100,41
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 10.799	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.049	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	SGD 10,30	k. A.	k. A.

	Global Bond Ex-US Fund (Forts.)			Global High Yield Bond Fund (Forts.)		
	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
H Institutional:						
thesaurierend	\$ 46.259	\$ 6.714	\$ 1.160	\$ 22.199	\$ 30.795	\$ 50.855
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.207	667	104	818	1.276	1.881
NIW je Anteil	\$ 11,00	\$ 10,06	\$ 11,20	\$ 27,15	\$ 24,14	\$ 27,04
Class Z:						
thesaurierend	\$ 115.239	\$ 104.722	\$ 137.893	\$ 16.634	\$ 21.259	\$ 32.985
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.957	10.957	13.049	1.621	2.225	2.956
NIW je Anteil	\$ 10,52	\$ 9,56	\$ 10,57	\$ 10,26	\$ 9,56	\$ 11,16
	Global High Yield Bond Fund					
Nettovermögen	\$ 2.980.250	\$ 3.102.868	\$ 5.169.160			
Institutional:						
thesaurierend	\$ 633.820	\$ 579.939	\$ 844.967			
ausgegebene und umlaufende Anteile	21.624	22.368	29.240			
NIW je Anteil	\$ 29,31	\$ 25,93	\$ 28,90			
Erträge	\$ 298.704	\$ 292.202	\$ 489.734			
ausgegebene und umlaufende Anteile	28.490	29.927	42.937			
NIW je Anteil	\$ 10,48	\$ 9,76	\$ 11,41			
Institutional CHF (Hedged):						
thesaurierend	CHF 24.625	CHF 22.915	CHF 38.082			
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.428	1.439	2.089			
NIW je Anteil	CHF 17,24	CHF 15,92	CHF 18,23			
Erträge	CHF 3.467	CHF 3.237	CHF 16.630			
ausgegebene und umlaufende Anteile	454	436	1.863			
NIW je Anteil	CHF 7,64	CHF 7,43	CHF 8,93			
Institutional EUR (Hedged):						
thesaurierend	€ 698.966	€ 725.182	€ 1.232.938			
ausgegebene und umlaufende Anteile	28.447	32.640	48.671			
NIW je Anteil	€ 24,57	€ 22,22	€ 25,33			
Erträge	€ 136.798	€ 155.150	€ 119.724			
ausgegebene und umlaufende Anteile	13.305	15.853	10.243			
NIW je Anteil	€ 10,28	€ 9,79	€ 11,69			
Institutional GBP (Hedged):						
thesaurierend	£ 45.376	£ 31.335	£ 239.206			
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.749	2.130	14.437			
NIW je Anteil	£ 16,51	£ 14,71	£ 16,57			
Erträge	£ 215.523	£ 292.800	£ 557.487			
ausgegebene und umlaufende Anteile	41.123	59.445	95.775			
NIW je Anteil	£ 5,24	£ 4,93	£ 5,82			
Investor:						
thesaurierend	\$ 2.146	\$ 1.820	\$ 12.295			
ausgegebene und umlaufende Anteile	156	149	902			
NIW je Anteil	\$ 13,73	\$ 12,19	\$ 13,64			
Erträge	\$ 11	k. A.	k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.			
NIW je Anteil	\$ 10,72	k. A.	k. A.			
Investor EUR (Hedged):						
thesaurierend	€ 5.450	€ 12.416	€ 5.703			
ausgegebene und umlaufende Anteile	232	583	234			
NIW je Anteil	€ 23,47	€ 21,30	€ 24,37			
Administrative:						
thesaurierend	\$ 22.199	\$ 30.795	\$ 50.855			
ausgegebene und umlaufende Anteile	818	1.276	1.881			
NIW je Anteil	\$ 27,15	\$ 24,14	\$ 27,04			
Erträge	\$ 16.634	\$ 21.259	\$ 32.985			
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.621	2.225	2.956			
NIW je Anteil	\$ 10,26	\$ 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			
BM Retail:						
ausschüttend II	\$ 3.173	\$ 10	k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile	324	1	k. A.			
NIW je Anteil	\$ 9,78	\$ 9,34	k. A.			
Class E:						
thesaurierend	\$ 123.931	\$ 129.353	\$ 186.558			
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.939	5.776	7.407			
NIW je Anteil	\$ 25,09	\$ 22,40	\$ 25,19			
Erträge	\$ 96.084	\$ 109.532	\$ 151.015			
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.302	11.389	13.453			
NIW je Anteil	\$ 10,33	\$ 9,62	\$ 11,23			
Class E EUR (Hedged):						
thesaurierend	€ 224.500	€ 224.727	€ 299.451			
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.501	10.424	12.074			
NIW je Anteil	€ 23,63	€ 21,56	€ 24,80			
Erträge	€ 27.762	€ 27.782	€ 38.159			
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.303	3.472	3.992			
NIW je Anteil	€ 8,40	€ 8,00	€ 9,56			
Class E GBP (Hedged):						
Erträge	£ 3.519	£ 5.932	£ 7.285			
ausgegebene und umlaufende Anteile	318	572	595			
NIW je Anteil	£ 11,06	£ 10,38	£ 12,25			
Class E SGD (Hedged):						
Erträge	SGD 8.215	SGD 6.387	SGD 11.731			
ausgegebene und umlaufende Anteile	865	711	1.116			
NIW je Anteil	SGD 9,50	SGD 8,98	SGD 10,52			
H Institutional:						
thesaurierend	\$ 128.939	\$ 218.500	\$ 82.082			
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.586	8.771	2.952			
NIW je Anteil	\$ 28,12	\$ 24,91	\$ 27,81			
Erträge	\$ 7.523	\$ 4.003	\$ 10.759			
ausgegebene und umlaufende Anteile	809	462	1.064			
NIW je Anteil	\$ 9,29	\$ 8,66	\$ 10,11			
M Retail:						
Erträge	\$ 16.994	\$ 17.710	\$ 25.552			
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.667	1.865	2.306			
NIW je Anteil	\$ 10,20	\$ 9,50	\$ 11,08			
ausschüttend II	\$ 34.630	\$ 35.654	\$ 107.627			
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.268	4.652	11.857			
NIW je Anteil	\$ 8,11	\$ 7,66	\$ 9,08			
Class R:						
thesaurierend	\$ 2.439	\$ 2.617	\$ 73.221			
ausgegebene und umlaufende Anteile	152	184	4.598			
NIW je Anteil	\$ 16,06	\$ 14,25	\$ 15,92			

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Global High Yield Bond Fund (Forts.)			
Class T:			
thesaurierend	\$ 5.769	\$ 5.339	\$ 7.458
ausgegebene und umlaufende Anteile	433	448	554
NIW je Anteil	\$ 13,31	\$ 11,93	\$ 13,47
Erträge	\$ 2.662	\$ 1.796	\$ 2.373
ausgegebene und umlaufende Anteile	277	200	227
NIW je Anteil	\$ 9,62	\$ 8,96	\$ 10,46
Class T 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
Global Investment Grade Credit Fund			
Nettovermögen	\$ 10.713.722	\$ 10.538.341	\$ 17.154.925
Institutional:			
thesaurierend	\$ 3.012.636	\$ 2.618.560	\$ 3.806.107
ausgegebene und umlaufende Anteile	148.124	140.682	172.781
NIW je Anteil	\$ 20,34	\$ 18,61	\$ 22,03
Erträge	\$ 587.774	\$ 474.941	\$ 705.907
ausgegebene und umlaufende Anteile	51.901	44.276	53.902
NIW je Anteil	\$ 11,32	\$ 10,73	\$ 13,10
Institutional (Currency Exposure):			
thesaurierend	\$ 117.937	\$ 100.855	\$ 86.823
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.912	7.439	5.244
NIW je Anteil	\$ 14,91	\$ 13,56	\$ 16,56
Erträge	\$ 19.023	\$ 22.435	\$ 33.395
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.261	2.833	3.347
NIW je Anteil	\$ 8,41	\$ 7,92	\$ 9,98
Institutional AUD (Hedged):			
Erträge	AUD 6.260	AUD 7.370	AUD 90.155
ausgegebene und umlaufende Anteile	705	861	8.528
NIW je Anteil	AUD 8,87	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 529.814	CHF 656.465	CHF 814.188
ausgegebene und umlaufende Anteile	34.237	44.353	45.260
NIW je Anteil	CHF 15,47	CHF 14,80	CHF 17,99
Erträge	CHF 31.431	CHF 33.474	CHF 49.517
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.344	4.674	5.516
NIW je Anteil	CHF 7,24	CHF 7,16	CHF 8,98
Institutional CZK (Hedged):			
Erträge	CZK 195.936	CZK 339.010	CZK 2.085.033
ausgegebene und umlaufende Anteile	22.425	41.499	216.797
NIW je Anteil	CZK 8,74	CZK 8,17	CZK 9,62
Institutional EUR (Currency Exposure):			
thesaurierend	€ 47.238	€ 43.714	€ 39.844
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.501	3.441	2.737
NIW je Anteil	€ 13,49	€ 12,70	€ 14,56

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)			
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 1.004.207	€ 1.343.974	€ 2.237.224
ausgegebene und umlaufende Anteile	55.930	79.965	109.970
NIW je Anteil	€ 17,95	€ 16,81	€ 20,34
Erträge	€ 365.512	€ 447.965	€ 803.485
ausgegebene und umlaufende Anteile	37.572	47.525	68.258
NIW je Anteil	€ 9,73	€ 9,43	€ 11,77
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 125.032	£ 112.550	£ 258.867
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.164	6.014	11.576
NIW je Anteil	£ 20,29	£ 18,72	£ 22,36
Erträge	£ 637.646	£ 767.395	£ 1.684.722
ausgegebene und umlaufende Anteile	55.185	69.403	123.537
NIW je Anteil	£ 11,55	£ 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 287.785	NOK 258.128	NOK 429.061
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.009	1.931	2.683
NIW je Anteil	NOK 143,24	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 2.820.196	SEK 2.527.557	SEK 3.657.935
ausgegebene und umlaufende Anteile	183.913	176.118	211.649
NIW je Anteil	SEK 15,33	SEK 14,35	SEK 17,28
Institutional SGD (Hedged):			
Erträge	SGD 98.125	SGD 11.301	SGD 8.028
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.785	1.291	749
NIW je Anteil	SGD 9,10	SGD 8,76	SGD 10,72
Investor:			
thesaurierend	\$ 337.303	\$ 440.714	\$ 988.957
ausgegebene und umlaufende Anteile	15.273	21.729	41.056
NIW je Anteil	\$ 22,08	\$ 20,28	\$ 24,09
Erträge	\$ 143.565	\$ 131.169	\$ 92.275
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.912	11.489	6.624
NIW je Anteil	\$ 12,05	\$ 11,42	\$ 13,93
Investor AUD (Hedged):			
Erträge	AUD 8.369	AUD 10.542	AUD 5.854
ausgegebene und umlaufende Anteile	961	1.256	565
NIW je Anteil	AUD 8,70	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

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)			
Investor CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 4.911	CHF 5.359	CHF 7.624
ausgegebene und umlaufende Anteile	435	494	577
NIW je Anteil	CHF 11,29	CHF 10,84	CHF 13,22
Erträge	CHF 4.293	CHF 5.334	CHF 8.176
ausgegebene und umlaufende Anteile	461	578	707
NIW je Anteil	CHF 9,32	CHF 9,23	CHF 11,56
Investor EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 31.093	€ 26.086	€ 49.619
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.843	1.646	2.577
NIW je Anteil	€ 16,87	€ 15,85	€ 19,25
Erträge	€ 10.366	€ 11.379	€ 16.646
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.016	1.151	1.349
NIW je Anteil	€ 10,20	€ 9,88	€ 12,34
Investor GBP (Hedged):			
Erträge	£ 4.257	£ 4.175	£ 5.735
ausgegebene und umlaufende Anteile	379	389	433
NIW je Anteil	£ 11,24	£ 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 7.115	SGD 7.277	SGD 7.473
ausgegebene und umlaufende Anteile	802	852	715
NIW je Anteil	SGD 8,88	SGD 8,54	SGD 10,45
Administrative:			
thesaurierend	\$ 88.580	\$ 76.931	\$ 215.743
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.693	4.431	10.444
NIW je Anteil	\$ 18,88	\$ 17,36	\$ 20,66
Erträge	\$ 70.601	\$ 47.290	\$ 99.369
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.060	4.285	7.378
NIW je Anteil	\$ 11,65	\$ 11,04	\$ 13,47
Administrative CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 173	CHF 391	CHF 629
ausgegebene und umlaufende Anteile	17	41	54
NIW je Anteil	CHF 9,92	CHF 9,54	CHF 11,65
Administrative EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 10.048	€ 7.522	€ 9.518
ausgegebene und umlaufende Anteile	632	503	523
NIW je Anteil	€ 15,91	€ 14,97	€ 18,21
Erträge	€ 9.002	€ 7.846	€ 9.315
ausgegebene und umlaufende Anteile	914	822	782
NIW je Anteil	€ 9,85	€ 9,54	€ 11,91
Administrative GBP (Hedged):			
Erträge	£ 6.900	£ 4.557	£ 6.985
ausgegebene und umlaufende Anteile	617	427	531
NIW je Anteil	£ 11,18	£ 10,68	£ 13,17
Administrative HKD (Unhedged):			
Erträge	HKD 35.963	HKD 10.505	HKD 12.810
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.033	1.244	1.244
NIW je Anteil	HKD 8,92	HKD 8,44	HKD 10,30
Administrative SEK (Hedged):			
thesaurierend	SEK 61.831	SEK 901.901	SEK 936.226
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.733	88.869	76.221
NIW je Anteil	SEK 10,78	SEK 10,15	SEK 12,28
Administrative SGD (Hedged):			
Erträge	SGD 19.497	SGD 2.918	SGD 5.459
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.276	354	542
NIW je Anteil	SGD 8,56	SGD 8,24	SGD 10,08

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)			
BM Retail:			
Decumulation	\$ 10	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 9,95	k. A.	k. A.
Class E:			
thesaurierend	\$ 726.293	\$ 605.749	\$ 799.659
ausgegebene und umlaufende Anteile	40.860	36.905	40.796
NIW je Anteil	\$ 17,78	\$ 16,41	\$ 19,60
Erträge	\$ 249.811	\$ 216.440	\$ 341.550
ausgegebene und umlaufende Anteile	20.324	18.589	24.037
NIW je Anteil	\$ 12,29	\$ 11,64	\$ 14,21
Class E CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 48.855	CHF 52.629	CHF 78.253
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.786	5.342	6.476
NIW je Anteil	CHF 10,21	CHF 9,85	CHF 12,08
Class E EUR (Currency Exposure)			
Erträge	€ 1.375	€ 1.340	€ 3.077
ausgegebene und umlaufende Anteile	148	148	288
NIW je Anteil	€ 9,26	€ 9,03	€ 10,67
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 350.203	€ 451.796	€ 630.730
ausgegebene und umlaufende Anteile	22.889	31.264	35.735
NIW je Anteil	€ 15,30	€ 14,45	€ 17,65
Erträge	€ 191.362	€ 197.011	€ 271.438
ausgegebene und umlaufende Anteile	22.805	24.230	26.741
NIW je Anteil	€ 8,39	€ 8,13	€ 10,15
Class E GBP (Hedged):			
Erträge	£ 20.954	£ 20.979	£ 31.335
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.795	1.881	2.279
NIW je Anteil	£ 11,68	£ 11,15	£ 13,75
Class E SGD (Hedged):			
Erträge	SGD 48.801	SGD 30.453	SGD 37.343
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.352	3.472	3.481
NIW je Anteil	SGD 9,12	SGD 8,77	SGD 10,73
H Institutional:			
thesaurierend	\$ 485.344	\$ 282.176	\$ 168.210
ausgegebene und umlaufende Anteile	22.978	14.572	7.327
NIW je Anteil	\$ 21,12	\$ 19,36	\$ 22,96
Erträge	\$ 18.189	\$ 17.320	\$ 14.287
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.990	2.000	1.351
NIW je Anteil	\$ 9,14	\$ 8,66	\$ 10,57
H Institutional (Currency Exposure):			
thesaurierend	\$ 85.535	\$ 184.082	\$ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.678	22.850	1
NIW je Anteil	\$ 8,84	\$ 8,06	\$ 9,85
M Retail:			
Decumulation	\$ 10	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 9,96	k. A.	k. A.
Erträge	\$ 28.765	\$ 25.037	\$ 49.229
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.092	2.840	4.577
NIW je Anteil	\$ 9,30	\$ 8,82	\$ 10,76
ausschüttend II	\$ 89.186	\$ 86.672	\$ 120.251
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.736	10.861	12.179
NIW je Anteil	\$ 8,31	\$ 7,98	\$ 9,87
M Retail HKD (Unhedged):			
Erträge	HKD 9.098	HKD 8.376	HKD 9.145
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.019	990	887
NIW je Anteil	HKD 8,93	HKD 8,46	HKD 10,31

	Zum 31. Dez. 2023		Zum 31. Dez. 2022		Zum 31. Dez. 2021	
	CHF	24	CHF	24	CHF	30
Global Investment Grade Credit ESG Fund (Forts.)						
Erträge						
ausgegebene und umlaufende Anteile		3		3		3
NIW je Anteil	CHF	8,07	CHF	8,00	CHF	9,87
Class E EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	16.648	€	3.370	€	7.130
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.906		406		709
NIW je Anteil	€	8,73	€	8,29	€	10,05
Erträge	€	638	€	581	€	869
ausgegebene und umlaufende Anteile		77		72		88
NIW je Anteil	€	8,32	€	8,07	€	9,92
Class E GBP (Hedged):						
thesaurierend	£	690	£	420	£	503
ausgegebene und umlaufende Anteile		76		50		50
NIW je Anteil	£	9,06	£	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
Class Z:						
thesaurierend	\$	4.612	\$	19.339	\$	22.582
ausgegebene und umlaufende Anteile		434		1.986		1.986
NIW je Anteil	\$	10,63	\$	9,74	\$	11,37
Global Low Duration Real Return Fund						
Nettovermögen	\$	1.177.052	\$	1.364.375	\$	1.199.076
Institutional:						
thesaurierend	\$	59.349	\$	136.292	\$	150.363
ausgegebene und umlaufende Anteile		4.779		11.554		12.580
NIW je Anteil	\$	12,42	\$	11,80	\$	11,95
Institutional CHF (Hedged):						
thesaurierend	CHF	37.402	CHF	22.752	CHF	32.711
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.747		2.303		3.190
NIW je Anteil	CHF	9,98	CHF	9,88	CHF	10,25
Institutional EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	267.868	€	498.384	€	518.804
ausgegebene und umlaufende Anteile		25.334		48.614		48.941
NIW je Anteil	€	10,57	€	10,25	€	10,60
Erträge	€	24.318	€	34.131	€	45.289
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.748		3.856		4.630
NIW je Anteil	€	8,85	€	8,85	€	9,78
Institutional GBP (Hedged):						
thesaurierend	£	34.278	£	55.816	£	63.979
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.010		5.128		5.771
NIW je Anteil	£	11,39	£	10,88	£	11,09
Erträge	£	67.020	£	62.640	£	57.902
ausgegebene und umlaufende Anteile		7.240		6.761		5.720
NIW je Anteil	£	9,26	£	9,26	£	10,12
Institutional SGD (Hedged):						
thesaurierend	SGD	609.791	SGD	351.313		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		58.427		34.943		k. A.
NIW je Anteil	SGD	10,44	SGD	10,05		k. A.
Investor:						
thesaurierend	\$	4.357	\$	6.751	\$	5.146
ausgegebene und umlaufende Anteile		364		591		443
NIW je Anteil	\$	11,98	\$	11,42	\$	11,61
Class E:						
thesaurierend	\$	24.371	\$	34.924	\$	26.574
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.145		3.206		2.386
NIW je Anteil	\$	11,36	\$	10,89	\$	11,14
Class E EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	118.010	€	177.147	€	153.469
ausgegebene und umlaufende Anteile		12.201		18.721		15.545
NIW je Anteil	€	9,67	€	9,46	€	9,87

	Zum 31. Dez. 2023		Zum 31. Dez. 2022		Zum 31. Dez. 2021	
	\$	2.381.093	\$	2.571.862	\$	3.703.379
Global Real Return Fund						
Nettovermögen	\$	2.381.093	\$	2.571.862	\$	3.703.379
Institutional:						
thesaurierend	\$	286.542	\$	272.591	\$	380.827
ausgegebene und umlaufende Anteile		12.657		12.628		14.784
NIW je Anteil	\$	22,64	\$	21,59	\$	25,76
Erträge	\$	5.867	\$	12.328	\$	22.531
ausgegebene und umlaufende Anteile		373		796		1.136
NIW je Anteil	\$	15,71	\$	15,49	\$	19,84
Institutional (Currency Exposure):						
thesaurierend	\$	49.161	\$	47.075	\$	68.405
ausgegebene und umlaufende Anteile		4.759		4.828		5.543
NIW je Anteil	\$	10,33	\$	9,75	\$	12,34
Institutional CHF (Hedged):						
thesaurierend	CHF	52.476	CHF	56.131	CHF	63.005
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.973		4.267		3.907
NIW je Anteil	CHF	13,21	CHF	13,15	CHF	16,12
Erträge	CHF	27.158	CHF	33.615	CHF	38.988
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.248		3.898		3.438
NIW je Anteil	CHF	8,36	CHF	8,62	CHF	11,34
Institutional EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	664.628	€	824.251	€	1.075.404
ausgegebene und umlaufende Anteile		35.832		45.572		48.681
NIW je Anteil	€	18,55	€	18,09	€	22,09
Erträge	€	84.433	€	98.750	€	140.728
ausgegebene und umlaufende Anteile		6.690		7.750		8.415
NIW je Anteil	€	12,62	€	12,74	€	16,72
Institutional GBP (Hedged):						
thesaurierend	£	34.169	£	38.820	£	45.209
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.789		3.298		3.177
NIW je Anteil	£	12,25	£	11,77	£	14,23
Erträge	£	185.264	£	205.454	£	276.097
ausgegebene und umlaufende Anteile		23.332		25.531		26.297
NIW je Anteil	£	7,94	£	8,05	£	10,50
Institutional SGD (Hedged):						
thesaurierend	SGD	243.298	SGD	236.796	SGD	307.106
ausgegebene und umlaufende Anteile		14.905		14.984		16.250
NIW je Anteil	SGD	16,32	SGD	15,80	SGD	18,90
Investor:						
thesaurierend	\$	33.204	\$	63.935	\$	92.993
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.575		3.170		3.850
NIW je Anteil	\$	21,08	\$	20,17	\$	24,16
Erträge	\$	12.287	\$	9.038	\$	31.044
ausgegebene und umlaufende Anteile		898		669		1.795
NIW je Anteil	\$	13,68	\$	13,51	\$	17,30
Investor CHF (Hedged):						
Erträge	CHF	1.598	CHF	2.516	CHF	5.139
ausgegebene und umlaufende Anteile		152		232		360
NIW je Anteil	CHF	10,53	CHF	10,85	CHF	14,28

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum		
	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	31. Dez. 2021
	Global Real Return Fund (Forts.)		
Investor EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 20.092	€ 22.838	€ 36.406
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.160	1.347	1.752
NIW je Anteil	€ 17,32	€ 16,95	€ 20,77
Administrative:			
thesaurierend	\$ 36.683	\$ 43.396	\$ 71.230
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.782	2.200	3.010
NIW je Anteil	\$ 20,59	\$ 19,73	\$ 23,66
Class E:			
thesaurierend	\$ 124.585	\$ 153.574	\$ 231.761
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.472	8.292	10.391
NIW je Anteil	\$ 19,25	\$ 18,52	\$ 22,30
Erträge	\$ 28.387	\$ 38.490	\$ 53.098
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.155	2.958	3.187
NIW je Anteil	\$ 13,17	\$ 13,01	\$ 16,66
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 216.460	€ 234.441	€ 321.175
ausgegebene und umlaufende Anteile	13.708	15.090	16.773
NIW je Anteil	€ 15,79	€ 15,54	€ 19,15
Class E 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
H Institutional:			
thesaurierend	\$ 145.477	\$ 90.138	\$ 150.924
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.639	4.307	6.032
NIW je Anteil	\$ 21,91	\$ 20,93	\$ 25,02
Class R:			
thesaurierend	\$ 903	\$ 1.569	\$ 7.292
ausgegebene und umlaufende Anteile	73	132	514
NIW je Anteil	\$ 12,40	\$ 11,85	\$ 14,18
Class R GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 6.705	£ 8.283	£ 12.683
ausgegebene und umlaufende Anteile	583	747	944
NIW je Anteil	£ 11,51	£ 11,09	£ 13,44
	Income Fund		
Nettovermögen	\$ 70.543.117	\$ 57.980.327	\$ 73.579.726
Institutional:			
thesaurierend	\$ 10.887.096	\$ 9.197.801	\$ 10.989.198
ausgegebene und umlaufende Anteile	634.431	582.256	643.353
NIW je Anteil	\$ 17,16	\$ 15,80	\$ 17,08
Erträge	\$ 5.004.823	\$ 4.597.148	\$ 5.308.194
ausgegebene und umlaufende Anteile	464.458	435.389	442.049
NIW je Anteil	\$ 10,78	\$ 10,56	\$ 12,01
Institutional AUD (Hedged):			
thesaurierend	AUD 100.109	AUD 80.591	AUD 96.588
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.864	7.611	8.329
NIW je Anteil	AUD 11,29	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

	Zum			
	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	
	Income Fund (Forts.)			
Erträge	AUD 246		k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	24		k. A.	k. A.
NIW je Anteil	AUD 10,23		k. A.	k. A.
Institutional BRL (Hedged):				
thesaurierend	\$ 353.963	\$ 274.136	\$ 561.362	
ausgegebene und umlaufende Anteile	20.644	20.003	43.619	
NIW je Anteil	\$ 17,15	\$ 13,70	\$ 12,87	
Institutional CAD (Hedged):				
thesaurierend	CAD 95.099	CAD 83.552	CAD 98.436	
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.208	6.821	7.406	
NIW je Anteil	CAD 13,19	CAD 12,25	CAD 13,29	
Erträge	CAD 122.367	CAD 117.940	CAD 138.770	
ausgegebene und umlaufende Anteile	13.288	12.956	13.346	
NIW je Anteil	CAD 9,21	CAD 9,10	CAD 10,40	
Institutional CHF (Hedged):				
thesaurierend	CHF 324.097	CHF 293.823	CHF 326.885	
ausgegebene und umlaufende Anteile	28.117	26.495	26.540	
NIW je Anteil	CHF 11,53	CHF 11,09	CHF 12,32	
Erträge	CHF 157.673	CHF 135.996	CHF 178.124	
ausgegebene und umlaufende Anteile	20.540	17.253	19.281	
NIW je Anteil	CHF 7,68	CHF 7,88	CHF 9,24	
Institutional EUR (Hedged):				
thesaurierend	€ 5.358.424	€ 4.856.302	€ 6.397.698	
ausgegebene und umlaufende Anteile	370.909	356.885	424.812	
NIW je Anteil	€ 14,45	€ 13,61	€ 15,06	
Erträge	€ 798.611	€ 858.841	€ 1.216.992	
ausgegebene und umlaufende Anteile	90.229	96.621	117.285	
NIW je Anteil	€ 8,85	€ 8,89	€ 10,38	
ausschüttend II	€ 23.567	€ 13.739	€ 21.567	
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.620	1.555	2.138	
NIW je Anteil	€ 8,99	€ 8,84	€ 10,09	
Institutional GBP (Hedged):				
thesaurierend	£ 249.561	£ 179.687	£ 223.422	
ausgegebene und umlaufende Anteile	22.404	17.378	19.797	
NIW je Anteil	£ 11,14	£ 10,34	£ 11,29	
Erträge	£ 583.372	£ 437.940	£ 465.680	
ausgegebene und umlaufende Anteile	63.749	48.401	44.776	
NIW je Anteil	£ 9,15	£ 9,05	£ 10,40	
Institutional HKD (Unhedged):				
Erträge	HKD 300.633	HKD 448.226	HKD 798.164	
ausgegebene und umlaufende Anteile	30.526	46.468	72.832	
NIW je Anteil	HKD 9,85	HKD 9,65	HKD 10,96	
Institutional JPY (Hedged):				
thesaurierend	k. A.	k. A.	¥ 255.548	
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	229	
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	¥ 1.118,00	
thesaurierend	¥ 2.154.442	k. A.	k. A.	
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.097	k. A.	k. A.	
NIW je Anteil	¥ 1.027,00	k. A.	k. A.	

	Income Fund (Forts.)			Income Fund (Forts.)			
	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	
Institutional NOK (Hedged): thesaurierend	NOK 2.372.450	NOK 2.153.310	NOK 2.187.743	CNH 105.901	CNH 66.886	CNH 124.077	
ausgegebene und umlaufende Anteile	20.619	19.915	18.488	ausgegebene und umlaufende Anteile	871	994	
NIW je Anteil	NOK 115,06	NOK 108,13	NOK 118,34	NIW je Anteil	CNH 121,55	CNH 124,87	
Institutional RMB (Hedged): thesaurierend	k. A.	k. A.	CNH 66	Investor SGD (Hedged): thesaurierend	SGD 17.361	SGD 6.150	SGD 1.979
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	1	ausgegebene und umlaufende Anteile	1.656	625	185
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	CNH 101,42	NIW je Anteil	SGD 10,48	SGD 9,84	SGD 10,70
Erträge	RMB 75	k. A.	k. A.	Erträge	SGD 69.437	SGD 47.450	SGD 67.208
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.	ausgegebene und umlaufende Anteile	7.811	5.340	6.605
NIW je Anteil	RMB 101,93	k. A.	k. A.	NIW je Anteil	SGD 8,89	SGD 8,89	SGD 10,18
Institutional SGD (Hedged): thesaurierend	SGD 99.211	SGD 57.007	SGD 46.472	Administrative: thesaurierend	\$ 912.884	\$ 744.526	\$ 912.059
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.134	5.614	4.222	ausgegebene und umlaufende Anteile	74.250	65.457	73.786
NIW je Anteil	SGD 10,86	SGD 10,15	SGD 11,01	NIW je Anteil	\$ 12,29	\$ 11,37	\$ 12,36
Erträge	SGD 411.788	SGD 233.054	SGD 277.493	Erträge	\$ 3.565.795	\$ 2.930.269	\$ 3.699.459
ausgegebene und umlaufende Anteile	43.143	24.522	25.607	ausgegebene und umlaufende Anteile	353.150	294.606	325.103
NIW je Anteil	SGD 9,54	SGD 9,50	SGD 10,84	NIW je Anteil	\$ 10,10	\$ 9,95	\$ 11,38
Investor: thesaurierend	\$ 2.002.496	\$ 1.938.128	\$ 2.841.494	Administrative AUD (Hedged): Erträge	AUD 406.120	AUD 286.887	AUD 316.049
ausgegebene und umlaufende Anteile	144.086	150.961	203.964	ausgegebene und umlaufende Anteile	45.885	32.273	30.677
NIW je Anteil	\$ 13,90	\$ 12,84	\$ 13,93	NIW je Anteil	AUD 8,85	AUD 8,89	AUD 10,30
Erträge	\$ 1.450.049	\$ 1.424.611	\$ 1.709.869	Administrative EUR (Hedged): thesaurierend	€ 85.658	€ 96.175	€ 193.792
ausgegebene und umlaufende Anteile	153.164	152.992	160.791	ausgegebene und umlaufende Anteile	7.555	8.961	16.228
NIW je Anteil	\$ 9,47	\$ 9,31	\$ 10,63	NIW je Anteil	€ 11,34	€ 10,73	€ 11,94
Investor AUD (Hedged): Erträge	AUD 84.018	AUD 64.155	AUD 73.714	Erträge	€ 305.892	€ 266.419	€ 308.049
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.724	7.404	7.348	ausgegebene und umlaufende Anteile	39.257	33.865	33.362
NIW je Anteil	AUD 8,64	AUD 8,66	AUD 10,03	NIW je Anteil	€ 7,79	€ 7,87	€ 9,23
Investor EUR (Hedged): thesaurierend	€ 226.229	€ 212.831	€ 508.040	Administrative GBP (Hedged): Erträge	£ 142.362	£ 112.506	£ 140.149
ausgegebene und umlaufende Anteile	19.795	19.702	42.352	ausgegebene und umlaufende Anteile	17.119	13.611	14.660
NIW je Anteil	€ 11,43	€ 10,80	€ 12,00	NIW je Anteil	£ 8,32	£ 8,27	£ 9,56
Erträge	€ 86.099	€ 75.705	€ 105.743	Administrative HKD (Unhedged): Erträge	HKD 4.564.281	HKD 3.221.408	HKD 4.681.912
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.198	9.766	11.634	ausgegebene und umlaufende Anteile	508.704	364.591	463.488
NIW je Anteil	€ 7,69	€ 7,75	€ 9,09	NIW je Anteil	HKD 8,97	HKD 8,84	HKD 10,10
ausschüttend A	€ 24.484	€ 29.277	€ 37.920	Administrative JPY (Hedged): thesaurierend	k. A.	k. A.	¥ 1.099
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.069	3.673	4.052	ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	1
NIW je Anteil	€ 7,98	€ 7,97	€ 9,36	NIW je Anteil	k. A.	k. A.	¥ 999,00
Investor GBP (Hedged): Erträge	£ 18.236	£ 16.799	£ 9.219	Administrative SGD (Hedged): Erträge	SGD 1.829.067	SGD 971.804	SGD 1.080.475
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.117	1.965	935	ausgegebene und umlaufende Anteile	186.853	99.186	96.129
NIW je Anteil	£ 8,62	£ 8,55	£ 9,86	NIW je Anteil	SGD 9,79	SGD 9,80	SGD 11,24
Investor HKD (Unhedged): Erträge	HKD 84	k. A.	k. A.	Class E: thesaurierend	\$ 5.787.064	\$ 4.837.460	\$ 6.088.898
ausgegebene und umlaufende Anteile	8	k. A.	k. A.	ausgegebene und umlaufende Anteile	372.334	335.073	386.539
NIW je Anteil	HKD 10,61	k. A.	k. A.	NIW je Anteil	\$ 15,54	\$ 14,44	\$ 15,75
Investor JPY (Hedged): thesaurierend	¥ 1.376	k. A.	k. A.				
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.				
NIW je Anteil	¥ 1.021,00	k. A.	k. A.				

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Income Fund (Forts.)		
Erträge	\$ 8.737.093	\$ 6.857.888	\$ 8.765.914
ausgegebene und umlaufende Anteile	911.535	723.233	804.221
NIW je Anteil	\$ 9,59	\$ 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
Class E AUD (Hedged):			
Erträge	AUD 799.635	AUD 595.621	AUD 699.187
ausgegebene und umlaufende Anteile	96.656	71.382	71.928
NIW je Anteil	AUD 8,27	AUD 8,34	AUD 9,72
Class E CHF (Hedged): thesaurierend	CHF 68.634	CHF 80.590	CHF 101.113
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.257	7.568	8.472
NIW je Anteil	CHF 10,97	CHF 10,65	CHF 11,93
Erträge	CHF 237.431	CHF 80.502	CHF 117.164
ausgegebene und umlaufende Anteile	34.173	11.178	13.731
NIW je Anteil	CHF 6,95	CHF 7,20	CHF 8,53
Class E EUR (Hedged): thesaurierend	€ 4.941.016	€ 4.356.288	€ 5.062.678
ausgegebene und umlaufende Anteile	377.958	350.614	364.865
NIW je Anteil	€ 13,07	€ 12,42	€ 13,88
Erträge	€ 3.451.544	€ 3.436.223	€ 4.359.865
ausgegebene und umlaufende Anteile	438.473	430.505	462.802
NIW je Anteil	€ 7,87	€ 7,98	€ 9,42
ausschüttend II	€ 158.809	€ 121.587	€ 125.779
ausgegebene und umlaufende Anteile	17.751	13.705	12.308
NIW je Anteil	€ 8,95	€ 8,87	€ 10,22
Ausschüttend II Q	€ 32.842	€ 38.028	€ 52.706
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.722	4.345	5.208
NIW je Anteil	€ 8,82	€ 8,75	€ 10,12
Class E GBP (Hedged):			
Erträge	£ 232.770	£ 208.926	£ 236.936
ausgegebene und umlaufende Anteile	29.126	26.188	25.560
NIW je Anteil	£ 7,99	£ 7,98	£ 9,27
Class E HKD (Unhedged):			
Erträge	HKD 4.105.214	HKD 3.442.414	HKD 4.704.540
ausgegebene und umlaufende Anteile	454.999	385.795	459.225
NIW je Anteil	HKD 9,02	HKD 8,92	HKD 10,24
Class E JPY (Hedged): thesaurierend	¥ 11.142.148	¥ 4.076.871	¥ 743.601
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.433	4.248	692
NIW je Anteil	¥ 975,00	¥ 960,00	¥ 1.075,00
Erträge	¥ 52.326.950	¥ 1.381	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	55.343	1	k. A.
NIW je Anteil	¥ 946,00	¥ 992,00	k. A.
Class E RMB (Hedged):			
Erträge	CNH 988.205	CNH 490.076	CNH 671.398
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.238	4.497	5.397
NIW je Anteil	CNH 106,97	CNH 108,97	CNH 124,39

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Income Fund (Forts.)		
Class E SGD (Hedged):			
Erträge	SGD 4.758.628	SGD 2.537.340	SGD 2.784.269
ausgegebene und umlaufende Anteile	551.466	292.512	278.445
NIW je Anteil	SGD 8,63	SGD 8,67	SGD 10,00
G Retail EUR (Hedged):			
Erträge	€ 81.915	€ 18.496	€ 29.724
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.629	2.393	3.263
NIW je Anteil	€ 7,71	€ 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	\$ 918.636	\$ 669.952	\$ 770.236
ausgegebene und umlaufende Anteile	76.610	60.591	64.313
NIW je Anteil	\$ 11,99	\$ 11,06	\$ 11,98
Erträge	\$ 452.440	\$ 287.285	\$ 333.808
ausgegebene und umlaufende Anteile	48.671	31.482	32.084
NIW je Anteil	\$ 9,30	\$ 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
Class R: thesaurierend	\$ 95.966	\$ 82.073	\$ 70.929
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.690	8.054	6.420
NIW je Anteil	\$ 11,04	\$ 10,19	\$ 11,05
Erträge	\$ 62.563	\$ 61.635	\$ 84.900
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.676	6.695	8.082
NIW je Anteil	\$ 9,37	\$ 9,21	\$ 10,50
Class R EUR (Hedged):			
Erträge	€ 12.323	€ 12.865	€ 16.112
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.511	1.567	1.678
NIW je Anteil	€ 8,15	€ 8,21	€ 9,60
Class R GBP (Hedged):			
Erträge	£ 25.773	£ 20.954	£ 33.995
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.706	2.220	3.123
NIW je Anteil	£ 9,52	£ 9,44	£ 10,88
Class T: thesaurierend	\$ 314.165	\$ 295.923	\$ 371.744
ausgegebene und umlaufende Anteile	24.722	24.971	28.634
NIW je Anteil	\$ 12,71	\$ 11,85	\$ 12,98
Erträge	\$ 115.745	\$ 102.600	\$ 130.671
ausgegebene und umlaufende Anteile	13.763	12.279	13.542
NIW je Anteil	\$ 8,41	\$ 8,36	\$ 9,65
Class T EUR (Hedged): thesaurierend	€ 252.546	€ 226.266	€ 268.086
ausgegebene und umlaufende Anteile	23.488	22.053	23.304
NIW je Anteil	€ 10,75	€ 10,26	€ 11,50
Erträge	€ 172.434	€ 165.117	€ 217.088
ausgegebene und umlaufende Anteile	24.832	23.351	25.890
NIW je Anteil	€ 6,94	€ 7,07	€ 8,38

	Zum		Zum		Zum	
	31. Dez. 2023		31. Dez. 2022		31. Dez. 2021	
	Income Fund (Forts.)					
Class Z:						
thesaurierend	\$	191.273	\$	219.519	\$	162.794
ausgegebene und umlaufende Anteile		10.499		13.161		9.076
NIW je Anteil	\$	18,22	\$	16,68	\$	17,94
Class Z AUD (Hedged):						
ausschüttend II	AUD	1.331.421	AUD	1.339.063	AUD	1.451.394
ausgegebene und umlaufende Anteile		134.703		136.394		129.096
NIW je Anteil	AUD	9,88	AUD	9,82	AUD	11,24
	Income Fund II					
Nettovermögen	\$	125.160	\$	56.623	\$	27.770
Institutional:						
thesaurierend	\$	24.344	\$	22.431	\$	24.374
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.396		2.396		2.396
NIW je Anteil	\$	10,16	\$	9,35	\$	10,17
Erträge		k. A.		k. A.		\$ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile		k. A.		k. A.		1
NIW je Anteil		k. A.		k. A.		\$ 9,94
Erträge	\$	11		k. A.		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		k. A.		k. A.
NIW je Anteil	\$	10,30		k. A.		k. A.
Class E:						
Erträge	\$	45.250	\$	17.894	\$	1.730
ausgegebene und umlaufende Anteile		5.130		2.069		174
NIW je Anteil	\$	8,82	\$	8,65	\$	9,92
Class E AUD (Hedged):						
Erträge	AUD	13.403	AUD	2.119	AUD	365
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.571		249		37
NIW je Anteil	AUD	8,53	AUD	8,52	AUD	9,90
Class E EUR (Hedged):						
Erträge	€	5.479	€	3.221	€	494
ausgegebene und umlaufende Anteile		658		385		50
NIW je Anteil	€	8,33	€	8,37	€	9,85
Class E GBP (Hedged):						
Erträge	£	12.067	£	2.810	£	196
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.396		329		20
NIW je Anteil	£	8,64	£	8,55	£	9,90
Class E HKD (Unhedged):						
Erträge	HKD	192.869	HKD	62.867	HKD	2.462
ausgegebene und umlaufende Anteile		21.739		7.226		247
NIW je Anteil	HKD	8,87	HKD	8,70	HKD	9,98
Class E JPY (Hedged):						
Erträge	¥	38.723		k. A.		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		38		k. A.		k. A.
NIW je Anteil	¥	1.029,00		k. A.		k. A.
Class E 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

	Zum		Zum		Zum	
	31. Dez. 2023		31. Dez. 2022		31. Dez. 2021	
	Inflation Multi-Asset Fund					
Nettovermögen	\$	253.248	\$	403.078	\$	164.345
Institutional:						
thesaurierend	\$	87.830	\$	83.455	\$	68.012
ausgegebene und umlaufende Anteile		7.446		7.503		5.798
NIW je Anteil	\$	11,80	\$	11,12	\$	11,73
Institutional EUR (Partially Hedged):						
thesaurierend	€	28.298	€	82.243	€	4.749
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.902		8.718		477
NIW je Anteil	€	9,75	€	9,43	€	9,96
Institutional GBP (Partially Hedged):						
thesaurierend	£	3.181	£	3.543	£	22.843
ausgegebene und umlaufende Anteile		266		308		1.924
NIW je Anteil	£	11,96	£	11,50	£	11,87
Administrative:						
ausschüttend II	\$	1.963	\$	2.961		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		223		338		k. A.
NIW je Anteil	\$	8,78	\$	8,75		k. A.
Administrative SGD (Hedged):						
ausschüttend II	SGD	5.209	SGD	10.723		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		585		1.197		k. A.
NIW je Anteil	SGD	8,90	SGD	8,95		k. A.
Class E:						
thesaurierend	\$	44.395	\$	85.842	\$	14.809
ausgegebene und umlaufende Anteile		4.268		8.673		1.405
NIW je Anteil	\$	10,40	\$	9,90	\$	10,54
ausschüttend II	\$	10	\$	9		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		1		k. A.
NIW je Anteil	\$	9,35	\$	9,27		k. A.
Class E AUD (Partially Hedged):						
thesaurierend	AUD	346	AUD	334		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		36		36		k. A.
NIW je Anteil	AUD	9,67	AUD	9,35		k. A.
Class E EUR (Partially Hedged):						
thesaurierend	€	64.630	€	110.990	€	33.996
ausgegebene und umlaufende Anteile		6.803		11.966		3.436
NIW je Anteil	€	9,50	€	9,28	€	9,89
Erträge	€	7.161	€	11.302	€	5.738
ausgegebene und umlaufende Anteile		833		1.312		608
NIW je Anteil	€	8,59	€	8,61	€	9,43
Class E GBP (Partially Hedged):						
thesaurierend	£	8	£	8		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		1		k. A.
NIW je Anteil	£	9,69	£	9,41		k. A.
Class E SGD (Partially Hedged):						
thesaurierend	SGD	14	SGD	13		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		1		k. A.
NIW je Anteil	SGD	9,67	SGD	9,35		k. A.
H Institutional:						
thesaurierend	\$	10	\$	9		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		1		k. A.
NIW je Anteil	\$	10,00	\$	9,45		k. A.
M Retail:						
ausschüttend II	\$	216	\$	9		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		23		1		k. A.
NIW je Anteil	\$	9,47	\$	9,32		k. A.
	Low Average Duration Fund					
Nettovermögen	\$	809.845	\$	1.072.758	\$	1.179.138
Institutional:						
thesaurierend	\$	520.962	\$	640.710	\$	747.732
ausgegebene und umlaufende Anteile		31.818		41.077		45.606
NIW je Anteil	\$	16,37	\$	15,60	\$	16,40

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Low Average Duration Fund (Forts.)			
Erträge	\$ 33.698	\$ 53.185	\$ 33.312
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.350	5.377	3.159
NIW je Anteil	\$ 10,06	\$ 9,89	\$ 10,54
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend	€ 23.355	€ 37.536	€ 35.456
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.338	3.864	3.402
NIW je Anteil	€ 9,99	€ 9,71	€ 10,42
Erträge	€ 3.340	€ 8.986	€ 10.023
ausgegebene und umlaufende Anteile	474	1.270	1.302
NIW je Anteil	€ 7,05	€ 7,08	€ 7,70
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend	£ 17.595	£ 17.044	£ 13.877
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.730	1.748	1.347
NIW je Anteil	£ 10,17	£ 9,75	£ 10,30
Erträge	£ 2.381	£ 3.285	£ 4.225
ausgegebene und umlaufende Anteile	264	367	439
NIW je Anteil	£ 9,01	£ 8,95	£ 9,64
Investor: thesaurierend	\$ 10.761	\$ 16.532	\$ 20.960
ausgegebene und umlaufende Anteile	703	1.131	1.359
NIW je Anteil	\$ 15,30	\$ 14,62	\$ 15,42
Erträge	\$ 1.454	\$ 2.022	\$ 7.973
ausgegebene und umlaufende Anteile	146	206	762
NIW je Anteil	\$ 9,98	\$ 9,81	\$ 10,46
Administrative: thesaurierend	\$ 8.728	\$ 10.755	\$ 11.016
ausgegebene und umlaufende Anteile	587	755	733
NIW je Anteil	\$ 14,87	\$ 14,24	\$ 15,04
Class E: thesaurierend	\$ 37.888	\$ 47.980	\$ 52.498
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.020	3.979	4.104
NIW je Anteil	\$ 12,55	\$ 12,06	\$ 12,79
Erträge	\$ 4.074	\$ 5.384	\$ 6.751
ausgegebene und umlaufende Anteile	393	528	621
NIW je Anteil	\$ 10,37	\$ 10,20	\$ 10,87
Class E EUR (Hedged): thesaurierend	€ 15.764	€ 25.480	€ 18.812
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.966	3.238	2.209
NIW je Anteil	€ 8,02	€ 7,87	€ 8,52
H Institutional: thesaurierend	\$ 113.500	\$ 186.190	\$ 186.367
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.245	15.891	15.108
NIW je Anteil	\$ 12,28	\$ 11,72	\$ 12,34
Erträge	\$ 1.267	\$ 1.521	\$ 7.574
ausgegebene und umlaufende Anteile	131	159	745
NIW je Anteil	\$ 9,69	\$ 9,54	\$ 10,16
Class R: thesaurierend	\$ 5.145	\$ 7.183	\$ 7.325
ausgegebene und umlaufende Anteile	470	687	665
NIW je Anteil	\$ 10,94	\$ 10,45	\$ 11,02
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund			
Nettovermögen	\$ 972.843	\$ 654.749	\$ 806.869
Institutional: thesaurierend	\$ 260.504	\$ 120.881	\$ 94.445
ausgegebene und umlaufende Anteile	21.237	10.562	7.805
NIW je Anteil	\$ 12,27	\$ 11,44	\$ 12,10
Erträge	\$ 17.872	\$ 17.001	\$ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.864	1.859	1
NIW je Anteil	\$ 9,59	\$ 9,15	\$ 9,82

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)			
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend	€ 547.196	€ 417.993	€ 520.319
ausgegebene und umlaufende Anteile	52.295	41.937	48.370
NIW je Anteil	€ 10,46	€ 9,97	€ 10,76
Erträge	€ 82	€ 133	€ 928
ausgegebene und umlaufende Anteile	9	15	95
NIW je Anteil	€ 9,15	€ 8,90	€ 9,75
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend	£ 16.669	£ 18.388	£ 18.462
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.453	1.708	1.611
NIW je Anteil	£ 11,47	£ 10,77	£ 11,46
Erträge	£ 3.766	£ 3.910	£ 18.096
ausgegebene und umlaufende Anteile	404	432	1.849
NIW je Anteil	£ 9,33	£ 9,06	£ 9,79
Institutional NOK (Hedged): thesaurierend	NOK 29.300	NOK 159.169	NOK 441.039
ausgegebene und umlaufende Anteile	276	1.581	4.119
NIW je Anteil	NOK 106,05	NOK 100,63	NOK 107,06
Institutional SEK (Hedged): thesaurierend	SEK 313.000	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.016	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	SEK 103,77	k. A.	k. A.
Class E EUR (Hedged): thesaurierend	€ 27.087	€ 25.901	€ 17.694
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.831	2.816	1.767
NIW je Anteil	€ 9,57	€ 9,20	€ 10,01
Low Duration Income Fund			
Nettovermögen	\$ 2.030.305	\$ 1.084.380	\$ 1.367.475
Institutional: thesaurierend	\$ 234.711	\$ 186.357	\$ 275.963
ausgegebene und umlaufende Anteile	19.914	17.111	24.381
NIW je Anteil	\$ 11,79	\$ 10,89	\$ 11,32
Erträge	\$ 302.944	\$ 11.734	\$ 13.398
ausgegebene und umlaufende Anteile	30.756	1.229	1.305
NIW je Anteil	\$ 9,85	\$ 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
thesaurierend	CHF 61.554	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.917	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	CHF 10,40	k. A.	k. A.
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend	€ 715.038	€ 633.070	€ 666.067
ausgegebene und umlaufende Anteile	67.973	63.769	63.153
NIW je Anteil	€ 10,52	€ 9,93	€ 10,55
Erträge	€ 9	€ 8	€ 60.301
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	6.036
NIW je Anteil	€ 9,22	€ 9,14	€ 9,99

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Low Duration Income Fund (Forts.)			
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 215.265	£ 3.280	£ 5.158
ausgegebene und umlaufende Anteile	19.315	316	475
NIW je Anteil	£ 11,14	£ 10,37	£ 10,85
Erträge	£ 117.567	£ 50.073	£ 130.935
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.705	5.539	13.372
NIW je Anteil	£ 9,25	£ 9,04	£ 9,79
Institutional SGD (Hedged):			
thesaurierend	SGD 19.310	SGD 15.840	SGD 19.822
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.789	1.566	1.883
NIW je Anteil	SGD 10,79	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
Class E:			
thesaurierend	\$ 56.816	\$ 27.537	\$ 16.491
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.058	2.629	1.502
NIW je Anteil	\$ 11,23	\$ 10,47	\$ 10,98
Erträge	\$ 7.583	\$ 8.193	\$ 9.075
ausgegebene und umlaufende Anteile	802	885	904
NIW je Anteil	\$ 9,45	\$ 9,25	\$ 10,04
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 85.839	€ 31.442	€ 16.611
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.571	3.297	1.625
NIW je Anteil	€ 10,01	€ 9,54	€ 10,22
Erträge	€ 9.989	€ 2.708	€ 1.014
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.188	322	109
NIW je Anteil	€ 8,41	€ 8,42	€ 9,34
Class E 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	\$ 17.331	\$ 62.043	\$ 3.622
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.587	6.136	344
NIW je Anteil	\$ 10,92	\$ 10,11	\$ 10,53
Erträge	\$ 3.119	\$ 418	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	324	45	k. A.
NIW je Anteil	\$ 9,62	\$ 9,34	k. A.
Class Z EUR (Hedged):			
thesaurierend	k. A.	€ 9	€ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	1	1
NIW je Anteil	k. A.	€ 10,21	€ 10,79
Low Duration Opportunities Fund			
Nettovermögen	\$ 787.624	\$ 1.345.781	\$ 3.217.260
Institutional:			
thesaurierend	\$ 93.820	\$ 61.036	\$ 142.348
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.007	5.569	12.027
NIW je Anteil	\$ 11,72	\$ 10,96	\$ 11,84
Erträge	\$ 25.780	\$ 33.224	\$ 41.508
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.619	3.555	4.051
NIW je Anteil	\$ 9,84	\$ 9,35	\$ 10,25
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 16.441	€ 23.753	€ 41.652
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.637	2.478	3.940
NIW je Anteil	€ 10,04	€ 9,58	€ 10,57

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Low Duration Opportunities Fund (Forts.)			
Erträge	€ 219	€ 10.599	€ 12.374
ausgegebene und umlaufende Anteile	25	1.244	1.297
NIW je Anteil	€ 8,78	€ 8,52	€ 9,54
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 236.099	£ 713.035	£ 1.734.093
ausgegebene und umlaufende Anteile	21.651	69.498	155.485
NIW je Anteil	£ 10,90	£ 10,26	£ 11,15
Erträge	£ 268.433	£ 288.970	£ 447.455
ausgegebene und umlaufende Anteile	28.510	31.985	44.752
NIW je Anteil	£ 9,42	£ 9,03	£ 10,00
Investor EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 2.996	€ 4.406	€ 8.109
ausgegebene und umlaufende Anteile	316	485	806
NIW je Anteil	€ 9,49	€ 9,09	€ 10,06
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 2.828	€ 3.102	€ 4.360
ausgegebene und umlaufende Anteile	307	350	443
NIW je Anteil	€ 9,21	€ 8,86	€ 9,84
Class Z:			
thesaurierend	\$ 10	\$ 1.534	\$ 2.989
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	166	301
NIW je Anteil	\$ 9,93	\$ 9,24	\$ 9,93
Low Duration Opportunities ESG Fund			
Nettovermögen	\$ 5.221	\$ 4.928	
Institutional:			
thesaurierend	\$ 4.672	\$ 4.426	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	447	446	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,45	\$ 9,90	k. A.
Erträge	\$ 10	\$ 10	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,02	\$ 9,81	k. A.
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 233	€ 225	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	23	23	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,11	€ 9,78	k. A.
Erträge	€ 9	€ 9	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	€ 9,69	€ 9,69	k. A.
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 204	£ 194	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	20	20	k. A.
NIW je Anteil	£ 10,33	£ 9,85	k. A.
Erträge	£ 8	£ 8	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	£ 9,86	£ 9,75	k. A.
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund			
Nettovermögen	\$ 98.493	\$ 120.137	\$ 100.538
Institutional:			
thesaurierend	\$ 13.881	\$ 21.492	\$ 21.487
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.194	2.114	2.658
NIW je Anteil	\$ 11,62	\$ 10,17	\$ 8,08
Erträge	\$ 8.737	\$ 10.469	\$ 29.680
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.274	1.678	5.697
NIW je Anteil	\$ 6,86	\$ 6,24	\$ 5,21
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 37.825	€ 41.892	€ 19.141
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.910	4.844	2.714
NIW je Anteil	€ 9,67	€ 8,65	€ 7,05

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund (Forts.)			
Erträge	€ 1.792	€ 3.309	€ 2.062
ausgegebene und umlaufende Anteile	315	625	455
NIW je Anteil	€ 5,69	€ 5,29	€ 4,54
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend	£ 1.418	£ 1.415	£ 1.362
ausgegebene und umlaufende Anteile	143	162	193
NIW je Anteil	£ 9,94	£ 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
Class E: Erträge	\$ 20.293	\$ 23.893	\$ 10.905
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.294	4.223	2.287
NIW je Anteil	\$ 6,16	\$ 5,66	\$ 4,77
Class Z: thesaurierend	\$ 10.013	\$ 14.340	\$ 11.293
ausgegebene und umlaufende Anteile	674	1.113	1.113
NIW je Anteil	\$ 14,87	\$ 12,88	\$ 10,14
Mortgage Opportunities Fund			
Nettovermögen	\$ 925.256	\$ 849.148	\$ 2.238.424
Institutional: thesaurierend	\$ 418.366	\$ 409.011	\$ 558.563
ausgegebene und umlaufende Anteile	36.426	38.104	47.581
NIW je Anteil	\$ 11,49	\$ 10,73	\$ 11,74
Erträge	\$ 36.446	\$ 94.373	\$ 351.769
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.056	10.759	35.231
NIW je Anteil	\$ 8,99	\$ 8,77	\$ 9,98
Institutional CAD (Hedged): thesaurierend	CAD 41.430	CAD 23.438	CAD 25.659
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.206	2.532	2.532
NIW je Anteil	CAD 9,85	CAD 9,26	CAD 10,14
Institutional CHF (Hedged): thesaurierend	CHF 2.643	CHF 3.010	CHF 5.577
ausgegebene und umlaufende Anteile	275	322	532
NIW je Anteil	CHF 9,59	CHF 9,34	CHF 10,47
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend	€ 251.283	€ 192.977	€ 317.357
ausgegebene und umlaufende Anteile	25.105	20.209	29.769
NIW je Anteil	€ 10,01	€ 9,55	€ 10,66
Erträge	€ 9.804	€ 14.970	€ 26.722
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.252	1.923	2.953
NIW je Anteil	€ 7,83	€ 7,78	€ 9,05
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend	£ 4.831	£ 7.355	£ 19.288
ausgegebene und umlaufende Anteile	449	727	1.733
NIW je Anteil	£ 10,76	£ 10,12	£ 11,13
Erträge	£ 10.837	£ 6.104	£ 5.764
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.289	740	609
NIW je Anteil	£ 8,40	£ 8,25	£ 9,46
Investor: thesaurierend	\$ 19.812	\$ 20.219	\$ 32.611
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.804	1.963	2.885
NIW je Anteil	\$ 10,98	\$ 10,30	\$ 11,30
Erträge	\$ 5.989	\$ 4.762	\$ 19.104
ausgegebene und umlaufende Anteile	666	543	1.914
NIW je Anteil	\$ 8,99	\$ 8,77	\$ 9,98

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Mortgage Opportunities Fund (Forts.)			
Administrative: Erträge	k. A.	\$ 44	\$ 540
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	5	54
NIW je Anteil	k. A.	\$ 8,77	\$ 9,98
Class E: thesaurierend	\$ 59.228	\$ 43.823	\$ 58.797
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.485	4.304	5.232
NIW je Anteil	\$ 10,80	\$ 10,18	\$ 11,24
Erträge	\$ 11.408	\$ 4.351	\$ 10.154
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.271	496	1.017
NIW je Anteil	\$ 8,97	\$ 8,77	\$ 9,99
Class E CHF (Hedged): Erträge	k. A.	CHF 166	CHF 319
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	22	36
NIW je Anteil	k. A.	CHF 7,55	CHF 8,82
Class E EUR (Hedged): thesaurierend	€ 10.172	€ 12.803	€ 16.220
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.082	1.415	1.591
NIW je Anteil	€ 9,40	€ 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
Class E 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	\$ 3.119	\$ 39	\$ 71
ausgegebene und umlaufende Anteile	295	4	7
NIW je Anteil	\$ 10,56	\$ 9,88	\$ 10,83
Erträge	\$ 935	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	91	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,32	k. A.	k. A.
Class Z: thesaurierend	\$ 15.772	\$ 10	\$ 214.716
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.497	1	19.628
NIW je Anteil	\$ 10,54	\$ 9,78	\$ 10,94
Class Z 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	\$ 1.962.988	\$ 1.008.739	\$ 3.761.156
Institutional: thesaurierend	\$ 1.336.603	\$ 581.668	\$ 2.349.757
ausgegebene und umlaufende Anteile	22.608	12.422	39.164
NIW je Anteil	\$ 59,12	\$ 46,83	\$ 60,00
Erträge	\$ 33.385	\$ 24.829	\$ 39.901
ausgegebene und umlaufende Anteile	811	734	913
NIW je Anteil	\$ 41,15	\$ 33,81	\$ 43,69

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
StocksPLUS™ Fund (Forts.)			
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend	€ 135.929	€ 131.649	€ 570.050
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.150	4.953	16.237
NIW je Anteil	€ 32,75	€ 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	k. A.	£ 3.922	£ 199
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	456	18
NIW je Anteil	k. A.	£ 8,60	£ 11,28
Institutional SGD (Hedged): thesaurierend	k. A.	SGD 335	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	38	k. A.
NIW je Anteil	k. A.	SGD 8,76	k. A.
Investor: thesaurierend	\$ 26.850	\$ 19.778	\$ 21.609
ausgegebene und umlaufende Anteile	494	458	389
NIW je Anteil	\$ 54,31	\$ 43,17	\$ 55,51
BE Retail: thesaurierend	\$ 6.299	\$ 9	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	588	1	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,72	\$ 8,66	k. A.
Class E: thesaurierend	\$ 214.093	\$ 165.517	\$ 175.651
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.225	4.087	3.355
NIW je Anteil	\$ 50,67	\$ 40,50	\$ 52,35
Class E EUR (Hedged): thesaurierend	€ 101.366	€ 35.366	€ 13.927
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.177	2.632	777
NIW je Anteil	€ 16,41	€ 13,44	€ 17,91
H Institutional: thesaurierend	\$ 83.630	\$ 33.724	\$ 504.831
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.672	2.884	33.635
NIW je Anteil	\$ 14,74	\$ 11,69	\$ 15,01
Class T: 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			
Nettvermögen	\$ 11.175	\$ 9.528	\$ 11.610
Institutional: thesaurierend	\$ 11.175	\$ 9.327	\$ 10.848
ausgegebene und umlaufende Anteile	625	663	603
NIW je Anteil	\$ 17,89	\$ 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	k. A.	£ 167	£ 198
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	19	18
NIW je Anteil	k. A.	£ 8,59	£ 11,24
Class E: thesaurierend	k. A.	k. A.	\$ 34
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	2
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	\$ 17,53
Strategic Income Fund			
Nettvermögen	\$ 449.949	\$ 506.557	\$ 619.928
Institutional: thesaurierend	\$ 20.423	\$ 21.761	\$ 33.080
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.656	1.939	2.754
NIW je Anteil	\$ 12,33	\$ 11,22	\$ 12,01

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Strategic Income Fund (Forts.)			
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend	€ 143.972	€ 168.023	€ 207.426
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.480	13.134	14.906
NIW je Anteil	€ 13,74	€ 12,79	€ 13,92
Institutional GBP (Hedged): Erträge	£ 219	£ 201	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	22	21	k. A.
NIW je Anteil	£ 10,01	£ 9,67	k. A.
Class E: thesaurierend	\$ 33.466	\$ 37.001	\$ 35.991
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.314	2.786	2.509
NIW je Anteil	\$ 14,46	\$ 13,28	\$ 14,34
ausschüttend II	\$ 17.325	\$ 18.150	\$ 18.959
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.838	1.989	1.828
NIW je Anteil	\$ 9,42	\$ 9,13	\$ 10,37
Class E EUR (Hedged): thesaurierend	€ 111.233	€ 133.817	€ 140.034
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.879	11.367	10.837
NIW je Anteil	€ 12,53	€ 11,77	€ 12,92
ausschüttend II	€ 66.793	€ 76.984	€ 94.373
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.196	9.528	10.105
NIW je Anteil	€ 8,15	€ 8,08	€ 9,34
Class T EUR (Hedged): thesaurierend	€ 13.470	€ 15.503	€ 17.708
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.209	1.475	1.529
NIW je Anteil	€ 11,14	€ 10,51	€ 11,58
Erträge	€ 7.135	€ 8.019	€ 8.185
ausgegebene und umlaufende Anteile	789	908	817
NIW je Anteil	€ 9,05	€ 8,83	€ 10,02
Total Return Bond Fund			
Nettvermögen	\$ 4.420.051	\$ 4.150.717	\$ 4.944.898
Institutional: thesaurierend	\$ 1.615.253	\$ 1.419.973	\$ 1.598.195
ausgegebene und umlaufende Anteile	52.631	49.161	46.882
NIW je Anteil	\$ 30,69	\$ 28,88	\$ 34,09
Erträge	\$ 125.064	\$ 112.085	\$ 174.533
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.283	7.634	9.829
NIW je Anteil	\$ 15,10	\$ 14,68	\$ 17,76
Institutional CAD (Hedged): Erträge	CAD 12.612	CAD 13.555	CAD 26.323
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.448	1.587	2.540
NIW je Anteil	CAD 8,71	CAD 8,54	CAD 10,36
Institutional CHF (Hedged): thesaurierend	CHF 6.050	CHF 3.138	CHF 13.206
ausgegebene und umlaufende Anteile	608	320	1.111
NIW je Anteil	CHF 9,96	CHF 9,79	CHF 11,88
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend	€ 393.477	€ 388.231	€ 358.693
ausgegebene und umlaufende Anteile	19.584	20.056	15.344
NIW je Anteil	€ 20,09	€ 19,36	€ 23,38

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021		Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
				Total Return Bond Fund (Forts.)			
Erträge	€ 215.481	€ 212.408	€ 260.110	Class E EUR (Hedged):	€ 433.274	€ 471.035	€ 623.265
ausgegebene und umlaufende Anteile	18.302	18.120	17.931	thesaurierend			
NIW je Anteil	€ 11,77	€ 11,72	€ 14,51	ausgegebene und umlaufende Anteile	25.285	28.276	30.705
Institutional EUR (Unhedged):				NIW je Anteil	€ 17,14	€ 16,66	€ 20,30
thesaurierend	€ 7.459	€ 19.929	€ 14.618	Erträge	€ 34.883	€ 40.476	€ 54.687
ausgegebene und umlaufende Anteile	269	736	488	ausgegebene und umlaufende Anteile	4.443	5.177	5.655
NIW je Anteil	€ 27,78	€ 27,06	€ 29,97	NIW je Anteil	€ 7,85	€ 7,82	€ 9,67
Institutional GBP (Hedged):				Class E EUR (Unhedged):			
thesaurierend	£ 7.797	£ 3.621	£ 5.534	thesaurierend	k. A.	€ 489	€ 710
ausgegebene und umlaufende Anteile	605	296	379	ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	51	67
NIW je Anteil	£ 12,89	£ 12,24	£ 14,59	NIW je Anteil	k. A.	€ 9,53	€ 10,65
Erträge	£ 19.631	£ 29.067	£ 43.763	Class E HKD (Unhedged):			
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.347	3.543	4.355	thesaurierend	k. A.	HKD 1.568	HKD 3.128
NIW je Anteil	£ 8,36	£ 8,20	£ 10,05	ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	155	259
Institutional ILS (Hedged):				NIW je Anteil	k. A.	HKD 10,15	HKD 12,07
thesaurierend	k. A.	k. A.	ILS 185	Class E SGD (Hedged):			
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	13	thesaurierend	SGD 32.839	SGD 30.035	SGD 38.699
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	ILS 14,41	ausgegebene und umlaufende Anteile	874	828	894
Institutional SGD (Hedged):				NIW je Anteil	SGD 37,59	SGD 36,28	SGD 43,30
thesaurierend	SGD 7.871	SGD 7.941	SGD 21.940	H Institutional:			
ausgegebene und umlaufende Anteile	618	652	1.524	thesaurierend	\$ 197.186	\$ 115.199	\$ 199.555
NIW je Anteil	SGD 12,73	SGD 12,17	SGD 14,40	ausgegebene und umlaufende Anteile	6.643	4.116	6.033
Investor:				NIW je Anteil	\$ 29,68	\$ 27,98	\$ 33,08
thesaurierend	\$ 352.467	\$ 409.533	\$ 369.122	Erträge	\$ 10.522	\$ 8.589	\$ 17.255
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.551	15.440	11.750	ausgegebene und umlaufende Anteile	1.137	954	1.585
NIW je Anteil	\$ 28,08	\$ 26,52	\$ 31,41	NIW je Anteil	\$ 9,26	\$ 9,00	\$ 10,89
Erträge	\$ 50.617	\$ 67.693	\$ 35.775	M Retail HKD (Unhedged):			
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.305	4.545	1.987	Erträge	HKD 84.232	HKD 76.242	HKD 91.252
NIW je Anteil	\$ 15,31	\$ 14,89	\$ 18,01	ausgegebene und umlaufende Anteile	9.270	8.622	8.552
Investor CHF (Hedged):				NIW je Anteil	HKD 9,09	HKD 8,84	HKD 10,67
thesaurierend	CHF 2.342	CHF 2.893	CHF 4.784	Class R EUR (Hedged):			
ausgegebene und umlaufende Anteile	246	307	417	thesaurierend	€ 2.254	€ 2.836	€ 5.974
NIW je Anteil	CHF 9,53	CHF 9,41	CHF 11,46	ausgegebene und umlaufende Anteile	236	308	535
Investor EUR (Hedged):				NIW je Anteil	€ 9,54	€ 9,22	€ 11,16
thesaurierend	€ 17.085	€ 18.868	€ 19.262	Class T:			
ausgegebene und umlaufende Anteile	909	1.038	874	thesaurierend	\$ 5.824	\$ 6.382	\$ 13.697
NIW je Anteil	€ 18,80	€ 18,18	€ 22,03	ausgegebene und umlaufende Anteile	567	652	1.172
Administrative:				NIW je Anteil	\$ 10,27	\$ 9,79	\$ 11,69
thesaurierend	\$ 128.181	\$ 130.283	\$ 159.690	Class T EUR (Hedged):			
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.630	4.975	5.141	thesaurierend	€ 4.804	€ 4.426	€ 4.561
NIW je Anteil	\$ 27,69	\$ 26,19	\$ 31,06	ausgegebene und umlaufende Anteile	549	518	437
Erträge	\$ 51.477	\$ 4.583	k. A.	NIW je Anteil	€ 8,76	€ 8,54	€ 10,44
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.263	482	k. A.				
NIW je Anteil	\$ 9,78	\$ 9,51	k. A.	PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund			
Administrative EUR (Hedged):				Nettovermögen	\$ 240.346	\$ 435.924	\$ 101.789
thesaurierend	€ 2.760	€ 2.966	€ 1.953	Institutional:			
ausgegebene und umlaufende Anteile	246	273	148	thesaurierend	\$ 92.466	\$ 183.555	\$ 70.982
NIW je Anteil	€ 11,20	€ 10,84	€ 13,16	ausgegebene und umlaufende Anteile	7.501	14.361	6.152
Administrative SGD (Hedged):				NIW je Anteil	\$ 12,33	\$ 12,78	\$ 11,54
Erträge	SGD 14	k. A.	k. A.	Institutional EUR (Hedged):			
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.	thesaurierend	€ 5.945	€ 121.520	€ 11.436
NIW je Anteil	SGD 10,06	k. A.	k. A.	ausgegebene und umlaufende Anteile	555	10.765	1.108
Class E:				NIW je Anteil	€ 10,71	€ 11,29	€ 10,32
thesaurierend	\$ 407.981	\$ 380.803	\$ 478.210	Institutional GBP (Hedged):			
ausgegebene und umlaufende Anteile	15.599	15.332	16.167	thesaurierend	£ 245	£ 9	k. A.
NIW je Anteil	\$ 26,15	\$ 24,84	\$ 29,58	ausgegebene und umlaufende Anteile	26	1	k. A.
Erträge	\$ 139.042	\$ 151.164	\$ 199.962	NIW je Anteil	£ 9,51	£ 9,88	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.101	13.526	14.801	Erträge	£ 46.771	£ 31.132	k. A.
NIW je Anteil	\$ 11,49	\$ 11,18	\$ 13,51	ausgegebene und umlaufende Anteile	5.378	3.333	k. A.
Class E CHF (Hedged):				NIW je Anteil	£ 8,70	£ 9,34	k. A.
thesaurierend	CHF 10.506	CHF 9.731	CHF 5.648				
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.250	1.166	553				
NIW je Anteil	CHF 8,40	CHF 8,34	CHF 10,22				

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Forts.)			
Investor:			
thesaurierend	\$ 4.741	\$ 9	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	523	1	k. A.
NIW je Anteil	\$ 9,06	\$ 9,43	k. A.
Investor EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 9	€ 9	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	€ 8,87	€ 9,39	k. A.
Class E:			
thesaurierend	\$ 12.105	\$ 11.079	\$ 2.886
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.078	941	269
NIW je Anteil	\$ 11,23	\$ 11,78	\$ 10,74
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 12.722	€ 17.465	€ 1.747
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.305	1.680	182
NIW je Anteil	€ 9,75	€ 10,40	€ 9,61
H Institutional:			
thesaurierend	\$ 877	\$ 43	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	90	4	k. A.
NIW je Anteil	\$ 9,76	\$ 10,13	k. A.
Class Z:			
thesaurierend	\$ 49.591	\$ 55.435	\$ 12.929
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.534	4.958	1.299
NIW je Anteil	\$ 10,94	\$ 11,18	\$ 9,95
UK Corporate Bond Fund			
Nettvermögen	£ 361.061	£ 389.173	£ 592.164
Institutional:			
thesaurierend	£ 43.923	£ 46.355	£ 75.231
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.210	2.532	3.348
NIW je Anteil	£ 19,87	£ 18,31	£ 22,47
Erträge	£ 245.303	£ 276.939	£ 436.466
ausgegebene und umlaufende Anteile	27.741	32.956	41.393
NIW je Anteil	£ 8,84	£ 8,40	£ 10,54
Class Z:			
thesaurierend	£ 71.835	£ 65.879	£ 80.467
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.715	7.715	7.715
NIW je Anteil	£ 9,31	£ 8,54	£ 10,43
UK Long Term Corporate Bond Fund			
Nettvermögen	£ 324.768	£ 325.020	£ 425.748
Institutional:			
thesaurierend	£ 286.707	£ 283.958	£ 366.869
ausgegebene und umlaufende Anteile	13.320	14.455	13.155
NIW je Anteil	£ 21,52	£ 19,65	£ 27,89
Erträge	£ 38.061	£ 41.062	£ 58.879
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.228	3.656	3.578
NIW je Anteil	£ 11,79	£ 11,23	£ 16,45
US High Yield Bond Fund			
Nettvermögen	\$ 1.872.887	\$ 1.984.922	\$ 3.923.786
Institutional:			
thesaurierend	\$ 681.351	\$ 780.024	\$ 1.665.090
ausgegebene und umlaufende Anteile	16.860	21.785	40.803
NIW je Anteil	\$ 40,41	\$ 35,80	\$ 40,81
Erträge	\$ 215.871	\$ 233.780	\$ 400.716
ausgegebene und umlaufende Anteile	24.177	27.877	39.668
NIW je Anteil	\$ 8,93	\$ 8,39	\$ 10,10
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

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
US High Yield Bond Fund (Forts.)			
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 219.196	€ 240.268	€ 482.095
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.285	8.811	15.170
NIW je Anteil	€ 30,09	€ 27,27	€ 31,78
Erträge	€ 21.347	€ 33.678	€ 138.522
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.144	3.520	11.751
NIW je Anteil	€ 9,96	€ 9,57	€ 11,79
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 30.402	£ 40.143	£ 48.533
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.294	1.913	2.009
NIW je Anteil	£ 23,49	£ 20,99	£ 24,16
Erträge	£ 2.283	£ 1.108	£ 5.115
ausgegebene und umlaufende Anteile	269	138	522
NIW je Anteil	£ 8,48	£ 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	\$ 240.439	\$ 236.934	\$ 434.782
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.689	7.413	11.894
NIW je Anteil	\$ 35,95	\$ 31,96	\$ 36,56
Erträge	\$ 17.026	\$ 20.862	\$ 37.431
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.356	3.073	4.581
NIW je Anteil	\$ 7,23	\$ 6,79	\$ 8,17
Investor EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 2.811	€ 2.708	€ 3.173
ausgegebene und umlaufende Anteile	104	110	110
NIW je Anteil	€ 27,04	€ 24,59	€ 28,78
Class E:			
thesaurierend	\$ 130.888	\$ 132.559	\$ 225.933
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.797	4.302	6.375
NIW je Anteil	\$ 34,47	\$ 30,82	\$ 35,44
Erträge	\$ 68.093	\$ 58.679	\$ 124.742
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.147	6.557	11.581
NIW je Anteil	\$ 9,53	\$ 8,95	\$ 10,77
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 50.468	€ 56.406	€ 77.393
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.969	2.407	2.808
NIW je Anteil	€ 25,63	€ 23,44	€ 27,56
H Institutional:			
thesaurierend	\$ 114.190	\$ 88.253	\$ 139.658
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.926	2.548	3.532
NIW je Anteil	\$ 39,02	\$ 34,63	\$ 39,54
Erträge	\$ 5.515	\$ 2.482	\$ 3.370
ausgegebene und umlaufende Anteile	625	299	337
NIW je Anteil	\$ 8,83	\$ 8,29	\$ 9,99
M Retail:			
Erträge	\$ 16.293	\$ 12.265	\$ 4.154
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.687	1.351	381
NIW je Anteil	\$ 9,66	\$ 9,08	\$ 10,91
Class R:			
thesaurierend	\$ 4.113	\$ 5.477	\$ 4.914
ausgegebene und umlaufende Anteile	258	387	304
NIW je Anteil	\$ 15,95	\$ 14,17	\$ 16,18
Class Z:			
thesaurierend	\$ 12.870	\$ 8.528	\$ 9.666
ausgegebene und umlaufende Anteile	879	661	661
NIW je Anteil	\$ 14,65	\$ 12,91	\$ 14,63

	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
US Investment Grade Corporate Bond Fund			
Nettovermögen	\$ 480.861	\$ 388.522	\$ 878.100
Institutional:			
thesaurierend	\$ 232.236	\$ 151.061	\$ 132.646
ausgegebene und umlaufende Anteile	20.229	14.307	10.461
NIW je Anteil	\$ 11,48	\$ 10,56	\$ 12,68
Erträge	\$ 66.032	\$ 61.577	\$ 63.781
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.392	7.201	5.999
NIW je Anteil	\$ 8,93	\$ 8,55	\$ 10,63
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 80.273	€ 124.155	€ 214.560
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.188	13.447	18.908
NIW je Anteil	€ 9,80	€ 9,23	€ 11,35
Institutional GBP (Hedged):			
ausschüttend II	£ 27.296	£ 13.692	£ 304.200
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.477	1.794	31.489
NIW je Anteil	£ 7,85	£ 7,63	£ 9,66
Class E:			
thesaurierend	\$ 49.311	\$ 21.852	\$ 17.627
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.243	2.504	1.667
NIW je Anteil	\$ 9,40	\$ 8,73	\$ 10,58
Erträge	\$ 7.652	\$ 5.002	\$ 8.025
ausgegebene und umlaufende Anteile	844	576	743
NIW je Anteil	\$ 9,07	\$ 8,68	\$ 10,80
H Institutional:			
thesaurierend	\$ 2.160	\$ 55	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	204	6	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,56	\$ 9,73	k. A.
US Short-Term Fund			
Nettovermögen	\$ 1.854.206	\$ 2.310.115	\$ 2.650.198
Institutional:			
thesaurierend	\$ 573.993	\$ 865.421	\$ 835.096
ausgegebene und umlaufende Anteile	47.741	76.197	73.558
NIW je Anteil	\$ 12,02	\$ 11,36	\$ 11,35
Erträge	\$ 123.753	\$ 131.027	\$ 102.552
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.302	13.207	10.172
NIW je Anteil	\$ 10,06	\$ 9,92	\$ 10,08
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 68.515	€ 202.833	€ 233.199
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.659	20.470	23.092
NIW je Anteil	€ 10,29	€ 9,91	€ 10,10
Institutional GBP (Hedged):			
Erträge	£ 207	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	21	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	£ 10,07	k. A.	k. A.
Investor:			
thesaurierend	\$ 7.368	\$ 12.829	\$ 18.474
ausgegebene und umlaufende Anteile	633	1.164	1.671
NIW je Anteil	\$ 11,63	\$ 11,02	\$ 11,06
Class E:			
thesaurierend	\$ 412.185	\$ 412.347	\$ 467.026
ausgegebene und umlaufende Anteile	35.571	37.521	42.334
NIW je Anteil	\$ 11,59	\$ 10,99	\$ 11,03
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 18.008	€ 44.471	€ 9.227
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.824	4.656	944
NIW je Anteil	€ 9,88	€ 9,55	€ 9,77
H Institutional:			
thesaurierend	\$ 18.000	\$ 22.367	\$ 33.914
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.634	2.147	3.250
NIW je Anteil	\$ 11,01	\$ 10,42	\$ 10,44
Class Z:			
Erträge	\$ 623.066	\$ 602.189	\$ 917.450
ausgegebene und umlaufende Anteile	61.599	60.375	90.541
NIW je Anteil	\$ 10,11	\$ 9,97	\$ 10,13

20. 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 vorangehenden Ausführungen gelten lediglich zum 31. Dezember 2023.

21. KREDITFAZILITÄT

PIMCO Funds: Global Investors Series plc, handelnd für den PIMCO Asia High Yield Bond Fund, den Global High Yield Bond Fund und den US High Yield Bond Fund (zusammen die „Teilfonds“ und jeweils ein „Teilfonds“) hat am 18. August 2023 eine vierte geänderte und neu gefasste Kreditfazilität (die „Kreditvereinbarung“) zwischen u.a. den Fonds und bestimmten Darlehensgebern, einschließlich MUFG Bank Ltd., („MUFG“) (als Kreditgeber) und MUFG in ihrer Funktion als Agent und Lead Arranger abgeschlossen.

Jeder Teilfonds ist befugt, die Fazilität für vorübergehende Zwecke in Übereinstimmung mit der Anlagepolitik des jeweiligen Teilfonds zu nutzen.

Der Gesamtbetrag, der für eine Nutzung durch die Teilfonds zur Verfügung steht, beläuft sich vorbehaltlich der Bestimmungen der Kreditvereinbarung auf USD 240.000.000. Die Unterlimes für die einzelnen Teilfonds sind: Für den Global High Yield Bond Fund 95.000.000 USD; für den US High Yield Bond Fund 60.000.000 USD und für den PIMCO Asia High Yield Bond Fund 85.000.000 USD. Der Gesamtbetrag, der den Teilfonds zusammen mit den anderen Kreditnehmern (zusammen die „Kreditnehmer“) zur Verfügung steht, beläuft sich vorbehaltlich der den Bedingungen der Kreditvereinbarung auf 268.000.000 USD (der „Gesamtbetrag der Zusage“). Die Kreditnehmer können vorbehaltlich der Bedingungen der Kreditvereinbarung eine Erhöhung um bis zu 332.000.000 USD des Gesamtbetrags der Zusage beantragen (bis zu einem Höchstbetrag der erhöhten Zusage von 600.000.000 USD). 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 Teilfonds selbst, welcher Zinssatz für das jeweilige Darlehen gilt. Hierbei wird der geltende Zinssatz durch Bezugnahme auf (i) die Alternate Base Rate (alternativer Basiszinssatz) oder (ii) die Adjusted Daily Simple SOFR bestimmt.

Die Alternate Base Rate beträgt für jeden Tag den höheren Wert aus (i) der Federal Funds Rate (wie in der Kreditvereinbarung definiert) oder (ii) der Overnight Bank Funding Rate (wie in der Kreditvereinbarung definiert), die an diesem Tag gilt. Jedes Darlehen, das zur Alternate Base Rate verzinst wird, wird für den ausstehenden Kapitalbetrag für den Zeitraum vom Tag der Darlehensgewährung bis zum Tag der vollständigen Rückzahlung des Darlehens zu einem Jahreszinssatz verzinst, der der Alternate Base Rate zuzüglich der Applicable Margin (1,125 %) entspricht.

Die Adjusted Daily Simple SOFR ist ein jährlicher Zinssatz, der gleich (a) der Daily Simple SOFR (wie in der Kreditvereinbarung definiert) zuzüglich (b) 0,10 % ist. Jeder Kredit, dessen Zinsen unter Bezugnahme auf den Adjusted Daily Simple SOFR berechnet werden, wird für den ausstehenden Kapitalbetrag für den Zeitraum, der mit dem Datum der Gewährung des Kredits beginnt bzw. bis zum Datum der vollständigen Rückzahlung des Kredits läuft, mit einem Jahreszins verzinst, der dem Adjusted Daily Simple SOFR zuzüglich der Applicable Margin (1,125 %) entspricht.

Jede Kreditaufnahme ist vorbehaltlich der Bedingungen der Kreditvereinbarung 60 Tage nach Inanspruchnahme oder am 16. August 2024 rückzahlbar, je nachdem, welches Datum früher liegt, es sei denn, sie ist gemäß den Bedingungen der Kreditvereinbarung früher rückzahlbar.

Sämtliche Kredite werden auf unbesicherter Basis gewährt, und der Rückgriff der Kreditgeber gegenüber einem Fonds ist auf die Vermögenswerte des betreffenden Fonds beschränkt.

Zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 hatte keiner der Teilfonds im Rahmen der Kreditvereinbarung Kredite in Anspruch genommen.

22. VERORDNUNG ÜBER WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTE

Die Richtlinie über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Securities Financing Transactions Regulation, „SFTR“) führt Melde- und Offenlegungspflichten für Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Securities Financing Transactions, „SFTs“) und Total Return Swaps ein. SFTs sind gemäß Artikel 3(11) der SFTR folgendermaßen konkret definiert:

- Pensionsgeschäfte/umgekehrte Pensionsgeschäfte
- Wertpapier- oder Rohstoffleihgeschäfte
- Buy-Sellback- oder Rückkaufgeschäfte
- Lombardgeschäfte

(a) Globale Daten und Konzentration von SFT-Kontrahenten

Zum 31. Dezember 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 31. Dezember 2023 wie nachfolgend angeben (wenn weniger als zehn Kontrahenten verwendet werden, sind alle Kontrahenten aufgeführt).

Fonds	31. Dez. 2023	
	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
PIMCO Asia High Yield Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
SSB	\$ 3.856	0,16
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(12.951)	(0,53)
Asia Strategic Interest Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
SSB	\$ 252	0,14
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(505)	(0,28)
PIMCO Balanced Income and Growth Fund		
Total Return Swaps		
CBK	\$ (34)	(0,01)
MEI	28	0,01
MYI	(261)	(0,04)
Summe	(267)	(0,04)
Pensionsgeschäfte		
DEU	9.600	1,43
FICC	2.484	0,37
SSB	520	0,08
Summe	12.604	1,88
PIMCO Capital Securities Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 7.572	0,15
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(34.160)	(0,66)
BRC	(5.159)	(0,10)
IND	(29.387)	(0,57)
JPS	(42.901)	(0,84)
MYI	(13.355)	(0,26)
RCE	(2.375)	(0,05)
SCX	(52.323)	(1,02)
WFS	(52.545)	(1,02)
Summe	(232.205)	(4,52)
PIMCO Climate Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
BOS	\$ 5.800	2,21
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
JML	(803)	(0,31)

Fonds	31. Dez. 2023	
	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
Commodity Real Return Fund		
Total Return Swaps		
BPS	\$ (394)	(0,05)
CBK	(588)	(0,07)
CIB	(27)	0,00
GST	(866)	(0,10)
JPM	(794)	(0,09)
MAC	(422)	(0,05)
MEI	(33)	(0,01)
SOG	(7)	0,00
Summe	(3.131)	(0,37)
Pensionsgeschäfte		
BPS	40.300	4,69
FICC	42.718	4,98
Summe	83.018	9,67
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BSN	(61.063)	(7,11)
CIB	(293.867)	(34,21)
GRE	(41.128)	(4,79)
Summe	(396.058)	(46,11)
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund		
Total Return Swaps		
BPS	\$ (366)	(0,37)
Pensionsgeschäfte		
SSB	737	0,74
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
GRE	(2.942)	(2,94)
Diversified Income Fund		
Pensionsgeschäfte		
BSN	\$ 83.422	1,12
CEW	910.056	12,24
DEU	81.400	1,09
FICC	104.525	1,40
IND	42.068	0,57
Summe	1.221.471	16,42
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(1.261)	(0,02)
BRC	(22.929)	(0,31)
JML	(14.371)	(0,19)
MYI	(11.115)	(0,15)
Summe	(49.676)	(0,67)
Diversified Income Duration Hedged Fund		
Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ 32.300	7,82
BSN	34.900	8,46
FICC	2.352	0,57
Summe	69.552	16,85
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
JML	(529)	(0,13)
Diversified Income ESG Fund		
Pensionsgeschäfte		
BOS	\$ 3.000	5,21
Dynamic Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ 382.440	11,10
BRC	136.900	3,97
DEU	160.000	4,64
FICC	55.076	1,60
Summe	734.416	21,31
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(537)	(0,01)
JML	(192)	(0,01)
MBC	(625)	(0,02)
Summe	(1.354)	(0,04)

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

Fonds	31. Dez. 2023		Fonds	31. Dez. 2023	
	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens		Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
Dynamic Multi-Asset Fund			Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund		
Total Return Swaps			Pensionsgeschäfte		
BOA	€ (347)	(0,01)	SSB	\$ 158	0,79
BPS	(11)	0,00			
JPM	30	0,00	PIMCO ESG Income Fund		
RBC	67	0,00	Pensionsgeschäfte		
Summe	(261)	(0,01)	BOS	\$ 8.200	3,02
Pensionsgeschäfte					
BPS	256.700	7,86	Euro Bond Fund		
CEW	70.000	2,15	Pensionsgeschäfte		
FICC	32.149	0,99	COM	€ 95.300	5,70
Summe	358.849	11,00	FICC	2.281	0,14
			Summe	97.581	5,84
Emerging Local Bond Fund			Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			BPS	(1.041)	(0,06)
BPS	\$ (103.811)	(3,60)			
BRC	(154.191)	(5,36)	Euro Credit Fund		
JML	(6.409)	(0,22)	Pensionsgeschäfte		
MBC	(16.938)	(0,59)	BPS	€ 13.700	2,55
Summe	(281.349)	(9,77)	FICC	737	0,14
			Summe	14.437	2,69
Emerging Local Bond ESG Fund			Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
Pensionsgeschäfte			BPS	(1.403)	(0,26)
BPS	\$ 15.600	15,23	JML	(6.045)	(1,12)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			MBC	(728)	(0,14)
BPS	(722)	(0,70)	Summe	(8.176)	(1,52)
Emerging Markets Bond Fund			Euro Income Bond Fund		
Pensionsgeschäfte			Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 2.599	0,07	COM	€ 133.900	9,66
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			FICC	4.075	0,29
BPS	(122.193)	(3,19)	Summe	137.975	9,95
BRC	(7.473)	(0,19)	Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BSN	(180.824)	(4,70)	BPS	(324)	(0,03)
MYI	(5.169)	(0,13)	BRC	(3.765)	(0,27)
NOM	(9.980)	(0,26)	JML	(179)	(0,01)
SCX	(77.088)	(2,00)	Summe	(4.268)	(0,31)
Summe	(402.727)	(10,47)			
			Euro Long Average Duration Fund		
Emerging Markets Bond ESG Fund			Pensionsgeschäfte		
Pensionsgeschäfte			BPS	€ 50.700	5,48
DEU	\$ 3.400	0,13	FICC	1.634	0,18
FICC	3.494	0,13	Summe	52.334	5,66
SAL	6.800	0,25	Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
Summe	13.694	0,51	BRC	(10.485)	(1,13)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte					
BPS	(74.306)	(2,76)	Euro Short-Term Fund		
BRC	(17.281)	(0,65)	Pensionsgeschäfte		
BSN	(15.443)	(0,57)	BPS	€ 12.400	6,41
MYI	(22.112)	(0,81)			
SCX	(49.858)	(1,85)	PIMCO European High Yield Bond Fund		
TDM	(35.833)	(1,33)	Pensionsgeschäfte		
Summe	(214.833)	(7,97)	BPS	€ 30.300	8,24
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte			Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BRC	(44.884)	(1,66)	BPS	(601)	(0,17)
GSC	(11.781)	(0,44)	MYI	(1.257)	(0,34)
Summe	(56.665)	(2,10)	Summe	(1.858)	(0,51)
Emerging Markets Corporate Bond Fund			PIMCO European Short-Term Opportunities Fund		
Pensionsgeschäfte			Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 993	0,63	BPS	€ 1.000	0,77
Umgekehrte Pensionsgeschäfte					
BPS	(166)	(0,11)	Global Advantage Fund		
			Pensionsgeschäfte		
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund			FICC	\$ 534	0,12
Pensionsgeschäfte					
SSB	\$ 6.274	2,22	Global Bond Fund		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			Pensionsgeschäfte		
BOS	(5.271)	(1,86)	BPS	\$ 76.000	0,58
			CEW	159.260	1,22
			FICC	93.314	0,71
			IND	43.343	0,33
			Summe	371.917	2,84
			Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
			BPS	(328)	0,00
			JML	(289)	0,00
			Summe	(617)	0,00

Fonds	31. Dez. 2023		Fonds	31. Dez. 2023	
	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens		Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
Global Bond ESG Fund			Income Fund		
Pensionsgeschäfte			Total Return Swaps		
BOS	\$ 91.000	2,56	MYC	\$ (28)	0,00
FICC	74.958	2,10	Pensionsgeschäfte		
Summe	165.958	4,66	CEW	265.433	0,38
			FICC	9.035	0,01
Global Bond Ex-US Fund			Summe	274.468	0,39
Total Return Swaps			Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ (1.160)	(0,14)	JML	(495)	0,00
JPM	(368)	(0,05)			
MYC	(85)	(0,01)	Income Fund II		
Summe	(1.613)	(0,20)	Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
Pensionsgeschäfte			MSC	\$ (3.572)	(2,85)
FICC	1.005	0,13			
Global High Yield Bond Fund			Inflation Multi-Asset Fund		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			Total Return Swaps		
BPS	\$ (3.690)	(0,12)	BOA	\$ 0	0,00
BRC	(1.985)	(0,07)	CBK	(32)	(0,01)
BSN	(6.109)	(0,21)	JPM	(154)	(0,06)
JML	(6.912)	(0,23)	MAC	(178)	(0,07)
MYI	(1.421)	(0,05)	MYI	0	0,00
TDM	(436)	(0,01)	Summe	(364)	(0,14)
Summe	(20.553)	(0,69)	Pensionsgeschäfte		
Global Investment Grade Credit Fund			SSB	364	0,14
Pensionsgeschäfte			Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
CEW	\$ 151.676	1,41	GRE	(15.063)	(5,95)
DEU	22.200	0,21	Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
FICC	3.237	0,03	TDM	(1.229)	(0,49)
Summe	177.113	1,65	Low Average Duration Fund		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			Pensionsgeschäfte		
BPS	(4.457)	(0,04)	FICC	\$ 59.744	7,38
BRC	(2.084)	(0,02)	JPS	100	0,01
JML	(1.287)	(0,01)	SAL	40.900	5,05
Summe	(7.828)	(0,07)	Summe	100.744	12,44
Global Investment Grade Credit ESG Fund			Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
Pensionsgeschäfte			STR	(525.595)	(64,90)
SSB	\$ 1.300	0,06	Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			MSC	(44.279)	(5,47)
BOS	(2.191)	(0,10)	Low Duration Global Investment Grade Credit Fund		
BPS	(617)	(0,03)	Pensionsgeschäfte		
BRC	(30.730)	(1,42)	FICC	\$ 678	0,07
JML	(1.755)	(0,08)	Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
MBC	(382)	(0,02)	BOS	(6.973)	(0,72)
SCX	(72.357)	(3,33)	Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
Summe	(108.032)	(4,98)	BRC	(4.817)	(0,50)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte			Low Duration Income Fund		
BPG	(36.861)	(1,70)	Pensionsgeschäfte		
Global Low Duration Real Return Fund			BOS	\$ 6.700	0,33
Pensionsgeschäfte			BRC	65.000	3,20
FICC	\$ 2.889	0,25	CEW	204.763	10,09
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			FICC	69.021	3,40
BOS	(3.872)	(0,33)	Summe	345.484	17,02
BRC	(9.365)	(0,80)	Low Duration Opportunities Fund		
CIB	(604.777)	(51,38)	Pensionsgeschäfte		
Summe	(618.014)	(52,51)	FICC	\$ 2.805	0,36
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte			Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPG	(2.463)	(0,21)	BPS	(268)	(0,04)
TDM	(22.223)	(1,89)	SCX	(14.817)	(1,88)
Summe	(24.686)	(2,10)	Summe	(15.085)	(1,92)
Global Real Return Fund			PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund		
Pensionsgeschäfte			Total Return Swaps		
FICC	\$ 2.878	0,12	BOA	\$ (113)	(0,12)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			CBK	(13)	(0,01)
CIB	(193.455)	(8,13)	FAR	(3)	(0,00)
NOM	(378.792)	(15,91)	JPM	(69)	(0,07)
SCX	(70.474)	(2,96)	MYI	(53)	(0,05)
STR	(914.247)	(38,39)	Summe	(251)	(0,25)
Summe	(1.556.968)	(65,39)	Pensionsgeschäfte		
			SSB	631	0,64

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

Fonds	31. Dez. 2023	
	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
Mortgage Opportunities Fund		
Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ 31.900	3,45
FICC	37.068	4,00
Summe	68.968	7,45
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	(55.855)	(6,04)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
BPG	(823)	(0,09)
StocksPLUS™ Fund		
Total Return Swaps		
CBK	\$ (214)	(0,01)
FAR	(1.104)	(0,06)
JPM	(1.272)	(0,06)
RBC	(3.302)	(0,16)
TOR	(8)	0,00
UAG	(69)	(0,01)
Summe	(5.969)	(0,30)
Pensionsgeschäfte		
BOS	130.000	6,62
BPS	99.700	5,08
BRC	38.800	1,98
DEU	11.000	0,56
FICC	1.388	0,07
GSC	50.000	2,55
SAL	155.000	7,89
TDM	58.700	2,99
Summe	544.588	27,74
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund		
Total Return Swaps		
BOA	\$ (3)	(0,02)
BRC	(5)	(0,05)
CBK	(7)	(0,07)
RBC	(27)	(0,24)
Summe	(42)	(0,38)
Pensionsgeschäfte		
BOS	900	8,05
SSB	195	1,75
Summe	1.095	9,80
Strategic Income Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 605	0,13
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
GRE	(29.197)	(6,49)
SCX	(3.928)	(0,87)
Summe	(33.125)	(7,36)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
TDM	(1.037)	(0,23)
Total Return Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 732	0,02
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BRC	(1.947)	(0,04)
MBC	(1.299)	(0,03)
Summe	(3.246)	(0,07)
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund		
Total Return Swaps		
MEI	\$ 506	0,21
Pensionsgeschäfte		
DEU	17.200	7,15
SSB	1.266	0,53
Summe	18.466	7,68

Fonds	31. Dez. 2023	
	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
UK Corporate Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	£ 255	0,07
SCX	5.200	1,44
Summe	5.455	1,51
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(506)	(0,14)
MEI	(20.086)	(5,56)
Summe	(20.592)	(5,70)
UK Long Term Corporate Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
SCX	£ 6.500	2,00
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(168)	(0,05)
CEW	(2.697)	(0,83)
MEI	(1.081)	(0,34)
Summe	(3.946)	(1,22)
US High Yield Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 912	0,05
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	(6.071)	(0,33)
BPS	(1.042)	(0,05)
MYI	(1.087)	(0,06)
Summe	(8.200)	(0,44)
US Investment Grade Corporate Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 259	0,05
US Short-Term Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 4.561	0,25
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
BPG	(32.279)	(1,74)
MSC	(11.615)	(0,63)
Summe	(43.894)	(2,37)

Zum 31. Dezember 2022 hielten die Fonds Total Return Swaps und die folgenden Arten von SFTs:

- Pensionsgeschäfte
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte
- Sale-Buyback-Geschäfte

Der Marktwert von Vermögenswerten/(Verbindlichkeiten) über alle SFTs und Total Return Swaps hinweg, jeweils gruppiert nach SFT-Art(en), und die zehn größten Kontrahenten gestalteten sich zum 31. Dezember 2022 wie nachfolgend angegeben (wenn weniger als zehn Kontrahenten verwendet werden, sind alle Kontrahenten aufgeführt).

Fonds	31. Dez. 2022	
	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
PIMCO Asia High Yield Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
SSB	\$ 20.572	0,69
Asia Strategic Interest Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
SSB	\$ 820	0,26
PIMCO Balanced Income and Growth 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

Fonds	31. Dez. 2022		Fonds	31. Dez. 2022	
	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens		Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
Pensionsgeschäfte					
BPS	\$ 7.300	0,97	Dynamic Bond Fund		
FICC	11.236	1,50	Pensionsgeschäfte		
Summe	18.536	2,47	BRC	\$ 1.055.700	30,31
			FICC	2.892	0,08
PIMCO Capital Securities Fund			SAL	87.100	2,50
Pensionsgeschäfte			Summe	1.145.692	32,89
FICC	\$ 10.172	0,18	Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			DBL	(2.164)	(0,06)
BPS	(71.348)	(1,25)			
BRC	(4.860)	(0,08)	Dynamic Multi-Asset Fund		
BYR	(59.977)	(1,05)	Total Return Swaps		
FBF	(2.857)	(0,05)	BPS	€ 440	0,01
IND	(171.111)	(2,98)	JPM	146	0,00
JML	(135.138)	(2,36)	MEI	80	0,00
SCX	(133.184)	(2,34)	Summe	666	0,01
Summe	(578.475)	(10,11)	Pensionsgeschäfte		
			BPS	22.818	0,45
PIMCO Climate Bond Fund			CDI	100.000	1,96
Pensionsgeschäfte			FICC	1.786	0,03
TDM	\$ 36.800	12,57	Summe	124.604	2,44
			Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
Commodity Real Return Fund			BPS	(17.828)	(0,35)
Total Return Swaps					
BPS	\$ (2.955)	(0,21)	Emerging Local Bond Fund		
CBK	(2.457)	(0,18)	Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
CIB	(334)	(0,02)	BPS	\$ (39.132)	(2,04)
FBF	(181)	(0,01)	BRC	(46.181)	(2,41)
GST	(3.476)	(0,25)	Summe	(85.313)	(4,45)
JPM	(345)	(0,03)			
MAC	1.137	0,08	Emerging Markets Bond Fund		
MEI	(251)	(0,02)	Pensionsgeschäfte		
SOG	(497)	(0,04)	FICC	\$ 9.160	0,28
Summe	(9.359)	(0,68)	Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
Pensionsgeschäfte			BPS	(36.659)	(1,11)
FICC	613	0,04	BRC	(16.023)	(0,48)
IND	58.500	4,28	MBC	(1.622)	(0,05)
Summe	59.113	4,32	MEI	(21.052)	(0,64)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			Summe	(75.356)	(2,28)
BOS	(485)	(0,04)			
CIB	(331.976)	(24,23)	Emerging Markets Bond ESG Fund		
GRE	(67.687)	(4,94)	Pensionsgeschäfte		
RCY	(25.154)	(1,84)	FICC	\$ 9.261	0,37
Summe	(425.302)	(31,05)	NOM	35.400	1,42
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte			Summe	44.661	1,79
BOS	(17.959)	(1,31)	Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
			BPS	(21.023)	(0,84)
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund			BRC	(6.168)	(0,25)
Total Return Swaps			MEI	(4.460)	(0,18)
BPS	\$ (160)	(0,16)	NOM	(7.189)	(0,29)
Pensionsgeschäfte			Summe	(38.840)	(1,56)
BPS	6.300	6,48			
FICC	610	0,63	Emerging Markets Corporate Bond Fund		
Summe	6.910	7,11	Pensionsgeschäfte		
			BPS	\$ 6.100	3,61
Diversified Income Fund			FICC	2.286	1,35
Pensionsgeschäfte			Summe	8.386	4,96
BOS	\$ 500.000	5,71			
BRC	568.200	6,49	PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund		
CIB	580.100	6,63	Pensionsgeschäfte		
FICC	41.323	0,47	SSB	\$ 706	0,35
MBC	56.700	0,65			
Summe	1.746.323	19,95	Emerging Markets Short-Term Local		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			Currency Fund		
BRC	(4.363)	(0,05)	Pensionsgeschäfte		
JML	(2.283)	(0,03)	SAL	\$ 2.500	11,95
Summe	(6.646)	(0,08)	SSB	266	1,27
			Summe	2.766	13,22
Diversified Income Duration Hedged Fund					
Pensionsgeschäfte			PIMCO ESG Income Fund		
FICC	\$ 102.832	18,21	Pensionsgeschäfte		
			BPS	\$ 44.400	18,66

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

Fonds	31. Dez. 2022	
	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
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
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
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 Nettovermögens
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
MCB	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)

Fonds	31. Dez. 2022		Fonds	31. Dez. 2022	
	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens		Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
Inflation Multi-Asset Fund			StocksPLUS™ Fund		
Total Return Swaps			Total Return Swaps		
BPS	\$ (373)	(0,09)	FAR	\$ (1.148)	(0,11)
BRC	(21)	(0,01)	MBC	(120)	(0,01)
CBK	(76)	(0,02)	RBC	(1.063)	(0,11)
GST	(118)	(0,03)	UBS	(35)	(0,01)
JPM	17	0,00	Summe	(2.366)	(0,24)
MAC	192	0,05	Pensionsgeschäfte		
MYI	(362)	(0,09)	BOS	20.300	2,01
SOG	(48)	(0,01)	FICC	14.743	1,46
Summe	(789)	(0,20)	NOM	60.000	5,95
Pensionsgeschäfte			SGY	24.500	2,43
GSC	37.700	9,34	TOR	36.902	3,67
SSB	3.020	0,76	Summe	156.445	15,52
Summe	40.720	10,10			
Low Average Duration Fund			PIMCO StocksPLUS™ AR Fund		
Pensionsgeschäfte			Total Return Swaps		
FICC	\$ 956	0,09	BRC	\$ (4)	(0,04)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			FAR	(16)	(0,16)
BOS	(128.895)	(12,01)	RBC	(17)	(0,19)
GRE	(15.962)	(1,49)	Summe	(37)	(0,39)
Summe	(144.857)	(13,50)	Pensionsgeschäfte		
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte			BPS	1.200	12,59
CSN	(4.077)	(0,38)	SSB	174	1,83
			Summe	1.374	14,42
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund			Strategic Income Fund		
Pensionsgeschäfte			Total Return Swaps		
FICC	\$ 1.604	0,24	GST	\$ (4)	0,00
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			Pensionsgeschäfte		
BOS	(2.415)	(0,37)	FICC	781	0,15
BRC	(607)	(0,09)			
GRE	(9.754)	(1,49)	Total Return Bond Fund		
Summe	(12.776)	(1,95)	Pensionsgeschäfte		
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte			BOS	\$ 26.100	0,63
BPG	(1.409)	(0,22)	FICC	144.795	3,49
			Summe	170.895	4,12
Low Duration Income Fund			Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
Total Return Swaps			BRC	(1.745)	(0,04)
GST	\$ (2)	0,00	Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
Pensionsgeschäfte			BPG	(76.809)	(1,85)
FICC	5.431	0,50			
MBC	93.400	8,61	PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund		
Summe	98.831	9,11	Total Return Swaps		
Low Duration Opportunities Fund			MEI	\$ (165)	(0,04)
Pensionsgeschäfte			Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 118.800	8,83	BPS	22.700	5,21
			SSB	4.752	1,09
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund			Summe	27.452	6,30
Total Return Swaps			UK Corporate Bond Fund		
BOA	\$ (130)	(0,10)	Pensionsgeschäfte		
CBK	(8)	(0,01)	FICC	£ 177	0,05
FAR	(18)	(0,01)	UK Long Term Corporate Bond Fund		
JPM	(1)	0,00	Pensionsgeschäfte		
MYI	16	0,01	FICC	£ 269	0,08
Summe	(141)	(0,11)	US High Yield Bond Fund		
Pensionsgeschäfte			Pensionsgeschäfte		
SSB	811	0,68	FICC	\$ 9.269	0,47
Mortgage Opportunities Fund			US Investment Grade Corporate Bond Fund		
Pensionsgeschäfte			Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ 13.700	1,61	BOS	\$ 12.800	3,30
FICC	3.618	0,43	FICC	2.583	0,66
Summe	17.318	2,04	Summe	15.383	3,96
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
CIB	(264.111)	(31,10)	BPG	(38.655)	(9,95)
JPS	(724)	(0,09)	US Short-Term Fund		
RCY	(23.192)	(2,73)	Pensionsgeschäfte		
SCX	(28.466)	(3,35)	FICC	\$ 154.472	6,69
Summe	(316.493)	(37,27)			

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

(b) Sicherheiten

(i) Verwahrung erhaltener Sicherheiten:

Die zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 erhaltenen Sicherheiten wurden im 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 31. Dezember 2023 wie folgt. Wenn weniger als zehn Emittenten vorliegen, sind alle Emittenten nachfolgend aufgeführt:

Fonds	Zum 31. Dez. 2023	
	Sicherheitenemittent	Marktwert (000S)
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	\$ 3.933
Asia Strategic Interest Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	257
PIMCO Balanced Income and Growth Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	12.888
PIMCO Capital Securities Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	7.724
PIMCO Climate Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	5.930
Commodity Real Return Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	84.755
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	752
Diversified Income Fund	Canada Government	1.042.215
	United Kingdom Government	43.772
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	189.743
Diversified Income Duration Hedged Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	71.060
Diversified Income ESG Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	3.067
Dynamic Bond Fund	Freddie Mac	104
	United Kingdom Government	413.260
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	360.307
Dynamic Multi-Asset Fund	Regierung von Belgien	€ 253.574
	Europäische Union	72.014
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	32.792
Emerging Local Bond ESG Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	\$ 15.987
Emerging Markets Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	2.651
Emerging Markets Bond ESG Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	13.986
Emerging Markets Corporate Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.013
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	6.400
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	161
PIMCO ESG Income Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	8.383
Euro Bond Fund	Germany Government	€ 99.142
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	2.327
Euro Credit Fund	Regierung von Belgien	13.533
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	752
Euro Income Bond Fund	Germany Government	137.888
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	4.156
Euro Long Average Duration Fund	Bpifrance SACA	51.761
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.667
	Bpifrance SACA	12.736
Euro Short-Term Fund		
PIMCO European High Yield Bond Fund	Regierung von Belgien	29.918
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	Regierung von Belgien	987
Global Advantage Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	\$ 545
Global Bond Fund	Canada Government	162.36-
	United Kingdom Government	45.099
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	172.784
Global Bond ESG Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	169.340
Global Bond Ex-US Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.025
Global Investment Grade Credit Fund	Canada Government	159.576
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	25.972
Global Investment Grade Credit ESG Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.326

Fonds	Zum 31. Dez. 2023	
	Sicherheitenemittent	Marktwert (000S)
Global Low Duration Real Return Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	\$ 2.947
Global Real Return Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	2.936
Income Fund	Canada Government	271.720
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	9.216
Inflation Multi-Asset Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	371
Low Average Duration Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	102.823
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	692
Low Duration Income Fund	Canada Government	210.724
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	143.518
Low Duration Opportunities Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	2.861
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	644
Mortgage Opportunities Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	70.406
StocksPLUS™ Fund	Freddie Mac	40.217
	Ginnie Mae	135.354
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	384.551
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.120
Strategic Income Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	617
Total Return Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	747
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	18.899
UK Corporate Bond Fund	United Kingdom Government	£ 5.300
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	260
UK Long Term Corporate Bond Fund	Regierung des Vereinigten Königreichs	6.625
US High Yield Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	\$ 930
US Investment Grade Corporate Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	264
US Short-Term Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	4.652

Die zehn größten Emittenten von Wertpapieren, die als Sicherheiten über sämtliche SFTs hinweg erhalten wurden, gestalteten sich zum 31. Dezember 2022 wie folgt. Wenn weniger als zehn Emittenten vorliegen, sind alle Emittenten nachfolgend aufgeführt:

Fonds	Zum 31. Dez. 2022	
	Sicherheitenemittent	Marktwert (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 Balanced Income and Growth Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	18.879
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 fuer Wiederaufbau	161
	Landwirtschaftliche Rentenbank	4.907
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.822
Emerging Markets Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	\$ 9.343

Fonds	Zum 31. Dez. 2022	
	Sicherheitenemittent	Marktwert (000S)
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 fuer Wiederaufbau	4.431
	Landwirtschaftliche Rentenbank	8.536
	Land Nordrhein-Westfalen	837
	UNEDIC	1.626
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	940
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 fuer Wiederaufbau	1.517
	BNG Bank NV	14.286
Euro Short-Term Fund	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	3.743
PIMCO European High Yield Bond Fund	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	4.454
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	\$ 1.436
Global Advantage Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.378.007
Global Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.181.854
Global Bond ESG Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.658
Global Bond Ex-US Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	11.642

Fonds	Zum 31. Dez. 2022	
	Sicherheitenemittent	Marktwert (000S)
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
Mortgage Opportunities Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	17.694
StocksPLUS™ Fund	Canada Government	36.902
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	122.051
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.405
Strategic Income Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	797
Total Return Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	174.491
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	28.016
UK Corporate Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	£ 181
UK Long Term Corporate Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	274
US High Yield Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	\$ 9.454
US Investment Grade Corporate Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	15.768
US Short-Term Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	157.561

(iii) Aggregierte Transaktionsdaten:

Die aggregierten Transaktionsdaten für Sicherheitenpositionen (einschließlich von Barmitteln), die über sämtliche SFTs und Total Return Swaps hinweg erhalten wurden, gestalteten sich zum 31. Dezember 2023 wie folgt:

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art der Sicherheiten	Marktwert (000S)		Fälligkeitsprofil der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Gründungsland des Kontrahenten	Abrechnung und Clearing	
				Qualität	Marktwert					
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	\$	3.933	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel		630	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
Asia Strategic Interest Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury		257	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO Balanced Income and Growth Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury		9.824	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury		3.064	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO Capital Securities Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury		7.724	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel		6.850	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel		5.779	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		Morgan Stanley U.S. Treasury Bonds	Unternehmensanleihen		5.707	A-	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	EUROCLEAR, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury		1.678	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO Climate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury		5.930	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Commodity Real Return Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel		10	k. A.	k. A.	USD	Australien	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel		1.480	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel		1.660	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury		41.183	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury		43.572	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel		935	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury		777	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Kanada	FED, Bilateral

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art der Sicherheiten	Marktwert (000S)	Qualität	Fälligkeitsprofil der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Gründungsland des Kontrahenten	Abrechnung und Clearing
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	\$ 752	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Diversified Income Fund	Pensionsgeschäfte	Canada Government International Bond	Treasury	84.905	AA+	Mehr als 1 Jahr	CAD	Kanada	CANADA, Bilateral
		Province of Ontario	Treasury	155.333	AA-	3 Monate - 1 Jahr	CAD	Vereinigte Staaten	CANADA, Bilateral
		Province of Ontario	Treasury	674.322	AA-	Mehr als 1 Jahr	CAD	Vereinigte Staaten	CANADA, Bilateral
		Province of Quebec	Treasury	127.655	AA-	Mehr als 1 Jahr	CAD	Vereinigte Staaten	CANADA, Bilateral
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	103	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	189.640	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		United Kingdom Inflation-Linked Gilt	Treasury	43.772	AA-	Mehr als 1 Jahr	GBP	Frankreich	CREST, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	2.346	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
Diversified Income Duration Hedged Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	35.656	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Kanada	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	33.005	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	2.399	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Diversified Income ESG Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	3.067	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Dynamic Bond Fund	Pensionsgeschäfte	Freddie Mac Mortgage Pass Thru		104	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	EUROCLEAR, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	54.877	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	164.281	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	139.745	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	1.404	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		United Kingdom Inflation-Linked Gilt	Treasury	413.260	AA-	Mehr als 1 Jahr	GBP	Frankreich	CREST, Bilateral
Dynamic Multi-Asset Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	€ 2.500	k. A.	k. A.	EUR	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	Belgium Government International Bond	Treasury	253.574	AA-	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	EUROCLEAR, Bilateral
		Europäische Union	Treasury	72.014	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Vereinigte Staaten	EUROCLEAR, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	32.792	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Emerging Local Bond Fund	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	\$ 690	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	1.195	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
Emerging Local Bond ESG Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	15.987	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
Emerging Markets Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	2.651	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	580	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	2.801	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	537	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	1.979	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Kanada	FED, Bilateral
		United Kingdom Inflation-Linked Gilt	Treasury	1.712	AA-	Mehr als 1 Jahr	GBP	Großbritannien	CREST, Bilateral
Emerging Markets Bond ESG Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	13.986	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	690	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	5.606	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	301	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Kanada	FED, Bilateral
Emerging Markets Corporate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	1.013	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	6.400	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art der Sicherheiten	Marktwert (000S)	Qualität	Fälligkeitsprofil der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Gründungsland des Kontrahenten	Abrechnung und Clearing
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	\$ 161	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO ESG Income Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	8.383	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Euro Bond Fund	Pensionsgeschäfte	Land Nordrhein-Westfalen	Treasury	€ 99.142	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Deutschland	EUROCLEAR, Bilateral
Euro Credit Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	2.327	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Euro Credit Fund	Pensionsgeschäfte	Belgium Government International Bond	Treasury	13.533	AA-	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	EUROCLEAR, Bilateral
Euro Income Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	752	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Euro Income Bond Fund	Pensionsgeschäfte	Land Brandenburg Landesbank Baden-Wuerttemberg	Treasury	86.782	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Deutschland	EUROCLEAR, Bilateral
Euro Income Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	57.106	A-	Mehr als 1 Jahr	EUR	Deutschland	EUROCLEAR, Bilateral
Euro Long Average Duration Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	4.156	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Euro Long Average Duration Fund	Pensionsgeschäfte	Bpifrance SACA	Unternehmensanleihen	51.761	AA-	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	EUROCLEAR, Bilateral
Euro Long Average Duration Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	1.667	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Euro Short-Term Fund	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	821	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
Euro Short-Term Fund	Pensionsgeschäfte	Bpifrance SACA	Unternehmensanleihen	12.736	AA-	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	EUROCLEAR, Bilateral
PIMCO European High Yield Bond Fund	Pensionsgeschäfte	Belgium Government International Bond	Treasury	29.918	AA-	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	EUROCLEAR, Bilateral
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	Pensionsgeschäfte	Belgium Government International Bond	Treasury	987	AA-	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	EUROCLEAR, Bilateral
Global Advantage Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	\$ 545	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Bond Fund	Pensionsgeschäfte	Province of Alberta	Treasury	15.562	AA-	Mehr als 1 Jahr	CAD	Vereinigte Staaten	CANADA, Bilateral
Global Bond Fund	Pensionsgeschäfte	Province of Ontario	Treasury	84.805	AA-	Mehr als 1 Jahr	CAD	Vereinigte Staaten	CANADA, Bilateral
Global Bond Fund	Pensionsgeschäfte	Province of Quebec	Treasury	61.993	AA-	Mehr als 1 Jahr	CAD	Vereinigte Staaten	CANADA, Bilateral
Global Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	77.604	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
Global Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	95.180	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Bond ESG Fund	Pensionsgeschäfte	United Kingdom Inflation-Linked Gilt	Treasury	45.099	AA-	Mehr als 1 Jahr	GBP	Frankreich	CREST, Bilateral
Global Bond ESG Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	169.340	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Bond Ex-US Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	1.025	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global High Yield Bond Fund	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	250	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
Global High Yield Bond Fund	Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	316	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
Global Investment Grade Credit Fund	Pensionsgeschäfte	Province of Ontario	Treasury	151.161	AA-	Mehr als 1 Jahr	CAD	Vereinigte Staaten	CANADA, Bilateral
Global Investment Grade Credit Fund	Pensionsgeschäfte	Province of Quebec	Treasury	8.415	AA-	Mehr als 1 Jahr	CAD	Vereinigte Staaten	CANADA, Bilateral
Global Investment Grade Credit Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	25.972	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Investment Grade Credit ESG Fund	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	260	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
Global Investment Grade Credit ESG Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	1.326	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Low Duration Real Return Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	2.947	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Real Return Fund	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	3.735	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Real Return Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	2.936	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Real Return Fund	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	3.304	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Real Return Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	4.213	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Real Return Fund	Pensionsgeschäfte	United Kingdom Inflation-Linked Gilt	Treasury	213	AA-	3 Monate - 1 Jahr	GBP	Großbritannien	CREST, Bilateral
Global Real Return Fund	Pensionsgeschäfte	United Kingdom Inflation-Linked Gilt	Treasury	238	AA-	Mehr als 1 Jahr	GBP	Großbritannien	CREST, Bilateral
Income Fund	Pensionsgeschäfte	Province of Ontario	Treasury	147.735	AA-	Mehr als 1 Jahr	CAD	Vereinigte Staaten	CANADA, Bilateral
Income Fund	Pensionsgeschäfte	Province of Quebec	Treasury	123.985	AA-	Mehr als 1 Jahr	CAD	Vereinigte Staaten	CANADA, Bilateral
Income Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	9.216	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art der Sicherheiten	Marktwert (000S)	Qualität	Fälligkeitsprofil der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Gründungsland des Kontrahenten	Abrechnung und Clearing	
Inflation Multi-Asset Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	\$ 480	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral	
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	1.080	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
Low Average Duration Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	371	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Notes	Treasury	61.041	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Notes	Treasury	41.782	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	692	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
Low Duration Income Fund	Pensionsgeschäfte	Province of Alberta	Treasury	105.423	AA-	Mehr als 1 Jahr	CAD	Vereinigte Staaten	CANADA, Bilateral	
		Province of Ontario	Treasury	54.325	AA-	Mehr als 1 Jahr	CAD	Vereinigte Staaten	CANADA, Bilateral	
		Province of Quebec	Treasury	50.976	AA-	Mehr als 1 Jahr	CAD	Vereinigte Staaten	CANADA, Bilateral	
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	66.267	AA+	3 Monate - 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral	
Low Duration Opportunities Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	77.251	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Notes	Treasury	2.861	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	644	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
Mortgage Opportunities Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	32.596	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Notes	Treasury	37.810	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Notes	Treasury	37.810	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
StocksPLUS™ Fund	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	1.837	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	58.670	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	Ginnie Mae	Mortgage Pass Thru	82.373	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral	
		Ginnie Mae	Mortgage Pass Thru	52.981	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		Freddie Mac	Mortgage Pass Thru	40.217	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral	
	U.S. Treasury Bonds	Treasury	71.637	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral		
		U.S. Treasury Notes	Treasury	20.093	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral	
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	Swap-Kontrakte	U.S. Treasury Notes	Treasury	292.821	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	30	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral	
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	260	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
Strategic Income Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	1.120	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Notes	Treasury	617	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
Total Return Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	747	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Notes	Treasury	747	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	35	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	690	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	17.608	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
UK Corporate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	1.291	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		United Kingdom Inflation-Linked Gilt	Treasury	£ 260	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		United Kingdom Inflation-Linked Gilt	Treasury	5.300	AA-	Mehr als 1 Jahr	GBP	Großbritannien	CREST, Bilateral	
UK Long Term Corporate Bond Fund	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	United Kingdom Inflation-Linked Gilt	Treasury	483	AA-	Mehr als 1 Jahr	GBP	Großbritannien	CREST, Bilateral	
		United Kingdom Inflation-Linked Gilt	Treasury	6.625	AA-	Mehr als 1 Jahr	GBP	Großbritannien	CREST, Bilateral	
US High Yield Bond Fund	Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	251	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Notes	Treasury	\$ 930	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
US Investment Grade Corporate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	264	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
US Short-Term Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	4.652	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Notes	Treasury	4.652	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 der Sicherheiten	Marktwert (000S)	Qualität	Fälligkeitsprofil der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Gründungsland des Kontrahenten	Abrechnung und Clearing
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	\$ 20.983	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
Asia Strategic Interest Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	836	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO Balanced Income and Growth 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
	Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	590	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bills	Treasury	11.461	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO Capital Securities Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	7.418	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		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
	Pensionsgeschäfte	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
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	157	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	622	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Diversified Income Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	6.438	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		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
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	58.078	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bills	Treasury	42.150	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	513.516	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	592.195	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	277	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral	
Diversified Income Duration Hedged Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	2.481	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	102.408	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Dynamic Bond Fund	Pensionsgeschäfte	Freddie Mac	Mortgage Pass Thru	139.541	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		Ginnie Mae	Mortgage Pass Thru	413.154	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bills	Treasury	2.950	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	529.681	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	88.769	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Dynamic Multi-Asset Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	€ 10.200	k. A.	k. A.	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	4.040	k. A.	k. A.	EUR	Großbritannien	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	7.080	k. A.	k. A.	EUR	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	Treasury	100.270	AA	3 Monate - 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Europäischer Stabilitätsmechanismus	Treasury	18.150	AAA	1-3 Monate	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	Unternehmensanleihen	161	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
Pensionsgeschäfte	Landwirtschaftliche Rentenbank	Unternehmensanleihen	4.907	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral	
	U.S. Treasury Bills	Treasury	1.822	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art der Sicherheiten	Marktwert (000S)	Qualität	Fälligkeitsprofil der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Gründungsland des Kontrahenten	Abrechnung und Clearing
Emerging Markets Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	\$ 9.343	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		Umgekehrte Barsicherheiten	Zahlungsmittel	2.609	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	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
Emerging Markets Corporate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	Umgekehrte Barsicherheiten	Zahlungsmittel	807	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bills	Treasury	2.332	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	6.235	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	720	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	2.549	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	271	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO ESG Income Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	45.259	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
Euro Bond Fund	Pensionsgeschäfte	BNG Bank NV	Treasury	€ 11.063	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	627	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Euro Credit Fund	Pensionsgeschäfte	BNG Bank NV	Treasury	2.776	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Bpifrance SACA	Treasury	483	AA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	Treasury	568	AA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Rat der Europäischen Entwicklungsbank	Treasury	784	AA+	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Europäischer Stabilitätsmechanismus	Treasury	4.996	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Europäische Investitionsbank	Treasury	6.798	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Europäische Union	Treasury	12.520	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Kreditanstalt 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
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

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art der Sicherheiten	Marktwert (000S)	Qualität	Fälligkeitsprofil der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Gründungsland des Kontrahenten	Abrechnung und Clearing
Global Bond ESG Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	\$ 320.650	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	36.147	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	281.796	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
Global Bond Ex-US Fund	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
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
Global Investment Grade Credit Fund	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	205	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
	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
Global Investment Grade Credit ESG Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	15.695	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	15.545	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Low Duration Real Return Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	1.074	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Real Return Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	2.290	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Bonds	Treasury	101	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten
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
Inflation Multi-Asset Fund	Swap-Kontrakte	U.S. Treasury Bills	Treasury	1	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	240	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	Freddie Mac Mortgage Pass Thru	Treasury	38.846	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Low Average Duration Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	3.080	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	975	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	1.636	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Low Duration Income Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	5.540	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	96.407	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
Low Duration Opportunities Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	121.176	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	370	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	827	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art der Sicherheiten	Marktwert (000S)	Qualität	Fälligkeitsprofil der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Gründungsland des Kontrahenten	Abrechnung und Clearing
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
StocksPLUS™ Fund	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	4.656	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		Province of Ontario	Treasury	36.902	AA-	Mehr als 1 Jahr	CAD	Kanada	FED, Bilateral
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	Pensionsgeschäfte	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
Strategic Income 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
Total Return Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	797	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	26.800	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	Pensionsgeschäfte	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
UK Corporate Bond 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 Long Term Corporate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	£ 181	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		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
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	13.133	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
US Investment Grade Corporate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	2.635	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	2.725	AAA	3 Monate - 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, Rückkaufgeschäften und sonstigen Finanzierungsgeschäften ab, die oben nicht enthalten sind. Der Gesamtbetrag der zum 31. Dezember 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, und der Gesamtbetrag der Sicherheiten für diese Vereinbarungen ist in den obigen Angaben enthalten.

(c) Rendite/Kosten

Die nachfolgenden Tabellen liefern detaillierte Angaben zur Rendite und den Kosten jeder Art von SFT und Total Return Swap für die Geschäftsjahre zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022. Die Beträge sind in der Basiswährung der Fonds ausgewiesen.

Fonds	31. Dez. 2023							
	Pensionsgeschäfte		Umgekehrte Pensionsgeschäfte		Buy-Sellback-Finanzierungsgeschäfte		Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	
	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	\$ 1.159	\$ 0	\$ 0	\$ (223)	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0
Asia Strategic Interest Bond Fund	72	0	0	(3)	0	0	0	0
PIMCO Balanced Income and Growth Fund	858	0	2	(30)	0	0	0	(32)

Ein Teil der angegebenen Sicherheiten bezieht sich auf Derivate, die nicht unter die SFTR fallen.

(iv) Angaben zur Wiederverwendung von Sicherheiten:

Als Sicherheiten erhaltene Wertpapiere wurden zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 nicht wiederverwendet.

Die zum 31. Dezember 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 31. Dezember 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.

Fonds	31. Dez. 2023							
	Pensionsgeschäfte		Umgekehrte Pensionsgeschäfte		Buy-Sellback-Finanzierungsgeschäfte		Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	
	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)
PIMCO Capital Securities Fund	\$ 2.849	\$ 0	\$ 676	\$ (16.412)	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0
PIMCO Climate Bond Fund	1.367	0	0	(7)	0	0	0	0
Commodity Real Return Fund	449	0	0	(18.205)	0	(2)	0	(359)
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	324	0	0	(35)	0	0	0	(10)
Diversified Income Fund	60.918	0	59	(1.014)	0	0	0	0
Diversified Income Duration Hedged Fund	4.181	0	0	(17)	0	0	0	0
Diversified Income ESG Fund	185	0	0	0	0	0	0	0
Dynamic Bond Fund	36.282	(2)	0	(12)	0	0	0	0
Dynamic Multi-Asset Fund	€ 9.647	€ 0	€ 0	€ (52)	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0
Emerging Local Bond Fund	\$ 681	\$ 0	\$ 70	\$ (11.198)	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0
Emerging Local Bond ESG Fund	52	0	0	(28)	0	0	0	0
Emerging Markets Bond Fund	144	0	0	(6.008)	0	0	0	(256)
Emerging Markets Bond ESG Fund	3.526	0	0	(2.525)	0	(51)	0	(141)
Emerging Markets Corporate Bond Fund	81	0	0	(3)	0	0	0	0
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	206	0	0	(229)	0	0	0	(73)
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	158	0	0	0	0	0	0	0
PIMCO ESG Income Fund	1.550	0	0	(256)	0	0	0	(5)
Euro Bond Fund	€ 1.830	€ (87)	€ 14	€ (17)	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0
Euro Credit Fund	708	0	0	(65)	0	0	0	0
Euro Income Bond Fund	3.607	0	7	(97)	0	0	0	0
Euro Long Average Duration Fund	376	0	0	(165)	0	0	0	0
Euro Short-Term Fund	377	0	0	(1)	0	0	0	0
PIMCO European High Yield Bond Fund	630	0	0	(23)	0	0	0	0
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	74	0	0	0	0	0	0	0
Global Advantage Fund	\$ 41	\$ 0	\$ 0	\$ (353)	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (58)
Global Bond Fund	30.277	(90)	64	(1)	0	0	0	(20)
Global Bond ESG Fund	14.597	0	0	(28)	0	0	0	(21)
Global Bond Ex-US Fund	50	0	0	(8)	0	0	0	(3)
Global High Yield Bond Fund	332	0	52	(402)	0	0	0	(13)
Global Investment Grade Credit Fund	26.901	(37)	0	(81)	0	0	0	(8)
Global Investment Grade Credit ESG Fund	422	0	0	(5.682)	0	(3)	0	(1.119)
Global Low Duration Real Return Fund	56	0	0	(22.301)	0	0	0	(874)
Global Real Return Fund	74	(2.448)	0	(42.618)	0	0	0	(457)
Income Fund	177.779	0	5	(387)	0	0	0	(682)
Income Fund II	0	(51)	0	0	0	0	0	(23)
Inflation Multi-Asset Fund	426	0	0	(220)	0	0	0	(22)
Low Average Duration Fund	0	(1.316)	0	(5.703)	0	(1)	0	(2.284)
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	63	0	0	(866)	0	0	0	(492)
Low Duration Income Fund	11.266	0	0	0	0	0	0	0
Low Duration Opportunities Fund	2.437	0	0	(221)	23	0	0	(103)
Low Duration Opportunities ESG Fund	6	0	0	0	0	0	0	0
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	20	0	0	0	0	0	0	0
Mortgage Opportunities Fund	1.295	0	0	(12.150)	0	0	0	(10)
StocksPLUS™ Fund	24.579	0	0	0	0	0	0	0
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	130	0	0	0	0	0	0	0
Strategic Income Fund	31	0	0	(352)	0	0	0	(82)
Total Return Bond Fund	440	0	0	(409)	0	0	0	(140)
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	564	0	0	(11)	0	0	0	(28)
UK Corporate Bond Fund	£ 227	£ 0	£ 0	£ (856)	£ 0	£ 0	£ 0	£ 0
UK Long Term Corporate Bond Fund	114	0	0	(171)	0	0	0	0
US High Yield Bond Fund	\$ 338	\$ 0	\$ 29	\$ (134)	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (22)
US Investment Grade Corporate Bond Fund	512	0	0	0	0	0	1	0
US Short-Term Fund	2.743	0	0	(4)	0	(16)	0	(297)

31. Dez. 2022

Fonds	Pensionsgeschäfte		Umgekehrte Pensionsgeschäfte		Buy-Sellback-Finanzierungsgeschäfte		Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	
	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	\$ 1.057	\$ 0	\$ 818	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0
Asia Strategic Interest Bond Fund	33	0	29	0	0	0	0	0
PIMCO Balanced Income and Growth Fund	144	0	0	0	0	0	0	0
PIMCO Capital Securities Fund	195	0	401	(9.618)	0	0	0	0
PIMCO Climate Bond Fund	271	0	0	(4)	0	0	0	(1)
Commodity Real Return Fund	327	0	0	(4.073)	0	(105)	0	(1.859)
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	127	0	0	0	0	0	0	0
Diversified Income Fund	15.705	0	3.046	(7)	0	0	0	0
Diversified Income Duration Hedged Fund	1.358	0	60	0	0	0	0	0
Dynamic Bond Fund	8.310	0	43	0	0	0	0	0
Dynamic Multi-Asset Fund	€ 148	€ 0	€ 0	€ (6)	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0
Emerging Local Bond Fund	\$ 141	\$ (91)	\$ 0	\$ (6.016)	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0
Emerging Markets Bond Fund	240	0	0	(994)	0	0	0	(87)
Emerging Markets Bond ESG Fund	888	0	137	(245)	0	0	0	0
Emerging Markets Corporate Bond Fund	33	0	0	(1)	0	0	0	0
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	324	0	0	0	0	0	0	0
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	12	0	0	0	0	0	0	0
PIMCO ESG Income Fund	514	0	0	0	0	0	0	0
Euro Bond Fund	€ 9	€ (36)	€ 14	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0
Euro Credit Fund	56	0	4	0	0	0	0	0
Euro Income Bond Fund	13	(5)	44	0	0	0	0	0
Euro Long Average Duration Fund	0	(1)	0	0	0	0	0	0
Euro Short-Term Fund	0	(41)	0	0	0	0	0	0
PIMCO European High Yield Bond Fund	0	(15)	2	0	0	0	0	0
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	0	(29)	4	0	0	0	0	0
Global Advantage Fund	\$ 7	\$ 0	\$ 130	\$ (189)	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (59)
Global Bond Fund	9.293	0	2.787	(1.200)	0	0	0	(31)
Global Bond ESG Fund	6.766	0	0	(8)	0	0	0	(1)
Global Bond Ex-US Fund	9	0	313	(50)	0	0	0	(12)
Global High Yield Bond Fund	1.677	0	387	(93)	0	0	0	0
Global Investment Grade Credit Fund	325	0	0	(70)	0	0	0	(7)
Global Investment Grade Credit ESG Fund	90	0	0	(830)	0	0	0	(234)
Global Low Duration Real Return Fund	28	0	0	(431)	0	(3)	0	(3.169)
Global Real Return Fund	108	0	58	(12.072)	0	0	0	(272)
Income Fund	93.412	(70)	1.457	0	0	0	0	(89)
Income Fund II	14	(1)	0	0	0	0	0	0
Inflation Multi-Asset Fund	1.101	0	0	(1)	0	0	0	(2)
Low Average Duration Fund	448	0	0	(959)	0	0	0	(199)
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	13	0	0	(150)	0	0	0	(45)
Low Duration Income Fund	1.256	0	0	0	0	0	0	0
Low Duration Opportunities Fund	2.501	0	8	(102)	0	0	0	0
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	10	0	0	0	0	0	0	0
Mortgage Opportunities Fund	126	0	0	(6.518)	0	0	0	(7)
StocksPLUS™ Fund	2.323	0	0	0	0	0	0	0
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	26	0	0	0	0	0	0	0
Strategic Income Fund	7	0	0	(6)	0	0	0	(1)
Total Return Bond Fund	3.214	0	20	(353)	0	0	0	(22)
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	174	0	0	0	0	0	0	0
UK Corporate Bond Fund	£ 145	£ 0	£ 0	£ (195)	£ 0	£ 0	£ 0	£ 0
UK Long Term Corporate Bond Fund	30	0	0	(86)	0	0	0	0
US High Yield Bond Fund	\$ 1.076	\$ 0	\$ 29	\$ (58)	\$ 0	\$ 0	\$ 1	\$ 0
US Investment Grade Corporate Bond Fund	45	0	0	(8)	0	0	0	(9)
US Short-Term Fund	1.315	0	0	(683)	0	0	0	(391)

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 Geschäftsjahres identifiziert und sind in der Betriebsergebnisrechnung im realisierten Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten sowie in der Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten enthalten.

23. WESENTLICHE EREIGNISSE

Seit Februar 2022 herrscht ein anhaltender bewaffneter Konflikt zwischen Russland und der Ukraine, der zu Sanktionen gegenüber verschiedenen russischen Unternehmen und Personen geführt hat. Seit Oktober 2023 gibt es einen anhaltenden bewaffneten Konflikt in Israel und Gaza, seit Anfang April 2024 führen Iran und Israel Militäroffensiven gegeneinander durch, und die Situation entwickelt sich rasch. Die Fonds können in Wertpapieren und Instrumenten

anlegen, die wirtschaftlich an diese Konfliktgebiete gebunden sind. Solche Anlagen könnten gegebenenfalls durch Sanktionen und Gegensanktionen negativ beeinflusst worden sein, einschließlich Wertverlusten und Liquiditätsrückgängen. Die Liquiditätsrückgänge von Anlagen können dazu führen, dass die Fonds Portfoliobestände zu einem ungünstigen Zeitpunkt oder Preis verkaufen oder weiterhin Anlagen halten, die die Fonds möglicherweise nicht mehr halten möchten. PIMCO wird diese Positionen weiterhin aktiv im besten Interesse der Fonds und ihrer Anteilhaber verwalten.

Am 1. 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 3. 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 6. April 2023 wurde von der Verwaltungsgesellschaft eine Zeichnung in Höhe von USD 5.000.000 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 1. 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.

Am 18. August 2023 wurde die Vereinbarung über eine Kreditfazilität zwischen PIMCO Funds und Global Investors Series plc, handelnd für den Global High Yield Bond Fund und den US High Yield Bond Fund mit bestimmten Kreditgebern, einschließlich MUFG Bank Ltd („MUFG“), geändert und auf den PIMCO Asia High Yield Bond Fund erweitert.

Am 1. September 2023 wurde die Benchmark für den Euro Short-Term Fund in den ICE BofA 3-Month German Treasury Bill Index geändert.

Am 29. November 2023 wurde der PIMCO Global Core Asset Allocation Fund nach Genehmigung durch die Aufsichtsbehörden in PIMCO Balanced Income and Growth Fund umbenannt. Zusätzlich zur Namensänderung und wie den Anteilhabern mitgeteilt, wurde der Nachtrag aktualisiert, um bestimmte nicht wesentliche Änderungen an der Anlagepolitik widerzuspiegeln.

Abgesehen von den oben erwähnten Ereignissen waren während des Geschäftsjahres keine wesentlichen Ereignisse zu verzeichnen.

24. EREIGNISSE NACH ABSCHLUSS DES BERICHTSZEITRAUMS

Am 2. Januar 2024 wurde die Ergänzung für den PIMCO Credit Opportunities Bond Fund aktualisiert und die Gesamtgebühr für alle Anteilsklassen um 25 Bp gesenkt, mit Ausnahme der Anteilsklassen R und T, für die die Verwaltungsgebühr um 14 Bp bzw. 15 Bp gesenkt wird.

Am 10. Januar 2024 wurde der Verzicht auf die Verwaltungsgebühr für die entsprechenden Anteilsklassen für den Euro Short-Term Fund und den PIMCO European Short-Term Opportunities Fund auf den 18. Januar 2025 bzw. den 17. Januar 2025 verlängert. Am selben Tag wurde eine überarbeitete Ergänzung für den für den Asia Strategic Interest Bond Fund herausgegeben, um die bestehenden Angaben besser an die der meisten anderen Fonds der Gesellschaft anzupassen und

festzulegen, in was die mindestens zwei Drittel des Portfolios investiert werden sollen.

Am 1. Februar 2024 wurde die Ergänzung für den Emerging Markets Bond Fund aktualisiert und die Gesamtgebühr für die institutionellen Anteilsklassen um 7 Bp gesenkt. Für alle anderen relevanten Anteilsklassen des Fonds wird eine anteilige Reduzierung vorgenommen.

Mit tiefer Betroffenheit nahmen wir am 6. Februar 2024 den Tod von John Bruton, ein Verwaltungsratsmitglied der Gesellschaft und der Verwaltungsgesellschaft, zur Kenntnis.

Am 21. März 2024 wurde der Prospekt aktualisiert, um bestimmte nicht wesentliche Änderungen aufzunehmen, wie zum Beispiel: Aktualisierung der Risikofaktoren, Klarstellungen zu den Angaben zu den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, Erweiterungen der allgemeinen Angaben zu ESG-Anlagen, Aktualisierung des Abschnitts Besteuerung, Aktualisierung der Biographien der Verwaltungsratsmitglieder, Änderungen der Bestimmungen zur Geldwäschebekämpfung und Aufnahme von Angaben zu ereignisabhängigen Anleihen für bestimmte Fondsergänzungen, die am selben Datum aktualisiert wurden.

Am 8. April 2024 wurde die Ergänzung für den PIMCO Climate Bond Fund aktualisiert, um die Ausschlussstrategie des Fonds an die Nachhaltigkeits-Ausschlusspolitik von PGAIL anzupassen, die auf der Website von PGAIL bereitgestellt wurde, und um die bestehende Offenlegung in Bezug auf das Emittentenengagement zu verdeutlichen. Zudem wurde auch der Anhang zur Fondsergänzung aktualisiert, um diese Änderungen widerzuspiegeln und bestimmte nicht wesentliche Änderungen aufzunehmen, wie zum Beispiel: Klarstellungen in Bezug auf das nachhaltige Anlageziel des Fonds, Aktualisierung der Nachhaltigkeitsindikatoren, die zur Messung der Erreichung des nachhaltigen Anlageziels des Fonds verwendet werden, Erweiterungen zur Klärung der Art und Weise, in der die nachhaltigen Investitionen des Fonds bewertet werden, um sicherzustellen, dass sie dem nachhaltigen Investitionsziel des Fonds nicht erheblich schaden und um zu bestätigen, dass die Investitionen des Fonds keine taxonomiekonformen Tätigkeiten im Bereich Gas und Kernenergie umfassen.

Am selben Datum wurde die Ergänzung für den Low Duration Income Fund aktualisiert, um das maximal zulässige nicht auf USD lautende Fremdwährungsengagement des Fonds von 10 % auf 15 % des Gesamtvermögens zu erhöhen.

Abgesehen von den oben erwähnten Ereignissen waren nach Abschluss des Geschäftsjahres keine wesentlichen Ereignisse zu verzeichnen.

25. GENEHMIGUNG VON FINANZABSCHLÜSSEN

Dieser Abschluss wurde am 25. April 2024 vom Verwaltungsrat genehmigt.

Bericht des Verwaltungsrats

Der Verwaltungsrat legt den Anteilhabern den geprüften Jahresabschluss der Gesellschaft für das zum 31. Dezember 2023 endende Geschäftsjahr vor.

VERANTWORTUNG DES VERWALTUNGSRATS

Der Verwaltungsrat ist für die Erstellung des Jahresberichts und des Jahresabschlusses gemäß geltendem irischem Recht und den in Irland allgemein anerkannten Rechnungslegungsgrundsätzen einschließlich des Financial Reporting Standard 102 („FRS 102“), des „The Financial Reporting Standard applicable in the United Kingdom and Republic of Ireland“, herausgegeben vom Financial Reporting Council, dem Companies Act 2014 und der OGAW-Vorschriften verantwortlich.

Nach irischem Recht darf der Verwaltungsrat den Abschluss nur dann genehmigen, wenn er der Ansicht ist, dass dieser ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögenswerte, der Verbindlichkeiten und der Finanzlage des Fonds zum Ende des Geschäftsjahres und des Gewinns oder Verlusts der Gesellschaft für das Geschäftsjahr widerspiegelt.

Bei der Erstellung des Abschlusses muss der Verwaltungsrat:

- geeignete Bilanzierungs- und Bewertungsmethoden auswählen und diese konsequent anwenden;
- vernünftige, vorsichtige Beurteilungen und Schätzungen vornehmen;
- angeben, ob der Abschluss in Übereinstimmung mit den geltenden Bilanzierungsgrundsätzen erstellt wurde, die entsprechenden Standards identifizieren und wesentliche Abweichungen von diesen Richtlinien in den Erläuterungen zum Abschluss anzugeben und erläutern; und
- den Abschluss auf der Basis der Unternehmensfortführung erstellen, es sei denn, es ist unangemessen, davon auszugehen, dass die Gesellschaft ihre Geschäftstätigkeit fortsetzen wird.

Der Verwaltungsrat ist für die Führung ordnungsgemäßer Geschäftsbücher verantwortlich, die ausreichend sind, um:

- die Transaktionen der Gesellschaft korrekt zu erfassen und zu erläutern;
- jederzeit die Ermittlung der Vermögenswerte, der Verbindlichkeiten, der Finanzlage und des Gewinns oder Verlusts der Gesellschaft mit angemessener Genauigkeit zu ermöglichen; und
- den Verwaltungsrat in die Lage zu versetzen, sicherzustellen, dass der Abschluss dem Companies Act von 2014 entspricht, und eine Prüfung dieses Abschlusses zu ermöglichen.

Darüber hinaus ist der Verwaltungsrat für den Schutz des Vermögens der Gesellschaft und somit für das Ergreifen angemessener Maßnahmen verantwortlich, um Betrug und anderen Regelwidrigkeiten vorzubeugen und diese aufzudecken.

Der Verwaltungsrat ist für die Pflege und Integrität der Unternehmens- und Finanzinformationen auf der Website der Gesellschaft verantwortlich. Die Gesetzgebung Irlands, die die Erstellung und Verteilung der Abschlüsse regelt, kann sich von der Gesetzgebung anderer Rechtsräume unterscheiden.

ENTSPRECHENERKLÄRUNG DES VERWALTUNGSRATS

Die Gesellschaft verfolgt die Politik, ihre maßgeblichen Pflichten (gemäß Definition im Companies Act 2014) zu erfüllen. Wie gemäß Section 225(2) des Companies Act von 2014 erforderlich, bestätigt der Verwaltungsrat, dass er dafür verantwortlich ist, die Erfüllung der maßgeblichen Pflichten durch die Gesellschaft sicherzustellen. Der Verwaltungsrat hat eine Compliance-Grundsatzklärung im Sinne von Section 225(3)(a) des Companies Act von 2014 sowie eine Compliance-Richtlinie erarbeitet, die sich auf die Vorkehrungen und Strukturen bezieht, die eingerichtet wurden und nach Einschätzung des Verwaltungsrats darauf ausgelegt sind, eine wesentliche Erfüllung der maßgeblichen Pflichten der Gesellschaft sicherzustellen. Zudem hat der Verwaltungsrat während dieses Geschäftsjahres eine Prüfung entsprechender Vorkehrungen und Strukturen, die eingerichtet wurden, durchgeführt. Bei der Erfüllung seiner Verantwortlichkeiten gemäß Section 225 hat sich der Verwaltungsrat unter anderem auf bereitgestellte Dienste, Ratschläge und/oder Erklärungen von Dritten verlassen, die nach Einschätzung des Verwaltungsrats über das erforderliche Wissen und die Erfahrung verfügen, um eine wesentliche Erfüllung der maßgeblichen Pflichten der Gesellschaft sicherzustellen.

MITARBEITER

Die Gesellschaft beschäftigte während der Geschäftsjahre zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 keine Mitarbeiter.

ERKLÄRUNG ZU PRÜFUNGSRELEVANTEN ANGABEN

Die zum Datum dieses Berichts amtierenden Verwaltungsratsmitglieder haben jeweils bestätigt, dass:

- es nach ihrer Kenntnis keine relevanten Prüfungsinformationen gibt, die dem Abschlussprüfer der Gesellschaft nicht vorliegen; und

- sie alle Schritte unternommen haben, die von ihnen als Mitglieder des Verwaltungsrats erwartet werden, um Kenntnis aller prüfungsrelevanten Informationen zu erlangen und zu gewährleisten, dass der Abschlussprüfer der Gesellschaft diese Informationen erhält.

ERGEBNISSE, AKTIVITÄTEN UND ZUKÜNFTIGE ENTWICKLUNGEN

Die Betriebsergebnisse und festgesetzten Dividenden werden in der Betriebsergebnisrechnung auf den Seiten 92 bis 111 ausgewiesen. Die Seiten 6 bis 66 enthalten einen Überblick über die Entwicklung der Anlagen der Fonds und ihrer Portfolios.

HAUPTRISIKEN UND UNGEWISSEHEITEN

Einzelheiten zu den Risikomanagementzielen und -grundsätzen der Gesellschaft und dem Marktpreis-, Fremdwährungs-, Zins-, Liquiditäts- und Kredit- und Kontrahentenrisiko der Gesellschaft sind in Erläuterung 16 in den Erläuterungen zum Abschluss angegeben.

WESENTLICHE EREIGNISSE

Eine Liste der wesentlichen Ereignisse, die während des Geschäftsjahres Einfluss auf die Gesellschaft hatten, ist in Erläuterung 23 angegeben.

EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG

Eine Liste der Ereignisse nach dem Bilanzstichtag, die nach Ende des Geschäftsjahres Einfluss auf die Gesellschaft hatten, ist in Erläuterung 24 angegeben.

GESCHÄFTSBÜCHER

Die vom Verwaltungsrat ergriffenen Maßnahmen mit dem Ziel, die Erfüllung der Pflicht der Gesellschaft zur Führung ordnungsgemäßer Geschäftsbücher zu gewährleisten, umfassen den Einsatz geeigneter Systeme und Verfahren sowie den Einsatz kompetenter Personen. Die Geschäftsbücher werden bei State Street Fund Services (Ireland) Limited, 78 Sir John Rogerson's Quay, Dublin D02 HD32, Irland aufbewahrt.

CORPORATE GOVERNANCE

Die Gesellschaft unterliegt irischem Recht und ist mit diesem konform, einschließlich des Companies Acts von 2014, der European Communities (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations 2011 (S.I. Nr. 352 aus 2011) (die „UCITS Regulations“) sowie den für Investmentfonds geltenden Regeln für die Notierung am Global Exchange Market („GEM“) der Euronext Dublin. Der Verwaltungsrat (der „Verwaltungsrat“) hat die Maßgaben geprüft, die in dem von der Irish Fund Industry Association im Dezember 2011 veröffentlichten freiwilligen Corporate Governance Code for Collective Investment Schemes and Management Companies enthalten sind (der „IFIA Code“). Der Verwaltungsrat hat sämtliche Governance-Praktiken und -Verfahren des IFIA-Code IFIA Code angenommen.

Der Verwaltungsrat hat erklärt, dass die Maßnahmen im Code der IFIA mit seinen Corporate Governance-Praktiken und -verfahren für das Geschäftsjahr übereinstimmen. Die einzelnen, von der Gesellschaft engagierten Dienstleister unterliegen ihren eigenen Corporate Governance-Anforderungen.

Finanzberichterstattung – Beschreibung der wichtigsten Merkmale

Der Verwaltungsrat muss für die Finanzberichterstattung angemessene interne Systeme zur Kontrolle und Verwaltung des Risikos der Gesellschaft einführen und aufrechterhalten. Derartige Systeme haben nicht zum Ziel, das Risiko, dass die Gesellschaft ihre Ziele im Zusammenhang mit der Finanzberichterstattung nicht erreicht, völlig auszuschalten, sondern es zu verwalten. Sie bieten keine vollständige, jedoch eine angemessene Absicherung gegen wesentliche Fehldarstellungen und Verluste.

Der Verwaltungsrat verfügt über bewährte Verfahren im Zusammenhang mit Systemen für interne die Kontrolle und das Risikomanagement, um die effiziente Überwachung des Finanzberichterstattungsverfahrens zu gewährleisten. Dies schließt die Bestellung des Administrators, State Street Fund Administration Services (Ireland) Limited, zur Führung der Bücher und Aufzeichnungen ein. Der Administrator ist von der Zentralbank zugelassen und reguliert und muss sich an die von dieser erlassenen Regeln halten. Darüber hinaus ist der Administrator vertraglich verpflichtet, den Jahresbericht, einschließlich des Abschlusses, der ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Geschäftslage der Gesellschaft geben soll, sowie die Halbjahresabschlüsse zu erstellen, die durch den Verwaltungsrat überprüft und genehmigt werden.

Der Verwaltungsrat beurteilt und diskutiert bei Bedarf wesentliche Probleme im Zusammenhang mit der Rechnungslegung und Berichterstattung. Darüber hinaus untersucht und beurteilt der Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit die Finanzbuchhaltungs- und Berichterstattungsprozeduren des Administrators und überwacht und bewertet die Leistung, Qualifikation und Unabhängigkeit des externen Abschlussprüfers. Der Administrator hat die operative Verantwortung für seine internen Kontrollen im Zusammenhang mit dem Finanzberichterstattungsverfahren und dem Bericht des Administrators an den Verwaltungsrat.

Risikobewertung

Der Verwaltungsrat ist für die Beurteilung des Risikos von Regelwidrigkeiten verantwortlich, unabhängig davon, ob diese auf Betrug oder Fehler in der Finanzberichterstattung zurückzuführen sind. Darüber hinaus muss er gewährleisten, dass entsprechende Verfahren zur rechtzeitigen Identifizierung interner und externer Angelegenheiten existieren, die sich möglicherweise auf die Finanzberichterstattung auswirken. Darüber hinaus hat der Verwaltungsrat Verfahren zur Identifizierung von Änderungen der Rechnungslegungsregeln und -empfehlungen eingeführt, und um zu gewährleisten, dass diesen Veränderungen in den Abschlüssen der Gesellschaft entsprechend Rechnung getragen wird.

Kontrollaktivitäten

Der Administrator verfügt über Kontrollstrukturen zur Verwaltung der mit der Finanzberichterstattung verbundenen Risiken. Diese Kontrollstrukturen umfassen die angemessene Teilung der Verantwortung und spezifischen Kontrollaktivitäten mit dem Ziel, für alle wichtigen Konten im Abschluss und in den entsprechenden Erläuterungen im Jahresbericht der Gesellschaft wesentliche Mängel in der Finanzberichterstattung aufzudecken oder solchen vorzubeugen. Beispiele für die durch den Administrator durchgeführten Kontrollen sind analytische Prüfungen, Abgleiche und automatische Kontrollen der IT-Systeme. Die Methode zur Bewertung von Wertpapieren und anderen Vermögenswerten, wenn keine Kurse aus externen, unabhängigen Quellen verfügbar sind, wird in Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss beschrieben.

Information und Kommunikation

Um zu gewährleisten, dass die Anforderungen an die Informationen über die Finanzberichterstattung vollständig und angemessen erfüllt werden, werden die Grundsätze der Gesellschaft und die Anweisungen des Verwaltungsrats, die Auswirkungen auf die Finanzberichterstattung haben, über geeignete Kanäle aktualisiert und mitgeteilt, z. B. über E-Mail, Schriftverkehr und Versammlungen.

Überwachung

Der Verwaltungsrat erhält regelmäßig Präsentationen und Kontrollberichte von der Verwahrestelle, der Anlageberatungsgesellschaft und dem Administrator. Des Weiteren verfügt der Verwaltungsrat über ein jährliches Verfahren, um angemessene Reaktionen auf vom unabhängigen Abschlussprüfer identifizierte Mängel und empfohlene Maßnahmen zu gewährleisten.

Kapitalstruktur

Niemand hält eine wesentliche direkte oder indirekte Beteiligung an der Gesellschaft. Niemand verfügt über besondere Kontrollrechte am Grundkapital der Gesellschaft.

Die Stimmrechte sind in keiner Weise eingeschränkt.

Befugnisse des Verwaltungsrats

Im Hinblick auf die Ernennung und Ersetzung von Verwaltungsratsmitgliedern unterliegt die Gesellschaft ihrer Satzung, den irischen Gesetzen einschließlich dem Companies Act von 2014, den UCITS Regulations und den für Investmentfonds geltenden Notierungsregeln am GEM der Euronext Dublin. Die Satzung der Gesellschaft kann durch besonderen Beschluss der Anteilinhaber geändert werden.

Der Verwaltungsrat ist dafür verantwortlich, die Geschäfte der Gesellschaft in Übereinstimmung mit der Satzung zu führen. Der Verwaltungsrat kann bestimmte Aufgaben an den Administrator und andere Parteien übertragen, wobei diese der Überwachung und Leitung des Verwaltungsrats unterstehen. Der Verwaltungsrat hat den Administrator mit der täglichen Verwaltung der Gesellschaft beauftragt und hat die Anlageverwaltung und die Vertriebsfunktionen an die Anlageverwaltungsgesellschaft übertragen. Kein Verwaltungsratsmitglied ist daher ein geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied.

Gemäß der Satzung darf der Verwaltungsrat die Befugnisse der Gesellschaft wahrnehmen, wie z. B. Kredite aufnehmen oder vergeben, das Unternehmen, dessen Eigentum oder einen Teil davon hypothekarisch oder anderweitig belasten, oder sie an die Anlageverwaltungsgesellschaft übertragen.

In den folgenden Situationen darf der Verwaltungsrat jederzeit und zu gegebener Zeit die Berechnung des Nettoinventarwerts eines bestimmten Teilfonds sowie die Ausgabe, die Rücknahme und den Umtausch von Anteilen vorübergehend aussetzen:

(a) während Zeiträumen (mit Ausnahme von gesetzlichen Feiertagen oder üblichen Schließungen an Wochenenden), in denen ein Markt oder eine anerkannte Börse geschlossen oder der Handel an ihm/ihr eingeschränkt ist, der/die den Hauptmarkt für einen wesentlichen Teil der Anlagen des betreffenden Fonds bildet;

(b) während Zeiträumen, in denen eine Notsituation vorliegt, die dazu führt, dass die Gesellschaft Anlagen, die einen wesentlichen Teil des Vermögens einer bestimmten Klasse

bilden, praktisch nicht veräußern kann, die Übertragung von Geldern für den Erwerb oder die Veräußerung von Anlagen zu normalen Wechselkursen nicht möglich ist oder der Verwaltungsrat oder dessen Bevollmächtigter praktisch nicht in der Lage ist, den Wert von Anlagen des betreffenden Fonds angemessen zu bestimmen;

(c) während eines Ausfalls der normalerweise zur Bestimmung des Preises irgendeiner Anlage des betreffenden Fonds oder der aktuellen Kurse an einem beliebigen Markt oder einer anerkannten Börse verwendeten Kommunikationsmittel;

(d) wenn aus irgendeinem Grund die Preise einer Anlage der betreffenden Klasse nicht angemessen, umgehend oder genau ermittelt werden können;

(e) während Zeiträumen, in denen die Überweisung von Geldern für die Zahlung einer der Anlagen der betreffenden Klasse nach Meinung des Verwaltungsrats nicht zu normalen Wechselkursen möglich ist;

(f) bei Abwicklung der Gesellschaft oder Beendigung eines Fonds; oder

(g) wenn die Bestimmung des Wertes eines wesentlichen Teils der Anlagen der Gesellschaft oder eines Teilfonds für den Beauftragten aus einem anderen Grund unmöglich oder undurchführbar ist.

Die Zentralbank und die Euronext Dublin müssen umgehend über eine derartige Aussetzung und über das Ende einer derartigen Aussetzung informiert werden. Darüber hinaus muss sie Anteilsscheinern und Anteilinhabern, die die Rücknahme ihrer Anteile beantragen, bei Antragstellung oder Registrierung des schriftlichen Antrags auf Rücknahme mitgeteilt werden. Soweit möglich werden alle angemessenen Schritte unternommen, um die Aussetzung so schnell wie möglich zu beenden.

Eingetragene Anteile können schriftlich übertragen werden. Der schriftlichen Übertragung muss eine Bescheinigung des Übertragungsempfängers beiliegen, dass er die Anteile nicht für eine oder zugunsten einer US-Person erwirbt. Im Falle des Todes eines Mitanteilnehmers sind die anderen Mitanteilhaber die einzigen Personen, die laut Administrator Anspruch auf das Eigentum oder eine Beteiligung an den auf den Namen der Mitanteilhaber eingetragenen Anteile haben. Der Verwaltungsrat kann die Eintragung einer Übertragung ablehnen, wenn er darüber informiert oder davon überzeugt ist, dass die Übertragung dazu führen würde, dass das wirtschaftliche Eigentum einer Person zufällt, die damit gegen die vom Verwaltungsrat auferlegten Einschränkungen für den Besitz verstößt oder rechtliche, aufsichtsrechtliche, geldliche, steuerliche oder wesentliche administrative Nachteile für den entsprechenden Fonds oder die Anteilinhaber allgemein zur Folge hätte.

Versammlungen der Anteilinhaber

Die Jahreshauptversammlung der Gesellschaft findet normalerweise im Mai, an einem vom Verwaltungsrat festgelegten Datum in Dublin statt. Die Einladung zur Jahreshauptversammlung, auf der jedes Jahr der geprüfte Jahresabschluss der Gesellschaft (und die Berichte des Verwaltungsrats und der Abschlussprüfer) vorgelegt wird, wird den Anteilinhabern mindestens 21 volle Tage vor dem Datum der Versammlung an ihre eingetragene Anschrift zugesandt. Der Verwaltungsrat kann zu gegebener Zeit gemäß irischem Recht andere Hauptversammlungen einberufen.

Jeder Anteil berechtigt seinen Inhaber, an den Hauptversammlungen der Gesellschaft und des Fonds, den die Anteile repräsentieren, teilzunehmen und auf diesen abzustimmen. Auf Versammlungen der Anteilinhaber kann die Abstimmung per Handzeichen erfolgen, es sei denn, ein Anteilinhaber mit Stimmrecht auf der Versammlung oder der Vorsitzende der Versammlung verlangt eine Abstimmung per Stimmzettel. Bei einer Abstimmung per Handzeichen verfügt jeder Anteilinhaber über eine Stimme. Bei Angelegenheiten im Zusammenhang mit der Gesellschaft, die den Anteilinhabern zur Abstimmung per Stimmzettel vorgelegt werden, verleiht jeder Anteil seinem Inhaber eine Stimme.

Keine Anteilsklasse verleiht ihren Anteilinhabern Vorzugs- oder Vorrechte oder Rechte auf Beteiligung an den Gewinnen oder Dividenden einer anderen Anteilsklasse oder Stimmrechte im Zusammenhang mit Angelegenheiten, die sich ausschließlich auf eine andere Anteilsklasse beziehen.

Beschlüsse zur Änderung der mit einer Anteilsklasse verbundenen Rechte erfordern die Zustimmung von drei Vierteln der Inhaber der Anteile, die auf der Hauptversammlung der Anteilsklasse anwesend oder vertreten sind und an der Abstimmung teilnehmen. Die beschlussfähige Mehrheit für Hauptversammlungen von Anteilsklassen, auf denen über eine Änderung der mit der Klasse verbundenen Rechte entschieden wird, beträgt mindestens zwei Personen, deren Anteilsbesitz ein Drittel der Anteile ausmacht.

Alle Anteile mit Ausnahme der Zeichneranteile geben dem Anteilinhaber Anspruch auf eine anteilmäßige Beteiligung an den Dividenden und am Nettovermögen des Fonds, der die Anteile ausgegeben hat. Dies gilt nicht für Dividenden, die vor dem Erwerb der Anteile durch den Anteilinhaber festgesetzt wurden.

Zeichneranteile berechtigen ihre Inhaber zur Teilnahme an und Abstimmung auf allen Hauptversammlungen der Gesellschaft, verleihen jedoch keinen Anspruch auf eine Beteiligung an den Dividenden oder am Nettovermögen der Gesellschaft.

Zusammensetzung und Funktionsweise des Verwaltungsrats und seiner Ausschüsse
Der Verwaltungsrat besteht derzeit aus fünf Mitgliedern, von denen keines geschäftsführende Aufgaben übernimmt und von denen zwei vom Anlageverwalter unabhängig sind. Die Verwaltungsratsmitglieder können durch einen ordentlichen Beschluss der Anteilinhaber gemäß den durch den Irish Companies Act von 2014 festgelegten Verfahren ihres Amtes enthoben werden. Der Verwaltungsrat tritt während jedes Kalenderjahres mindestens einmal pro Quartal zusammen. Der Verwaltungsrat verfügt über einen für die Abschlussprüfung zuständigen Prüfungsausschuss, der derzeit aus zwei unabhängigen Mitgliedern besteht und im Laufe des Berichtsjahres viermal zusammengesetzt ist.

TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PERSONEN

Transaktionen, die mit der Verwaltungsgesellschaft oder Verwahrstelle eines OGAW, den Beauftragten oder Unterbeauftragten einer solchen Verwaltungsgesellschaft oder Verwahrstelle (unter Ausschluss von konzernfremden, von einer Verwahrstelle bestellten Unterverwahrstellen) oder angeschlossenen Unternehmen oder Konzerngesellschaften einer solchen Verwaltungsgesellschaft, Verwahrstelle oder von entsprechenden Beauftragten oder Unterbeauftragten („verbundene Personen“) durchgeführt werden, müssen so durchgeführt werden, als wären sie unter gewöhnlichen geschäftlichen Bedingungen ausgehandelt worden, und nur dann, wenn sie im besten Interesse der Anteilinhaber sind. Der Verwaltungsrat ist davon überzeugt, dass Vorkehrungen (durch schriftliche Verfahren nachgewiesen) getroffen wurden, um sicherzustellen, dass Transaktionen mit verbundenen Personen wie oben beschrieben durchgeführt werden, und dass diese Vorkehrungen während des Geschäftsjahres eingehalten wurden.

MITGLIEDER DES VERWALTUNGSRATS

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 setzte sich der Verwaltungsrat aus folgenden Mitgliedern zusammen:

V. Mangala Ananthanarayanan – ernannt am 30. Juni 2016
Ryan P. Blute – ernannt am 30. Mai 2014
John Bruton – ernannt am 28. Februar 2018
Craig A. Dawson – ernannt am 6. Mai 2009
David M. Kennedy – ernannt am 16. April 1999
Frances Ruane – ernannt am 28. Februar 2018

Die Satzung sieht keinen turnusmäßigen Rücktritt der Verwaltungsratsmitglieder vor.

SEKRETÄR

Walkers Corporate Services (Ireland) Limited war während des zum 31. Dezember 2023 endenden Geschäftsjahres Sekretär der Gesellschaft.

BETEILIGUNGEN DER VERWALTUNGSRATSMITGLIEDER UND DES SEKRETÄRS AN ANTEILEN UND VERTRÄGEN

Zum 31. Dezember 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, null (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 31. Dezember 2023 hielt Ryan P. Blate null (31. Dezember 2022: 5.387,93) Anteile des PIMCO Asia High Yield Bond Fund, 28.827,68 (31. Dezember 2022: 24.131,27) Anteile des Low Average Duration Fund und 50.751,14 (31. Dezember 2022: 82.494,63) Anteile des Low Duration Income Fund, wobei es sich jeweils um Fonds der Gesellschaft handelt.

Zum 31. Dezember 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, wobei es sich jeweils um Teilfonds der Gesellschaft handelt.

Zum 31. Dezember 2023 hielt David M. Kennedy 4.186,59 (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 Balanced Income and Growth Fund. Beide sind Teilfonds der Gesellschaft.

Während der zum 31. Dezember 2023 bzw. zum 31. Dezember 2022 endenden Geschäftsjahre hielt der Sekretär keine Beteiligung an Anteilen der Gesellschaft.

Keines der Verwaltungsratsmitglieder verfügte über einen Dienstleistungsvertrag mit der Gesellschaft.

RECHTSBERATER FÜR IRISCHES RECHT

Dillon Eustace LLP war während des Geschäftsjahres zum 31. Dezember 2023 Rechtsberater (für irisches Recht) der Gesellschaft.

UNABHÄNGIGE ABSCHLUSSPRÜFER

Die unabhängigen Abschlussprüfer, PricewaterhouseCoopers, haben ihre Bereitschaft bestätigt, ihre Aufgabe weiterhin gemäß § 383 des Companies Act 2014 wahrzunehmen.

Für den Verwaltungsrat

Verwaltungsratsmitglied: Craig A. Dawson

Verwaltungsratsmitglied: David M. Kennedy

Datum: 25. April 2024

Bericht des unabhängigen Abschlussprüfers an die Anteilhaber der Pimco Funds: Global Investors Series plc

Bericht über die Prüfung des Abschlusses

Testat

Nach unserer Einschätzung:

- vermittelt der Abschluss von PIMCO Funds: Global Investor Series plc (der „Abschluss“) ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögenswerte, der Verbindlichkeiten und der Finanzlage der Gesellschaft und der Fonds zum 31. Dezember 2023 sowie der Ergebnisse für das an diesem Tag abgelaufene Geschäftsjahr;
- wurde der Abschluss ordnungsgemäß im Einklang mit den in Irland allgemein anerkannten Bilanzierungsrichtlinien (die vom Financial Reporting Council ausgegebenen Rechnungslegungsstandards, einschließlich Financial Reporting Standard 102 „The Financial Reporting Standard applicable in the UK and Republic of Ireland“ und irisches Recht) erstellt; und
- wurde der Abschluss in Übereinstimmung mit den Vorschriften des Companies Acts von 2014 und den European Communities (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations von 2011 (in der jeweils gültigen Fassung) ordnungsgemäß erstellt.

Wir haben den im Jahresbericht enthaltenen Abschluss geprüft, der Folgendes umfasst:

- den Finanzstatus zum 31. Dezember 2023;
- die Betriebsergebnisrechnung für das an diesem Tag abgelaufene Geschäftsjahr;
- den Ausweis der Veränderungen im Nettovermögen für das an diesem Tag abgelaufene Geschäftsjahr;
- die Aufstellung der Wertpapieranlagen jedes Fonds zum 31. Dezember 2023; und
- die Erläuterungen zum Abschluss für die Gesellschaft sowie für sämtliche Fonds, einschließlich einer Beschreibung der wichtigsten Bilanzierungs- und Bewertungsmethoden.

Grundlage unseres Bestätigungsvermerks

Wir haben unsere Prüfung gemäß den International Standards on Auditing (Ireland) („ISAs (Ireland)“) und geltendem Recht durchgeführt.

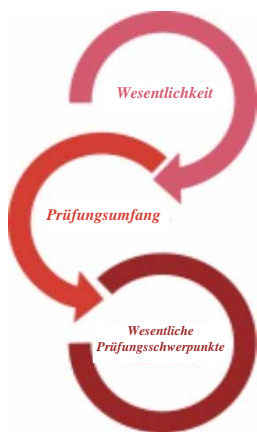
Unsere Verantwortlichkeiten im Rahmen der ISAs (Ireland) sind im Abschnitt „Verantwortung der Abschlussprüfer für die Prüfung des Abschlusses“ unseres Berichts näher beschrieben. Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und angemessen sind, um eine Grundlage für unser Prüfungsurteil zu bilden.

Unabhängigkeit

Wir sind gemäß den ethischen Anforderungen, die für unsere Prüfung des Abschlusses in Irland relevant sind und die den Ethikstandard der IAASA, wie er auf börsennotierte Unternehmen anzuwenden ist, umfassen, von der Gesellschaft unabhängig geblieben und haben unsere sonstigen ethischen Verpflichtungen gemäß mit diesen Anforderungen erfüllt.

Unser Prüfungsansatz

Überblick



Wesentlichkeit

- Gesamtwesentlichkeit: 50 Basispunkte (2022: 50 Basispunkte des Nettoinventarwerts („NIW“) zum 31. Dezember 2023 (2022: 31. Dezember 2022) für jeden der Teilfonds der Gesellschaft.
- Toleranzwesentlichkeit 75 % der Gesamtwesentlichkeit.

Prüfungsumfang

- Bei der Gesellschaft handelt es sich um eine offene Investmentgesellschaft mit variablem Kapital. Sie hat PIMCO Global Advisors (Ireland) Limited (die „Verwaltungsgesellschaft“) mit der Verwaltung bestimmter Pflichten und Verantwortlichkeiten im Zusammenhang mit der täglichen Verwaltung der Gesellschaft beauftragt. Bei der Bestimmung des Umfangs unserer Prüfung haben wir die Arten von Anlagen der Fonds, die Beteiligung der umseitig aufgeführten Dritten, die bilanziellen Verfahren und Kontrollen sowie die Branche, in der die Gesellschaft tätig ist, berücksichtigt. Wir betrachten jeden Fonds einzeln.

Wesentliche Prüfungsschwerpunkte

- Bewertung der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten.
- Existenz der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten.

Umfang unserer Prüfung

Im Rahmen der Planung unserer Prüfung haben wir die Wesentlichkeit ermittelt und die Risiken wesentlicher Fehldarstellungen im Abschluss beurteilt. Insbesondere haben wir Bereiche untersucht, in denen der Verwaltungsrat subjektive Beurteilungen vorgenommen hat, beispielsweise bei der Auswahl von Preisquellen für die Bewertung des Anlageportfolios. Wie in unseren Prüfungen üblich, sind wir auch auf das Risiko eingegangen, dass die Unternehmensleitung interne Kontrollmaßnahmen umgehen könnte. Unter anderem haben wir untersucht, ob Hinweise auf eine Voreingenommenheit des Verwaltungsrats vorliegen, wodurch sich ein Risiko wesentlicher Fehldarstellungen aufgrund von Betrug ergeben könnte.

Wesentliche Prüfungsschwerpunkte

Bei den wesentlichen Prüfungsschwerpunkten handelt es sich um diejenigen Sachverhalte, die nach pflichtgemäßem Ermessen der Abschlussprüfer für die Prüfung des Abschlusses für den aktuellen Berichtszeitraum von größter Bedeutung waren. Sie umfassen die erheblichsten von den Abschlussprüfern ermittelten Risiken wesentlicher Fehldarstellungen (sei es aufgrund von Betrug oder anderweitig), einschließlich der Risiken mit den stärksten Auswirkungen auf die Prüfungsstrategie insgesamt, die Zuteilung von Ressourcen im Rahmen der Prüfung und die Steuerung der Anstrengungen des Prüfungsteams. Diese Sachverhalte und alle Bemerkungen, die wir zu den Ergebnissen unserer diesbezüglichen Verfahren machen, wurden im Rahmen unserer Prüfung des Abschlusses als Ganzes und bei der Erstellung unseres Bestätigungsvermerks behandelt, und wir geben zu diesen Sachverhalten kein gesondertes Prüfungsurteil ab. Hierbei handelt es sich nicht um eine vollständige Liste sämtlicher im Rahmen unserer Prüfung identifizierten Risiken.

Wesentlicher Prüfungsschwerpunkt

Bewertung der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten.

Informationen hierzu finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen für den jeweiligen Fonds, unter „Wichtige Bilanzierungs- und Bewertungsmethoden“ in Erläuterung 2 und unter „Anlagen zum Marktwert und Marktbewertungshierarchie“ in Erläuterung 3. Die im Finanzstatus enthaltenen erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten zum 31. Dezember 2023 wurden gemäß den in Irland allgemein anerkannten Bilanzierungsrichtlinien (Generally Accepted Accounting Practice in Ireland) zum beizulegenden Zeitwert bewertet. Wir haben die Bewertung von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und finanziellen Verbindlichkeiten als wesentlichen Prüfungsschwerpunkt betrachtet, da diese das Hauptelement des Abschlusses darstellt.

Umgang mit dem Prüfungsschwerpunkt im Rahmen unserer Prüfung

Wir haben die Bewertung von übertragbaren Wertpapieren, Einlagen bei Kreditinstituten und zum beizulegenden Zeitwert leerverkauften Wertpapieren zum 31. Dezember 2023 unter Einbeziehung von Quellen von Drittanbietern, soweit verfügbar, geprüft. Da für bestimmte Wertpapiere der Stufen 1 und 2 keine Quellen von Drittanbietern zur Verfügung stehen, haben wir alternative Prüfverfahren angewendet, die die Einholung von Kursbestätigungen von Maklern oder die Unterstützung der Preisgestaltung durch das Management beinhalten.

Wir haben den beizulegenden Zeitwert der als Anlagen der Stufe 3 eingestuft Wertpapiere geprüft, indem wir die vom Management verwendeten Methoden und Daten berücksichtigt haben, um die geschätzten beizulegenden Zeitwerte zu bestimmen. Wir haben die Ergebnisse unserer unabhängigen Bewertung mit der Schätzung des Managements verglichen, um zu bestimmen, ob die Schätzung des Managements für den beizulegenden Zeitwert angemessen war. Investmentfonds umfassen börsengehandelte Fonds und Organismen für gemeinsame Anlagen. Wir haben die Bewertung der börsengehandelten Fonds mit Quellen von Drittanbietern überprüft. Hinsichtlich der Organismen für gemeinsame Anlagen haben wir den beizulegenden Zeitwert mit einer unabhängigen Bestätigung der zuständigen Transferstelle abgestimmt.

Wir haben den Marktwert von Pensionsgeschäften durch Abstimmung des beizulegenden Zeitwertes mit Angaben von Gegenparteien geprüft.

Wir haben die Bewertung derivativer Finanzinstrumente geprüft, indem wir unseren internen Bewertungsexperten gebeten haben, eine unabhängige Schätzung des beizulegenden Zeitwerts abzugeben und zu bestimmen, ob die Schätzung des beizulegenden Zeitwerts durch das Management angemessen war, oder unter Einholung von Preisangaben von Drittanbietern, soweit vorhanden. Bei der Durchführung dieser Verfahren wurden keine wesentlichen Fehldarstellungen festgestellt.

Vorliegen der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten.

Informationen hierzu finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen für den jeweiligen Fonds, unter „Wichtige Bilanzierungs- und Bewertungsmethoden“ in Erläuterung 2 und unter „Anlagen zum Marktwert und Marktbewertungshierarchie“ in Erläuterung 3. Die im Finanzstatus ausgewiesenen erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten der jeweiligen Fonds wurden zum 31. Dezember 2023 im Namen der einzelnen Fonds gehalten. Wir haben das Vorliegen von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und finanziellen Verbindlichkeiten als wesentlichen Prüfungsschwerpunkt betrachtet, da dies das Hauptelement des Abschlusses darstellt.

Wir haben eine unabhängige Bestätigung von der Verwahrstelle oder unabhängiger Gegenparteien bezüglich der Bestände an übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten zum 31. Dezember 2023 eingeholt. Wir haben die Bestände gemäß den Bestätigungen mit den Beständen gemäß den Geschäftsbüchern abgeglichen, und eine Stichprobe der aufgeführten Abgleichsposten wurde mit den zugrunde liegenden Belegen verglichen.

Für den beizulegenden Zeitwert leerverkaufter Wertpapiere haben wir unabhängige Bestätigungen der Gegenparteien eingeholt. Investmentfonds umfassen börsengehandelte Fonds und Organismen für gemeinsame Anlagen. Für börsengehandelte Fonds haben wir eine unabhängige Bestätigung der Verwahrstelle eingeholt. Hinsichtlich der Organismen für gemeinsame Anlagen haben wir eine unabhängige Bestätigung der zuständigen Transferstelle eingeholt.

Was Pensionsgeschäfte betrifft, haben wir unabhängige Bestätigungen der Gegenparteien eingeholt.

In Bezug auf Finanzderivate haben wir, soweit möglich, unabhängige Bestätigungen der Gegenparteien eingeholt. Aufgrund des Fehlens einer verfügbaren Bestätigung einer unabhängigen Gegenpartei haben wir für bestimmte Positionen alternative Prüfverfahren verwendet.

Devisenterminkontrakte haben wir, soweit möglich, entsprechend den Bankauszügen liquidiert. Alternativ haben wir bei unabhängigen Gegenparteien eine Bestätigung eingeholt, wenn es sich um wesentliche Positionen handelte oder das Fälligkeitsdatum nach dem Genehmigungsdatum der Prüfung liegt.

Bei der Durchführung dieser Verfahren wurden keine wesentlichen Fehldarstellungen festgestellt.

Bestimmung des Prüfungsumfangs

Wir haben den Umfang unserer Prüfung so bemessen, dass gewährleistet ist, dass wir ausreichende Leistungen erbracht haben, um ein Prüfungsurteil über den Jahresabschluss als Ganzes unter Berücksichtigung der Struktur der Gesellschaft, der Rechnungslegungsprozesse und -kontrollen sowie der Branche, in der sie tätig ist, abgeben zu können.

Zum 31. Dezember 2023 waren 56 Teilfonds in Betrieb. Der Finanzstatus, die Betriebsergebnisrechnung und der Ausweis der Veränderungen im Nettovermögen der Gesellschaft sind eine Zusammenfassung der Positionen und Ergebnisse der einzelnen Fonds.

Der Verwaltungsrat kontrolliert die Geschäfte der Gesellschaft und ist für die allgemeine Anlagepolitik verantwortlich, die von ihm festgelegt wird. Die Gesellschaft hat die Verwaltungsgesellschaft mit der Verwaltung bestimmter Pflichten und Verantwortlichkeiten im Zusammenhang mit der täglichen Verwaltung der Gesellschaft beauftragt. Die Verwaltungsgesellschaft hat bestimmte Verantwortlichkeiten an die Anlageberatungsgesellschaften sowie an State Street Fund Services (Ireland) Limited (den „Administrator“) delegiert. Der Abschluss, der weiterhin in der Verantwortung des Verwaltungsrats liegt, wird in seinem Namen vom Administrator erstellt. Die Gesellschaft hat State Street Custodial Services (Ireland) Limited (die „Verwahrstelle“) zur Verwahrstelle für das Vermögen der Gesellschaft bestellt. Bei der Festlegung des globalen Ansatzes für unsere Prüfung haben wir das Risiko wesentlicher Fehldarstellungen auf Teilfondsebene beurteilt. Hierbei haben wir die Art, die Wahrscheinlichkeit und das potenzielle Ausmaß möglicher Fehldarstellungen berücksichtigt. Im Rahmen unserer Risikobeurteilung haben wir die Interaktion der Gesellschaft mit dem Administrator berücksichtigt und das beim Administrator vorliegende Kontrollumfeld beurteilt.

Wesentlichkeit

Der Umfang unserer Prüfung wurde durch Anwendung von Wesentlichkeitskriterien bestimmt. Wir haben bestimmte quantitative Wesentlichkeitsgrenzen angesetzt, die uns gemeinsam mit qualitativen Überlegungen geholfen haben, den Umfang unserer Prüfung und die Art, die zeitliche Gestaltung und das Ausmaß unserer Prüfverfahren für die einzelnen Posten des Abschlusses und die darin enthaltenen Angaben festzulegen und die Auswirkungen von Fehldarstellungen sowohl individuell betrachtet als auch bezüglich des Abschlusses insgesamt zu beurteilen.

Nach unserem pflichtgemäßen Ermessen haben wir Wesentlichkeit für die Abschlüsse der einzelnen Teilfonds der Gesellschaft folgendermaßen bestimmt:

<i>Allgemeine Wesentlichkeit und Art der Bestimmung</i>	50 Basispunkte (2022: 50 Basispunkte des Nettoinventarwerts („NIW“) zum 31. Dezember 2023 (2022: 31. Dezember 2022) für jeden der Teilfonds der Gesellschaft.
<i>Begründung für den angewandten Vergleichswert</i>	Wir haben diesen Vergleichswert herangezogen, da das Hauptziel der Gesellschaft darin besteht, den Anlegern eine Gesamtrendite auf Teilfondsebene unter Berücksichtigung der Kapital- und Ertragsrenditen zu bieten.

Wir nutzen die Toleranzwesentlichkeit, um die Wahrscheinlichkeit, dass die Summe nicht korrigierter und unerkannter Fehldarstellungen die Gesamtwesentlichkeitsgrenze übersteigt, auf ein angemessen niedriges Niveau zu reduzieren. Insbesondere nutzen wir die Toleranzwesentlichkeit bei der Bestimmung des Umfangs unserer Prüfungsleistung sowie der Art und des Umfangs unserer Prüfung von Kontensalden, Transaktionsklassen und Offenlegungen, zum Beispiel bei der Festlegung des Stichprobenumfangs. Unsere Toleranzwesentlichkeit betrug 75 % der Gesamtwesentlichkeitsgrenze.

Bei der Ermittlung der Toleranzwesentlichkeit haben wir eine Reihe von Faktoren berücksichtigt – die Historie von Fehldarstellungen, die Risikobewertung und das Aggregationsrisiko sowie die Wirksamkeit der Kontrollen – und kamen zu dem Schluss, dass ein Wert am oberen Ende unseres Normalbereichs angemessen war.

Wir haben mit dem Verwaltungsrat vereinbart, diesem sämtliche bei unserer Prüfung ermittelten Fehldarstellungen mit Auswirkung auf den NIW je Anteil in Höhe von mehr als 10 % der Gesamtwesentlichkeit (2022: 10 % der Gesamtwesentlichkeit bei Differenzen mit Auswirkung auf den NIW je Anteil) zu melden, ebenso wie Fehldarstellungen unterhalb dieses Betrags, die unserer Einschätzung nach aus qualitativen Gründen zu melden sind.

Schlussfolgerungen zur Unternehmensfortführung

Unsere Bewertung der Beurteilung des Verwaltungsrats hinsichtlich der Fähigkeit der Gesellschaft und der Fonds zur Fortführung der Rechnungslegung unter der Annahme der Unternehmensfortführung umfasste Folgendes:

- Erlangung eines Verständnisses der Schlüsselindikatoren, die im Hinblick auf die Annahme der Unternehmensfortführung überwacht werden, sowie der Zukunftsplanung des Managements für die Teilfonds für den Zeitraum der Unternehmensfortführung (d.h. 12 Monate ab dem Datum der Genehmigung des Jahresabschlusses);
- Prüfung der verfügbaren Protokolle des Verwaltungsrats während des Prüfungszeitraums und der bis zum Datum dieses Berichts verfügbaren Protokolle;
- Berücksichtigung der in den zugrunde liegenden Geschäftsbüchern erfassten Kapitalaktivität nach Ende des Geschäftsjahres;
- Erkundigungen bei der Geschäftsleitung über geplante umfangreiche Rücknahmen, über die sie in Kenntnis gesetzt wurde;
- Prüfung der Techniken zur Steuerung des Liquiditätsrisikos, die der Gesellschaft und den Teilfonds zur Verfügung stehen.

Im Rahmen unserer Prüfung haben wir keine wesentlichen Unsicherheiten in Bezug auf Ereignisse oder Bedingungen festgestellt, die einzeln oder zusammen erhebliche Zweifel an der Fähigkeit der Gesellschaft und der Fonds aufwerfen, für einen Zeitraum von mindestens zwölf Monaten ab dem Datum, an dem der Abschluss zur Veröffentlichung genehmigt wird, weiter zu bestehen.

Bei der Prüfung des Abschlusses sind wir zu dem Schluss gekommen, dass die Anwendung des Grundsatzes der Unternehmensfortführung als Grundlage der Rechnungslegung für die Erstellung des Abschlusses angemessen ist.

Da es jedoch nicht möglich ist, alle künftigen Ereignisse oder Schlussfolgerung vorherzusagen, ist diese Erklärung keine Garantie für die Fähigkeit der Gesellschaft bzw. der Fonds zur Fortsetzung des Geschäftsbetriebs.

Unsere Verantwortlichkeiten und die Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrats im Hinblick auf die Unternehmensfortführung werden in den jeweiligen Abschnitten dieses Berichts beschrieben.

Berichterstattung über sonstige Informationen

Die sonstigen Informationen umfassen die im Jahresbericht enthaltenen Informationen, nicht jedoch den Abschluss und unseren diesbezüglichen Prüfungsbericht. Der Verwaltungsrat ist für die sonstigen Informationen verantwortlich. Unser Bestätigungsvermerk zum Abschluss erstreckt sich nicht auf die sonstigen Informationen, und dementsprechend geben wir auch weder einen Bestätigungsvermerk noch, sofern in diesem Bericht nicht ausdrücklich etwas anderes angegeben ist, eine Zusicherung jeglicher Art darüber ab. In Verbindung mit unserer Prüfung des Abschlusses liegt es in unserer Verantwortung, die sonstigen Informationen zu lesen und dabei zu erwägen, ob die sonstigen Informationen wesentliche Widersprüche zum Abschluss oder unseren im Rahmen der Prüfung erlangten Kenntnissen enthalten oder anderweitig wesentlich fehlerhaft zu sein scheinen. Wenn wir offensichtliche wesentliche Widersprüchlichkeiten oder wesentliche Fehldarstellungen feststellen, sind wir verpflichtet, Verfahren durchzuführen, um zu bestimmen, ob eine wesentliche Fehldarstellung des Abschlusses oder eine wesentliche Fehldarstellung der sonstigen Informationen vorliegt. Wenn wir aufgrund der von uns geleisteten Arbeit zu dem Schluss kommen, dass eine wesentliche Fehldarstellung dieser sonstigen Informationen vorliegt, sind wir verpflichtet, diese Tatsache zu melden. Wir haben diesbezüglich nichts zu berichten.

Im Hinblick auf den Bericht des Verwaltungsrats haben wir zudem geprüft, ob die vom Companies Act 2014 geforderten Angaben enthalten sind.

Beruhend auf den oben beschriebenen Verantwortlichkeiten und unserer Arbeit im Rahmen der Abschlussprüfung sind wir gemäß den ISAs (Irland) und dem Companies Act 2014 zudem verpflichtet, bestimmte Meinungen und Sachverhalte, wie nachfolgend beschrieben, offenzulegen:

- Auf Basis der bei der Prüfung gewonnenen Erkenntnisse entsprechen die Angaben im Bericht des Verwaltungsrats für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 unseres Erachtens dem Jahresabschluss und wurden in Übereinstimmung mit den anwendbaren gesetzlichen Vorschriften erstellt.
- Auf Basis unserer Kenntnis und unseres Verständnisses der Gesellschaft und ihres Umfelds, die wir im Rahmen unserer Prüfung erlangt haben, haben wir keine wesentlichen Fehldarstellungen im Bericht des Verwaltungsrats identifiziert.

Verantwortung für den Abschluss und die Prüfung

Verantwortung des Verwaltungsrats für den Abschluss

Wie in der auf Seite 884 dargelegten Erklärung zu den Aufgaben des Verwaltungsrats ausführlicher erläutert, sind die Verwaltungsratsmitglieder für die Erstellung des Jahresabschlusses in Übereinstimmung mit den anwendbaren Bilanzierungsrichtlinien verantwortlich und müssen sich davon überzeugen, dass dieser ein wahrheitsgemäßes und angemessenes Bild vermittelt.

Der Verwaltungsrat ist außerdem für interne Kontrollmaßnahmen verantwortlich, die er für notwendig erachtet, um die Erstellung von Abschlüssen zu ermöglichen, die frei von wesentlichen Fehldarstellungen sind, sei es aufgrund von Betrug oder Irrtum.

Bei der Erstellung des Abschlusses ist der Verwaltungsrat dafür verantwortlich, die Fähigkeit der Gesellschaft und der Fonds zur Unternehmensfortführung zu beurteilen, wobei er gegebenenfalls Angelegenheiten in Bezug auf die Unternehmensfortführung oder die Anwendung des Fortführungsprinzips offenlegen muss, sofern der Verwaltungsrat nicht die Auflösung der Gesellschaft oder die Einstellung des Betriebs beabsichtigt oder keine realistische Alternative dazu hat.

Verantwortung der Abschlussprüfer für die Prüfung des Abschlusses

Unsere Zielsetzung ist es, eine hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob der Abschluss insgesamt frei von wesentlichen Fehldarstellungen ist, sei es aufgrund von Betrug oder Irrtum, und einen Prüfbericht zu erstellen, der unseren Bestätigungsvermerk enthält. Eine hinreichende Sicherheit ist ein hohes Maß an Sicherheit, jedoch keine Garantie dafür, dass eine gemäß den ISAs (Irland) durchgeführte Prüfung stets eine eventuell vorliegende wesentliche Fehldarstellung aufdeckt. Fehldarstellungen können aufgrund von Betrug oder Irrtum entstehen und werden als wesentlich angesehen, wenn angemessenerweise davon ausgegangen werden könnte, dass sie einzeln oder insgesamt die auf der Grundlage dieses Abschlusses getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Benutzern beeinflussen könnten.

Unregelmäßigkeiten, einschließlich Betrug, sind Verstöße gegen Gesetze und Vorschriften. Wir entwickeln die Verfahren im Einklang mit unseren oben beschriebenen Verantwortlichkeiten, um wesentliche Fehldarstellungen in Bezug auf Unregelmäßigkeiten, einschließlich Betrug, aufzudecken. Der Umfang, in dem unsere Verfahren Unregelmäßigkeiten, einschließlich Betrug, aufdecken können, ist nachfolgend näher beschrieben.

Auf der Grundlage unseres Verständnisses von Gesellschaft und Branche haben wir festgestellt, dass die Hauptrisiken der Nichteinhaltung von Gesetzen und Vorschriften in Bezug auf Unregelmäßigkeiten, einschließlich Betrug, bestehen. Wir entwickeln die Verfahren im Einklang mit unseren oben beschriebenen Verantwortlichkeiten, um wesentliche Fehldarstellungen in Bezug auf Unregelmäßigkeiten, einschließlich Betrug, aufzudecken. Der Umfang, in dem unsere Verfahren Unregelmäßigkeiten, einschließlich Betrug, aufdecken können, ist nachstehend näher erläutert, und wir haben untersucht, inwieweit eine Nichteinhaltung einen wesentlichen Einfluss auf den Abschluss haben könnte. Wir haben auch die Gesetze und Verordnungen berücksichtigt, die einen direkten Einfluss auf die Erstellung des Jahresabschlusses haben, wie z.B. den Companies Act 2014 und die European Communities (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations 2011 (in der jeweils gültigen Fassung). Wir haben die Anreize und Gelegenheiten für betrügerische Manipulationen des Jahresabschlusses (einschließlich des Risikos der Umgehung von Kontrollen) durch das Management bewertet und festgestellt, dass die Hauptrisiken mit dem Risiko der Umgehung von Kontrollen durch das Management in Zusammenhang stehen.

Die vom Prüfungsteam durchgeführten Prüfungshandlungen umfassten:

- Erkundigungen bei der Geschäftsleitung, um Verstöße gegen Gesetze und Vorschriften aufzuzeigen;
- Identifizierung und Prüfung von Buchungssätzen, die unseren spezifischen risikobasierten Kriterien entsprachen;
- Prüfung von Schätzungen und Annahmen in der Rechnungslegung und des möglichen Potenzials einer Voreingenommenheit der Geschäftsleitung;
- Entwurf von Prüfverfahren, um Unvorhersehbarkeiten in Bezug auf Art, Zeitpunkt oder Umfang unserer Prüfungen zu berücksichtigen; und
- Überprüfung der Protokolle von Verwaltungsratssitzungen.

Die beschriebenen Prüfungsverfahren unterliegen zwangsläufig Einschränkungen. Es ist weniger wahrscheinlich, dass wir von Fällen von Verstößen gegen Gesetze und Vorschriften Kenntnis erlangen, die nicht eng mit im Abschluss enthaltenen Ereignissen und Transaktionen verbunden sind. Außerdem ist das Risiko, dass wesentliche Fehldarstellungen aufgrund von dolosen Handlungen nicht aufgedeckt werden, höher als das Risiko, dass wesentliche Fehldarstellungen aufgrund von Irrtümern nicht aufgedeckt werden, da dolose Handlungen vorsätzliche Verschleierung, beispielsweise durch Fälschungen oder vorsätzliche Fehldarstellungen, oder durch geheime Absprachen beinhalten können.

Zu den Prüfungen im Rahmen unserer Abschlussprüfung kann die Prüfung vollständiger Bestände bestimmter Transaktionen und Salden zählen, möglicherweise unter Verwendung von Datenprüfungstechniken. Üblicherweise wird jedoch eine beschränkte Anzahl von Elementen für die Prüfung ausgewählt, statt vollständige Bestände zu prüfen. Oftmals sind wir bestrebt, uns bei der Prüfung auf bestimmte Elemente zu konzentrieren, basierend auf deren Umfang oder Risikomerkmale. In anderen Fällen führen wir eine stichprobenbasierte Prüfung durch, um Schlussfolgerungen hinsichtlich des Bestandes zu ziehen, aus dem die Stichprobe ausgewählt wurde.

Eine weitere Beschreibung unserer Verantwortlichkeiten für die Prüfung des Abschlusses finden sich auf der IAASA-Website unter https://www.iaasa.ie/getmedia/b2389013-1cf6-458b-9b8f-a98202dc9c3a/Description_of_auditors_responsibilities_for_audit.pdf.

Diese Beschreibung ist Bestandteil unseres Berichts des Abschlussprüfers.

Verwendung dieses Berichts

Dieser Bericht einschließlich des Testats wurde ausschließlich für die Anteilhaber der Gesellschaft als Organ gemäß § 391 des Companies Act von 2014 und zu keinem anderen Zweck erstellt. Mit unserer Stellungnahme akzeptieren oder übernehmen wir keine Verantwortung für andere Zwecke oder gegenüber anderen Personen, die von diesem Bericht Kenntnis erhalten oder in deren Hände er gerät, es sei denn, dies wurde von uns vorab ausdrücklich schriftlich zugesichert.

Sonstige Berichtspflichten

Stellungnahmen zu anderen Angelegenheiten gemäß dem Companies Act 2014

- Wir haben alle Informationen und Erklärungen erhalten, die wir für unsere Prüfung für notwendig halten.
- Unserer Auffassung nach waren die Geschäftsbücher der Gesellschaft ausreichend, um eine problemlose und ordnungsgemäße Prüfung des Abschlusses zu ermöglichen.
- Der Abschluss stimmt mit den Geschäftsbüchern überein.

Ausnahmemeldungen gemäß dem Companies Act 2014

Vergütung und Transaktionen der Verwaltungsratsmitglieder

Gemäß dem Companies Act von 2014 müssen wir Ihnen mitteilen, wenn unserer Auffassung nach die von den Paragraphen 305 bis 312 dieses Gesetzes geforderten Angaben zur Vergütung und den Transaktionen der Verwaltungsratsmitglieder nicht gemacht wurden. Wir haben diesbezüglich keine Ausnahmen zu melden.

Mary Ruane
für und im Namen von PricewaterhouseCoopers
Chartered Accountants und Statutory Audit Firm
Dublin
25. April 2024

Wir haben das Geschäftsgebaren der PIMCO Funds: Global Investors Series plc (die „Gesellschaft“) für das zum 31. Dezember 2023 endende Geschäftsjahr in unserer Eigenschaft als Verwahrstelle der Gesellschaft untersucht.

Dieser Bericht, einschließlich des Bestätigungsvermerks, wurde ausschließlich für die Anteilhaber der Gesellschaft als Körperschaft im Einklang mit Verordnung 34, (1), (3) und (4) in Teil 5 der European Communities (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations von 2011 in ihrer jeweils geltenden Fassung („UCITS Regulations“) und zu keinem anderen Zweck erstellt. Mit diesem Testat übernehmen und akzeptieren wir keinerlei Verantwortung zu anderen Zwecken oder gegenüber anderen Personen, die Kenntnis von diesem Bericht erhalten.

VERANTWORTUNG DER VERWAHRSTELLE

Unsere Pflichten und unsere Verantwortung sind in Verordnung 34, (1), (3) und (4) in Teil 5 der UCITS Regulations dargelegt. Eine dieser Pflichten ist die Untersuchung des Geschäftsgebarens der Gesellschaft für jeden Rechnungslegungszeitraum von einem Jahr und die Berichterstattung hierüber an die Anteilhaber.

Aus unserem Bericht geht hervor, ob die Gesellschaft unserer Meinung nach während dieses Zeitraums in Übereinstimmung mit den Bestimmungen der Satzung der Gesellschaft (die „Satzung“) und den UCITS Regulations verwaltet wurde. Die Gesellschaft ist dafür verantwortlich, diese Bestimmungen einzuhalten. Sollte die Gesellschaft nicht für eine derartige Übereinstimmung gesorgt haben, ist es unsere Pflicht als Verwahrstelle, hierüber zu berichten und die von uns getroffenen Abhilfemaßnahmen aufzuführen.

GRUNDLAGE DES TESTATS DER VERWAHRSTELLE

Die Verwahrstelle führt alle Prüfungen durch, die ihrer Meinung nach angemessen sind, um ihre in Verordnung 34, (1), (3) und (4) in Teil 5 der UCITS Regulations erwähnten Pflichten zu erfüllen und zu gewährleisten, dass die Gesellschaft unter allen wesentlichen Gesichtspunkten folgendermaßen verwaltet wurde: (i) unter Einhaltung der von ihrer Satzung und den UCITS Regulations auferlegten Anlagegrenzen und Kreditaufnahmebefugnisse und (ii) ansonsten in Übereinstimmung mit der Satzung und den entsprechenden Vorschriften.

TESTAT

Unserer Meinung nach wurde die Gesellschaft während des Berichtszeitraums unter allen wesentlichen Gesichtspunkten folgendermaßen verwaltet:

- (i) unter Einhaltung der von ihrer Satzung, den UCITS Regulations und den Central Bank (Supervision and Enforcement) Act 2013 (Section 48(1)) (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations 2019 (die „Central Bank UCITS Regulations“) auferlegten Anlagegrenzen und Kreditaufnahmebefugnisse; und
- (ii) ansonsten in Übereinstimmung mit den Bestimmungen der Satzung, den UCITS Regulations und den Central Bank UCITS Regulations.

State Street Custodial Services (Ireland) Limited,
78 Sir John Rogerson's Quay,
Dublin D02 HD32,
Irland

Datum: 25. April 2024

PIMCO Global Advisors (Ireland) Limited (die „Verwaltungsgesellschaft“) ist im Rahmen ihren Pflichten gemäß Richtlinie 2009/65/EG in ihrer jeweils geltenden Fassung (die „OGAW-Richtlinie“) verpflichtet, für diejenigen Mitarbeiterkategorien, einschließlich Geschäftsleitung, Risikoträger und Mitarbeiter mit Kontrollfunktionen und aller Mitarbeiter, die eine Gesamtvergütung erhalten, aufgrund derer sie sich in derselben Einkommensstufe befinden wie Mitglieder der Geschäftsleitung und Risikoträger, deren Tätigkeit sich wesentlich auf die Risikoprofile der Verwaltungsgesellschaft oder von dieser verwalteter Organismen für gemeinsame Anlagen („OGAW“) auswirkt, Vergütungsrichtlinien und -praktiken vorzuhalten, die mit einem soliden und wirksamen Risikomanagement vereinbar und diesem förderlich sind und keine Anreize zur Eingehung von Risiken setzen, die nicht mit dem Risikoprofil, den Vorschriften oder der Gründungsurkunde der Verwaltungsgesellschaft oder von PIMCO Funds: Global Investors Series plc (die „Gesellschaft“) vereinbar sind.

Die Vergütungspolitik enthält zudem Angaben zur Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken in die Vergütungsverfahren der Verwaltungsgesellschaft, wie in der EU-Verordnung über die Offenlegung nachhaltiger Finanzprodukte (2019/2088) gefordert.

Die Vergütung besteht aus allen Arten von Zahlungen oder Leistungen, die unmittelbar durch die oder mittelbar, jedoch im Auftrag der Verwaltungsgesellschaft als Gegenleistung für von Mitarbeitern erbrachte berufliche Dienstleistungen gewährt werden. Hierzu zählen, je nach Sachlage: (i) alle Arten von Zahlungen oder Leistungen, die durch die Verwaltungsgesellschaft gezahlt werden; (ii) jeder Betrag, der durch die Gesellschaft gezahlt wird, einschließlich jedes Anteils an Erfolgsgebühren; und/oder (iii) jede Übertragung von Anteilen oder Aktien einer Gesellschaft als Gegenleistung für durch die identifizierten Mitarbeiter erbrachte berufliche Dienstleistungen. Bei einer festen Vergütung erfolgen Zahlungen oder Leistungen ohne Berücksichtigung von Leistungskriterien. Bei einer variablen Vergütung erfolgen zusätzliche Zahlungen oder Leistungen in Abhängigkeit von der Leistung oder ggf. anderen vertraglich vereinbarten Kriterien.

Angaben erfolgen in Bezug auf (a) die Mitarbeiter der Verwaltungsgesellschaft; (b) Mitarbeiter, die der Geschäftsleitung angehören; und (c) Mitarbeiter mit der Fähigkeit, wesentlichen Einfluss auf das Risikoprofil des Fonds zu nehmen, einschließlich natürlicher Personen, die zwar nicht unmittelbar durch die Verwaltungsgesellschaft beschäftigt sind, jedoch von ihrem Arbeitgeber für die Erbringung von Dienstleistungen unmittelbar für die Verwaltungsgesellschaft abgestellt sind („Beauftragte“).

Der Betrag der Gesamtvergütung, die die Verwaltungsgesellschaft ihren Mitarbeitern gewährt und die dem OGAW-bezogenen Geschäft der Verwaltungsgesellschaft im Hinblick auf das Geschäftsjahr der Verwaltungsgesellschaft zum 31. Dezember 2023 zugerechnet wurde, beläuft sich auf 180.000 EUR. Dieser Wert umfasst die feste Vergütung in Höhe von 180.000 EUR und die variable Vergütung in Höhe von 0 EUR. Insgesamt gab es drei Begünstigte bezüglich der vorstehend beschriebenen Vergütung.

Der Betrag der durch die Verwaltungsgesellschaft gewährten Gesamtvergütung, die dem OGAW-bezogenen Geschäft der Verwaltungsgesellschaft im Hinblick auf das Geschäftsjahr der Verwaltungsgesellschaft zum 31. Dezember 2023 zugerechnet wurde, belief sich für ihre Geschäftsleitung auf null USD und für andere Mitglieder ihrer Belegschaft, deren Handlungen eine wesentliche Auswirkung auf das Risikoprofil des OGAW-bezogenen Geschäft der Verwaltungsgesellschaft haben, auf null USD.

Der Betrag der durch ihren identifizierten Mitarbeitern durch Beauftragte gewährten Gesamtvergütung, der den Teilfonds im Hinblick auf das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 zugerechnet wird, beläuft sich auf 10.515.112 USD. Diese Zahl umfasst eine feste Vergütung in Höhe von 84.451 USD und eine variable Vergütung in Höhe von 10.430.661 USD. Insgesamt gab es 62 Begünstigte bezüglich der vorstehend beschriebenen Vergütung.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des PIMCO Asia High Yield Bond Fund

31. Dezember 2023 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2023			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2023		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	81.115.936	\$ 807.852	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	83.957.336	\$ 836.148
	PARI (000S)			PARI (000S)	
Standard Chartered PLC 7,750 % fällig am 15.08.2027	\$ 53.700	53.836	Sands China Ltd. 4,300 % fällig am 08.01.2026	\$ 46.100	43.795
Mongolia Government International Bond 8,650 % fällig am 19.01.2028	30.770	30.509	Sands China Ltd. 5,375 % fällig am 08.08.2025	32.400	31.942
Shriram Finance Ltd. 4,400 % fällig am 13.03.2024	28.254	27.684	Indika Energy Capital Pte. Ltd. 8,250 % fällig am 22.10.2025	25.900	25.696
Huarong Finance Co. Ltd. 4,750 % fällig am 27.04.2027	30.300	26.327	Sands China Ltd. 5,650 % fällig am 08.08.2028	26.300	25.511
Sino-Ocean Land Treasure Ltd. 3,250 % fällig am 05.05.2026	32.250	24.086	Standard Chartered PLC 7,750 % fällig am 15.08.2027	21.400	21.290
Dah Sing Bank Ltd. 7,375 % fällig am 15.11.2033	22.200	22.070	Muthoot Finance Ltd. 4,400 % fällig am 02.09.2023	21.400	21.059
Standard Chartered PLC 6,000 % fällig am 26.07.2025	22.100	21.613	Freeport Indonesia PT 5,315 % fällig am 14.04.2032	21.800	20.424
Indonesia Government International Bond 4,650 % fällig am 20.09.2032	21.684	21.457	VLL International, Inc. 5,750 % fällig am 28.11.2024	20.900	20.328
Bangkok Bank PCL 5,000 % fällig am 23.09.2025	20.300	19.266	Indonesia Government International Bond 4,650 % fällig am 20.09.2032	21.684	20.028
Huarong Finance Co. Ltd. 4,500 % fällig am 29.05.2029	19.300	15.271	Yanlord Land HK Co. Ltd. 5,125 % fällig am 20.05.2026	23.400	18.533
SK Hynix, Inc. 6,375 % fällig am 17.01.2028	15.200	15.126	NWD Finance BVI Ltd. 6,150 % fällig am 16.03.2025	19.300	17.178
Sino-Ocean Land Treasure Ltd. 2,700 % fällig am 13.01.2025	21.200	15.109	Krung Thai Bank PCL 4,400 % fällig am 25.03.2026	18.800	17.128
Yunda Holding Investment Ltd. 2,250 % fällig am 19.08.2025	15.600	14.077	Mongolia Government International Bond 8,650 % fällig am 19.01.2028	16.800	16.709
Northern Star Resources Ltd. 6,125 % fällig am 11.04.2033	14.094	13.810	Periama Holdings LLC 5,950 % fällig am 19.04.2026	17.200	16.546
Wanda Properties Global Co. Ltd. 11,000 % fällig am 20.01.2025	14.000	13.668	Vedanta Resources Finance PLC 8,950 % fällig am 11.03.2025	23.100	16.385
India Cleantech Energy 4,700 % fällig am 10.08.2026	15.450	13.571	India Green Power Holdings 4,000 % fällig am 22.02.2027	18.100	15.666
GS Caltex Corp. 5,375 % fällig am 07.08.2028	13.600	13.552	Huarong Finance Co. Ltd. 4,500 % fällig am 29.05.2029	18.800	15.614
ReNew Wind Energy AP2 4,500 % fällig am 14.07.2028	15.800	13.431	Greenko Solar Mauritius Ltd. 5,950 % fällig am 29.07.2026	15.800	14.868
FWD Group Holdings Ltd. 6,375 % fällig am 13.09.2024	15.270	13.266	NWD Finance BVI Ltd. 5,250 % fällig am 22.03.2026	16.200	13.870

(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 Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Asia Strategic Interest Income Fund

31. Dezember 2023 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2023			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2023		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	15.771.481	\$ 157.062	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	17.599.287	\$ 175.260
	PARI (000S)			PARI (000S)	
Korea Housing Finance Corp. 4,625 % fällig am 24.02.2028	\$ 7.100	7.039	Korea Housing Finance Corp. 4,625 % fällig am 24.02.2028	\$ 7.100	6.901
Kasikornbank PCL 5,458 % fällig am 07.03.2028	5.600	5.600	Indonesia Government International Bond 4,650 % fällig am 20.09.2032	6.900	6.766
BOC Aviation Ltd. 6,667 % fällig am 26.09.2023	4.000	4.001	Korea National Oil Corp. 2,125 % fällig am 18.04.2027	5.300	4.808
POSCO 5,750 % fällig am 17.01.2028	3.700	3.682	Huarong Finance Co. Ltd. 4,500 % fällig am 29.05.2029	6.000	4.770
Export-Import Bank of Korea 5,000 % fällig am 11.01.2028	3.500	3.520	Kasikornbank PCL 5,458 % fällig am 07.03.2028	4.200	4.284
Korea National Oil Corp. 4,875 % fällig am 03.04.2028	3.500	3.506	ONGC Videsh Ltd. 3,750 % fällig am 07.05.2023	4.100	4.082
SK Hynix, Inc. 2,375 % fällig am 19.01.2031	4.620	3.477	Korea Electric Power Corp. 5,375 % fällig am 06.04.2026	4.000	3.985
SMBC Aviation Capital Finance DAC 5,450 % fällig am 03.05.2028	3.400	3.401	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2032 (b)	4.315	3.656
SK on Co. Ltd. 5,375 % fällig am 11.05.2026	3.400	3.397	Export-Import Bank of Korea 5,000 % fällig am 11.01.2028	3.500	3.573
China Life Insurance Overseas Co. Ltd. 5,350 % fällig am 15.08.2033	3.000	3.000	SK Hynix, Inc. 2,375 % fällig am 19.01.2031	4.600	3.492
Bank Mandiri Persero Tbk PT 5,500 % fällig am 04.04.2026	2.900	2.888	Periama Holdings LLC 5,950 % fällig am 19.04.2026	3.500	3.378
Shriram Finance Ltd. 4,400 % fällig am 13.03.2024	2.680	2.600	SK on Co. Ltd. 5,375 % fällig am 11.05.2026	3.400	3.368
India Toll Roads 5,500 % fällig am 19.08.2024	2.700	2.594	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 4,400 % fällig am 06.06.2027	3.200	3.165
NWD Finance BVI Ltd. 4,125 % fällig am 10.03.2028	3.550	2.523	Celestial Miles Ltd. 5,750 % fällig am 31.01.2024	3.100	3.014
Vietnam Debt & Asset Trading Corp. 1,000 % fällig am 10.10.2025	2.900	2.458	Airport Authority Hong Kong 2,500 % fällig am 12.01.2032	3.600	2.979
Korea Mine Rehabilitation & Mineral Resources Corp. 5,375 % fällig am 11.05.2028	2.450	2.431	CNAC HK Finbridge Co. Ltd. 3,875 % fällig am 19.06.2029	3.200	2.933
Standard Chartered PLC 6,301 % fällig am 09.01.2029	2.300	2.303	Korea National Oil Corp. 4,875 % fällig am 03.04.2028	2.900	2.849
Huarong Finance Co. Ltd. 5,000 % fällig am 19.11.2025	2.500	2.251	Melco Resorts Finance Ltd. 5,750 % fällig am 21.07.2028	3.100	2.683
Woori Bank 4,875 % fällig am 26.01.2028	2.200	2.192	India Green Energy Holdings 5,375 % fällig am 29.04.2024	2.700	2.650

(a) Der Asia Strategic Interest Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des PIMCO Balanced Income and Growth Fund

31. Dezember 2023 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2023			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2023		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	25.221.337	\$ 251.166	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	40.324.229	\$ 401.606
	PARI (000S)		PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)	1.284.312	127.849
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 05.06.2023	¥ 9.458.000	69.376		PARI (000S)	
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 04.09.2023	9.458.000	67.755	Japan Treasury Bills 2,150 % fällig am 01.09.2052	¥ 9.458.000	63.188
Japan Treasury Bills 2,150 % fällig am 01.09.2052	9.458.000	64.797	Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 22.01.2024	8.387.000	56.051
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 18.07.2023	8.387.000	63.708	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,125 % fällig am 15.01.2033 (b)	\$ 25.779	24.202
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 10.04.2023	8.387.000	63.277	China Government International Bond 3,280 % fällig am 03.12.2027	CNY 139.660	20.181
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 16.10.2023	8.387.000	60.523	U.S. Treasury Notes 4,375 % fällig am 30.11.2030	\$ 18.500	18.892
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 22.01.2024	8.387.000	56.067	Japan Treasury Bills 2,980 % fällig am 18.03.2031	¥ 2.520.000	16.837
U.S. Treasury Notes 4,375 % fällig am 30.11.2030	\$ 41.000	41.384	South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR 163.150	9.702
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,125 % fällig am 15.01.2033 (b)	39.930	39.441	Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 24.04.2023	¥ 1.162.000	8.781
	AKTIEN			AKTIEN	
PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)	272.100	27.050	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Capital Securities Fund (a)	747.114	8.120
	PARI (000S)			PARI (000S)	
U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 11.01.2024	\$ 25.400	25.256	Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos 4,700 % fällig am 01.09.2030	CLP 5.200.000	5.986
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 12.06.2023	¥ 2.520.000	18.493	Israelische Schatzwechsel 0,000 % fällig am 05.07.2023	ILS 18.900	5.389
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 11.09.2023	2.520.000	18.090		AKTIEN	
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.11.2053	\$ 17.400	17.811	Prologis, Inc.	42.264	4.763
Japan Treasury Bills 2,980 % fällig am 18.03.2031	¥ 2.520.000	17.073		PARI (000S)	
	AKTIEN		U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 11.01.2024	\$ 4.500	4.485
Apple, Inc.	82.221	15.656	Berry Global, Inc. 4,875 % fällig am 15.07.2026	4.500	4.389
Microsoft Corp.	39.364	15.066		AKTIEN	
	PARI (000S)		Invitation Homes, Inc.	104.896	3.508
Uniform Mortgage-Backed Security 6,000 % fällig am 01.10.2053	\$ 9.300	9.437		PARI (000S)	
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 24.04.2023	¥ 1.162.000	8.899	Midwest Connector Capital Co. LLC 3,900 % fällig am 01.04.2024	\$ 3.400	3.375
			Colombian TES 13,250 % fällig am 09.02.2033	COP 14.473.700	3.332
				AKTIEN	
			Equinix, Inc.	3.871	3.085

(a) Der PIMCO Balanced Income and Growth Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des PIMCO Capital Securities Fund

31. Dezember 2023 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2023			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2023		
U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 25.05.2023	\$ 276.400	\$ 274.978	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 23.02.2023	\$ 224.500	\$ 224.137
U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 12.09.2023	262.100	257.809	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 06.06.2023	206.000	204.755
U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 02.05.2023	209.100	208.300	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 02.05.2023	177.400	177.147
U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 06.06.2023	206.000	204.571	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 06.04.2023	155.000	154.338
U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 16.05.2023	195.000	194.351	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 30.05.2023	140.800	140.627
U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 04.05.2023	181.000	180.758	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 05.10.2023	138.800	138.658
U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 07.03.2023	155.900	155.783	U.S. Treasury Bills 3,250 % fällig am 14.01.2025	130.500	130.462
U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 06.04.2023	155.000	153.281	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 04.04.2023	127.000	126.909
U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 28.12.2023	155.000	152.912	Stichting AK Rabobank Certificaten 6,500 %	€ 111.600	108.716
U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 04.04.2023	152.500	151.928	U.S. Treasury Bills 1,125 % fällig am 27.03.2025	\$ 107.600	106.965
Federal Home Loan Bank 5,330 % fällig am 25.09.2023	143.100	143.100	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 12.09.2023	104.800	104.492
U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 30.05.2023	140.800	140.387	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 22.08.2023	98.400	97.944
U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 05.10.2023	138.800	137.013	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 16.02.2023	96.700	96.371
U.S. Treasury Bills 3,250 % fällig am 14.01.2025	130.500	129.609	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 17.08.2023	94.900	94.384
Credit Agricole S.A. 7,250 % fällig am 23.09.2028	€ 117.500	125.610	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 28.12.2023	89.500	89.212
U.S. Treasury Bills 1,125 % fällig am 27.03.2025	\$ 107.600	106.724	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 26.09.2023	85.600	84.966
U.S. Treasury Bills 2,226 % fällig am 21.01.2026	106.800	105.589	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 6,000 % fällig am 29.03.2024	€ 76.600	80.898
Federal Home Loan Bank 5,070 % fällig am 25.08.2023	104.700	104.700	HSBC Holdings PLC 4,750 % fällig am 04.07.2029	83.102	78.626
U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 23.01.2024	105.900	104.314	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 02.03.2023	\$ 77.200	77.065
U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 11.01.2024	99.400	98.697	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 14.11.2023	74.500	74.297
U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 22.08.2023	98.400	97.617	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 25.05.2023	74.100	74.050
U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 17.08.2023	94.900	93.687	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 07.03.2023	72.600	72.569
U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 09.05.2023	90.300	89.905	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 25.04.2023	72.700	72.565
U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 26.09.2023	85.600	84.494	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 21.12.2023	71.000	70.691
U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 21.03.2023	77.400	77.153	Societe Generale S.A. 6,221 % fällig am 15.06.2033	70.100	66.370

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des PIMCO Climate Bond Fund

31. Dezember 2023 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2023			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2023		
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 20.04.2023	\$ 15.500	\$ 15.498	U.S. Treasury Notes 0,375 % fällig am 30.11.2025	\$ 7.490	\$ 6.751
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 16.06.2023	15.500	15.383	U.S. Treasury Notes 1,125 % fällig am 15.01.2025	3.600	3.378
U.S. Treasury Bills 0,637 % fällig am 26.07.2024	15.000	14.948	BNP Paribas S.A. 0,500 % fällig am 04.06.2026	€ 2.900	2.873
U.S. Treasury Bills 3,250 % fällig am 14.01.2025	15.000	14.947	HAT Holdings LLC 3,750 % fällig am 15.09.2030	\$ 3.200	2.426
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.10.2053	6.402	5.903	India Green Energy Holdings 5,375 % fällig am 29.04.2024	2.100	2.050
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 09.06.2023	5.200	5.162	PNC Financial Services Group, Inc. 4,758 % fällig am 26.01.2027	2.000	1.956
Europäische Investitionsbank 3,750 % fällig am 14.02.2033	5.000	4.974	Dominion Energy, Inc. 2,250 % fällig am 15.08.2031	2.350	1.944
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 28.04.2023	4.900	4.898	DTE Electric Co. 1,900 % fällig am 01.04.2028	2.200	1.936
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 25.04.2023	3.000	3.000	Liberty Utilities Finance GP 2,050 % fällig am 15.09.2030	2.475	1.911
U.S. Treasury Notes 4,125 % fällig am 31.07.2028	2.400	2.396	LeasePlan Corp. NV 0,250 % fällig am 23.02.2026	€ 2.000	1.910
New York State Electric & Gas Corp. 5,650 % fällig am 15.08.2028	2.300	2.295	Avangrid, Inc. 3,800 % fällig am 01.06.2029	\$ 1.965	1.827
Caja Rural de Navarra SCC 3,000 % fällig am 26.04.2027	€ 2.100	2.271	Schaeffler AG 3,375 % fällig am 12.10.2028	€ 1.700	1.776
Nordea Bank Abp 6,000 % fällig am 02.06.2026	£ 1.800	2.236	DNB Bank ASA 3,625 % fällig am 16.02.2027	1.700	1.751
Hyundai Capital America 5,800 % fällig am 26.06.2025	\$ 2.200	2.197	Public Service Co. of Oklahoma 2,200 % fällig am 15.08.2031	\$ 2.050	1.674
TDC Net A/S 5,618 % fällig am 06.02.2030	€ 1.900	2.071	Assicurazioni Generali SpA 4,125 % fällig am 04.05.2026	€ 1.400	1.535
PNC Financial Services Group, Inc. 4,758 % fällig am 26.01.2027	\$ 2.000	2.000	Thermo Fisher Scientific Finance BV 0,000 % fällig am 18.11.2025	1.400	1.372
Kering S.A. 5,125 % fällig am 23.11.2026	£ 1.500	1.866	Mizuho Financial Group, Inc. 3,490 % fällig am 05.09.2027	1.300	1.316
DNB Bank ASA 3,625 % fällig am 16.02.2027	€ 1.700	1.825	Forvia SE 2,375 % fällig am 15.06.2029	1.500	1.296
Regie Autonome des Transports Parisiens 3,250 % fällig am 11.04.2033	1.400	1.523	ING Groep NV 4,875 % fällig am 16.05.2029	\$ 1.600	1.289
Bank of America Corp. 4,134 % fällig am 12.06.2028	1.400	1.500	Schneider Electric SE 3,250 % fällig am 12.06.2028	€ 1.200	1.260
			U.S. Treasury Notes 4,125 % fällig am 31.07.2028	\$ 1.200	1.207
			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
			Compass Group PLC 4,375 % fällig am 08.09.2032	£ 1.000	1.155
			NXP BV 5,000 % fällig am 15.01.2033	\$ 1.100	1.086
			Valeo 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

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des PIMCO Credit Opportunities Bond Fund

31. Dezember 2023 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2023			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2023		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	2.876.308	\$ 28.648	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	3.484.218	\$ 34.700
	PARI (000S)			PARI (000S)	
U.S. Treasury Notes			U.S. Treasury Notes		
4,000 % fällig am 29.02.2028	\$ 15.000	14.888	4,000 % fällig am 29.02.2028	\$ 15.000	15.246
U.S. Treasury Notes			U.S. Treasury Notes		
0,500 % fällig am 31.10.2027	9.900	8.560	0,500 % fällig am 31.10.2027	7.100	6.032
U.S. Treasury Notes			U.S. Treasury Notes		
4,500 % fällig am 15.11.2033	4.100	4.300	4,500 % fällig am 15.11.2033	4.100	4.302
JPMorgan Chase & Co.			U.S. Treasury Notes		
3,540 % fällig am 01.05.2028	2.200	2.013	3,125 % fällig am 31.08.2027	3.825	3.727
U.S. Treasury Bills			U.S. Treasury Bills		
0,000 % fällig am 13.02.2024	2.000	1.967	0,000 % fällig am 13.02.2024	2.000	1.968
U.S. Treasury Bills			U.S. Treasury Bills		
0,000 % fällig am 03.10.2023	1.700	1.686	0,000 % fällig am 03.10.2023	1.700	1.694
U.S. Treasury Bills			U.S. Treasury Bills		
0,000 % fällig am 09.11.2023	1.600	1.579	0,000 % fällig am 09.11.2023	1.600	1.592
AerCap Ireland Capital DAC			JPMorgan Chase & Co.		
2,875 % fällig am 14.08.2024	1.150	1.102	4,912 % fällig am 25.07.2033	1.400	1.331
Netflix, Inc.			Netflix, Inc.		
4,875 % fällig am 15.04.2028	1.100	1.060	5,375 % fällig am 15.11.2029	1.300	1.319
NextEra Energy Operating Partners LP			Bank of America Corp.		
4,250 % fällig am 15.07.2024	1.000	976	5,015 % fällig am 22.07.2033	1.350	1.267
Uniform Mortgage-Backed Security			U.S. Treasury Notes		
5,000 % fällig am 01.09.2053	998	961	2,750 % fällig am 15.08.2032	1.300	1.196
Uniform Mortgage-Backed Security			Crown Castle, Inc.		
4,500 % fällig am 01.09.2052	1.005	954	2,250 % fällig am 15.01.2031	1.200	1.001
Carnival Corp.			NextEra Energy Operating Partners LP		
4,000 % fällig am 01.08.2028	1.100	952	4,250 % fällig am 15.07.2024	1.000	991
Leidos, Inc.			Buckeye Partners LP		
2,300 % fällig am 15.02.2031	1.200	952	1,000 % fällig am 01.11.2026	986	986
Boston Scientific Corp.			Citigroup, Inc.		
2,650 % fällig am 01.06.2030	1.100	922	6,270 % fällig am 17.11.2033	900	972
MGM China Holdings Ltd.			USI, Inc.		
4,750 % fällig am 01.02.2027	1.000	916	1,000 % fällig am 02.12.2026	970	970
U.S. Treasury Notes			Air Canada		
4,875 % fällig am 31.10.2028	900	914	3,875 % fällig am 15.08.2026	1.025	923
Mattel, Inc.			U.S. Treasury Notes		
3,375 % fällig am 01.04.2026	900	828	4,875 % fällig am 31.10.2028	900	918
Plains All American Pipeline LP			RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc.		
4,500 % fällig am 15.12.2026	800	762	9,023 % fällig am 16.11.2025	936	876

(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 Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2023			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2023		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	53.896.641	\$ 536.771	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	59.389.431	\$ 591.433
	PARI (000S)			PARI (000S)	
Federal Home Loan Bank 2,125 % fällig am 12.02.2027	\$ 175.600	175.600	Federal Home Loan Bank 3,356 % fällig am 29.11.2023	\$ 88.500	88.505
Federal Home Loan Bank 3,356 % fällig am 29.11.2023	158.500	158.500	WP/AP Telecom Holdings BV 7,498 % fällig am 30.03.2029	€ 62.100	67.253
Ungarische Schatzwechsel 0,000 % fällig am 04.01.2024	HUF 11.991.000	34.745	Nissan Motor Co. Ltd. 4,345 % fällig am 17.09.2027	\$ 55.900	51.340
Saudi Arabia Government International Bond 3,450 % fällig am 02.02.2061	\$ 34.500	24.317	Setanta Aircraft Leasing DAC 7,610 % fällig am 05.11.2028	48.800	48.721
CIFC Funding Ltd. 6,710 % fällig am 24.04.2030	23.154	23.112	CommScope, Inc. 4,750 % fällig am 01.09.2029	65.600	47.954
Occidental Petroleum Corp. 6,625 % fällig am 01.09.2030	20.900	22.475		AKTIEN	
Verizon Communications, Inc. 2,355 % fällig am 15.03.2032	26.800	21.956	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO European High Yield Bond Fund (a)	3.637.652	40.252
Hungary Government International Bond 5,375 % fällig am 12.09.2033	€ 20.675	21.766		PARI (000S)	
Venture Global LNG, Inc. 8,375 % fällig am 01.06.2031	\$ 21.725	21.725	NatWest Group PLC 4,800 % fällig am 05.04.2026	\$ 40.275	39.116
Federal Home Loan Bank 5,090 % fällig am 09.05.2023	21.500	21.500		AKTIEN	
Federal Home Loan Bank 1,000 % fällig am 09.03.2027	21.500	21.500	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (a)	4.307.334	37.000
Netflix, Inc. 4,875 % fällig am 15.06.2030	21.000	20.854		PARI (000S)	
Saudi Arabia Government International Bond 4,875 % fällig am 18.07.2033	20.000	20.272	Huarong Finance Co. Ltd. 2,125 % fällig am 30.09.2023	\$ 38.200	36.947
Saudi Arabia Government International Bond 5,000 % fällig am 18.01.2053	20.000	19.153	Bellis Acquisition Co. PLC 3,250 % fällig am 16.02.2026	£ 34.300	35.353
Peru Government International Bond 8,750 % fällig am 21.11.2033	15.000	19.142	Petroleos Mexicanos 6,700 % fällig am 16.02.2032	\$ 45.800	35.164
Mexico Government International Bond 4,500 % fällig am 31.01.2050	26.100	18.889	Fortune Star BVI Ltd. 3,950 % fällig am 02.10.2026	€ 48.900	35.006
Venture Global LNG, Inc. 8,125 % fällig am 01.06.2028	18.775	18.775	BNP Paribas S.A. 1,904 % fällig am 30.09.2028	\$ 35.700	30.160
Credicorp Capital Sociedad Titulizadora S.A. 10,100 % fällig am 15.12.2043	PEN 68.400	18.452	Altice Financing S.A. 5,750 % fällig am 15.08.2029	38.200	29.928
Romania Government International Bond 6,375 % fällig am 18.09.2033	€ 16.400	17.481		AKTIEN	
			PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Asia Strategic Interest Bond Fund (a)	3.159.591	27.850
				PARI (000S)	
			Renault S.A. 2,375 % fällig am 25.05.2026	€ 28.600	27.795
			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
			Banco de Sabadell S.A. 5,375 % fällig am 08.09.2026	22.100	24.129
			Ford Motor Credit Co. LLC 4,675 % fällig am 01.12.2024	21.600	23.428

(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 Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Diversified Income Duration Hedged Fund

31. Dezember 2023 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2023			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2023		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	4.371.880	\$ 43.543	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	3.678.983	\$ 36.642
	PARI (000S)		PIMCO Funds: Global Investors Series plc - US Short-Term Fund (a)	1.017.598	10.278
U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 09.03.2023	\$ 21.900	21.785	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 26.01.2023	\$ 8.000	7.994
U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 17.10.2023	15.200	15.075		AKTIEN	
U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 17.08.2023	8.500	8.390	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO European High Yield Bond Fund (a)	538.168	6.006
U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 20.04.2023	8.000	7.908	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (a)	651.264	5.601
Federal Home Loan Bank 5,090 % fällig am 09.05.2023	7.500	7.500		PARI (000S)	
U.S. Treasury Bonds 3,875 % fällig am 15.05.2043	4.100	3.773	Nissan Motor Co. Ltd. 4,345 % fällig am 17.09.2027	\$ 5.200	4.754
Mexico Government International Bond 5,400 % fällig am 09.02.2028	2.800	2.794	CommScope, Inc. 4,750 % fällig am 01.09.2029	5.800	4.486
Ivory Coast Government International Bond 5,750 % fällig am 31.12.2032	2.985	2.746	Hilton Domestic Operating Co., Inc. 6,939 % fällig am 22.06.2026	4.185	4.180
U.S. Treasury Bonds 4,375 % fällig am 15.08.2043	2.900	2.729	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 20.04.2023	4.100	4.053
Saudi Arabia Government International Bond 4,875 % fällig am 18.07.2033	2.500	2.521	WP/AP Telecom Holdings BV 7,498 % fällig am 30.03.2029	€ 3.700	4.023
CIFC Funding Ltd. 6,710 % fällig am 24.04.2030	2.263	2.259	Altice Financing S.A. 5,750 % fällig am 15.08.2029	\$ 4.500	3.586
Venture Global LNG, Inc. 8,125 % fällig am 01.06.2028	2.200	2.200	Bellis Acquisition Co. PLC 3,250 % fällig am 16.02.2026	£ 3.300	3.509
Romania Government International Bond 5,000 % fällig am 27.09.2026	€ 2.000	2.190	Deutsche Bank AG 1,750 % fällig am 19.11.2030	€ 3.600	3.176
Saudi Arabia Government International Bond 4,750 % fällig am 18.01.2028	\$ 2.000	1.993	Deutsche Bank AG 3,547 % fällig am 18.09.2031	\$ 3.600	3.022
Gaci First Investment Co. 4,750 % fällig am 14.02.2030	2.000	1.979	Renault S.A. 2,375 % fällig am 25.05.2026	€ 3.000	2.982
Occidental Petroleum Corp. 7,875 % fällig am 15.09.2031	1.700	1.936	ZF Finance GmbH 3,750 % fällig am 21.09.2028	3.100	2.934
Ungarische Schatzwechsel 0,000 % fällig am 04.01.2024	HUF 664.000	1.924	Level 3 Financing, Inc. 7,220 % fällig am 01.03.2027	\$ 3.226	2.845
Verizon Communications, Inc. 2,355 % fällig am 15.03.2032	\$ 2.200	1.802	Syngenta Finance NV 3,375 % fällig am 16.04.2026	€ 2.600	2.736
Pertamina Persero PT 6,500 % fällig am 07.11.2048	1.700	1.760	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	\$ 3.100	2.669
			Petroleos Mexicanos 6,625 % fällig am 15.06.2035	3.800	2.607
			Huarong Finance Co. Ltd. 2,125 % fällig am 30.09.2023	2.400	2.320
			AKTIEN		
			PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Asia Strategic Interest Bond Fund (a)	250.000	2.255
				PARI (000S)	
			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
			Fortune Star BVI Ltd. 3,950 % fällig am 02.10.2026	3.000	2.182
			Avolon TLB Borrower (U.S.) LLC 7,708 % fällig am 22.06.2028	\$ 2.140	2.142

(a) Der Diversified Income Duration Hedged Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Diversified Income ESG Fund

31. Dezember 2023 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2023		
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Emerging Markets Bond ESG Fund (a)	466.614	\$ 4.748
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Global Investment Grade Credit ESG Fund (a)	147.887	1.485
	PARI (000S)	
Federal Home Loan Bank 1,000 % fällig am 31.01.2029	\$ 1.100	1.100
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 15.03.2023	1.100	1.100
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 10.03.2023	1.000	1.000
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 16.03.2023	1.000	1.000
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 13.03.2023	1.000	1.000
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.04.2053	1.000	993
U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 15.06.2023	1.000	988
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.03.2053	1.000	937
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
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 03.05.2023	700	699
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
Oman Government International Bond 6,000 % fällig am 01.08.2029	500	501
Sprint Capital Corp. 8,750 % fällig am 15.03.2032	400	492

BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2023		
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Emerging Markets Bond ESG Fund (a)	114.213	\$ 1.166
	PARI (000S)	
U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 15.06.2023	\$ 700	695
Oman Government International Bond 6,000 % fällig am 01.08.2029	500	494
Dominican Republic Government International Bond 4,500 % fällig am 30.01.2030	500	434
U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 09.03.2023	400	398
Uruguay Government International Bond 5,100 % fällig am 18.06.2050	400	393
BNP Paribas S.A. 1,675 % fällig am 30.06.2027	400	355
Enel Finance International NV 2,875 % fällig am 11.04.2029	£ 300	329
KBC Group NV 5,796 % fällig am 19.01.2029	\$ 300	301
B.C. Unlimited Liability Co. 4,000 % fällig am 15.10.2030	350	297
Mexico Government International Bond 4,875 % fällig am 19.05.2033	300	265
Peru Government International Bond 3,000 % fällig am 15.01.2034	300	250
Dominican Republic Government International Bond 6,500 % fällig am 15.02.2048	300	246
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 6,750 % fällig am 17.01.2048	200	199
U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 10.05.2023	200	198
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
Owens & Minor, Inc. 6,625 % fällig am 01.04.2030	200	182
FMG Resources Pty. Ltd. 4,375 % fällig am 01.04.2031	200	181
Ivory Coast Government International Bond 6,125 % fällig am 15.06.2033	200	180
Catalent Pharma Solutions, Inc. 3,125 % fällig am 15.02.2029	200	168
Graphic Packaging International LLC 3,500 % fällig am 01.03.2029	200	167
Natura Cosméticos S.A. 4,125 % fällig am 03.05.2028	200	162
Chile Government International Bond 3,100 % fällig am 07.05.2041	200	153
Paraguay Government International Bond 5,400 % fällig am 30.03.2050	200	150
Post Holdings, Inc. 5,500 % fällig am 15.12.2029	150	140
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

(a) Der Diversified Income ESG Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Dynamic Bond Fund

31. Dezember 2023 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2023		
U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 11.01.2024	\$ 225.000	\$ 223.751
Japanische Schatzwechsel 0,000 % fällig am 24.04.2023	¥ 23.470.000	179.750
Japanische Schatzwechsel 0,000 % fällig am 31.07.2023	23.470.000	174.672
AKTIEN		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	14.933.834	148.732
PARI (000S)		
U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 24.08.2023	\$ 147.400	145.502
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 26.05.2023	119.800	119.516
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 11.05.2023	78.300	78.289
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.07.2032 (b)	77.740	71.091
Brazil Letras do Tesouro Nacional 0,000 % fällig am 01.01.2024	BRL 342.670	67.400
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,125 % fällig am 15.01.2033 (b)	\$ 71.075	67.286
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,375 % fällig am 15.07.2033 (b)	66.670	64.648
U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 15.06.2023	58.000	57.332
Brazil Letras do Tesouro Nacional 0,000 % fällig am 01.07.2024	BRL 266.600	52.112
Federal Home Loan Bank 2,125 % fällig am 12.02.2027	\$ 47.000	47.000
Ungarische Schatzwechsel 0,000 % fällig am 04.01.2024	HUF 16.036.000	46.466
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 16.03.2023	\$ 45.000	44.994
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 17.03.2023	42.700	42.695
Ungarische Schatzwechsel 0,000 % fällig am 29.06.2023	HUF 13.739.000	40.630
Ungarische Schatzwechsel 0,000 % fällig am 27.07.2023	13.646.000	40.414
Ungarische Schatzwechsel 0,000 % fällig am 09.11.2023	14.673.000	40.409
Ungarische Schatzwechsel 0,000 % fällig am 02.11.2023	14.700.000	40.303
Ungarische Schatzwechsel 0,000 % fällig am 20.07.2023	13.604.000	40.224
Ungarische Schatzwechsel 0,000 % fällig am 09.07.2023	13.888.000	39.936
Ungarische Schatzwechsel 0,000 % fällig am 22.06.2023	13.696.000	39.869
Ungarische Schatzwechsel 0,000 % fällig am 06.07.2023	13.520.000	39.563
Ungarische Schatzwechsel 0,000 % fällig am 19.10.2023	14.376.000	39.369
Ungarische Schatzwechsel 0,000 % fällig am 26.10.2023	14.380.000	39.339
Ungarische Schatzwechsel 0,000 % fällig am 03.08.2023	13.686.000	39.305
Ungarische Schatzwechsel 0,000 % fällig am 31.08.2023	13.851.000	39.186
Ungarische Schatzwechsel 0,000 % fällig am 28.09.2023	14.008.000	39.031

BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2023		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	15.986.067	\$ 159.200
PARI (000S)		
Brazil Letras do Tesouro Nacional 0,000 % fällig am 01.01.2024	BRL 253.700	52.121
U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 11.01.2024	\$ 27.000	26.901
U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 24.01.2023	13.200	13.173
U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 20.07.2023	11.100	11.079
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 01.05.2023	10.600	10.564
Deutsche Bank AG 6,119 % fällig am 14.07.2026	8.902	8.769
AKTIEN		
PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)	84.200	8.388
PARI (000S)		
Bellis Acquisition Co. PLC 3,250 % fällig am 16.02.2026	£ 7.600	8.095
Caesars Entertainment Corp. 8,452 % fällig am 06.02.2030	\$ 5.495	5.481
CPI Property Group S.A. 2,750 % fällig am 22.01.2028	£ 5.950	5.119
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	31.074	4.778
PARI (000S)		
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 16.05.2023	\$ 4.600	4.592
BNP Paribas S.A. 4,400 % fällig am 14.08.2028	4.800	4.451
HSI Asset Securitization Corp. Trust 6,250 % fällig am 25.01.2036	5.700	4.442
Banco Santander S.A. 5,147 % fällig am 18.08.2025	4.400	4.302
U.S. Foods, Inc. 7,970 % fällig am 22.11.2028	4.008	4.003
Volkswagen Financial Services NV 1,125 % fällig am 18.09.2023	£ 3.300	3.829

(a) Der Dynamic Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Dynamic Multi-Asset Fund

31. Dezember 2023 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2023		
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.07.2032 (b)	\$ 596.057	€ 521.863
France Treasury Bills 0,000 % fällig am 13.09.2023	€ 186.960	185.506
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
SNCF Réseau 4,500 % fällig am 30.01.2024	€ 119.300	119.351
France Government International Bond 4,250 % fällig am 25.10.2023	117.260	117.530
Japanische Schatzwechsel 0,000 % fällig am 26.06.2023	¥ 15.410.000	109.714
Japanische Schatzwechsel 0,000 % fällig am 25.09.2023	15.410.000	98.546
Japanische Schatzwechsel 0,000 % fällig am 04.04.2023	13.690.000	97.240
Japanische Schatzwechsel 0,000 % fällig am 10.07.2023	13.690.000	95.054
Japanische Schatzwechsel 0,000 % fällig am 12.06.2023	13.440.000	93.067
U.K. Treasury Bills 0,000 % fällig am 11.03.2024	£ 80.050	92.035
Japanische Schatzwechsel 0,000 % fällig am 04.04.2024	¥ 14.150.000	90.312
Japanische Schatzwechsel 0,000 % fällig am 25.12.2023	14.170.000	90.175
Japanische Schatzwechsel 0,000 % fällig am 11.09.2023	13.440.000	89.688
Japanische Schatzwechsel 4,250 % fällig am 27.07.2027	13.690.000	87.962
Japanische Schatzwechsel 2,375 % fällig am 07.07.2023	12.460.000	79.726
Japanische Schatzwechsel 2,980 % fällig am 18.03.2031	12.140.000	76.759
Japanische Schatzwechsel 0,000 % fällig am 15.01.2024	9.220.000	58.608
France Treasury Bills 0,000 % fällig am 30.08.2023	€ 53.160	52.839
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

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2023		
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.07.2032 (b)	\$ 479.825	€ 404.513
	AKTIEN	
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	1.878.900	182.462
	PARI (000S)	
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,625 % fällig am 15.10.2027 (b)	\$ 193.418	173.893
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,125 % fällig am 15.01.2033 (b)	184.621	155.183
France Treasury Bills 0,000 % fällig am 13.09.2023	€ 144.960	144.579
European Union Treasury Bills 0,000 % fällig am 03.03.2023	135.230	134.944
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,000 % fällig am 28.04.2023	82.600	82.171
European Union Bills 0,000 % fällig am 07.04.2023	66.430	66.178
	AKTIEN	
Vertex Pharmaceuticals, Inc.	192.000	60.007
	PARI (000S)	
Italy Government International Bond 0,000 % fällig am 31.03.2023	€ 56.400	56.206
Treasury Bills des europäischen Stabilitätsmechanismus 0,000 % fällig am 19.01.2023	54.100	54.065
	AKTIEN	
Exxon Mobil Corp.	512.000	49.522
	PARI (000S)	
Japanische Schatzwechsel 0,000 % fällig am 06.03.2023	¥ 7.000.000	48.827
	AKTIEN	
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	2.955.000	48.521
Humana, Inc.	104.455	47.011
Panasonic Holdings Corp.	4.421.740	44.440
	PARI (000S)	
France Treasury Bills 0,000 % fällig am 15.03.2023	€ 44.500	44.365
	AKTIEN	
Regeneron Pharmaceuticals, Inc.	60.700	42.844
	PARI (000S)	
Treasury Bills des europäischen Stabilitätsmechanismus 0,000 % fällig am 09.03.2023	€ 41.300	41.212
	AKTIEN	
Samsung Electronics Co. Ltd.	837.600	40.466

(a) Der Dynamic Multi-Asset Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Emerging Local Bond Fund

31. Dezember 2023 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG			KOSTEN (000S)				ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2023				VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2023			
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)				PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)			
		210.458.673	\$ 2.095.880			200.663.390	\$ 1.998.400
		PARI (000S)				PARI (000S)	
South Africa Government International Bond				Thailand Government International Bond			
8,000 % fällig am 31.01.2030	ZAR	2.343.500	116.540	2,350 % fällig am 17.06.2026	THB	3.247.762	95.252
Thailand Government International Bond				Thailand Government International Bond			
3,350 % fällig am 17.06.2033	THB	3.294.778	100.382	3,350 % fällig am 17.06.2033		2.847.758	86.607
Thailand Government International Bond				Mexico Government International Bond			
2,350 % fällig am 17.06.2026		3.247.762	95.107	7,000 % fällig am 03.09.2026	MXN	1.576.190	84.248
Mexico Government International Bond				Malaysia Government Investment Issue			
7,000 % fällig am 03.09.2026	MXN	1.576.190	86.566	3,990 % fällig am 15.10.2025	MYR	353.679	79.905
South Africa Government International Bond				Mexico Government International Bond			
10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	1.472.800	83.982	5,500 % fällig am 04.03.2027	MXN	1.583.300	78.557
Thailand Government International Bond				South Africa Government International Bond			
2,400 % fällig am 17.03.2029	THB	3.057.040	83.678	10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	1.251.400	69.363
Ungarische Schatzwechsel				Mexico Government International Bond			
0,000 % fällig am 22.06.2023	HUF	26.816.000	78.061	5,000 % fällig am 06.03.2025	MXN	1.173.200	61.851
Ungarische Schatzwechsel				Japanische Schatzwechsel			
0,000 % fällig am 15.06.2023		26.728.000	77.462	0,000 % fällig am 10.04.2023	¥	7.646.000	58.866
Ungarische Schatzwechsel				Malaysia Government Investment Issue			
0,000 % fällig am 25.05.2023		26.465.000	77.063	4,369 % fällig am 31.10.2028	MYR	262.638	58.821
Ungarische Schatzwechsel				Peru Government International Bond			
0,000 % fällig am 01.06.2023		26.551.000	76.511	7,300 % fällig am 12.08.2033	PEN	206.800	57.771
Ungarische Schatzwechsel				Thailand Government International Bond			
0,000 % fällig am 08.06.2023		26.639.000	76.343	3,390 % fällig am 17.06.2037	THB	1.874.307	57.316
Bonos de la Tesorería de la República en Pesos				Colombian TES			
6,000 % fällig am 01.04.2033	CLP	57.325.000	73.139	9,250 % fällig am 28.05.2042	COP	290.345.000	53.535
Thailand Government International Bond				Thailand Government International Bond			
2,650 % fällig am 17.06.2028	THB	2.263.201	67.815	2,650 % fällig am 17.06.2028	THB	1.758.630	50.306
Mexico Government International Bond				Indonesia Government International Bond			
2,750 % fällig am 27.11.2031	MXN	1.317.427	65.611	7,000 % fällig am 15.02.2033	IDR	681.081.000	47.647
Thailand Government International Bond				South Africa Government International Bond			
2,250 % fällig am 17.03.2027	THB	2.223.090	63.028	8,000 % fällig am 31.01.2030	ZAR	1.004.200	47.564
Ungarische Schatzwechsel				Romania Government International Bond			
0,000 % fällig am 27.07.2023	HUF	21.103.000	62.498	4,500 % fällig am 17.06.2024	RON	212.500	45.884
Ungarische Schatzwechsel				China Government International Bond			
0,000 % fällig am 20.07.2023		21.105.000	62.403	3,030 % fällig am 11.03.2026	CNY	308.500	43.891
Ungarische Schatzwechsel				Peru Government International Bond			
0,000 % fällig am 29.06.2023		20.907.000	61.828	5,940 % fällig am 12.02.2029	PEN	135.000	36.176
Ungarische Schatzwechsel				Mexico Government International Bond			
0,000 % fällig am 09.07.2023		21.483.000	61.776	4,000 % fällig am 30.11.2028	MXN	574.629	32.461

(a) Der Emerging Local Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarriere genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Emerging Local Bond ESG Fund

31. Dezember 2023 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG		PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2023				VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2023			
Colombian TES 7,000 % fällig am 26.03.2031	COP	15.275.200	\$ 3.196	Poland Government International Bond 2,750 % fällig am 25.10.2029	PLN	3.500	\$ 781
Ungarische Schatzwechsel 0,000 % fällig am 04.01.2024	HUF	693.000	2.008	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 21.03.2023	\$	400	400
Indonesia Government International Bond 8,250 % fällig am 15.05.2036	IDR	21.808.000	1.576	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 21.02.2023		400	399
Czech Republic Government International Bond 0,050 % fällig am 29.11.2029	CZK	41.700	1.469	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 06.04.2023		400	397
Indonesia Government International Bond 6,375 % fällig am 15.04.2032	IDR	19.987.000	1.273	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 10.05.2023		400	396
Europäische Investitionsbank 2,875 % fällig am 15.11.2029	PLN	4.900	1.065	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 03.10.2023		300	299
Indonesia Government International Bond 8,750 % fällig am 15.05.2031	IDR	14.069.000	1.014	Thailand Government International Bond 2,350 % fällig am 17.06.2026	THB	10.109	297
Romania Government International Bond 4,250 % fällig am 28.04.2036	RON	5.765	1.002	Dominican Republic Government International Bond 11,250 % fällig am 15.09.2035	DOP	11.900	219
Mexico Government International Bond 2,750 % fällig am 27.11.2031	MXN	19.093	955	South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	3.600	215
Romania Government International Bond 4,850 % fällig am 22.04.2026	RON	4.400	928	Thailand Government International Bond 2,650 % fällig am 17.06.2028	THB	7.179	213
Malaysia Government International Bond 3,885 % fällig am 15.08.2029	MYR	3.720	803	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 03.08.2023	\$	200	199
Malaysia Government Investment Issue 4,130 % fällig am 09.07.2029		3.550	775	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 07.09.2023		200	199
Romania Government International Bond 4,150 % fällig am 26.01.2028	RON	3.800	757	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 04.04.2023		200	199
Malaysia Government International Bond 2,632 % fällig am 15.04.2031	MYR	3.810	755	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 26.09.2023		200	198
Indonesia Government International Bond 6,375 % fällig am 15.08.2028	IDR	11.778.000	754	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 15.02.2024		200	198
Indonesia Government International Bond 8,375 % fällig am 15.03.2034		9.314.000	674	South Korea Government International Bond 3,250 % fällig am 10.06.2033	KRW	251.040	177
Colombian TES 13,250 % fällig am 09.02.2033	COP	2.343.000	661	Mexico Government International Bond 7,000 % fällig am 03.09.2026	MXN	3.330	176
Hungary Government International Bond 4,500 % fällig am 27.05.2032	HUF	221.900	554	Romania Government International Bond 3,250 % fällig am 29.04.2024	RON	800	171
Malaysia Government Investment Issue 3,465 % fällig am 15.10.2030	MYR	2.500	526	Dominican Republic Government International Bond 13,625 % fällig am 10.02.2034	DOP	7.700	162
Malaysia Government International Bond 4,762 % fällig am 07.04.2037		2.222	514	Thailand Government International Bond 3,350 % fällig am 17.06.2033	THB	5.140	157
Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung 6,750 % fällig am 09.02.2029	ZAR	10.300	501	Malaysia Government Investment Issue 4,130 % fällig am 09.07.2029	MYR	690	153
Romania Government International Bond 4,150 % fällig am 24.10.2030	RON	2.600	492	Israelische Schatzwechsel 0,000 % fällig am 08.02.2023	ILS	500	148
Thailand Government International Bond 2,400 % fällig am 17.03.2029	THB	17.160	486	Peru Government International Bond 7,300 % fällig am 12.08.2033	PEN	500	140
Malaysia Government Investment Issue 4,369 % fällig am 31.10.2028	MYR	2.100	463	Israelische Schatzwechsel 0,000 % fällig am 02.08.2023	ILS	500	140
Indonesia Government International Bond 6,375 % fällig am 15.04.2042	IDR	7.139.000	442	Malaysia Government Investment Issue 4,369 % fällig am 31.10.2028	MYR	610	136
				Israel Government International Bond 0,150 % fällig am 31.07.2023	ILS	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
				Mexico Government International Bond 7,500 % fällig am 26.05.2033	MXN	2.300	118
				South Africa Government International Bond 6,500 % fällig am 28.02.2041	ZAR	3.300	112
				Malaysia Government International Bond 3,800 % fällig am 17.08.2023	MYR	500	111
				Israelische Schatzwechsel 0,000 % fällig am 05.07.2023	ILS	400	111
				Japanische Schatzwechsel 0,000 % fällig am 17.04.2023	¥	14.000	108

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Emerging Markets Bond Fund

31. Dezember 2023 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG		AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG		AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2023				VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2023			
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		196.830.296	\$ 1.960.293	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		183.139.485	\$ 1.823.900
		PARI (000S)				PARI (000S)	
Mexico Government International Bond 3,000 % fällig am 03.12.2026	MXN	809.324	42.597	Saudi Arabia Government International Bond 4,875 % fällig am 18.07.2033	\$	28.400	26.689
Israel Government International Bond 5,000 % fällig am 30.10.2026	€	39.500	41.520	CBB International Sukuk Programme Co. 6,250 % fällig am 18.10.2030		21.000	21.171
U.S. Treasury Notes 4,000 % fällig am 28.02.2030	\$	33.100	32.946	Nogaholding Sukuk Ltd. 6,625 % fällig am 25.05.2033		13.900	13.893
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	484.900	28.930	Israel Government International Bond 1,500 % fällig am 30.11.2023	ILS	54.100	13.654
Saudi Arabia Government International Bond 4,875 % fällig am 18.07.2033	\$	28.400	28.065	Egypt Government International Bond 4,750 % fällig am 16.04.2026	€	14.508	13.585
Saudi Arabia Government International Bond 4,750 % fällig am 18.01.2028		27.600	27.504	Nigeria Government International Bond 6,500 % fällig am 28.11.2027	\$	15.300	13.243
Ivory Coast Government International Bond 6,915 % fällig am 28.06.2024	€	25.500	27.042	Chile Government International Bond 2,750 % fällig am 31.01.2027		13.400	12.720
Serbia Government International Bond 6,500 % fällig am 26.09.2033	\$	24.000	23.739	Serbia Government International Bond 1,650 % fällig am 03.03.2033	€	16.700	12.333
Malaysia Government International Bond 3,800 % fällig am 17.08.2023	MYR	107.200	22.992	Bahamas Government International Bond 6,000 % fällig am 21.11.2028	\$	14.550	11.955
CBB International Sukuk Programme Co. 6,250 % fällig am 18.10.2030	\$	21.000	21.000	Standard Chartered PLC 7,767 % fällig am 16.11.2028		11.200	11.943
Serbia Government International Bond 6,250 % fällig am 26.05.2028		20.250	20.207	Colombia Government International Bond 4,000 % fällig am 26.02.2024		12.100	11.933
Poland Government International Bond 4,875 % fällig am 04.10.2033		19.000	18.854	Romania Government International Bond 1,750 % fällig am 13.07.2030	€	13.200	11.209
Ungarische Schatzwechsel 0,000 % fällig am 30.11.2023	HUF	6.482.000	18.434	Serbia Government International Bond 6,250 % fällig am 26.05.2028	\$	10.650	10.560
Senegal Government International Bond 5,375 % fällig am 08.06.2037	€	24.000	18.142	Jordan Government International Bond 5,750 % fällig am 31.01.2027		10.800	10.557
Suci Second Investment Co. 6,000 % fällig am 25.10.2028	\$	17.400	17.327	ZhongAn Online P&C Insurance Co. Ltd. 3,125 % fällig am 16.07.2025		11.800	10.381
Mexico Government International Bond 6,350 % fällig am 09.02.2035		16.400	16.340	Mexico Government International Bond 6,338 % fällig am 04.05.2053		10.400	9.841
Japanische Schatzwechsel 0,000 % fällig am 22.01.2024	¥	2.280.000	16.095	Indonesia Government International Bond 4,850 % fällig am 11.01.2033		9.700	9.754
Nigeria Government International Bond 6,500 % fällig am 28.11.2027	\$	18.844	15.749	Mexico Government International Bond 5,400 % fällig am 09.02.2028		9.500	9.723
Banco do Brasil S.A. 8,500 % fällig am 29.07.2026	MXN	294.000	15.378	Hungary Government International Bond 5,250 % fällig am 16.06.2029		9.400	9.139

(a) Der Emerging Markets Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Emerging Markets Bond ESG Fund

31. Dezember 2023 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG		PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2023				VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2023			
Mexico Government International Bond 3,000 % fällig am 03.12.2026	MXN	604.727	\$ 31.827	Israel Government International Bond 1,500 % fällig am 30.11.2023	ILS	152.300	\$ 40.645
Poland Government International Bond 4,875 % fällig am 04.10.2033	\$	25.500	25.131	U.S. Treasury Notes 3,125 % fällig am 31.08.2029	\$	24.800	22.675
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.10.2053		25.008	23.765	Israel Government International Bond 0,150 % fällig am 31.07.2023	ILS	79.600	21.341
Mexico Government International Bond 4,875 % fällig am 19.05.2033		24.900	23.745	U.S. Treasury Bonds 3,250 % fällig am 15.05.2042	\$	25.300	20.849
Uruguay Government International Bond 5,750 % fällig am 28.10.2034		21.900	23.381	Poland Government International Bond 5,500 % fällig am 16.11.2027		15.800	16.049
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	324.500	19.365	Mexico Government International Bond 6,350 % fällig am 09.02.2035		14.000	14.659
Brazil Government International Bond 6,250 % fällig am 18.03.2031	\$	19.200	18.926	South Africa Government International Bond 4,300 % fällig am 12.10.2028		14.500	13.268
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.07.2053		19.875	18.850	Israel Government International Bond 4,500 % fällig am 17.01.2033		13.400	13.224
Philippines Government International Bond 5,500 % fällig am 17.01.2048		18.200	18.370	South Africa Government International Bond 5,875 % fällig am 20.04.2032		13.500	12.538
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.09.2053		18.991	18.124	Chile Government International Bond 2,750 % fällig am 31.01.2027		12.900	12.245
Masdar Abu Dhabi Future Energy Co. 4,875 % fällig am 25.07.2033		18.000	17.923	OTP Bank Nyrt 8,750 % fällig am 15.05.2033		12.300	12.194
Finance Department Government of Sharjah 6,500 % fällig am 23.11.2032		17.600	17.659	Hungary Government International Bond 5,000 % fällig am 22.02.2027	€	10.600	11.416
Israel Government International Bond 1,500 % fällig am 30.11.2023	ILS	62.400	17.333	Serbia Government International Bond 6,250 % fällig am 26.05.2028	\$	10.950	10.915
Ivory Coast Government International Bond 6,915 % fällig am 28.06.2024	€	16.000	16.968	Argentina Government International Bond 3,625 % fällig am 09.07.2035		41.500	10.864
Turkey Government International Bond 9,125 % fällig am 13.07.2030	\$	16.900	16.739	Sociedad Quimica y Minera de Chile S.A. 3,500 % fällig am 10.09.2051		13.700	9.575
Malaysia Government International Bond 3,800 % fällig am 17.08.2023	MYR	74.400	15.957	Philippines Government International Bond 3,200 % fällig am 06.07.2046		12.900	9.534
Hungary Government International Bond 6,750 % fällig am 25.09.2052	\$	16.600	15.891	Colombia Government International Bond 6,125 % fällig am 18.01.2041		11.400	8.922
U.S. Treasury Bonds 3,250 % fällig am 15.05.2042		17.500	15.314	Poland Government International Bond 2,750 % fällig am 25.05.2032	€	9.100	8.888
Serbia Government International Bond 1,000 % fällig am 23.09.2028	€	16.900	14.247	Mexico Government International Bond 5,400 % fällig am 09.02.2028	\$	8.700	8.829
Hanwha Q Cells Americas Holdings Corp. 5,000 % fällig am 27.07.2028	\$	14.200	14.096	Fondo MIVIVIENDA S.A. 4,625 % fällig am 12.04.2027		9.100	8.823
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.05.2053		14.652	13.965	Eastern & Southern African Trade & Development Bank 4,125 % fällig am 30.06.2028		10.900	8.701
Mexico Government International Bond 6,350 % fällig am 09.02.2035		14.000	13.948	Israel Government International Bond 4,250 % fällig am 31.03.2023	ILS	30.500	8.658
Ungarische Schatzwechsel 0,000 % fällig am 30.11.2023	HUF	4.801.000	13.653	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

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Emerging Markets Corporate Bond Fund

31. Dezember 2023 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2023			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2023		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	5.985.427	\$ 59.607	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	6.956.780	\$ 69.280
	PARI (000S)			PARI (000S)	
Japanische Schatzwechsel 0,000 % fällig am 17.04.2023	¥ 430.000	3.373	Israel Government International Bond 1,500 % fällig am 30.11.2023	ILS 6.000	1.650
Bank Leumi Le-Israel B.M. 7,129 % fällig am 18.07.2033	\$ 2.200	2.200	Bank Leumi Le-Israel B.M. 3,275 % fällig am 29.01.2031	\$ 1.800	1.631
Colombia Government International Bond 7,500 % fällig am 02.02.2034	1.500	1.489	QNB Finance Ltd. 3,500 % fällig am 28.03.2024	1.548	1.524
KazMunayGas National Co. JSC 6,375 % fällig am 24.10.2048	1.500	1.277	Fab Sukuk Co. Ltd. 3,875 % fällig am 22.01.2024	1.500	1.492
QNB Finance Ltd. 1,375 % fällig am 26.01.2026	1.400	1.268	LG Chem Ltd. 3,625 % fällig am 15.04.2029	1.600	1.445
Bank Hapoalim B.M. 3,255 % fällig am 21.01.2032	1.300	1.153	Colombia Government International Bond 7,500 % fällig am 02.02.2034	1.500	1.433
Seazen Group Ltd. 4,450 % fällig am 13.07.2025	1.400	1.132	Bank Hapoalim B.M. 3,255 % fällig am 21.01.2032	1.500	1.265
Abu Dhabi National Energy Co. PJSC 4,375 % fällig am 24.01.2029	1.100	1.093	Mizrahi Tefahot Bank Ltd. 3,077 % fällig am 07.04.2031	1.300	1.167
Medco Maple Tree Pte Ltd. 8,960 % fällig am 27.04.2029	1.000	988	Banco Santander Chile 2,700 % fällig am 10.01.2025	1.200	1.162
Ecopetrol S.A. 0,000 % fällig am 17.08.2024	1.000	965	Abu Dhabi National Energy Co. PJSC 4,375 % fällig am 24.01.2029	1.100	1.061
ONGC Videsh Vankorneft Pte. Ltd. 3,750 % fällig am 27.07.2026	1.000	954	New Metro Global Ltd. 6,800 % fällig am 05.08.2023	1.100	1.055
Export-Credit Bank of Turkey 9,375 % fällig am 31.01.2026	900	912	Woori Bank 4,750 % fällig am 30.04.2024	1.000	995
BBVA Bancomer S.A. 8,450 % fällig am 29.06.2038	800	804	India Green Energy Holdings 5,375 % fällig am 29.04.2024	1.000	983
Masdar Abu Dhabi Future Energy Co. 4,875 % fällig am 25.07.2033	800	797	Rio Oil Finance Trust 8,200 % fällig am 06.04.2028	968	973
Sands China Ltd. 5,650 % fällig am 08.08.2028	800	777	MAF Sukuk Ltd. 4,638 % fällig am 14.05.2029	1.000	973
NBK SPC Ltd. 1,625 % fällig am 15.09.2027	800	714	ABJA Investment Co. Pte. Ltd. 5,450 % fällig am 24.01.2028	1.000	962
SK on Co. Ltd. 5,375 % fällig am 11.05.2026	700	699	Export-Credit Bank of Turkey 8,250 % fällig am 24.01.2024	900	903
Mersin Uluslararası Liman Isletmeciligi A/S 8,250 % fällig am 15.11.2028	700	693	Bank Leumi Le-Israel B.M. 7,129 % fällig am 18.07.2033	900	872
Shinhan Financial Group Co. Ltd. 5,000 % fällig am 24.07.2028	700	681	S.A. Global Sukuk Ltd. 2,694 % fällig am 17.06.2031	1.000	871

(a) Der Emerging Markets Corporate Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund

31. Dezember 2023 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2023			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2023		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	31.038.839	\$ 309.129	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	32.441.730	\$ 323.100
	PARI (000S)			PARI (000S)	
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.07.2032 (b)	\$ 15.449	13.798	U.S. Treasury Bonds 2,375 % fällig am 15.02.2042	\$ 14.900	11.348
U.S. Treasury Bonds 1,125 % fällig am 15.05.2040	17.500	11.093	Mexico Government International Bond 5,000 % fällig am 06.03.2025	MXN 182.400	8.865
Peru Government International Bond 7,300 % fällig am 12.08.2033	PEN 33.800	9.363	Peru Government International Bond 7,300 % fällig am 12.08.2033	PEN 24.400	6.636
Mexico Government International Bond 5,000 % fällig am 06.03.2025	MXN 182.400	8.782	U.S. Treasury Notes 2,500 % fällig am 30.04.2024	\$ 5.600	5.537
Bonos de la Tesorería de la República en Pesos 6,000 % fällig am 01.04.2033	CLP 6.390.000	8.227	Saudi Arabia Government International Bond 4,875 % fällig am 18.07.2033	5.200	5.317
Mexico Government International Bond 7,000 % fällig am 03.09.2026	MXN 148.000	8.043	U.S. Treasury Bonds 3,375 % fällig am 15.08.2042	4.000	3.773
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR 134.500	7.474	South Africa Government International Bond 8,000 % fällig am 31.01.2030	ZAR 75.100	3.715
Ecuador Government International Bond 6,000 % fällig am 31.07.2030	\$ 12.920	6.194	Ukraine Government International Bond 7,253 % fällig am 15.03.2035	\$ 12.500	3.563
Poland Government International Bond 0,250 % fällig am 25.10.2026	PLN 33.200	5.997	Ukraine Government International Bond 7,750 % fällig am 01.08.2041	7.400	3.497
Israel Government International Bond 5,000 % fällig am 30.10.2026	€ 5.300	5.571	Bonos de la Tesorería de la República en Pesos 6,000 % fällig am 01.04.2033	CLP 2.320.000	3.004
Credicorp Capital Sociedad Titulizadora S.A. 10,100 % fällig am 15.12.2043	PEN 20.500	5.530	Peru Government International Bond 8,200 % fällig am 12.08.2026	PEN 11.000	2.997
Bonos de la Tesorería de la República en pesos 5,800 % fällig am 01.10.2034	CLP 5.300.000	5.269	Mong Duong Finance Holdings BV 5,125 % fällig am 07.05.2029	\$ 2.800	2.520
Mexico Government International Bond 2,750 % fällig am 27.11.2031	MXN 105.981	5.161	Petroleos Mexicanos 6,500 % fällig am 02.06.2041	4.000	2.466
Saudi Arabia Government International Bond 4,875 % fällig am 18.07.2033	\$ 5.200	5.139	Ecuador Government International Bond 6,000 % fällig am 31.07.2030	5.100	2.386
Ukraine Government International Bond 7,253 % fällig am 15.03.2035	16.700	5.087	U.S. Treasury Bonds 3,250 % fällig am 15.05.2042	2.500	2.315
Ukraine Government International Bond 7,750 % fällig am 01.08.2041	9.900	4.944	Korea Electric Power Corp. 5,375 % fällig am 31.07.2026	2.300	2.279
Poland Government International Bond 3,750 % fällig am 25.05.2027	PLN 19.000	4.476	Hungarian Development Bank 6,500 % fällig am 29.06.2028	2.200	2.205
Dominican Republic Central Bank Notes 13,000 % fällig am 05.12.2025	DOP 269.700	4.461	Tierra Mojada Luxembourg SARL 5,750 % fällig am 01.12.2040	2.567	2.204
U.S. Treasury Bonds 1,750 % fällig am 15.08.2041	\$ 5.400	3.808	Philippines Government International Bond 5,000 % fällig am 17.07.2033	2.100	2.156

(a) Der PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund

31. Dezember 2023 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG		PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2023				VERKAUFE BIS 31. DEZEMBER 2023			
Japanische Schatzwechsel 0,000 % fällig am 17.04.2023	¥	350.000	\$ 2.746	Japanische Schatzwechsel 0,000 % fällig am 17.04.2023	¥	350.000	\$ 2.695
Malaysia Government International Bond 3,800 % fällig am 17.08.2023	MYR	5.400	1.158	Mexico Government International Bond 3,000 % fällig am 03.12.2026	MXN	15.860	859
Ungarische Schatzwechsel 0,000 % fällig am 30.11.2023	HUF	403.000	1.146	Israelische Schatzwechsel 0,000 % fällig am 03.05.2023	ILS	1.600	438
Mexico Government International Bond 3,000 % fällig am 03.12.2026	MXN	19.683	1.022	Mexico Government International Bond 7,000 % fällig am 03.09.2026	MXN	7.900	412
Ungarische Schatzwechsel 0,000 % fällig am 27.04.2023	HUF	306.000	882	Peru Government International Bond 7,300 % fällig am 12.08.2033	PEN	1.300	362
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	15.500	881	AKTIEN			
Ungarische Schatzwechsel 0,000 % fällig am 20.04.2023	HUF	164.000	479	PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)		3.400	338
Ungarische Schatzwechsel 0,000 % fällig am 13.04.2023		163.000	470	PARI (000S)			
Mexico Government International Bond 7,000 % fällig am 03.09.2026	MXN	7.900	433	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	1.300	353	Mexico Government International Bond 2,750 % fällig am 27.11.2031	MXN	6.025	290
Mexico Government International Bond 2,750 % fällig am 27.11.2031	MXN	7.109	348	South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	3.600	229
Export-Import Bank of Korea 4,890 % fällig am 09.08.2023	INR	26.600	322	Suci Second Investment Co. 6,000 % fällig am 25.10.2028	\$	200	211
Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos 5,000 % fällig am 01.10.2028	CLP	285.000	321	Bank Gospodarstwa Krajowego 6,250 % fällig am 31.10.2028		200	211
South Africa Government International Bond 8,000 % fällig am 31.01.2030	ZAR	6.200	306	Standard Chartered PLC 6,170 % fällig am 09.01.2027		200	204
Israel Government International Bond 5,000 % fällig am 30.10.2026	€	200	210	Danske Bank A/S 6,466 % fällig am 09.01.2026		200	203
		AKTIEN		Colombian TES 9,250 % fällig am 28.05.2042	COP	1.167.800	203
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short- Term Floating NAV Fund (a)		20.221	201	Hungarian Development Bank 6,500 % fällig am 29.06.2028	\$	200	202
		PARI (000S)		Gaci First Investment Co. 4,750 % fällig am 14.02.2030		200	202
Bank Leumi Le-Israel B.M. 7,129 % fällig am 18.07.2033	\$	200	200	Korea Electric Power Corp. 5,375 % fällig am 31.07.2026		200	199
Danske Bank A/S 6,466 % fällig am 09.01.2026		200	200	Bank Leumi Le-Israel B.M. 7,129 % fällig am 18.07.2033		200	198
Standard Chartered PLC 6,170 % fällig am 09.01.2027		200	200	Lloyds Banking Group PLC 4,716 % fällig am 11.08.2026		200	196
Bank Gospodarstwa Krajowego 6,250 % fällig am 31.10.2028		200	200	Greenko Solar Mauritius Ltd. 5,950 % fällig am 29.07.2026		200	185
Korea Electric Power Corp. 5,375 % fällig am 31.07.2026		200	200	Colombian TES 13,250 % fällig am 09.02.2033	COP	663.500	168
Suci Second Investment Co. 6,000 % fällig am 25.10.2028		200	199	Nykredit Realkredit A/S 1,500 % fällig am 01.10.2053	DKK	1.467	166
Korea Southern Power Co. Ltd. 5,375 % fällig am 21.09.2026		200	199	Mexico Government International Bond 7,500 % fällig am 03.06.2027	MXN	2.600	142
Gaci First Investment Co. 4,750 % fällig am 14.02.2030		200	198	Colombia Government International Bond 4,375 % fällig am 21.03.2023	COP	676.600	138
Hungarian Development Bank 6,500 % fällig am 29.06.2028		200	198	Colombia Government International Bond 4,375 % fällig am 21.03.2023		676.600	137
Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos 6,000 % fällig am 01.04.2033	CLP	155.000	192	Mexico Government International Bond 7,750 % fällig am 29.05.2031	MXN	2.300	129
Credicorp Capital Sociedad Titulizadora S.A. 10,100 % fällig am 15.12.2043	PEN	700	189				

(a) Der Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des PIMCO ESG Income Fund

31. Dezember 2023 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2023		
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.08.2053	\$ 23.800	\$ 22.975
Uniform Mortgage-Backed Security 5,500 % fällig am 01.06.2053	21.446	21.528
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.08.2053	14.733	13.534
Uniform Mortgage-Backed Security 5,500 % fällig am 01.08.2053	8.100	7.973
EMF-UK PLC 6,319 % fällig am 13.03.2046	£ 3.566	4.219
TDC Net A/S 5,618 % fällig am 06.02.2030	€ 2.700	2.944
Ginnie Mae 5,500 % fällig am 20.07.2053	\$ 2.495	2.490
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.01.2025 (a)	2.547	2.455
Great Hall Mortgages PLC 5,599 % fällig am 18.06.2038	£ 2.040	2.387
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.08.2053	\$ 2.500	2.359
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.07.2053	2.411	2.316
Ginnie Mae 5,500 % fällig am 20.08.2053	2.100	2.095
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.07.2053	1.927	1.806
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.10.2024 (a)	1.842	1.780
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust 4,470 % 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
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.10.2053	1.807	1.556
Towd Point Mortgage Funding PLC 5,891 % 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

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 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
Forvia SE 2,750 % fällig am 15.02.2027	€ 500	511
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
Greenko Solar Mauritius Ltd. 5,950 % fällig am 29.07.2026	200	188
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
Societe Generale S.A. 4,750 % fällig am 26.05.2026	200	166
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
Blue Owl Capital Corp. 2,875 % fällig am 11.06.2028	200	164
MPT Operating Partnership LP 3,375 % fällig am 24.04.2030	£ 200	150

(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 Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Euro Bond Fund

31. Dezember 2023 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2023			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2023		
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	1.343.400	€ 131.425	PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	1.583.400	€ 154.259
	PARI (000S)			PARI (000S)	
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,750 % fällig am 01.07.2024	€ 70.000	68.838	Spain Government International Bond 0,000 % fällig am 31.01.2026	€ 78.400	72.162
France Government International Bond 2,500 % fällig am 24.09.2026	61.600	60.830	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,750 % fällig am 01.07.2024	49.800	49.196
France Government International Bond 2,750 % fällig am 25.02.2029	51.300	50.951	Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 392.712	37.100
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,100 % fällig am 01.02.2029	34.700	35.684	France Government International Bond 2,500 % fällig am 24.09.2026	€ 28.300	28.396
	AKTIEN			AKTIEN	
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	283.500	27.505	PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	292.500	28.388
	PARI (000S)			PARI (000S)	
Spain Government International Bond 0,600 % fällig am 31.10.2029	€ 31.800	27.391	Spain Government International Bond 1,450 % fällig am 31.10.2027	€ 23.300	21.748
Spain Government International Bond 2,350 % fällig am 30.07.2033	25.300	22.234	Spain Government International Bond 1,400 % fällig am 30.07.2028	19.200	17.729
Europäische Union 2,750 % fällig am 04.12.2037	17.900	17.327	Europäische Union 2,750 % fällig am 04.12.2037	17.900	16.736
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,125 % fällig am 15.01.2033 (b)	\$ 17.171	14.775	Europäische Union 0,250 % fällig am 22.04.2036	23.000	16.386
Europäische Union 3,375 % fällig am 04.10.2038	€ 14.820	14.748	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 2,000 % fällig am 15.11.2029	17.100	15.978
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,500 % fällig am 01.10.2053	14.300	14.237	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,300 % fällig am 15.05.2028	14.447	14.360
Europäische Union 4,000 % fällig am 04.04.2044	12.100	12.074	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,000 % fällig am 15.09.2031	17.900	13.786
BMW Finance NV 4,119 % fällig am 09.12.2024	10.400	10.400	Europäische Union 4,000 % fällig am 04.04.2044	12.100	12.390
Credit Mutuel Home Loan SFH S.A. 3,250 % fällig am 20.04.2029	9.700	9.669	Spain Government International Bond 2,350 % fällig am 30.07.2033	12.900	12.184
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,375 % fällig am 15.07.2033 (b)	\$ 10.866	9.552	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,150 % fällig am 01.09.2052	19.000	12.014
Twin Bridges PLC 5,880 % fällig am 12.09.2055	£ 8.020	9.213	Barclays PLC 3,125 % fällig am 17.01.2024	£ 8.700	10.012
Barclays PLC 5,829 % fällig am 09.05.2027	\$ 9.800	8.805	Credit Mutuel Home Loan SFH S.A. 3,250 % fällig am 20.04.2029	€ 9.700	9.606
France Government International Bond 0,550 % fällig am 01.03.2039	€ 8.710	8.585	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,000 % fällig am 15.06.2029	11.100	9.311
UniCredit SpA 2,569 % fällig am 22.09.2026	\$ 9.100	7.771	France Government International Bond 0,100 % fällig am 25.07.2038	9.949	9.106
			Eurofima Europaeische Gesellschaft fuer die Finanzierung von Eisenbahnmaterial 0,010 % fällig am 23.06.2028	10.500	8.919
			France Government International Bond 0,550 % fällig am 01.03.2039	8.735	8.605

(a) Der Euro Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Euro Credit Fund

31. Dezember 2023 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2023			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2023		
Europäische Union 0,000 % fällig am 04.10.2030	€ 15.400	€ 12.406	PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	436.500	€ 42.821
Europäische Investitionsbank 2,250 % fällig am 15.03.2030	12.800	12.294		PARI (000S)	
Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 3,000 % fällig am 15.12.2028	11.000	10.940	UBS Group AG 1,250 % fällig am 17.04.2025	€ 12.500	12.146
BNP Paribas S.A. 2,750 % fällig am 25.07.2028	10.700	10.013	Wells Fargo & Co. 1,000 % fällig am 02.02.2027	12.100	10.889
Europäische Investitionsbank 0,050 % fällig am 13.10.2034	12.700	9.141	Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 78.904	7.577
Europäische Union 2,750 % fällig am 04.02.2033	7.600	7.529	Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	74.128	7.479
Region of Ile de France 3,050 % fällig am 03.02.2033	7.200	7.183	BNP Paribas S.A. 1,904 % fällig am 30.09.2028	\$ 9.000	7.020
Romania Government International Bond 6,625 % fällig am 27.09.2029	6.400	6.606	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 2,125 % fällig am 09.07.2027	€ 7.200	6.694
Europäische Union 0,000 % fällig am 04.11.2025	6.700	6.204	Barclays PLC 0,577 % fällig am 09.08.2029	8.300	6.670
Europäische Union 1,500 % fällig am 04.10.2035	7.400	6.189	Nationwide Building Society 4,363 % fällig am 01.08.2024	\$ 6.800	6.300
Europäische Union 0,400 % fällig am 04.02.2037	8.900	6.130	Europäische Union 0,000 % fällig am 04.11.2025	€ 6.700	6.297
Europäischer Stabilitätsmechanismus 0,750 % fällig am 15.03.2027	6.700	6.118	Cooperative Rabobank UA 4,655 % fällig am 22.08.2028	\$ 7.100	6.275
Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 1,250 % fällig am 24.05.2033	7.000	6.103	UBS Group AG 1,250 % fällig am 17.07.2025	€ 6.900	6.238
ING Groep NV 4,500 % fällig am 23.05.2029	6.100	6.102	Europäische Investitionsbank 2,250 % fällig am 15.03.2030	6.200	6.121
Europäische Union 0,450 % fällig am 04.07.2041	9.700	6.092	BNG Bank NV 3,000 % fällig am 11.01.2033	6.000	5.818
Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 2,375 % fällig am 11.04.2028	6.300	6.091	Europäische Union 2,750 % fällig am 04.12.2037	6.200	5.738
Europäische Investitionsbank 0,250 % fällig am 20.01.2032	7.500	6.088	Mizuho Financial Group, Inc. 3,490 % fällig am 05.09.2027	5.300	5.178
International Development Association 1,750 % fällig am 05.05.2037	7.400	6.024	Cooperative Rabobank UA 4,000 % fällig am 10.01.2030	5.100	5.141
BNG Bank NV 3,000 % fällig am 11.01.2033	6.000	5.997	Logicor Financing SARRL 2,250 % fällig am 13.05.2025	5.500	5.039
Europäische Union 2,750 % fällig am 04.12.2037	6.200	5.964	BNP Paribas S.A. 0,500 % fällig am 04.06.2026	5.400	5.021
BNG Bank NV 3,500 % fällig am 27.09.2038	5.800	5.743	Banque Federative du Credit Mutuel S.A. 0,625 % fällig am 19.11.2027	5.700	4.886
UBS Group AG 7,750 % fällig am 01.03.2029	5.100	5.697	Romania Government International Bond 6,625 % fällig am 27.09.2029	4.700	4.834
France Government International Bond 1,750 % fällig am 25.05.2023	5.600	5.588	Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC 4,715 % fällig am 15.07.2030	4.887	4.810
Hamburg Commercial Bank AG 6,250 % fällig am 18.11.2024	5.300	5.486	NatWest Group PLC 2,000 % fällig am 04.03.2025	4.900	4.798
Cooperative Rabobank UA 4,000 % fällig am 10.01.2030	5.100	5.078			
Cooperative Rabobank UA 4,233 % fällig am 25.04.2029	5.100	4.995			

(a) Der Euro Credit Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Euro Income Bond Fund

31. Dezember 2023 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2023			VERKAUFE BIS 31. DEZEMBER 2023		
Jupiter Mortgage PLC 6,621 % fällig am 20.07.2060	£ 24.700	€ 27.420	France Government International Bond 0,000 % fällig am 25.03.2023	€ 21.750	€ 21.715
Bridgewater Funding PLC 7,470 % fällig am 16.10.2062	24.122	26.663	Fairfax Financial Holdings Ltd. 2,750 % fällig am 29.03.2028	21.600	19.218
Dutch Property Finance BV 4,852 % fällig am 28.04.2064	€ 16.200	15.995	Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2053	DKK 168.664	16.983
Shamrock Residential DAC 4,876 % fällig am 24.06.2071	15.000	14.787	AKTIEN		
Glenbeigh Issuer DAC 4,666 % fällig am 24.06.2050	14.848	14.629	PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	154.800	14.875
France Government International Bond 0,000 % fällig am 25.03.2023	14.600	14.550		PARI (000S)	
RMAC PLC 0,000 % fällig am 15.02.2047	£ 11.100	12.937	HSBC Holdings PLC 1,589 % fällig am 24.05.2027	\$ 17.500	14.307
SLM Student Loan Trust 6,252 % fällig am 25.03.2026	\$ 13.701	12.699	Loxam S.A.S. 3,250 % fällig am 14.01.2025	€ 14.600	13.966
Barclays PLC 7,437 % fällig am 02.11.2033	12.226	12.596	Syngenta Finance NV 3,375 % fällig am 16.04.2026	13.600	13.148
Tower Bridge Funding PLC 6,721 % fällig am 20.10.2064	£ 10.400	11.876	Societa per Azioni Esercizi Aeroportuali SEA SpA 3,500 % fällig am 09.10.2025	14.000	13.108
NatWest Group PLC 6,016 % fällig am 02.03.2034	\$ 12.200	11.509	Banco de Sabadell S.A. 1,125 % fällig am 27.03.2025	14.000	12.872
BPCE S.A. 5,748 % fällig am 19.07.2033	12.100	11.072	Deutsche Bank AG 1,625 % fällig am 20.01.2027	14.200	12.616
Pacific Gas & Electric Co. 6,150 % fällig am 15.01.2033	11.700	11.005	Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 112.167	11.274
HSBC Holdings PLC 5,402 % fällig am 11.08.2033	12.000	10.902	Pacific Gas & Electric Co. 6,150 % fällig am 15.01.2033	\$ 11.700	10.992
ABN AMRO Bank NV 6,575 % fällig am 13.10.2026	11.200	10.636	Nissan Motor Co. Ltd. 2,652 % fällig am 17.03.2026	€ 11.400	10.717
Twin Bridges PLC 6,432 % fällig am 15.05.2056	£ 9.100	10.435	Mundys SpA 1,875 % fällig am 12.02.2028	11.500	9.831
Lloyds Banking Group PLC 4,750 % fällig am 21.09.2031	€ 10.300	10.238	Societe Generale S.A. 2,226 % fällig am 21.01.2026	\$ 11.000	9.624
Jupiter Mortgage PLC 7,721 % fällig am 20.07.2060	£ 8.760	10.131	IHO Verwaltungs GmbH 3,625 % fällig am 15.05.2025	€ 10.200	9.614
France Government International Bond 0,000 % fällig am 25.03.2024	€ 9.800	9.716	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 2,125 % fällig am 09.07.2027	10.500	9.562
Avon Finance PLC 0,000 % fällig am 28.12.2049	£ 8.300	9.596	Accor S.A. 2,375 % fällig am 29.11.2028	9.600	8.237
Pacific Gas & Electric Co. 6,950 % fällig am 15.03.2034	\$ 9.500	8.820	TP ICAP Finance PLC 2,625 % fällig am 18.11.2028	£ 8.600	7.779
Atrium Hotel Portfolio Trust 7,309 % fällig am 15.06.2035	9.700	8.681	Aroundtown S.A. 1,500 % fällig am 28.05.2026	€ 9.000	7.774
Nationwide Building Society 6,557 % fällig am 18.10.2027	9.100	8.566	Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 75.223	7.222
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,375 % fällig am 15.07.2033 (b)	9.259	8.135	Avolon Holdings Funding Ltd. 2,875 % fällig am 15.02.2025	\$ 7.700	6.689
Standard Chartered PLC 6,750 % fällig am 08.02.2028	8.500	8.038	UBS Group AG 1,250 % fällig am 17.07.2025	€ 7.000	6.682
Shamrock Residential DAC 4,726 % fällig am 24.01.2061	€ 7.913	7.874	AerCap Ireland Capital DAC 3,150 % fällig am 15.02.2024	\$ 7.300	6.523
Societe Generale S.A. 6,446 % fällig am 10.01.2029	\$ 7.700	7.295	Digital Intrepid Holding BV 1,375 % fällig am 18.07.2032	€ 7.500	6.038
Option One Mortgage Loan Trust 5,650 % fällig am 25.04.2037	13.654	7.290	WPC Eurobond BV 1,350 % fällig am 15.04.2028	7.000	5.922
Fieldstone Mortgage Investment Trust 6,250 % fällig am 25.12.2035	9.291	7.247	Santander UK Group Holdings PLC 0,603 % fällig am 13.09.2029	7.500	5.899
UBS Commercial Mortgage Trust 6,909 % fällig am 15.02.2032	7.520	6.700	Sofina S.A. 1,000 % fällig am 23.09.2028	7.400	5.819
KBC Group NV 5,796 % fällig am 19.01.2029	7.200	6.695	Grifols S.A. 6,223 % fällig am 15.11.2027	6.000	5.705
UBS Group AG 7,750 % fällig am 01.03.2029	€ 6.400	6.664	Avolon TLB Borrower (U.S.) LLC 7,708 % fällig am 22.06.2028	\$ 5.670	5.170
Mortimer BTL PLC 0,000 % fällig am 22.12.2056	£ 5.800	6.651	Ivory Coast Government International Bond 5,250 % fällig am 22.03.2030	€ 6.000	5.141
	AKTIEN		KBC Group NV 5,796 % fällig am 19.01.2029	\$ 5.200	4.878
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	66.500	6.533	INEOS Finance PLC 6,593 % fällig am 08.11.2028	€ 5.000	4.761
	PARI (000S)		AA Bond Co. Ltd. 5,500 % fällig am 31.07.2050	£ 4.510	4.650
Sandoz Finance BV 4,220 % fällig am 17.04.2030	€ 6.500	6.498			
UBS Group AG 6,246 % fällig am 22.09.2029	\$ 6.900	6.463			
AIB Group PLC 5,250 % fällig am 23.10.2031	€ 6.380	6.351			
Harbour Energy PLC 6,120 % fällig am 28.01.2054	£ 5.700	6.300			
Pacific Gas & Electric Co. 6,100 % fällig am 15.01.2029	\$ 6.800	6.283			

(a) Der Euro Income Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Euro Long Average Duration Fund

31. Dezember 2023 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2023			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2023		
France Government International Bond 4,500 % fällig am 25.04.2041	€ 91.700	€ 107.923	PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	624.900	€ 60.845
				PARI (000S)	
	AKTIEN		France Government International Bond 3,250 % fällig am 25.05.2045	€ 22.500	22.026
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	957.700	93.326	France Government International Bond 0,750 % fällig am 25.05.2052	40.900	21.004
	PARI (000S)		Belgium Government International Bond 3,750 % fällig am 22.06.2045	14.900	15.049
France Government International Bond 4,000 % fällig am 25.10.2038	€ 58.800	64.827	France Government International Bond 4,000 % fällig am 25.10.2038	14.200	14.666
France Government International Bond 4,000 % fällig am 25.04.2055	50.100	56.769	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2024 (b)	\$ 12.564	11.665
France Government International Bond 3,250 % fällig am 25.05.2045	55.400	54.868	Bundesrepublik Deutschland 4,750 % fällig am 04.07.2040	€ 7.800	10.095
France Government International Bond 3,000 % fällig am 25.05.2054	56.100	52.411	Bundesrepublik Deutschland 4,250 % fällig am 04.07.2039	7.200	8.578
France Government International Bond 4,000 % fällig am 25.04.2060	36.500	42.327	Bundesrepublik Deutschland 2,500 % fällig am 15.08.2046	7.300	7.051
France Government International Bond 2,500 % fällig am 25.05.2043	46.700	41.474	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,300 % fällig am 15.05.2028	6.852	6.807
Netherlands Government International Bond 2,750 % fällig am 15.01.2047	27.100	27.640	France Government International Bond 2,500 % fällig am 25.05.2043	7.600	6.516
Bundesrepublik Deutschland 4,750 % fällig am 04.07.2040	21.100	26.758	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b)	\$ 6.707	6.187
Belgium Government International Bond 3,750 % fällig am 22.06.2045	20.300	21.199	France Government International Bond 2,000 % fällig am 25.05.2048	€ 6.450	4.951
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,625 % fällig am 15.10.2027 (b)	\$ 21.904	19.845	France Government International Bond 0,500 % fällig am 25.05.2072	12.100	4.414
Netherlands Government International Bond 0,000 % fällig am 15.01.2038	€ 24.800	16.780	Europäische Union 4,000 % fällig am 04.04.2044	4.200	4.302
Netherlands Government International Bond 0,000 % fällig am 15.01.2052	32.000	15.652	France Government International Bond 4,000 % fällig am 25.04.2055	2.800	3.104
France Government International Bond 1,500 % fällig am 25.05.2050	20.600	14.226	Bundesrepublik Deutschland 1,250 % fällig am 15.08.2048	4.000	2.986
France Government International Bond 0,750 % fällig am 25.05.2052	25.700	14.149	Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 26.741	2.518
Bundesrepublik Deutschland 2,500 % fällig am 04.07.2044	13.500	12.691	France Government International Bond 1,750 % fällig am 25.06.2039	€ 2.850	2.405
Slovenia Government International Bond 1,500 % fällig am 25.03.2035	14.800	12.047	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 3,629 % fällig am 06.04.2026	2.400	2.373
France Government International Bond 1,250 % fällig am 25.05.2038	15.300	11.945			
France Government International Bond 2,000 % fällig am 25.05.2048	14.800	11.653			
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2024 (b)	\$ 12.474	11.248			
France Government International Bond 0,750 % fällig am 25.05.2053	€ 20.800	10.964			

(a) Der Euro Long Average Duration Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Euro Short-Term Fund

31. Dezember 2023 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2023		
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2025 (a)	\$ 14.211	€ 12.578
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,375 % fällig am 09.03.2026	€ 4.300	3.998
Towd Point Mortgage Funding PLC 6,690 % fällig am 20.02.2045	£ 2.997	3.513
Revocar UG 4,513 % fällig am 21.04.2036	€ 2.711	2.716
Europäische Union 0,400 % fällig am 04.02.2037	3.000	2.097
Bank of Queensland Ltd. 1,839 % fällig am 09.06.2027	2.000	1.863
JAB Holdings BV 1,750 % fällig am 25.06.2026	1.900	1.792
Nordea Kredit Realkreditatieselskab 1,000 % fällig am 01.10.2024	DKK 13.500	1.762
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 3,629 % fällig am 06.04.2026	€ 1.700	1.691
Bpifrance Financement S.A. 11,625 % fällig am 01.11.2027	1.600	1.598
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
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-Niederlanden Bank NV 0,500 % fällig am 10.10.2024	1.100	1.051

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2023		
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2025 (a)	\$ 14.396	€ 13.048
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
Korea Housing Finance Corp. 0,723 % fällig am 22.03.2025	€ 5.700	5.427
Trinity Square PLC 6,070 % fällig am 15.07.2059	£ 4.441	5.003
Towd Point Mortgage Funding PLC 6,365 % fällig am 20.10.2051	3.629	4.256
Bain Capital Euro CLO DAC 4,733 % fällig am 20.01.2032	€ 3.800	3.717
Freddie Mac 0,800 % fällig am 28.10.2026	\$ 4.200	3.469
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,375 % fällig am 09.03.2026	€ 3.700	3.440
BNZ International Funding Ltd. 0,625 % fällig am 03.07.2025	3.600	3.389
Freddie Mac 0,650 % fällig am 27.10.2025	\$ 3.900	3.313
Precise Mortgage Funding PLC 6,420 % fällig am 12.12.2055	£ 2.804	3.243
Australia & New Zealand Banking Group Ltd. 0,250 % fällig am 17.03.2025	€ 3.400	3.210
Korea Housing Finance Corp. 0,010 % fällig am 05.02.2025	3.300	3.113
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 1,625 % fällig am 09.07.2024	3.200	3.113
Yorkshire Building Society 0,125 % fällig am 08.05.2024	3.100	3.023
Toronto-Dominion Bank 1,707 % fällig am 28.07.2025	3.100	2.985
Becton Dickinson and 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
SEB S.A. 1,500 % fällig am 31.05.2024	3.000	2.923
Stratton Mortgage Funding PLC 6,121 % fällig am 20.07.2060	£ 2.492	2.894
Jubilee Place BV 4,835 % fällig am 17.01.2059	€ 2.899	2.884
Canada Square Funding PLC 6,170 % fällig am 17.06.2058	£ 2.535	2.814
Lanebrook Mortgage Transaction PLC 5,871 % fällig am 20.07.2058	2.512	2.802
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
Development Bank of Japan, Inc. 0,010 % fällig am 15.10.2024	2.600	2.492
Dell Bank International DAC 1,625 % fällig am 24.06.2024	2.500	2.438

(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 Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des PIMCO European High Yield Bond Fund

31. Dezember 2023 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2023			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2023		
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	106.500	€ 10.368	Rolls-Royce PLC 4,625 % fällig am 16.02.2026	€ 4.700	€ 4.628
	PARI (000S)		Ford Motor Credit Co. LLC 4,867 % fällig am 03.08.2027	4.150	4.071
France Government International Bond 4,250 % fällig am 25.10.2023	€ 7.340	7.352	Ford Motor Credit Co. LLC 3,625 % fällig am 17.06.2031	\$ 4.800	3.581
Treasury Bills des europäischen Stabilitätsmechanismus 0,000 % fällig am 23.05.2024	6.930	6.800	Summer BC Holdco SARL 5,750 % fällig am 31.10.2026	€ 2.800	2.458
Ford Motor Credit Co. LLC 4,867 % fällig am 03.08.2027	4.150	4.150	Telefonica Europe BV 6,750 % fällig am 31.12.2099	2.300	2.253
Intesa Sanpaolo SpA 4,198 % fällig am 01.06.2032	\$ 5.800	4.082	Mundys SpA 1,875 % fällig am 12.02.2028	2.500	2.138
AT&T, Inc. 2,875 % fällig am 02.03.2025	€ 4.100	3.810	Intesa Sanpaolo SpA 8,248 % fällig am 21.11.2033	\$ 2.100	2.036
Ford Motor Credit Co. LLC 3,625 % fällig am 17.06.2031	\$ 5.100	3.771	Renault S.A. 2,375 % fällig am 25.05.2026	€ 2.100	1.940
Wintershall Dea Finance BV 2,499 % fällig am 20.04.2026	€ 4.100	3.575		AKTIEN	
Grifols S.A. 3,200 % fällig am 01.05.2025	3.700	3.560	PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	19.000	1.879
Cirsa Finance International SARL 4,500 % fällig am 15.03.2027	3.800	3.548		PARI (000S)	
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV 1,875 % fällig am 31.03.2027	3.800	3.241	Adient Global Holdings Ltd. 3,500 % fällig am 15.08.2024	€ 1.900	1.865
Telecom Italia SpA 7,875 % fällig am 31.07.2028	3.200	3.215	Renault S.A. 1,125 % fällig am 04.10.2027	2.200	1.865
Virgin Media Secured Finance PLC 4,250 % fällig am 15.01.2030	£ 3.400	3.136	Lottomatica SpA 7,125 % fällig am 01.06.2028	1.800	1.853
France Government International Bond 0,000 % fällig am 25.03.2023	€ 3.090	3.078	Cellnex Finance Co. S.A. 1,500 % fällig am 08.06.2028	2.100	1.797
EP Infrastructure A/S 1,816 % fällig am 02.03.2031	4.300	3.076	Cirsa Finance International SARL 4,750 % fällig am 22.05.2025	1.800	1.761
Spectrum Brands, Inc. 4,000 % fällig am 01.10.2026	3.200	3.068	Intrum AB 9,250 % fällig am 15.03.2028	1.800	1.754
Pinnacle Bidco PLC 6,375 % fällig am 15.02.2025	£ 2.800	2.991	France Government International Bond 1,750 % fällig am 25.05.2023	1.700	1.698
Electricite de France S.A. 6,000 % fällig am 29.01.2026	2.600	2.726	Rolls-Royce PLC 3,375 % fällig am 18.06.2026	£ 1.580	1.681
Schaeffler AG 3,375 % fällig am 12.10.2028	€ 2.900	2.599	EP Infrastructure A/S 1,698 % fällig am 30.07.2026	€ 1.900	1.635
Telecom Italia SpA 2,375 % fällig am 12.10.2027	3.000	2.595	INEOS Quattro Finance Plc 3,375 % fällig am 15.01.2026	\$ 1.900	1.584
			Synthomer PLC 3,875 % fällig am 01.07.2025	€ 1.600	1.537
			Techem Verwaltungsgesellschaft mbH 2,000 % fällig am 15.07.2025	1.600	1.527
			Volkswagen International Finance NV 7,500 % fällig am 31.12.2099	1.400	1.432
			Marks & Spencer PLC 3,750 % fällig am 19.05.2026	£ 1.300	1.407
			Elior Group S.A. 3,750 % fällig am 15.07.2026	€ 1.700	1.389
			Accor S.A. 2,625 % fällig am 30.01.2025	1.400	1.321
			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
			WeBuild SpA 7,000 % fällig am 28.09.2028	1.200	1.214
			France Government International Bond 4,250 % fällig am 25.10.2023	1.200	1.200

(a) Der PIMCO European High Yield Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des PIMCO European Short-Term Opportunities Fund

31. Dezember 2023 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2023			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2023		
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	213.500	€ 20.618	PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	333.400	€ 32.263
	PARI (000S)			PARI (000S)	
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2025 (b)	\$ 8.375	7.412	Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 30.694	3.046
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,350 % fällig am 15.09.2024	€ 2.956	2.976	Jyske Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	31.521	2.999
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,100 % fällig am 01.02.2029	2.800	2.879	Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % fällig am 01.10.2050	28.880	2.744
Realkredit Danmark A/S 5,000 % fällig am 01.10.2053	DKK 20.800	2.785	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	2.296	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 9,000 % fällig am 01.11.2023	2.200	2.293
Spain Government International Bond 2,350 % fällig am 30.07.2033	1.600	1.461	UniCredit SpA 7,830 % fällig am 04.12.2023	\$ 2.050	1.879
Bundesrepublik Deutschland 4,250 % fällig am 04.07.2039	900	1.143	Realkredit Danmark A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 18.682	1.843
Europäische Union 4,000 % fällig am 04.04.2044	1.100	1.098	Realkredit Danmark A/S 2,000 % fällig am 01.10.2053	17.500	1.840
HSBC Holdings PLC 6,254 % fällig am 09.03.2034	\$ 1.000	944	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 0,125 % fällig am 15.09.2031	€ 2.300	1.831
Europäische Union 0,300 % fällig am 04.11.2050	€ 1.900	897	Realkredit Danmark A/S 3,000 % fällig am 01.10.2053	DKK 13.600	1.619
AMCO - Asset Management Co. SpA 4,625 % fällig am 06.02.2027	900	897	Spain Government International Bond 2,350 % fällig am 30.07.2033	€ 1.600	1.431
Credit Suisse Schweiz AG 3,390 % fällig am 05.12.2025	900	873	Crown European Holdings S.A. 2,625 % fällig am 30.09.2024	1.400	1.374
Societe Generale SFH S.A. 3,625 % fällig am 31.07.2026	800	799	Deutsche Bank AG 2,625 % fällig am 16.12.2024	£ 1.200	1.311
Santander UK Group Holdings PLC 6,534 % fällig am 10.01.2029	\$ 800	754	Credit Suisse Schweiz AG 3,390 % fällig am 05.12.2025	€ 1.200	1.194
United Kingdom Gilt 0,875 % fällig am 31.01.2046	£ 1.100	716	Volkswagen Bank GmbH 1,875 % fällig am 31.01.2024	1.200	1.184
Westpac Banking Corp. 3,457 % fällig am 04.04.2025	€ 700	700	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2025 (b)	\$ 1.287	1.146
ING Belgium S.A. 3,375 % fällig am 31.05.2027	700	699	Europäische Union 4,000 % fällig am 04.04.2044	€ 1.100	1.128
Barclays PLC 7,437 % fällig am 02.11.2033	\$ 600	606	Sparebanken Soer Boligkredit A/S 3,125 % fällig am 14.11.2025	1.100	1.101
Royal Bank of Canada 4,415 % fällig am 17.01.2025	€ 600	600	Australia & New Zealand Banking Group Ltd. 3,205 % fällig am 15.11.2024	1.100	1.099
			Bundesrepublik Deutschland 4,250 % fällig am 04.07.2039	900	1.098
			Charles Schwab Corp. 5,916 % fällig am 13.05.2026	\$ 1.200	1.086
			Deutsche Bank AG 4,000 % fällig am 29.11.2027	€ 1.100	1.082

(a) Der PIMCO European Short-Term Opportunities Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Global Advantage Fund

31. Dezember 2023 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG			KOSTEN (000S)		BESCHREIBUNG			ERLÖSE (000S)		
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2023				AKTIEN	VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2023					
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)			19.132.421	\$	190.536	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		19.149.288	\$	190.700
			PARI (000S)					PARI (000S)		
Japan Government International Bond 0,005 % fällig am 01.10.2024	¥	1.050.000	7.902		Canadian Government Real Return Bond 3,500 % fällig am 01.03.2028	CAD	5.500	4.137		
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b)	\$	6.654	6.452		U.S. Treasury Bonds 4,000 % fällig am 15.11.2042	\$	3.400	3.512		
Ungarische Schatzwechsel 0,000 % fällig am 20.04.2023	HUF	1.653.000	4.830		U.S. Treasury Bonds 1,875 % fällig am 15.02.2041		4.500	3.378		
Ungarische Schatzwechsel 0,000 % fällig am 13.04.2023		1.647.000	4.747		Peru Government International Bond 5,940 % fällig am 12.02.2029	PEN	9.000	2.157		
Israel Government International Bond 5,000 % fällig am 30.10.2026	€	4.200	4.415		Bulgaria Government International Bond 4,500 % fällig am 27.01.2033	€	2.100	2.143		
Ungarische Schatzwechsel 0,000 % fällig am 30.11.2023	HUF	1.538.000	4.374		Canada Government International Bond 1,750 % fällig am 01.12.2053	CAD	3.750	1.965		
Canadian Government Real Return Bond 3,500 % fällig am 01.03.2028	CAD	5.500	4.134		Canadian Government Real Return Bond 2,750 % fällig am 01.06.2033		2.180	1.554		
South Korea Government International Bond 4,250 % fällig am 10.12.2032	KRW	4.950.810	4.050		Morocco Government International Bond 2,000 % fällig am 30.09.2030	€	1.800	1.530		
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,125 % fällig am 15.01.2033 (b)	\$	3.824	3.800		CIFC Funding Ltd. 6,657 % fällig am 18.04.2031	\$	1.500	1.489		
U.S. Treasury Bonds 4,000 % fällig am 15.11.2042		3.400	3.509		UBS Group AG 4,703 % fällig am 05.08.2027		1.500	1.457		
Canada Government International Bond 2,750 % fällig am 01.12.2033	CAD	4.700	3.325		American Municipal Power, Inc. 7,334 % fällig am 15.02.2028		1.300	1.411		
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2025 (b)	\$	3.061	2.963		U.S. Treasury Notes 3,625 % fällig am 31.03.2028		1.400	1.399		
Japan Government International Bond 1,500 % fällig am 20.09.2043	¥	360.000	2.587		Japan Finance Organization for Municipalities 3,375 % fällig am 27.09.2023		1.400	1.383		
Bulgaria Government International Bond 4,500 % fällig am 27.01.2033	€	2.100	2.219		Serbia Government International Bond 3,125 % fällig am 15.05.2027	€	1.400	1.376		
Israel Government International Bond 4,500 % fällig am 17.01.2033	\$	2.200	2.178		LCM LP 6,717 % fällig am 20.07.2031	\$	1.300	1.285		
South Korea Government International Bond 3,250 % fällig am 10.06.2033	KRW	2.805.850	2.105		South Korea Government International Bond 3,250 % fällig am 10.06.2033	KRW	1.645.360	1.242		
Magyar Export-Import Bank 6,125 % fällig am 04.12.2027	\$	2.100	2.084		Madison Park Funding Ltd. 6,405 % fällig am 15.04.2029	\$	1.240	1.226		
Canada Government International Bond 1,750 % fällig am 01.12.2053	CAD	3.750	2.077		Man GLG Euro CLO DAC 4,775 % fällig am 15.10.2032	€	1.099	1.165		
Colombia Government International Bond 7,500 % fällig am 02.02.2034	\$	1.900	1.886		Citigroup, Inc. 3,785 % fällig am 17.03.2033	\$	1.300	1.157		

(a) Der Global Advantage Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Global Bond Fund

31. Dezember 2023 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG		AKTIEN	KOSTEN (000\$)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2023			
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		101.948.889	\$ 1.015.250
		PARI (000\$)	
Japanische Schatzwechsel 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
Uniform Mortgage-Backed Security 5,500 % fällig am 01.08.2053	\$	135.000	132.620
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b)		129.538	125.876
Japan Government International Bond 0,005 % fällig am 01.03.2024	¥	15.550.000	120.544
Israel Government International Bond 5,000 % fällig am 30.10.2026	€	109.000	114.574
Canadian Government Real Return Bond 2,750 % fällig am 01.09.2027	CAD	143.300	106.280
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.09.2053	\$	104.990	106.262
Canada Government International Bond 2,750 % fällig am 01.12.2033	CAD	145.600	103.006
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
Malaysia Government International Bond 3,519 % fällig am 20.04.2028	MYR	394.244	84.194
Japan Government International Bond 1,500 % fällig am 20.09.2043	¥	11.670.000	83.876
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
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.10.2052	\$	81.537	75.058
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.09.2052		68.000	63.908
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

BESCHREIBUNG		AKTIEN	ERLÖSE (000\$)
VERKAUFE BIS 31. DEZEMBER 2023			
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		87.617.069	\$ 872.500
		PARI (000\$)	
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
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	452.587	47.103
Deutsche Bank AG 1,625 % fällig am 20.01.2027	€	46.300	47.084
South Korea Government International Bond 3,250 % fällig am 10.06.2033	KRW	52.310.460	39.490
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. 6,797 % fällig am 20.10.2029		27.151	26.947
Thailand Government International Bond 3,450 % fällig am 17.06.2043	THB	793.970	25.139
Enel Finance International NV 2,650 % fällig am 10.09.2024	\$	25.800	24.810
Canada Government International Bond 2,000 % fällig am 01.06.2032	CAD	36.310	23.562
Canada Government International Bond 2,750 % fällig am 01.12.2033		29.920	21.395
Prudential Funding Asia PLC 2,950 % fällig am 03.11.2033	\$	24.600	20.708
Suci Second Investment Co. 6,250 % fällig am 25.10.2033		19.700	20.057

(a) Der Global Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Global Bond ESG Fund

31. Dezember 2023 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG		PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2023				VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2023			
Japanische Schatzwechsel 0,000 % fällig am 17.04.2023	¥	16.560.000	\$ 129.911	Canadian Government Real Return Bond 1,500 % fällig am 01.06.2031	CAD	63.552	\$ 42.161
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.04.2053	\$	51.995	51.858	Canadian Government Real Return Bond 2,750 % fällig am 01.06.2033		35.830	25.542
Japan Government International Bond 0,005 % fällig am 01.10.2024	¥	6.820.000	51.185	Canadian Government Real Return Bond 3,500 % fällig am 01.03.2028		31.800	23.916
Uniform Mortgage-Backed Security 5,500 % fällig am 01.05.2053	\$	47.995	48.440	Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.01.2053	\$	21.228	21.670
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.10.2052		49.956	45.987	Canada Government International Bond 2,000 % fällig am 01.06.2032	CAD	32.600	21.340
Canadian Government Real Return Bond 1,500 % fällig am 01.06.2031	CAD	63.552	42.126	Canada Government International Bond 1,750 % fällig am 01.12.2053		39.460	20.948
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,125 % fällig am 15.01.2033 (b)	\$	34.323	34.153	Deutsche Bank AG 1,875 % fällig am 23.02.2028	€	12.300	11.827
Japan Government International Bond 0,005 % fällig am 01.03.2024	¥	4.110.000	31.831	Region of Ile de France 3,700 % fällig am 14.06.2038		10.000	10.840
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b)	\$	31.387	30.523	Agence Francaise de Developpement 2,875 % fällig am 21.01.2030		9.000	9.644
South Korea Government International Bond 3,250 % fällig am 10.06.2033	KRW	36.353.420	27.444	Communaute Francaise de Belgique 1,625 % fällig am 03.05.2032		10.300	9.247
Canada Government International Bond 2,750 % fällig am 01.12.2033	CAD	36.800	26.035	Morgan Stanley 3,622 % fällig am 01.04.2031	\$	9.100	8.232
Jyske Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2023	DKK	180.000	25.801	U.S. Treasury Notes 3,625 % fällig am 31.03.2028		8.100	8.097
Canadian Government Real Return Bond 2,750 % fällig am 01.06.2033	CAD	35.830	25.510	Asian Development Bank 1,500 % fällig am 04.05.2028	CAD	11.700	7.854
Uniform Mortgage-Backed Security 6,000 % fällig am 01.01.2053	\$	24.453	24.989	Marks & Spencer PLC 3,750 % fällig am 19.05.2026	£	7.145	7.798
Canadian Government Real Return Bond 3,500 % fällig am 01.03.2028	CAD	31.800	23.900	Province of Ontario 1,550 % fällig am 01.11.2029	CAD	11.600	7.486
South Korea Government International Bond 2,000 % fällig am 10.06.2031	KRW	34.358.800	23.680	Fannie Mae 6,500 % fällig am 01.07.2053	\$	6.954	7.100
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2025 (b)	\$	24.374	23.595	Goldman Sachs Group, Inc. 2,650 % fällig am 21.10.2032		8.300	6.805
Japan Government International Bond 1,500 % fällig am 20.09.2043	¥	3.270.000	23.503	Region of Ile de France 3,050 % fällig am 03.02.2033	€	6.000	6.432
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.04.2024	DKK	160.400	22.889	Freddie Mac 6,500 % fällig am 01.07.2053	\$	6.044	6.171
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.01.2053	\$	21.826	22.365	Israel Government International Bond 1,500 % fällig am 30.11.2023	ILS	23.200	5.855
Malaysia Government International Bond 3,519 % fällig am 20.04.2028	MYR	104.662	22.352	Japan Government International Bond 0,200 % fällig am 20.09.2032	¥	750.000	5.839
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	AKTIEN			
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,000 % fällig am 30.10.2031	€	20.000	21.914	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Global Investment Grade Credit ESG Fund (a)		580.000	5.788
Canada Government International Bond 2,000 % fällig am 01.06.2032	CAD	32.600	21.300				
				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
				Societe Nationale SNCF S.A. 3,125 % fällig am 02.11.2027		5.000	5.374
				Fannie Mae 6,500 % fällig am 01.08.2053	\$	5.209	5.318
				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
				Deutsche Bank AG 3,961 % fällig am 26.11.2025		5.300	5.172
				Uniform Mortgage-Backed Security 2,500 % fällig am 01.01.2052		5.819	5.019

(a) Der Global Bond ESG Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Global Bond Ex-US Fund

31. Dezember 2023 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG		AKTIEN	KOSTEN (000S)		BESCHREIBUNG		AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2023					VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2023			
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)					PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)			
		PARI (000S)				PARI (000S)		
Japanische Schatzwechsel 0,000 % fällig am 17.04.2023	¥	2.880.000	22.593		Canadian Government Real Return Bond 1,500 % fällig am 01.06.2031	CAD	24.958	16.228
China Government International Bond 2,440 % fällig am 15.10.2027	CNY	149.740	21.921		Canadian Government Real Return Bond 3,500 % fällig am 01.03.2028		7.300	5.490
Canadian Government Real Return Bond 1,500 % fällig am 01.06.2031	CAD	24.958	16.215		Canadian Government Real Return Bond 2,750 % fällig am 01.06.2033		7.670	5.476
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.04.2053	\$	11.703	10.967		China Government International Bond 3,810 % fällig am 14.09.2050	CNY	24.300	3.921
Uniform Mortgage-Backed Security 5,500 % fällig am 01.10.2053		11.000	10.807		Canada Government International Bond 1,750 % fällig am 01.12.2053	CAD	6.700	3.603
Japan Government International Bond 0,005 % fällig am 01.10.2024	¥	1.320.000	9.878		Canada Government International Bond 2,000 % fällig am 01.12.2051		6.150	3.455
Malaysia Government International Bond 1,935 % fällig am 20.04.2028	MYR	44.429	9.488		Thailand Government International Bond 3,450 % fällig am 17.06.2043	THB	109.900	3.392
South Korea Government International Bond 4,250 % fällig am 10.12.2032	KRW	10.509.430	8.589		Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	25.382	2.786
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b)	\$	8.259	8.024		Palmer Square European Loan Funding DAC 4,685 % fällig am 15.10.2031	€	2.392	2.548
Israel Government International Bond 5,000 % fällig am 30.10.2026	€	7.200	7.568		South Korea Government International Bond 3,250 % fällig am 10.06.2033	KRW	3.225.240	2.433
Canada Government International Bond 2,750 % fällig am 01.12.2033	CAD	9.100	6.438		Malaysia Government International Bond 3,885 % fällig am 15.08.2029	MYR	10.179	2.175
Canadian Government Real Return Bond 3,500 % fällig am 01.03.2028		7.300	5.487		Oracle Corp. 2,300 % fällig am 25.03.2028	\$	2.400	2.143
Canadian Government Real Return Bond 2,750 % fällig am 01.06.2033		7.670	5.472		Banco Santander S.A. 4,875 % fällig am 18.10.2031	€	1.900	2.002
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2025 (b)	\$	5.487	5.312		Boeing Co. 2,750 % fällig am 01.02.2026	\$	2.100	1.980
Japan Government International Bond 0,005 % fällig am 01.04.2024	¥	690.000	5.304		Peru Government International Bond 6,350 % fällig am 12.08.2028	PEN	7.900	1.954
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,125 % fällig am 15.01.2033 (b)	\$	5.339	5.302		U.S. Treasury Notes 3,625 % fällig am 31.03.2028	\$	1.800	1.799
South Korea Government International Bond 3,250 % fällig am 10.06.2033	KRW	6.805.960	5.118		Japan Finance Organization for Municipalities 3,375 % fällig am 27.09.2023		1.800	1.778
Japan Government International Bond 1,500 % fällig am 20.09.2043	¥	710.000	5.103		Deutsche Bank AG 1,625 % fällig am 20.01.2027	€	1.700	1.729
Uniform Mortgage-Backed Security 5,500 % fällig am 01.07.2053	\$	5.000	4.911		Commerzbank AG 5,125 % fällig am 18.01.2030		1.600	1.715

(a) Der Global Bond Ex-US Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds 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 Teilfondsbarriere genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Global High Yield Bond Fund

31. Dezember 2023 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2023			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2023		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	85.721.928	\$ 853.684	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	100.110.738	\$ 997.000
	PARI (000S)			PARI (000S)	
U.S. Treasury Notes 5,000 % fällig am 31.10.2025	\$ 59.100	59.112	U.S. Treasury Notes 3,875 % fällig am 30.11.2027	\$ 90.700	89.960
EP Infrastructure A/S 1,816 % fällig am 02.03.2031	€ 39.000	30.632	U.S. Treasury Notes 4,125 % fällig am 31.10.2027	78.000	76.746
Electricite de France S.A. 9,125 % fällig am 15.03.2033	\$ 26.800	27.399	U.S. Treasury Notes 4,125 % fällig am 30.09.2027	20.000	20.048
ZF Europe Finance BV 6,125 % fällig am 13.03.2029	€ 17.900	19.224	EP Infrastructure A/S 1,816 % fällig am 02.03.2031	€ 19.500	14.747
TIM SpA 7,875 % fällig am 31.07.2023	16.850	18.321	Sprint Capital Corp. 8,750 % fällig am 15.03.2032	\$ 10.000	12.236
Las Vegas Sands Corp. 3,900 % fällig am 08.08.2029	\$ 20.500	17.831	Techem Verwaltungsgesellschaft mbH 2,000 % fällig am 15.07.2025	€ 10.000	10.694
Cidron Aida Finco SARRL 5,000 % fällig am 01.04.2028	€ 17.500	17.159	Ctec GmbH 5,250 % fällig am 15.02.2030	12.000	10.610
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 6,750 % fällig am 05.09.2027	15.300	16.768	Axalta Coating Systems Dutch Holding BV 3,750 % fällig am 15.01.2025	10.000	10.320
Harbour Energy PLC 5,500 % fällig am 15.10.2026	\$ 17.300	16.186	Sprint LLC 7,625 % fällig am 15.02.2025	\$ 10.000	10.255
Loarre Investments SARRL 6,500 % fällig am 15.05.2029	€ 15.500	16.146	U.S. Treasury Notes 3,500 % fällig am 15.09.2025	10.000	9.865
United Group BV 3,625 % fällig am 15.02.2028	17.330	14.710	Mundys SpA 1,875 % fällig am 13.07.2027	€ 10.000	9.735
HAT Holdings LLC 8,000 % fällig am 15.06.2027	\$ 14.150	14.157	TMNL Holding BV 3,750 % fällig am 15.01.2029	10.000	9.485
NCR Atleos Corp. 9,500 % fällig am 01.04.2029	12.475	12.319	Telefonica Europe BV 6,750 % fällig am 31.12.2099	9.100	9.437
Wintershall Dea Finance BV 2,499 % fällig am 20.04.2026	€ 12.000	11.334	Tenet Healthcare Corp. 6,125 % fällig am 01.10.2028	\$ 10.000	9.176
Freedom Mortgage Corp. 12,000 % fällig am 01.10.2028	\$ 10.900	10.682	UPCB Finance Ltd. 3,625 % fällig am 15.06.2029	€ 9.500	8.905
Cerba Healthcare SACA 3,500 % fällig am 31.05.2028	€ 11.900	10.661	Synthomer PLC 3,875 % fällig am 01.07.2025	8.800	8.870
Allegiant Travel Co. 7,250 % fällig am 15.08.2027	\$ 10.500	10.461	American Builders & Contractors Supply Co., Inc. 4,000 % fällig am 15.01.2028	\$ 10.000	8.863
Virgin Media Secured Finance PLC 4,250 % fällig am 15.01.2030	£ 10.000	10.301	Virgin Media Finance PLC 3,750 % fällig am 15.07.2030	€ 10.000	8.789
goeasy Ltd. 9,250 % fällig am 01.12.2028	\$ 10.300	10.300	Energizer Gamma Acquisition BV 3,500 % fällig am 30.06.2029	10.000	8.673

(a) Der Global High Yield Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Global Investment Grade Credit Fund

31. Dezember 2023 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG		AKTIEN	KOSTEN (000\$)	BESCHREIBUNG		AKTIEN	ERLÖSE (000\$)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2023				VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2023			
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)				PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)			
		PARI (000\$)				PARI (000\$)	
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b)	\$	99.833	96.362	U.S. Treasury Notes 3,875 % fällig am 30.09.2029	\$	203.940	199.437
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,500 % fällig am 15.02.2053 (b)		96.458	94.054	U.S. Treasury Bonds 2,000 % fällig am 15.11.2041		172.700	114.331
U.S. Treasury Bonds 2,750 % fällig am 15.11.2047		105.800	82.567	U.S. Treasury Bonds 1,875 % fällig am 15.11.2051		164.371	106.542
Wells Fargo & Co. 5,557 % fällig am 25.07.2034		80.400	79.639	U.S. Treasury Bonds 2,875 % fällig am 15.05.2052		130.500	105.970
U.S. Treasury Notes 3,875 % fällig am 15.08.2033		69.700	66.011	U.S. Treasury Bonds 1,375 % fällig am 15.11.2040		147.600	86.946
U.S. Treasury Bonds 4,750 % fällig am 15.11.2043		64.200	65.467	U.S. Treasury Bonds 1,875 % fällig am 15.02.2041		110.467	72.563
Saudi Arabia Government International Bond 4,750 % fällig am 18.01.2028		52.000	51.820	U.S. Treasury Notes 3,875 % fällig am 15.08.2033		69.700	66.515
Australia Government International Bond 3,500 % fällig am 21.12.2034	AUD	77.700	47.469	U.S. Treasury Bonds 1,750 % fällig am 15.08.2041		80.982	51.446
Venture Global Calcasieu Pass LLC 6,250 % fällig am 15.01.2030	\$	39.500	39.500	U.S. Treasury Bonds 2,250 % fällig am 15.02.2052		70.400	50.831
Amgen, Inc. 5,600 % fällig am 02.03.2043		36.650	36.540	Tencent Holdings Ltd. 3,975 % fällig am 11.04.2029		42.750	39.795
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.10.2024 (b)		35.179	34.082	U.S. Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.02.2048		40.992	33.359
Goldman Sachs Group, Inc. 6,484 % fällig am 24.10.2029		31.500	31.500	U.S. Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.05.2045		32.398	25.254
BPCE S.A. 6,714 % fällig am 19.10.2029		30.000	30.000	U.S. Treasury Bonds 3,125 % fällig am 15.05.2048		29.360	24.506
UnitedHealth Group, Inc. 5,875 % fällig am 15.02.2053		25.000	27.431	Peru Government International Bond 6,350 % fällig am 12.08.2028	PEN	98.387	24.496
Societe Generale S.A. 6,691 % fällig am 10.01.2034		26.900	27.019	Aroundtown S.A. 5,375 % fällig am 21.03.2029	\$	31.800	24.377
NatWest Group PLC 6,016 % fällig am 02.03.2034		25.900	25.900	Bevco Lux SARL 1,500 % fällig am 16.09.2027	€	23.000	22.536
Mexico Government International Bond 2,750 % fällig am 27.11.2031	MXN	524.123	25.123	Intesa Sanpaolo SpA 7,750 % fällig am 11.01.2027		22.042	21.886
Saudi Arabia Government International Bond 4,875 % fällig am 18.07.2033	\$	25.000	24.705	Crown Castle, Inc. 4,450 % fällig am 15.02.2026	\$	20.933	20.730
U.S. Treasury Bonds 4,375 % fällig am 15.08.2043		25.400	23.871	MH Sub LLC 9,220 % fällig am 13.09.2024		20.277	20.077

(a) Der Global Investment Grade Credit Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Global Investment Grade Credit ESG Fund

31. Dezember 2023 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2023			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2023		
U.S. Treasury Notes 4,250 % fällig am 31.05.2025	\$ 46.300	\$ 46.035	U.S. Treasury Bonds 1,750 % fällig am 15.08.2041	\$ 37.750	\$ 26.484
U.S. Treasury Bonds 4,750 % fällig am 15.11.2043	33.800	34.757	U.S. Treasury Notes 0,500 % fällig am 30.11.2023	22.700	22.263
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.07.2053	19.852	19.145	U.S. Treasury Notes 4,250 % fällig am 15.10.2025	21.700	21.422
Europäische Union 2,750 % fällig am 04.12.2037	€ 15.300	15.744	U.S. Treasury Notes 4,250 % fällig am 31.05.2025	15.500	15.302
U.S. Treasury Bonds 3,875 % fällig am 15.05.2043	\$ 16.200	15.710	Bundesrepublik Deutschland 0,000 % fällig am 15.08.2031	€ 14.700	12.621
BNG Bank NV 3,250 % fällig am 29.08.2033	€ 14.000	15.242	United Kingdom Gilt 0,875 % fällig am 31.07.2033	£ 11.050	9.716
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,375 % fällig am 15.07.2033 (a)	\$ 12.566	11.887	U.S. Treasury Bonds 4,000 % fällig am 15.11.2042	\$ 8.900	8.840
U.S. Treasury Bonds 4,000 % fällig am 15.11.2042	10.900	11.402	Nordea Bank Abp 1,500 % fällig am 30.09.2026	7.600	6.641
Morgan Stanley 3,875 % fällig am 27.01.2026	11.743	11.390	U.S. Treasury Bonds 3,875 % fällig am 15.05.2043	6.100	5.900
Arkea Home Loans SFH S.A. 3,250 % fällig am 01.08.2033	€ 9.900	10.524	U.S. Treasury Bonds 3,250 % fällig am 15.05.2042	6.200	5.617
Wisconsin Power & Light Co. 4,950 % fällig am 01.04.2033	\$ 10.249	10.260	Apple, Inc. 1,400 % fällig am 05.08.2028	6.100	5.291
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.12.2052	9.993	9.686	Enel Finance International NV 4,625 % fällig am 15.06.2027	5.400	5.243
UBS Group AG 4,194 % fällig am 01.04.2031	10.350	9.242	CenterPoint Energy Houston Electric LLC 5,300 % fällig am 01.04.2053	5.250	5.075
Toronto-Dominion Bank 5,264 % fällig am 11.12.2026	8.900	8.900	Zoetis, Inc. 2,000 % fällig am 15.05.2030	6.100	5.067
Mizuho Financial Group, Inc. 3,170 % fällig am 11.09.2027	9.301	8.594	U.S. Treasury Bonds 2,250 % fällig am 15.05.2041	6.500	4.949
Morgan Stanley 5,123 % fällig am 01.02.2029	8.500	8.500	National Rural Utilities Cooperative Finance Corp. 4,150 % fällig am 15.12.2032	5.100	4.834
Hana Bank 3,750 % fällig am 04.05.2026	€ 7.500	8.282	Indian Railway Finance Corp. Ltd. 3,570 % fällig am 21.01.2032	5.100	4.425
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.05.2053	\$ 8.513	8.216	Israel Government International Bond 4,500 % fällig am 17.01.2033	4.400	4.237
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.05.2053	8.622	8.122	Owens Corning 3,875 % fällig am 01.06.2030	4.500	4.191
AP Moller - Maersk A/S 5,875 % fällig am 14.09.2033	7.701	7.670	Philippines Government International Bond 5,500 % fällig am 17.01.2048	3.900	4.059

(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 Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Global Low Duration Real Return Fund

31. Dezember 2023 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2023			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2023		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	44.222.266	\$ 440.384	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	45.419.585	\$ 452.300
	PARI (000S)			PARI (000S)	
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,875 % fällig am 15.01.2029 (b)	\$ 63.076	61.016	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.04.2024 (b)	\$ 62.081	60.566
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.01.2028 (b)	51.484	48.064	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2024 (b)	51.844	50.961
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,625 % fällig am 15.10.2027 (b)	43.057	43.717	United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.03.2026	£ 34.928	42.190
United Kingdom Gilt 1,250 % fällig am 22.11.2027	£ 27.902	35.555	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b)	\$ 34.837	33.959
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,500 % fällig am 15.05.2029	€ 32.706	34.758	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.04.2023 (b)	30.692	30.571
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,750 % fällig am 15.07.2028 (b)	\$ 35.666	34.516	Bundesrepublik Deutschland 0,500 % fällig am 15.04.2030	€ 24.573	26.993
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2027 (b)	35.175	33.944	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2026 (b)	\$ 26.720	25.271
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 3,125 % fällig am 10.10.2028	€ 26.000	28.145	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 15.01.2025 (b)	\$ 27.604	26.376	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026 (b)	22.264	21.172
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,350 % fällig am 15.09.2024	€ 22.663	24.981	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.01.2027 (b)	2.067	19.531
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026 (b)	\$ 25.015	24.150	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b)	19.844	19.084
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	19.599	18.806
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.09.2052	19.993	19.567	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.10.2025 (b)	19.026	18.112
France Government International Bond 1,850 % fällig am 25.07.2027	€ 13.761	15.973	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.01.2028 (b)	17.942	16.952
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b)	\$ 15.257	14.989	United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.03.2024	£ 13.160	16.556
United Kingdom Gilt 1,625 % fällig am 22.10.2028	£ 13.300	14.757	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2023 (b)	\$ 15.350	15.273
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,400 % fällig am 15.05.2039	€ 11.147	11.975	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2026 (b)	12.571	11.777
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	11.573
United Kingdom Gilt 0,875 % fällig am 22.10.2029	£ 11.400	11.544	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,875 % fällig am 15.01.2029 (b)	\$ 9.970	9.417

(a) Der Global Low Duration Real Return Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Global Real Return Fund

31. Dezember 2023 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000\$)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000\$)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2023			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2023		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	60.392.629	\$ 601.440	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	58.752.134	\$ 585.100
	PARI (000\$)			PARI (000\$)	
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.07.2032 (b)	\$ 99.122	91.288	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.04.2023 (b)	\$ 68.906	68.858
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 3,125 % fällig am 10.10.2028	€ 49.600	53.691	France Government International Bond 0,100 % fällig am 25.07.2031	€ 43.474	47.179
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,100 % fällig am 01.02.2029	43.400	48.359	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2024 (b)	\$ 34.784	34.588
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,400 % fällig am 15.05.2039	40.068	43.047	United Kingdom Gilt 1,250 % fällig am 22.11.2032	£ 23.576	32.480
France Government International Bond 0,100 % fällig am 25.07.2031	29.778	31.546	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.07.2032 (b)	\$ 27.458	25.961
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,125 % fällig am 15.01.2033 (b)	\$ 26.480	25.982	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2031 (b)	27.776	24.511
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2029	25.695	25.274	United Kingdom Gilt 0,500 % fällig am 31.01.2029	£ 22.500	23.404
France Government International Bond 1,800 % fällig am 25.07.2040	€ 19.094	25.075	United Kingdom Gilt 0,875 % fällig am 22.10.2029	20.000	21.141
United Kingdom Gilt 0,500 % fällig am 31.01.2029	£ 22.500	23.421	Australia Government International Bond 3,000 % fällig am 20.09.2025	AUD 20.720	20.475
Spain Government International Bond 0,600 % fällig am 31.10.2029	€ 24.400	22.978	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,550 % fällig am 15.09.2041	€ 16.901	19.055
United Kingdom Gilt 0,875 % fällig am 22.10.2029	£ 20.000	20.426	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2025 (b)	\$ 18.924	18.040
United Kingdom Gilt 0,625 % fällig am 22.03.2045	16.400	20.327	Europäische Union 4,000 % fällig am 04.04.2044	€ 16.200	17.805
Europäische Union 4,000 % fällig am 04.04.2044	€ 16.200	17.131	Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 173.918	17.741
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2027 (b)	\$ 15.800	15.126	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2030 (b)	\$ 16.026	14.043
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2031 (b)	16.730	14.535	Spain Government International Bond 1,450 % fällig am 31.10.2027	€ 13.400	13.749
United Kingdom Gilt 4,250 % fällig am 07.12.2049	£ 10.400	12.499	United Kingdom Gilt 4,250 % fällig am 07.12.2049	£ 10.400	12.443
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,500 % fällig am 15.02.2053 (b)	\$ 12.698	12.181	United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.03.2044	11.238	12.436
United Kingdom Gilt 1,125 % fällig am 22.11.2037	£ 8.330	11.703	United Kingdom Gilt 0,625 % fällig am 22.11.2042	8.825	11.159
Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 10.03.2028	¥ 1.609.290	11.600	France Government International Bond 0,100 % fällig am 25.07.2038	€ 9.945	9.741

(a) Der Global Real Return Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Income Fund

31. Dezember 2023 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2023			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2023		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	796.525.561	\$ 7.934.007	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	824.628.360	\$ 8.213.000
	PARI (000S)			PARI (000S)	
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.09.2053	\$ 2.548.609	2.597.214	Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.09.2053	\$ 1.150.000	1.156.469
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,375 % fällig am 15.07.2033 (b)	875.339	819.576	Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.06.2053	505.393	515.757
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b)	818.633	788.997	Uniform Mortgage-Backed Security 3,500 % fällig am 01.05.2052	450.387	417.289
Israel Government International Bond 5,000 % fällig am 30.10.2026	€ 739.900	777.734	Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.02.2053	404.682	415.942
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.10.2024 (b)	\$ 754.761	731.266	Uniform Mortgage-Backed Security 6,000 % fällig am 01.04.2053	369.447	369.533
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b)	726.740	705.802	Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.02.2053	357.415	366.585
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.06.2053	516.067	531.395	Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.01.2053	306.222	312.838
U.S. Treasury Notes 0,625 % fällig am 30.11.2027	542.910	471.290	Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.01.2053	285.949	291.813
Uniform Mortgage-Backed Security 6,000 % fällig am 01.01.2053	43.846	444.736	Uniform Mortgage-Backed Security 6,000 % fällig am 01.05.2053	289.155	289.222
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.02.2053	418.948	431.590	Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.03.2053	280.306	287.485
Uniform Mortgage-Backed Security 6,000 % fällig am 01.02.2053	416.026	423.907	Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.04.2053	205.308	210.702
Uniform Mortgage-Backed Security 6,000 % fällig am 01.04.2053	387.906	396.475	Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.08.2053	160.910	164.210
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.02.2053	366.898	377.741	Boeing Co. 5,805 % fällig am 01.05.2050	159.822	157.891
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.01.2053	315.667	324.820	Russia Government International Bond 5,930 % fällig am 24.04.2024	RUB 18.336.201	137.644
Ginnie Mae 5,500 % fällig am 20.07.2053	318.773	318.076	Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.03.2053	\$ 122.966	125.490
Uniform Mortgage-Backed Security 6,000 % fällig am 01.02.2053	306.748	312.487	Credit Suisse AG 5,500 % fällig am 20.08.2026	€ 100.800	114.028
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.01.2053	293.980	303.083	Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.03.2053	\$ 109.694	111.944
Uniform Mortgage-Backed Security 5,500 % fällig am 01.06.2053	301.781	300.555	Uniform Mortgage-Backed Security 6,000 % fällig am 01.04.2053	108.700	108.726
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.03.2053	287.921	295.749	Bank of Ireland Group PLC 7,500 % fällig am 19.05.2025	€ 102.118	108.139

(a) Der Income Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Income Fund II

31. Dezember 2023 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2023			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2023		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	8.955.611	\$ 89.181	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	9.118.051	\$ 90.800
	PARI (000S)			PARI (000S)	
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.02.2053	\$ 5.550	5.741	Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.02.2053	\$ 5.244	5.407
U.S. Treasury Notes 3,875 % fällig am 31.12.2027	4.600	4.640	U.S. Treasury Notes 4,125 % fällig am 15.11.2032	4.200	4.462
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.04.2053	4.800	4.490	U.S. Treasury Notes 3,875 % fällig am 31.12.2027	3.000	3.064
Uniform Mortgage-Backed Security 5,500 % fällig am 01.03.2053	4.000	4.022	U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 15.05.2025	2.500	2.453
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.10.2052	3.800	3.706	U.S. Treasury Notes 4,000 % fällig am 31.10.2029	1.700	1.729
Great Hall Mortgages PLC 5,599 % fällig am 18.06.2038	£ 2.960	3.436	Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.08.2053	1.485	1.514
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.03.2053	\$ 3.100	2.915	Stratton Mortgage Funding PLC 7,721 % fällig am 20.07.2060	£ 1.000	1.210
Uniform Mortgage-Backed Security 3,500 % fällig am 01.02.2053	3.182	2.906	Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.08.2053	\$ 795	810
U.S. Treasury Notes 4,125 % fällig am 15.11.2032	2.400	2.513	U.S. Treasury Notes 3,875 % fällig am 30.09.2029	700	707
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.01.2053	2.479	2.470	HSBC Holdings PLC 6,254 % fällig am 09.03.2034	600	624
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.07.2032 (b)	2.603	2.335	KBC Group NV 5,796 % fällig am 19.01.2029	600	599
Uniform Mortgage-Backed Security 6,000 % fällig am 01.04.2053	1.798	1.829	Eurosail PLC 4,165 % fällig am 15.12.2044	€ 504	531
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b)	1.794	1.742	UniCredit SpA 3,875 % fällig am 03.06.2027	500	382
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR 30.200	1.729	T-Mobile USA, Inc. 4,800 % fällig am 15.07.2028	\$ 300	287
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.08.2053	\$ 1.500	1.532	Glencore Funding LLC 4,000 % fällig am 27.03.2027	300	286
Uniform Mortgage-Backed Security 6,000 % fällig am 01.08.2053	1.500	1.512	Boeing Co. 5,150 % fällig am 01.05.2030	300	284
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.10.2024 (b)	1.483	1.433	Imperial Brands Finance PLC 3,500 % fällig am 26.07.2026	300	280
Eurosail PLC 4,408 % fällig am 13.03.2045	€ 1.500	1.349	Intesa Sanpaolo SpA 5,875 % fällig am 01.09.2031	€ 300	255
Curzon Mortgages PLC 6,970 % fällig am 28.07.2049	£ 1.000	1.256	Dryden Euro CLO DAC 4,775 % fällig am 15.01.2032	239	251

(a) Der Income Fund II legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Dynamic Multi-Asset Fund

31. Dezember 2023 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2023		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	10.196.296	\$ 101.542
Invesco Physical Gold ETC	120.744	22.562
	PARI (000S)	
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,125 % fällig am 15.01.2033 (b)	\$ 15.528	14.937
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.07.2032 (b)	9.336	8.847
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,100 % fällig am 15.05.2033	€ 6.158	5.442
Ginnie Mae 6,238 % 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
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.08.2052	\$ 2.986	2.635
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,500 % fällig am 15.02.2053 (b)	2.626	2.614
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2024 (b)	1.951	1.927
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,375 % fällig am 15.07.2033 (b)	1.419	1.320
Prologis, Inc.	AKTIEN 9.840	1.180
Equinix, Inc.	1.363	973
	PARI (000S)	
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2031 (b)	\$ 798	679
	AKTIEN	
Public Storage	2.041	595
Realty Income Corp.	9.346	589
	PARI (000S)	
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.09.2052	\$ 592	562
	AKTIEN	
Simon Property Group, Inc.	5.099	555
	PARI (000S)	
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,625 % fällig am 15.10.2027 (b)	\$ 506	513
	AKTIEN	
Invitation Homes, Inc.	13.911	432

BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2023		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	13.986.612	\$ 139.282
	PARI (000S)	
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.07.2032 (b)	\$ 38.637	36.609
	AKTIEN	
Invesco Physical Gold ETC	93.781	17.687
	PARI (000S)	
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,125 % fällig am 15.01.2033 (b)	\$ 15.686	14.753
	AKTIEN	
Invesco Physical Gold ETC	61.717	11.536
	PARI (000S)	
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,875 % fällig am 15.02.2047 (b)	\$ 4.985	4.046
MRCD Mark Mortgage Trust 2,718 % fällig am 15.12.2036	2.598	2.404
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 10.08.2031	£ 1.920	2.228
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,750 % fällig am 15.02.2045 (b)	\$ 2.675	2.212
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2024 (b)	2.047	2.035
Nykredit Realkredit A/S 1,500 % fällig am 01.10.2053	DKK 18.420	2.033
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	16.500	1.766
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,500 % fällig am 15.02.2053 (b)	\$ 1.850	1.528
United Kingdom Gilt 0,500 % fällig am 22.03.2050	£ 1.462	1.324
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.04.2024 (b)	\$ 1.332	1.310
United Kingdom Gilt 0,250 % fällig am 22.03.2052	£ 1.398	1.149
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,875 % fällig am 15.01.2029 (b)	\$ 1.205	1.148
Realkredit Danmark A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 9.000	964
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.01.2028 (b)	\$ 738	696
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2032 (b)	772	647

(a) Der Inflation Multi-Asset Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Low Average Duration Fund

31. Dezember 2023 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2023			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2023		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	28.870.296	\$ 287.496	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	29.412.569	\$ 292.900
	PARI (000S)			PARI (000S)	
U.S. Treasury Notes 4,250 % fällig am 31.12.2024	\$ 183.100	183.157	U.S. Treasury Notes 0,875 % fällig am 31.01.2024	\$ 246.600	238.128
U.S. Treasury Notes 0,375 % fällig am 31.01.2026	139.800	127.362	U.S. Treasury Notes 1,500 % fällig am 29.02.2024	190.000	183.439
U.S. Treasury Notes 5,000 % fällig am 31.08.2025	47.600	47.729	U.S. Treasury Notes 4,250 % fällig am 31.12.2024	117.800	116.300
U.S. Treasury Notes 5,000 % fällig am 30.09.2025	42.000	41.966	U.S. Treasury Notes 4,375 % fällig am 31.10.2024	88.200	87.570
U.S. Treasury Notes 3,875 % fällig am 15.01.2026	42.000	41.846	U.S. Treasury Notes 3,875 % fällig am 15.01.2026	42.000	41.467
U.S. Treasury Notes 4,750 % fällig am 31.07.2025	39.300	39.154	U.S. Treasury Notes 4,125 % fällig am 31.01.2025	38.500	38.219
U.S. Treasury Notes 4,125 % fällig am 31.01.2025	38.500	38.285	Brazil Letras do Tesouro Nacional 0,000 % fällig am 01.01.2024	BRL 68.300	14.032
U.S. Treasury Notes 4,375 % fällig am 30.11.2028	31.200	31.339	HSBC Holdings PLC 6,161 % fällig am 09.03.2029	\$ 5.200	5.283
U.S. Treasury Notes 4,875 % fällig am 30.11.2025	27.600	27.687	JPMorgan Chase & Co. 4,851 % fällig am 25.07.2028	4.300	4.284
U.S. Treasury Notes 4,375 % fällig am 15.08.2026	26.200	26.006	Mercedes-Benz Finance North America LLC 5,500 % fällig am 27.11.2024	3.900	3.936
U.S. Treasury Notes 0,250 % fällig am 31.05.2025	27.900	25.815	Philip Morris International, Inc. 5,125 % fällig am 15.11.2024	3.900	3.909
U.S. Treasury Notes 4,250 % fällig am 31.05.2025	19.800	19.753	UBS Group AG 4,488 % fällig am 12.05.2026	4.000	3.908
Brazil Letras do Tesouro Nacional 0,000 % fällig am 01.01.2024	BRL 93.000	17.939	Global Payments, Inc. 4,950 % fällig am 15.08.2027	3.800	3.719
Brazil Letras do Tesouro Nacional 0,000 % fällig am 01.07.2024	71.800	14.035	ABN AMRO Bank NV 2,375 % fällig am 01.06.2027	€ 3.600	3.694
Toronto-Dominion Bank 3,879 % fällig am 13.03.2026	€ 6.700	7.155	Reliance Steel & Aluminum Co. 1,300 % fällig am 15.08.2025	\$ 3.900	3.569
HSBC Holdings PLC 6,161 % fällig am 09.03.2029	\$ 5.200	5.200	Banco Santander S.A. 3,892 % fällig am 24.05.2024	3.600	3.545
Ginnie Mae 6,438 % fällig am 20.05.2073	4.325	4.323	Bank of America Corp. 6,233 % fällig am 23.07.2024	3.500	3.500
Canadian Imperial Bank of Commerce 3,250 % fällig am 31.03.2027	€ 3.400	3.651	UBS Group AG 5,711 % fällig am 12.01.2027	3.500	3.477
Freddie Mac 3,590 % fällig am 25.01.2025	\$ 3.604	3.532	HSBC Holdings PLC 2,999 % fällig am 10.03.2026	3.600	3.395

(a) Der Low Average Duration Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Low Duration Global Investment Grade Credit Fund

31. Dezember 2023 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2023			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2023		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	43.335.970	\$ 431.579	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	41.770.222	\$ 416.000
	PARI (000S)			PARI (000S)	
U.S. Treasury Notes 4,125 % fällig am 31.01.2025	\$ 41.600	41.459	U.S. Treasury Notes 4,125 % fällig am 31.01.2025	\$ 27.900	27.552
U.S. Treasury Notes 5,000 % fällig am 31.08.2025	26.000	26.009	U.S. Treasury Notes 5,000 % fällig am 31.08.2025	26.000	25.941
Australia Government International Bond 2,750 % fällig am 21.11.2028	AUD 41.600	25.922	Canada Government International Bond 3,750 % fällig am 01.05.2025	CAD 31.600	22.854
Canada Government International Bond 3,750 % fällig am 01.05.2025	CAD 31.600	23.357	U.S. Treasury Notes 4,250 % fällig am 15.10.2025	\$ 20.900	20.604
U.S. Treasury Notes 4,375 % fällig am 15.08.2026	\$ 20.700	20.587	U.S. Treasury Notes 4,375 % fällig am 15.08.2026	20.700	20.497
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2024 (b)	18.492	18.165	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2024 (b)	18.729	18.623
U.S. Treasury Notes 3,875 % fällig am 31.03.2025	16.500	16.504	U.S. Treasury Notes 3,875 % fällig am 31.03.2025	16.500	16.160
U.S. Treasury Notes 4,750 % fällig am 31.07.2025	15.600	15.555	U.S. Treasury Notes 4,750 % fällig am 31.07.2025	15.600	15.515
Europäische Union 2,000 % fällig am 04.10.2027	€ 12.200	12.912	U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 31.03.2024	12.100	11.767
Wells Fargo & Co. 5,574 % fällig am 25.07.2029	\$ 8.400	8.400	U.S. Treasury Notes 3,500 % fällig am 15.09.2025	6.700	6.505
United Kingdom Gilt 1,625 % fällig am 22.10.2028	£ 7.200	7.851	U.S. Treasury Notes 4,000 % fällig am 15.12.2025	6.100	6.002
Bundesrepublik Deutschland 2,500 % fällig am 13.03.2025	€ 6.700	7.148	U.S. Treasury Notes 4,375 % fällig am 31.10.2024	6.000	5.949
Barclays PLC 7,285 % fällig am 13.09.2027	\$ 6.500	6.500	U.S. Treasury Notes 4,500 % fällig am 15.11.2025	5.100	5.068
Mexico Government International Bond 3,000 % fällig am 03.12.2026	MXN 126.457	6.351	SK on Co. Ltd. 5,375 % fällig am 11.05.2026	3.900	3.890
MassMutual Global Funding 6,344 % fällig am 10.07.2026	\$ 6.000	6.000	Societe Generale S.A. 4,677 % fällig am 15.06.2027	3.500	3.391
Marriott International, Inc. 5,550 % fällig am 15.10.2028	5.500	5.469	Ford Motor Credit Co. LLC 6,860 % fällig am 05.06.2026	£ 2.500	3.115
Toronto-Dominion Bank 3,765 % fällig am 08.09.2026	€ 5.000	5.415	China Construction Bank Europe S.A. 0,000 % fällig am 28.06.2024	€ 2.800	2.949
JPMorgan Chase & Co. 5,299 % fällig am 24.07.2029	\$ 5.200	5.200	Syngenta Finance NV 3,375 % fällig am 16.04.2026	2.700	2.844
CenterPoint Energy Houston Electric LLC 5,200 % fällig am 01.10.2028	5.200	5.194	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 1,625 % fällig am 09.07.2024	2.600	2.690

(a) Der Low Duration Global Investment Grade Credit Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Low Duration Income Fund

31. Dezember 2023 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2023			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2023		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	21.264.905	\$ 211.821	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	11.957.291	\$ 119.116
	PARI (000S)			PARI (000S)	
Shamrock Residential DAC 4,726 % fällig am 24.01.2061	€ 23.831	25.327	Dufry One BV 3,625 % fällig am 15.04.2026	CHF 7.394	7.836
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.10.2024 (b)	\$ 22.515	21.773	Uber Technologies, Inc. 7,500 % fällig am 15.05.2025	\$ 7.600	7.714
Tower Bridge Funding PLC 0,000 % fällig am 20.01.2066	£ 16.000	20.268	INEOS Finance PLC 7,463 % fällig am 08.11.2027	€ 7.059	7.534
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b)	\$ 20.475	19.900	American Airlines, Inc. 5,500 % fällig am 20.04.2026	\$ 6.948	6.805
Israel Government International Bond 5,000 % fällig am 30.10.2026	€ 18.600	19.551	Wynn Resorts Finance LLC 7,750 % fällig am 15.04.2025	4.404	4.404
Canterbury Finance PLC 6,046 % fällig am 16.05.2058	£ 13.370	16.150	Pacific Gas & Electric Co. 3,150 % fällig am 01.01.2026	4.474	4.162
Jupiter Mortgage PLC 6,621 % fällig am 20.07.2060	13.201	16.077	Sprint LLC 7,125 % fällig am 15.06.2024	4.098	4.153
BPCE S.A. 6,612 % fällig am 19.10.2027	\$ 15.900	15.900	Petco Health & Wellness Co., Inc. 1,000 % fällig am 03.03.2028	3.767	3.738
RMAC PLC 0,000 % fällig am 15.02.2047	£ 12.300	15.347	ONEOK, Inc. 5,550 % fällig am 01.11.2026	3.400	3.366
SLM Student Loan Trust 6,252 % fällig am 25.03.2026	\$ 15.408	15.220	Bombardier, Inc. 7,500 % fällig am 15.03.2025	3.108	3.108
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,375 % fällig am 15.07.2033 (b)	15.298	14.671	SkyMiles IP Ltd. 9,166 % fällig am 20.10.2027	2.992	3.100
Shamrock Residential DAC 4,876 % fällig am 24.06.2071	€ 14.000	14.549	Rolls-Royce PLC 4,625 % fällig am 16.02.2026	€ 2.900	2.975
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b)	\$ 14.640	14.106	Sandoz Finance BV 3,970 % fällig am 17.04.2027	2.600	2.948
Nationwide Building Society 6,557 % fällig am 18.10.2027	14.000	14.000	Energy Transfer LP 6,050 % fällig am 01.12.2026	\$ 2.700	2.745
Twin Bridges PLC 6,432 % fällig am 15.05.2056	£ 10.900	13.393	Uber Technologies, Inc. 8,000 % fällig am 01.11.2026	2.585	2.646
Dutch Property Finance BV 4,852 % fällig am 28.04.2064	€ 12.400	13.348	Amgen, Inc. 5,150 % fällig am 02.03.2028	2.600	2.644
Shamrock Residential DAC 5,126 % fällig am 24.02.2071	12.335	13.233	Wynn Macau Ltd. 5,625 % fällig am 26.08.2028	2.700	2.331
ABN AMRO Bank NV 6,575 % fällig am 13.10.2026	\$ 13.200	13.200	VOC Escrow Ltd. 5,000 % fällig am 15.02.2028	2.600	2.294
Ginnie Mae 5,500 % fällig am 20.07.2053	13.074	13.046	UBS AG 5,125 % fällig am 15.05.2024	2.280	2.259
Harbour Energy PLC 6,120 % fällig am 28.01.2054	£ 10.800	12.739			
Nelnet Student Loan Trust 5,910 % fällig am 27.09.2066	\$ 12.646	12.571	(a) Der Low Duration Income Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.		
Twin Bridges PLC 6,170 % fällig am 14.06.2055	£ 10.000	12.427	(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.		
Atlas Funding PLC 6,348 % fällig am 20.01.2061	10.000	12.399	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.		
Kinbane DAC 4,685 % fällig am 25.09.2062	€ 11.522	12.268	Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.		
Avon Finance PLC 0,000 % fällig am 28.12.2049	£ 9.200	11.422			
Ginnie Mae 5,500 % fällig am 20.08.2053	\$ 11.400	11.375			

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Low Duration Opportunities Fund

31. Dezember 2023 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2023			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2023		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	25.809.541 \$	257.020	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	31.450.903 \$	313.200
	PARI (000S)			PARI (000S)	
U.S. Treasury Inflation Protected Securities			U.S. Treasury Notes		
0,625 % fällig am 15.07.2032 (b)	\$ 18.005	16.466	2,125 % fällig am 30.09.2024	\$ 73.200	71.005
Brazil Letras do Tesouro Nacional 0,000 % fällig am 01.01.2024	BRL 83.000	16.341	U.S. Treasury Notes		
U.S. Treasury Inflation Protected Securities			1,250 % fällig am 31.08.2024	37.300	36.000
1,125 % fällig am 15.01.2033 (b)	\$ 16.426	15.548	U.S. Treasury Notes		
U.S. Treasury Inflation Protected Securities			1,750 % fällig am 30.06.2024	21.600	20.930
1,375 % fällig am 15.07.2033 (b)	15.401	14.932	Brazil Letras do Tesouro Nacional 0,000 % fällig am 01.01.2024	BRL 61.000	12.532
Ungarische Schatzwechsel 0,000 % fällig am 20.04.2023	HUF 4.500.000	13.149	Toronto-Dominion Bank 3,879 % fällig am 13.03.2026	€ 8.000	8.773
Ungarische Schatzwechsel 0,000 % fällig am 13.04.2023	4.484.000	12.922	Peru Government International Bond 6,350 % fällig am 12.08.2028	PEN 29.700	7.351
Brazil Letras do Tesouro Nacional 0,000 % fällig am 01.07.2024	BRL 64.100	12.530		AKTIEN	
Ungarische Schatzwechsel 0,000 % fällig am 30.11.2023	HUF 3.007.000	8.552	PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)	71.100	7.076
Toronto-Dominion Bank 3,879 % fällig am 13.03.2026	€ 8.000	8.543		PARI (000S)	
Israel Government International Bond 5,000 % fällig am 30.10.2026	3.300	3.469	Peru Government International Bond 5,940 % fällig am 12.02.2029	PEN 27.500	6.597
Canadian Imperial Bank of Commerce 3,250 % fällig am 31.03.2027	3.200	3.436	Bellis Acquisition Co. PLC 3,250 % fällig am 16.02.2026	£ 5.200	5.309
U.S. Treasury Notes 2,125 % fällig am 30.09.2024	\$ 3.200	3.097	Sculptor European CLO DAC 4,755 % fällig am 14.01.2032	€ 5.000	5.258
Santander UK Group Holdings PLC 7,482 % fällig am 29.08.2029	£ 2.400	3.056	Aurium CLO DAC 4,966 % fällig am 23.03.2032	5.000	5.210
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 3,629 % fällig am 06.04.2026	€ 2.600	2.816	Southern California Edison Co. 2,750 % fällig am 01.02.2032	\$ 5.900	5.034
Virginia Electric and Power Co. 3,750 % fällig am 15.05.2027	\$ 2.900	2.789	Aurium CLO DAC 4,695 % fällig am 16.01.2031	€ 4.691	4.874
Barclays PLC 6,496 % fällig am 13.09.2027	2.500	2.500	Nissan Motor Co. Ltd. 4,810 % fällig am 17.09.2030	\$ 5.400	4.850
Goldman Sachs Group, Inc. 4,223 % fällig am 01.05.2029	2.500	2.371	Zayo Group Holdings, Inc. 8,217 % fällig am 09.03.2027	5.627	4.657
BPCE S.A. 4,625 % fällig am 12.09.2028	2.500	2.352	Nissan Motor Co. Ltd. 4,345 % fällig am 17.09.2027	4.700	4.291
HSBC Holdings PLC 6,254 % fällig am 09.03.2034	2.100	2.106	Lazard Group LLC 4,500 % fällig am 19.09.2028	4.000	3.852
			Sasol Financing USA LLC 5,875 % fällig am 27.03.2024	3.700	3.659
			Volkswagen Financial Services NV 1,125 % fällig am 18.09.2023	£ 3.100	3.597

(a) Der Low Duration Opportunities Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Low Duration Opportunities ESG Fund

31. Dezember 2023 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2023			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2023		
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.10.2053	\$ 992	\$ 946	Weyerhaeuser Co. 3,375 % fällig am 09.03.2033	\$ 36	\$ 31
U.S. Treasury Notes 5,000 % fällig am 30.09.2025	400	399	VeriSign, Inc. 2,700 % fällig am 15.06.2031	30	25
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.05.2053	399	380	CommScope, Inc. 8,720 % fällig am 06.04.2026	20	19
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 5,500 % fällig am 09.03.2028	200	200	U.S. Foods, Inc. 7,970 % fällig am 22.11.2028	16	16
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,375 % fällig am 15.07.2033 (a)	101	98	CenturyLink, Inc. 7,720 % fällig am 15.03.2027	20	15
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,125 % fällig am 15.01.2033 (a)	103	98	Lumen Technologies, Inc. 4,000 % fällig am 15.02.2027	18	12
Uniform Mortgage-Backed Security 5,500 % fällig am 01.08.2053	99	97	(a) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.		
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.07.2032 (a)	106	97	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.		
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.10.2053	100	94	Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.		
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.07.2053	100	92			
JPMorgan Chase & Co. 6,070 % fällig am 22.10.2027	50	50			
Weyerhaeuser Co. 4,750 % fällig am 15.05.2026	36	36			
New York State Electric & Gas Corp. 5,650 % fällig am 15.08.2028	30	30			
Toronto-Dominion Bank 5,264 % fällig am 11.12.2026	20	20			
AES Corp. 5,450 % fällig am 01.06.2028	20	20			

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund

31. Dezember 2023 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000\$)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000\$)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2023			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2023		
Kinder Morgan, Inc.	235.000	\$ 4.154	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	492.065	\$ 4.900
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	273.548	2.724	Pioneer Natural Resources Co.	19.200	4.577
Diamondback Energy, Inc.	13.000	1.943	Equitrans Midstream Corp.	492.882	4.511
ONEOK, Inc.	26.900	1.784	Pembina Pipeline Corp.	128.600	4.063
Antero Midstream Corp.	129.400	1.411	Enbridge, Inc.	92.200	3.455
EnLink Midstream LLC	96.800	1.192	Cheniere Energy, Inc.	19.100	3.171
Devon Energy Corp.	19.700	1.001	TC Energy Corp.	73.720	2.831
Antero Resources Corp.	37.700	986	ConocoPhillips Co.	19.000	2.165
Hess Midstream LP 'A'	33.800	948	Targa Resources Corp.	24.700	1.960
Marathon Oil Corp.	16.000	428	DTE Midstream LLC	30.000	1.566
Pioneer Natural Resources Co.	1.800	420	Chesapeake Energy Corp.	19.000	1.544
EQT Corp.	3.500	146	Williams Cos., Inc.	47.700	1.533
Occidental Petroleum Corp.	2.300	142	Devon Energy Corp.	30.200	1.486
Chesapeake Energy Corp.	800	68	EOG Resources, Inc.	8.700	1.119
			Diamondback Energy, Inc.	7.800	1.070
			EnLink Midstream LLC	67.500	844
			ONEOK, Inc.	13.400	792
			Hess Midstream LP 'A'	24.690	742
			EQT Corp.	20.600	726
			Antero Resources Corp.	26.400	704

(a) Der PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Mortgage Opportunities Fund

31. Dezember 2023 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2023			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2023		
Uniform Mortgage-Backed Security 5,500 % fällig am 01.01.2053	\$ 198.308	\$ 201.259	Uniform Mortgage-Backed Security 5,500 % fällig am 01.01.2053	\$ 198.308	\$ 200.349
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.03.2053	198.454	190.027	Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.03.2053	197.704	193.854
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.10.2052	193.733	189.987	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	109.386	109.767	Uniform Mortgage-Backed Security 5,500 % fällig am 01.05.2053	108.295	108.145
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.07.2053	99.667	97.927	Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.01.2053	99.467	99.750
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.04.2053	98.975	96.876	Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.07.2053	99.667	96.632
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.01.2053	98.116	96.035	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	95.357	Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.04.2053	98.820	94.906
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.08.2053	94.694	91.739	Fannie Mae 4,500 % fällig am 01.10.2052	97.237	93.138
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.08.2053	94.427	91.480	Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.08.2053	94.694	92.123
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.05.2053	93.787	88.222	Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.08.2053	94.427	91.863
Uniform Mortgage-Backed Security 5,500 % fällig am 01.02.2053	74.655	75.696	Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.01.2053	97.057	91.264
Freddie Mac 4,500 % fällig am 01.01.2053	74.876	73.569	Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.05.2053	93.787	86.859
Uniform Mortgage-Backed Security 6,000 % fällig am 01.07.2053	48.628	48.828	Uniform Mortgage-Backed Security 5,500 % fällig am 01.02.2053	74.655	75.424
Fannie Mae 5,500 % fällig am 01.06.2053	48.783	48.297	Freddie Mac 4,500 % fällig am 01.01.2053	74.876	73.347
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.03.2053	49.662	47.553	Uniform Mortgage-Backed Security 6,000 % fällig am 01.07.2053	48.628	48.380
Ginnie Mae 6,238 % fällig am 20.08.2073	43.443	43.303	Fannie Mae 5,500 % fällig am 01.06.2053	48.783	47.733
Ginnie Mae 6,238 % fällig am 20.07.2073	28.012	27.898	Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.03.2053	48.787	46.065
Fannie Mae 3,000 % fällig am 25.10.2052	146.437	24.429	Fannie Mae 3,000 % fällig am 01.06.2051	21.807	20.043
Ginnie Mae 6,238 % fällig am 20.08.2073	17.460	17.373	Fannie Mae 3,000 % fällig am 01.06.2051	21.386	19.656

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des StocksPLUS™ Fund

31. Dezember 2023 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000\$)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000\$)
KAUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2023			VERKAUFE BIS 31. DEZEMBER 2023		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	14.532.012	\$ 144.724	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	5.873.660	\$ 58.500
	PARI (000\$)			PARI (000\$)	
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b)	\$ 32.755	31.891	Ripon Mortgages PLC 5,920 % fällig am 28.08.2056	£ 12.228	14.381
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b)	29.764	28.673	Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 6,565 % fällig am 25.04.2036	\$ 11.300	10.622
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.10.2024 (b)	23.701	22.855	Taurus FR DAC 4,787 % fällig am 22.12.2030	€ 7.079	7.500
Primrose Residential DAC 4,626 % fällig am 24.03.2061	€ 16.246	17.549	Stratton Mortgage Funding PLC 5,920 % fällig am 12.12.2043	£ 5.578	6.521
LT Autorahoitus DAC 4,534 % fällig am 18.07.2033	15.249	16.554	Logicor Financing SARL 2,250 % fällig am 13.05.2025	€ 6.000	5.851
Bumper FR 4,576 % fällig am 27.04.2032	14.200	15.378	Quanta Services, Inc. 0,950 % fällig am 01.10.2024	\$ 6.300	5.813
Jupiter Mortgage PLC 6,021 % fällig am 20.07.2060	£ 11.540	14.424	Frost CMBS DAC 5,152 % fällig am 20.11.2033	€ 4.870	4.967
LT Autorahoitus DAC 4,744 % fällig am 18.12.2032	€ 12.869	14.113	Aroundtown S.A. 5,375 % fällig am 21.03.2029	\$ 6.500	4.696
Palmer Square European Loan Funding DAC 5,938 % fällig am 12.04.2032	12.960	13.918	Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 5,440 % fällig am 25.10.2047	5.400	4.686
Silver Arrow Athlon NL BV 4,576 % fällig am 26.04.2031	12.757	13.805	Hyatt Hotels Corp. 1,800 % fällig am 01.10.2024	4.600	4.321
Hill FL BV 4,604 % fällig am 18.05.2031	12.500	13.592	Park Place Securities, Inc. 6,080 % fällig am 25.05.2035	4.326	3.899
MidOcean Credit CLO 6,794 % fällig am 21.04.2031	\$ 12.444	12.428	Deutsche Bank AG 1,375 % fällig am 17.02.2032	€ 5.000	3.864
Driver UK Multi-Compartment S.A. 5,847 % fällig am 25.04.2031	£ 9.400	11.599	Broadcom, Inc. 4,000 % fällig am 15.04.2029	\$ 4.000	3.757
Citibank N.A. 5,864 % fällig am 29.09.2025	\$ 11.200	11.211	Nomura Resecuritization Trust 6,370 % fällig am 25.03.2037	3.691	3.567
U.S. Treasury Notes 0,625 % fällig am 30.11.2027	12.800	11.112	Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 5,750 % fällig am 25.12.2046	3.353	3.068
Tower Bridge Funding PLC 6,120 % fällig am 21.07.2064	£ 7.994	10.073	RAMP Series Trust 5,510 % fällig am 25.08.2046	3.188	2.879
Red & Black Auto Germany 4,283 % fällig am 15.09.2032	€ 9.400	10.066	JPMorgan Mortgage Acquisition Trust 6,130 % fällig am 25.07.2036	3.200	2.845
Avon Finance PLC 0,000 % fällig am 28.12.2049	£ 8.100	10.056	Option One Mortgage Loan Trust 5,600 % fällig am 25.07.2037	4.220	2.767
Freddie Mac 3,000 % fällig am 01.11.2032	\$ 10.574	9.742	Long Beach Mortgage Loan Trust 6,385 % fällig am 25.08.2035	3.000	2.674
			Countrywide Alternative Loan Trust 5,662 % 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 4,994 % 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
			Dutch Property Finance BV 5,202 % fällig am 28.04.2050	€ 2.093	2.195
			Fremont Home Loan Trust 6,085 % 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

(a) Der StocksPLUS™ Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des PIMCO StocksPLUS™ AR Fund

31. Dezember 2023 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2023			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2023		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	53.675	\$ 535	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	40.163	\$ 400
	PARI (000S)			PARI (000S)	
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b)	\$ 388	374	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,375 % fällig am 15.02.2044 (b)	\$ 128	127
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.07.2053	306	295	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.07.2032 (b)	103	97
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.07.2032 (b)	307	292	VICI Properties LP 3,750 % fällig am 15.02.2027	100	92
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.09.2052	201	191	245 Park Avenue Trust 3,508 % fällig am 05.06.2037	100	89
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.10.2053	176	152	Warnermedia Holdings, Inc. 4,279 % fällig am 15.03.2032	100	88
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.10.2024 (b)	119	114	Nykredit Realkredit A/S 1,500 % fällig am 01.10.2053	DKK 71	8
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.09.2053	125	107	(a) Der PIMCO StocksPLUS™ AR Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.		
Palmer Square European Loan Funding DAC 5,602 % fällig am 15.11.2032	€ 100	106	(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.		
Bank of America N.A. 5,650 % fällig am 18.08.2025	\$ 100	100	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.		
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 4,200 % fällig am 15.07.2046	100	100	Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.		
Uniform Mortgage-Backed Security 5,500 % fällig am 01.08.2053	99	97			
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			
Freddie Mac 3,458 % fällig am 25.08.2023	17	17			
Nykredit Realkredit A/S 2,464 % fällig am 01.10.2023	DKK 100	15			
Nykredit Realkredit A/S 3,501 % fällig am 01.10.2023	100	15			
Mexico Government International Bond 2,750 % fällig am 27.11.2031	MXN 157	8			

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Strategic Income Fund

31. Dezember 2023 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2023			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2023		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	20.696.661	\$ 206.101	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	23.658.557	\$ 235.600
Johnson & Johnson	26.139	4.297	Johnson & Johnson	28.695	4.900
	PARI (000S)			PARI (000S)	
Avon Finance PLC 0,000 % fällig am 28.12.2049	£ 3.100	3.849	INEOS Finance PLC 7,463 % fällig am 08.11.2027	€ 4.307	4.591
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,375 % fällig am 15.07.2033 (b)	\$ 4.029	3.770	Broadcom, Inc.	4.263	3.875
Israel Government International Bond 5,000 % fällig am 30.10.2026	€ 3.500	3.679		PARI (000S)	
UBS Group AG 5,959 % fällig am 12.01.2034	\$ 3.458	3.463	GLP Capital LP 4,000 % fällig am 15.01.2031	\$ 3.748	3.316
Nelnet Student Loan Trust 5,910 % fällig am 27.09.2066	3.329	3.310	Community Health Systems, Inc. 5,625 % fällig am 15.03.2027	3.611	3.121
	AKTIEN			AKTIEN	
Coca-Cola Co.	53.447	3.227	Philip Morris International, Inc.	31.021	2.893
	PARI (000S)		Merck & Co., Inc.	25.938	2.848
SLM Student Loan Trust 6,252 % fällig am 25.03.2026	\$ 3.162	3.123	BHP Group Ltd.	81.053	2.400
Man GLG Euro CLO DAC 5,779 % fällig am 15.10.2036	€ 2.880	3.040	Rio Tinto PLC	34.217	2.260
	AKTIEN		Novartis AG	22.839	2.243
AbbVie, Inc.	17.810	2.560	General Dynamics Corp.	9.607	2.225
	PARI (000S)		Iberdrola S.A.	166.615	2.125
Primrose Residential DAC 4,876 % fällig am 24.10.2061	€ 2.149	2.270	KDDI Corp.	65.000	2.055
	AKTIEN		Exxon Mobil Corp.	18.871	2.025
Phillips 66	21.092	2.204	American International Group, Inc.	31.339	1.922
	PARI (000S)		Phillips 66	19.251	1.873
Ginnie Mae 4,500 % fällig am 20.06.2041	\$ 2.141	2.070		PARI (000S)	
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.10.2024 (b)	2.097	2.023	Amgen, Inc. 5,250 % fällig am 02.03.2033	\$ 1.800	1.857
	AKTIEN			AKTIEN	
Verizon Communications, Inc.	57.824	2.005	Amgen, Inc.	7.188	1.833
Microsoft Corp.	6.029	1.964		PARI (000S)	
Amgen, Inc.	7.620	1.817	Pacific Gas & Electric Co. 3,500 % fällig am 15.06.2025	\$ 1.891	1.801
	PARI (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			

(a) Der Strategic Income Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Total Return Bond Fund

31. Dezember 2023 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG		AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG		AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2023				VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2023			
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		137.598.184	\$ 1.370.296	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		153.482.611	\$ 1.528.500
		PARI (000S)				PARI (000S)	
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.04.2053	\$	62.864	62.714	U.S. Treasury Inflation Protected Securities			
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,300 % fällig am 15.05.2028	€	44.063	47.081	0,625 % fällig am 15.01.2024 (b)	\$	70.669	70.118
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.05.2053	\$	40.982	41.034	U.S. Treasury Bonds 3,625 % fällig am 15.02.2053		27.300	26.208
U.S. Treasury Inflation Protected Securities				U.S. Treasury Notes 2,875 % fällig am 15.05.2032		25.000	23.683
0,625 % fällig am 15.01.2024 (b)		38.037	37.206	U.S. Treasury Bonds 4,000 % fällig am 15.11.2052		19.400	19.796
U.S. Treasury Bonds 3,875 % fällig am 15.05.2043		38.100	37.083	CPI Property Group S.A. 2,750 % fällig am 12.05.2026	€	20.200	18.092
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.06.2053		34.340	34.377	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 6,000 % fällig am 15.01.2026		15.000	15.832
U.S. Treasury Bonds 4,000 % fällig am 15.11.2052		30.800	33.069	U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 28.02.2027	\$	16.700	15.716
U.S. Treasury Inflation Protected Securities				U.S. Treasury Bonds 1,375 % fällig am 15.08.2050		26.000	14.853
0,125 % fällig am 15.02.2051 (b)		47.510	28.266	U.S. Treasury Bonds 2,000 % fällig am 15.02.2050		21.700	13.830
U.S. Treasury Bonds 3,625 % fällig am 15.02.2053		27.300	27.414	U.S. Treasury Bonds 4,000 % fällig am 15.11.2042		13.175	13.817
U.S. Treasury Inflation Protected Securities				Canada Government International Bond			
0,125 % fällig am 15.10.2024 (b)		21.480	20.693	2,000 % fällig am 01.06.2032	CAD	18.800	12.228
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.05.2053		20.000	19.916	Logicor Financing SARL 2,250 % fällig am 13.05.2025	€	11.000	10.930
U.S. Treasury Inflation Protected Securities				U.S. Treasury Inflation Protected Securities			
0,125 % fällig am 15.04.2025 (b)		20.742	19.841	1,500 % fällig am 15.02.2053 (b)	\$	12.504	10.822
Nykredit Realkredit A/S 3,700 % fällig am 01.10.2023	DKK	126.000	19.011	U.S. Treasury Bonds 3,250 % fällig am 15.05.2042		11.300	10.519
U.S. Treasury Bonds 4,375 % fällig am 15.08.2043	\$	18.000	17.696	Goldman Sachs Group, Inc. 5,700 % fällig am 01.11.2024		9.900	10.017
Ginnie Mae 6,238 % fällig am 20.01.2073		17.000	16.983	Prologis International Funding S.A. 3,125 % fällig am 01.06.2031	€	10.000	9.978
U.S. Treasury Inflation Protected Securities				Deutsche Bank AG 1,000 % fällig am 19.11.2025		10.000	9.937
0,750 % fällig am 15.02.2045 (b)		19.203	16.026	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB 1,125 % fällig am 04.09.2026		12.600	9.567
U.S. Treasury Inflation Protected Securities				Canada Government International Bond			
0,250 % fällig am 15.01.2025 (b)		14.905	14.374	2,750 % fällig am 01.12.2033	CAD	12.200	8.724
U.S. Treasury Inflation Protected Securities							
1,500 % fällig am 15.02.2053 (b)		14.434	13.780				
JDE Peet's NV 4,125 % fällig am 23.01.2030	€	12.500	13.656				

(a) Der Total Return Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund

31. Dezember 2023 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2023			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2023		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	19.924.454	\$ 198.407	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	20.847.720	\$ 207.600
	PARI (000S)		PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)	201.340	20.003
Japanische Schatzwechsel 0,000 % fällig am 17.04.2023	¥ 3.784.000	29.685		PARI (000S)	
Aries Capital DAC 0,000 % fällig am 18.09.2030	\$ 15.185	15.100	CPPIB Capital, Inc. 6,338 % fällig am 11.03.2026	\$ 11.000	11.238
Greenleaves Capital Designated Activity Co. 0,000 % fällig am 18.09.2030	15.185	15.100	Federal Home Loan Bank 5,370 % fällig am 21.05.2024	8.500	8.499
CPPIB Capital, Inc. 6,338 % fällig am 11.03.2026	11.000	11.240	Svensk Exportkredit AB 6,402 % fällig am 23.02.2024	8.000	8.049
	AKTIEN		Federal Home Loan Bank 5,350 % fällig am 17.05.2024	8.000	7.998
PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)	110.400	11.003	Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung 5,732 % fällig am 18.09.2025	6.000	6.014
	PARI (000S)		Morgan Stanley 5,519 % fällig am 25.01.2024	4.500	4.494
Federal Home Loan Bank 5,370 % fällig am 21.05.2024	\$ 8.500	8.500	ORIX Corp. 4,050 % fällig am 16.01.2024	4.500	4.463
Svensk Exportkredit AB 6,402 % fällig am 23.02.2024	8.000	8.065	Freddie Mac 5,375 % fällig am 24.04.2025	4.300	4.300
Federal Home Loan Bank 5,350 % fällig am 17.05.2024	8.000	8.000	Toyota Motor Credit Corp. 5,569 % fällig am 10.01.2025	4.200	4.200
Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung 5,732 % fällig am 18.09.2025	6.000	6.015	Federal Home Loan Bank 5,640 % fällig am 16.09.2024	4.000	4.000
Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd. 6,795 % fällig am 15.07.2031	5.996	5.939	Federal Home Loan Bank 5,360 % fällig am 10.05.2024	4.000	3.994
Morgan Stanley 5,519 % fällig am 25.01.2024	4.500	4.497	NXP BV 4,875 % fällig am 01.03.2024	3.800	3.784
Freddie Mac 5,375 % fällig am 24.04.2025	4.300	4.300	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 0,850 % fällig am 25.03.2024	3.700	3.558
Toyota Motor Credit Corp. 5,569 % fällig am 10.01.2025	4.200	4.200	National Bank of Canada 5,880 % fällig am 06.08.2024	3.500	3.497
Transpower New Zealand Ltd. 5,750 % fällig am 28.08.2023	AUD 6.000	4.159	Bank of Montreal 5,682 % fällig am 09.07.2024	3.435	3.428
Federal Home Loan Bank 5,640 % fällig am 16.09.2024	\$ 4.000	4.000	HCA, Inc. 5,000 % fällig am 15.03.2024	3.100	3.092
Federal Home Loan Bank 5,360 % fällig am 10.05.2024	4.000	4.000	CPPIB Capital, Inc. 6,604 % fällig am 04.04.2025	3.000	3.038
Bank of America Corp. 3,550 % fällig am 05.03.2024	4.000	3.994	VMware LLC 1,000 % fällig am 15.08.2024	3.000	2.876
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			

(a) Der PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des UK Corporate Bond Fund

31. Dezember 2023 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2023			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2023		
PIMCO ETFs plc - PIMCO Sterling Short Maturity UCITS ETF (a)	245.300	£ 24.997	United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 31.01.2023	£ 47.450	£ 47.365
	PARI (000S)		U.S. Treasury Notes 3,250 % fällig am 31.08.2024	\$ 23.400	18.728
U.S. Treasury Notes 3,250 % fällig am 31.08.2024	\$ 25.200	19.863	AKTIEN		
United Kingdom Gilt 1,625 % fällig am 22.10.2028	£ 17.700	15.897	PIMCO ETFs plc - PIMCO Sterling Short Maturity UCITS ETF (a)	118.800	12.096
United Kingdom Gilt 3,500 % fällig am 22.10.2025	14.900	14.650	PARI (000S)		
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 30.01.2026	14.100	12.761	United Kingdom Gilt 4,250 % fällig am 07.03.2036	£ 10.500	10.323
United Kingdom Gilt 3,750 % fällig am 22.10.2053	11.000	9.632	United Kingdom Gilt 4,250 % fällig am 07.12.2049	4.600	4.922
United Kingdom Gilt 4,250 % fällig am 07.12.2049	4.600	4.754	United Kingdom Gilt 1,625 % fällig am 22.10.2028	5.300	4.644
Lloyds Banking Group PLC 2,000 % fällig am 12.04.2028	3.900	3.409	United Kingdom Gilt 3,500 % fällig am 22.10.2025	4.400	4.344
NRW Bank 5,375 % fällig am 22.07.2026	2.800	2.792	UBS Group AG 7,375 % fällig am 07.09.2033	3.200	3.287
Barclays PLC 7,090 % fällig am 06.11.2029	2.650	2.670	United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 30.01.2026	3.100	2.815
Asian Development Bank 6,125 % fällig am 15.08.2025	2.550	2.546	United Kingdom Gilt 4,500 % fällig am 07.06.2028	2.400	2.415
Barclays PLC 6,369 % fällig am 31.01.2031	2.400	2.403	HSBC Holdings PLC 3,000 % fällig am 22.07.2028	2.500	2.224
United Kingdom Gilt 4,500 % fällig am 07.06.2028	2.400	2.362	Virgin Money UK PLC 4,000 % fällig am 25.09.2026	2.350	2.198
Volkswagen Financial Services NV 5,875 % fällig am 23.05.2029	2.100	2.104	Barclays PLC 3,250 % fällig am 17.01.2033	2.600	2.043
United Kingdom Gilt 4,500 % fällig am 07.09.2034	2.000	1.968	United Kingdom Gilt 4,500 % fällig am 07.09.2034	2.000	2.023
EP Infrastructure A/S 1,816 % fällig am 02.03.2031	€ 3.100	1.924	Europäische Union 0,000 % fällig am 04.10.2028	€ 2.400	1.809
Credit Suisse AG 7,750 % fällig am 10.03.2026	£ 1.900	1.897	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 4,125 % fällig am 18.02.2026	£ 1.800	1.761
Europäische Union 0,000 % fällig am 04.10.2028	€ 2.400	1.803	Network Rail Infrastructure Finance PLC 4,750 % fällig am 29.11.2035	1.800	1.738
Santander UK Group Holdings PLC 7,482 % fällig am 29.08.2029	£ 1.800	1.799	CPI Property Group S.A. 2,750 % fällig am 22.01.2028	2.450	1.706
Weir Group PLC 6,875 % fällig am 14.06.2028	1.800	1.796	Heathrow Funding Ltd. 2,750 % fällig am 09.08.2051	2.700	1.549
			Morgan Stanley 5,789 % fällig am 18.11.2033	1.500	1.454

(a) Der UK Corporate Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des UK Long Term Corporate Bond Fund

31. Dezember 2023 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2023			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2023		
United Kingdom Gilt 1,250 % fällig am 31.07.2051	£ 25.300	£ 14.813	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	4.031	United Kingdom Gilt 4,250 % fällig am 07.12.2049	3.900	4.223
Lloyds Bank PLC 6,500 % fällig am 17.09.2040	3.700	3.917	United Kingdom Gilt 1,250 % fällig am 31.07.2051	7.400	3.648
SNCF Reseau 4,830 % fällig am 25.03.2060	3.160	3.059	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,875 % fällig am 15.09.2026	3.400	3.047
United Kingdom Gilt 3,750 % fällig am 22.10.2053	2.800	2.615	Deutsche Bank AG 1,875 % fällig am 22.12.2028	3.600	2.982
British Telecommunications PLC 5,750 % fällig am 13.02.2041	2.500	2.372	United Kingdom Gilt 4,250 % fällig am 07.12.2046	2.600	2.477
Cooperatieve Rabobank UA 5,250 % fällig am 23.05.2041	2.050	2.187	GE Capital UK Funding Unlimited Co. 5,875 % fällig am 18.01.2033	2.500	2.461
National Grid Electricity Transmission PLC 5,272 % fällig am 18.01.2043	2.000	2.000	United Kingdom Gilt 1,500 % fällig am 22.07.2047	3.800	2.194
Southern Water Services Finance Ltd. 3,000 % fällig am 28.05.2037	2.700	1.864	United Kingdom Gilt 4,250 % fällig am 07.03.2036	1.900	1.962
Walmart, Inc. 5,250 % fällig am 28.09.2035	1.800	1.856	Europäische Investitionsbank 6,000 % fällig am 07.12.2028	1.700	1.877
Electricite de France S.A. 5,625 % fällig am 25.01.2053	1.900	1.846	Oracle Corp. 6,900 % fällig am 09.11.2052	\$ 1.900	1.639
Tesco Corporate Treasury Services PLC 5,500 % fällig am 27.02.2035	1.800	1.785	United Kingdom Gilt 3,500 % fällig am 22.01.2045	£ 1.900	1.635
National Gas Transmission PLC 5,750 % fällig am 05.04.2035	1.850	1.778	Credit Agricole S.A. 4,875 % fällig am 23.10.2029	1.600	1.596
BG Energy Capital PLC 5,000 % fällig am 04.11.2036	1.800	1.698	Barclays PLC 3,250 % fällig am 17.01.2033	2.030	1.582
United Utilities Water Finance PLC 5,750 % fällig am 26.06.2036	1.700	1.693	Lloyds Banking Group PLC 6,625 % fällig am 02.06.2033	1.600	1.565
Optivo Finance PLC 2,857 % fällig am 07.10.2035	2.200	1.626	E.ON International Finance BV 4,750 % fällig am 31.01.2034	1.700	1.519
Credit Agricole S.A. 4,875 % fällig am 23.10.2029	1.600	1.589	United Utilities Water Finance PLC 2,000 % fällig am 03.07.2033	1.700	1.266
Lloyds Banking Group PLC 6,625 % fällig am 02.06.2033	1.600	1.548	Holcim Sterling Finance Netherlands BV 2,250 % fällig am 04.04.2034	1.800	1.259
Siemens Financieringsmaatschappij NV 3,750 % fällig am 10.09.2042	1.800	1.509	Stichting AK Rabobank Certificaten 6,500 %	€ 1.481	1.237
Walmart, Inc. 5,625 % fällig am 27.03.2034	1.400	1.496	Annington Funding PLC 2,308 % fällig am 06.10.2032	£ 1.600	1.146
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			

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des US High Yield Bond Fund

31. Dezember 2023 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2023			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2023		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	84.245.388	\$ 838.969	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	82.932.278	\$ 825.900
	PARI (000S)			PARI (000S)	
U.S. Treasury Notes 3,500 % fällig am 31.01.2028	\$ 25.000	24.384	U.S. Treasury Notes 3,875 % fällig am 30.11.2027	\$ 50.700	49.840
	AKTIEN		U.S. Treasury Notes 3,500 % fällig am 15.09.2025	50.000	48.854
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO European High Yield Bond Fund (a)	1.743.573	20.021	U.S. Treasury Notes 4,125 % fällig am 30.09.2027	25.000	24.669
	PARI (000S)		U.S. Treasury Notes 3,500 % fällig am 31.01.2028	25.000	23.802
Las Vegas Sands Corp. 3,900 % fällig am 08.08.2029	\$ 15.275	13.303	U.S. Treasury Notes 3,125 % fällig am 31.08.2027	25.000	23.757
TIM SpA 7,875 % fällig am 31.07.2023	€ 11.400	12.395	U.S. Treasury Notes 4,250 % fällig am 15.10.2025	23.000	22.700
Venture Global LNG, Inc. 8,375 % fällig am 01.06.2031	\$ 10.800	10.772	Medline Borrower LP 5,250 % fällig am 01.10.2029	14.200	12.455
U.S. Treasury Notes 3,875 % fällig am 31.12.2027	10.000	10.149	U.S. Treasury Notes 3,875 % fällig am 31.12.2027	10.000	9.668
GN Bondco LLC 9,500 % fällig am 15.10.2031	9.875	9.678	U.S. Treasury Notes 4,125 % fällig am 31.10.2027	9.000	9.006
Trident TPI Holdings, Inc. 12,750 % fällig am 31.12.2028	9.750	9.647	Sprint Capital Corp. 8,750 % fällig am 15.03.2032	7.000	8.565
Medline Borrower LP 5,250 % fällig am 01.10.2029	10.750	9.297	McAfee Corp. 7,375 % fällig am 15.02.2030	10.000	8.272
TransDigm, Inc. 4,625 % fällig am 15.01.2029	10.400	9.240	Mundys SpA 1,875 % fällig am 12.02.2028	€ 8.750	8.229
Cerba Healthcare SACA 3,500 % fällig am 31.05.2028	€ 9.900	9.100	Heartland Dental LLC 8,500 % fällig am 01.05.2026	\$ 9.000	8.010
Grifols S.A. 4,750 % fällig am 15.10.2028	\$ 9.675	8.354	Sigma Holdco BV 7,875 % fällig am 15.05.2026	8.000	6.679
Intesa Sanpaolo SpA 9,125 % fällig am 07.09.2029	€ 7.500	8.153	Team Health Holdings, Inc. 6,375 % fällig am 01.02.2025	12.000	6.621
HAT Holdings LLC 8,000 % fällig am 15.06.2027	\$ 7.850	7.850	Ford Motor Credit Co. LLC 2,900 % fällig am 10.02.2029	8.000	6.558
MajorDrive Holdings LLC 6,375 % fällig am 01.06.2029	9.475	7.653	LBM Acquisition LLC 6,250 % fällig am 15.01.2029	8.000	6.319
Bausch & Lomb Escrow Corp. 8,375 % fällig am 01.10.2028	7.225	7.276	Global Medical Response, Inc. 6,500 % fällig am 01.10.2025	10.000	6.050
American Airlines, Inc. 5,750 % fällig am 20.04.2029	7.475	7.098	White Cap Buyer LLC 6,875 % fällig am 15.10.2028	6.800	6.001
Freedom Mortgage Corp. 12,000 % fällig am 01.10.2028	7.225	7.081			
Triumph Group, Inc. 9,000 % fällig am 15.03.2028	6.950	6.986			

(a) Der US High Yield Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des US Investment Grade Corporate Bond Fund

31. Dezember 2023 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2023			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2023		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	12.646.991	\$ 125.957	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	14.700.227	\$ 146.400
	PARI (000S)			PARI (000S)	
U.S. Treasury Bonds 2,500 % fällig am 15.02.2046	\$ 15.900	11.760	U.S. Treasury Bonds 4,000 % fällig am 15.11.2042	\$ 16.900	16.235
U.S. Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.02.2048	11.800	8.617	U.S. Treasury Notes 3,375 % fällig am 15.05.2033	7.700	7.162
U.S. Treasury Notes 3,375 % fällig am 15.05.2033	7.700	7.473	U.S. Treasury Notes 3,875 % fällig am 15.08.2033	7.100	6.731
U.S. Treasury Notes 3,875 % fällig am 15.08.2033	7.100	6.589	U.S. Treasury Notes 2,875 % fällig am 15.05.2032	6.301	5.866
U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 15.08.2032	7.100	6.326	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	5.542	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	5.509	U.S. Treasury Bonds 4,375 % fällig am 15.08.2043	5.900	5.505
U.S. Treasury Bonds 4,375 % fällig am 15.08.2043	5.900	5.352	U.S. Treasury Bonds 4,000 % fällig am 15.11.2052	5.100	5.230
U.S. Treasury Bonds 2,750 % fällig am 15.08.2047	6.900	5.336	U.S. Treasury Notes 3,500 % fällig am 15.02.2033	4.400	4.148
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	3.918
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	3.634
U.S. Treasury Bonds 3,625 % fällig am 15.02.2053	3.800	3.722	U.S. Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.02.2048	3.796	2.799
Bank of America Corp. 5,288 % fällig am 25.04.2034	3.700	3.696	U.S. Treasury Bonds 3,250 % fällig am 15.05.2042	2.764	2.518
Morgan Stanley 5,250 % fällig am 21.04.2034	3.600	3.600	U.S. Treasury Bonds 3,375 % fällig am 15.08.2042	2.800	2.490
Synchrony Financial 7,250 % fällig am 02.02.2033	3.600	3.587	Vonovia SE 0,000 % fällig am 01.12.2025	€ 2.300	2.175
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,500 % fällig am 15.02.2053 (b)	3.452	3.365	U.S. Treasury Bonds 2,875 % fällig am 15.05.2052	\$ 2.600	2.154
U.S. Treasury Bonds 4,000 % fällig am 15.11.2042	3.200	3.348	Synchrony Financial 7,250 % fällig am 02.02.2033	2.400	2.127
Amgen, Inc. 5,600 % fällig am 02.03.2043	3.075	3.066	RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc. 9,023 % fällig am 16.11.2025	2.006	1.954
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 6,750 % fällig am 05.09.2027	€ 2.300	2.491	DaVita, Inc. 4,625 % fällig am 01.06.2030	2.200	1.829

(a) Der US Investment Grade Corporate Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des US Short-Term Fund

31. Dezember 2023 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2023			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2023		
U.S. Treasury Notes 3,500 % fällig am 31.01.2028	\$ 71.500	\$ 71.193	U.S. Treasury Notes 3,500 % fällig am 31.01.2028	\$ 71.500	\$ 71.556
U.S. Treasury Notes 4,125 % fällig am 31.07.2028	42.600	42.074	U.S. Treasury Notes 3,500 % fällig am 15.09.2025	63.700	62.354
Federal Home Loan Bank 5,660 % fällig am 26.08.2024	40.000	40.000	AKTIEN		
Federal Home Loan Bank 5,500 % fällig am 08.05.2025	38.000	38.000	PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)	431.565	42.943
Freddie Mac 5,950 % fällig am 21.03.2025	33.000	33.000	PARI (000S)		
Freddie Mac 5,550 % fällig am 09.05.2025	25.000	25.000	U.S. Treasury Notes 4,125 % fällig am 31.07.2028	\$ 42.600	42.147
Freddie Mac 5,520 % fällig am 28.05.2025	22.400	22.400	Federal Home Loan Bank 1,115 % fällig am 26.02.2027	31.500	27.837
Federal Home Loan Bank 5,480 % fällig am 26.02.2025	22.400	22.400	Federal Home Loan Bank 0,900 % fällig am 26.02.2027	26.500	22.994
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.10.2024 (b)	22.560	21.865	Ginnie Mae 3,000 % fällig am 20.07.2051	25.968	22.345
Federal Home Loan Bank 5,650 % fällig am 28.05.2025	21.000	21.000	Ginnie Mae 3,000 % fällig am 20.06.2051	22.856	19.763
Freddie Mac 5,820 % fällig am 20.03.2025	21.000	21.000	NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 6,449 % fällig am 21.03.2024	17.700	17.707
Freddie Mac 5,730 % fällig am 03.04.2025	21.000	21.000	Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung		
Freddie Mac 5,680 % fällig am 03.04.2025	21.000	21.000	0,850 % fällig am 10.02.2027	18.800	16.711
Federal Home Loan Bank 5,980 % fällig am 17.07.2025	20.600	20.600	Santander UK Group Holdings PLC 1,089 % fällig am 15.03.2025	16.700	15.975
Morgan Stanley 0,790 % fällig am 30.05.2025	21.500	20.390	Bayer U.S. Finance LLC 3,875 % fällig am 15.12.2023	15.979	15.819
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd. 6,788 % fällig am 19.10.2031	20.250	20.136	Danske Bank A/S 5,375 % fällig am 12.01.2024	14.850	14.765
Federal Home Loan Bank 5,710 % fällig am 14.03.2025	20.000	20.000	Wells Fargo & Co. 6,701 % fällig am 25.04.2026	14.500	14.617
Freddie Mac 5,800 % fällig am 03.07.2025	20.000	20.000	BAT Capital Corp. 3,222 % fällig am 15.08.2024	14.750	14.315
Wells Fargo & Co. 2,406 % fällig am 30.10.2025	17.800	17.036	AerCap Ireland Capital DAC 1,150 % fällig am 29.10.2023	12.950	12.734
Lloyds Banking Group PLC 3,870 % fällig am 09.07.2025	17.000	16.635	Eni SpA 4,000 % fällig am 12.09.2023	11.800	11.743
Barclays PLC 3,932 % fällig am 07.05.2025	15.500	15.176	Thermo Fisher Scientific, Inc. 5,562 % fällig am 18.10.2024	11.500	11.498
Athene Global Funding 6,108 % fällig am 24.05.2024	14.200	14.073	Ginnie Mae 2,500 % fällig am 20.06.2051	13.399	11.253
Hyundai Capital America 6,532 % fällig am 04.08.2025	14.000	14.000	Boeing Co. 1,433 % fällig am 04.02.2024	10.900	10.596
HCA, Inc. 5,000 % fällig am 15.03.2024	14.000	13.906	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.10.2024 (b)	10.793	10.490
CIFC Funding Ltd. 6,710 % fällig am 24.04.2030	13.891	13.791	DBS Group Holdings Ltd. 2,591 % fällig am 20.01.2028	10.000	10.021
Westpac Banking Corp. 4,862 % fällig am 16.11.2023	AUD 20.000	13.782	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
			Hyatt Hotels Corp. 1,300 % fällig am 01.10.2023	9.400	9.257
			Mizuho Financial Group, Inc. 6,123 % fällig am 08.09.2024	9.200	9.205
			Nomura Holdings, Inc. 1,851 % fällig am 16.07.2025	9.773	8.958
			CNH Industrial Capital LLC 4,200 % fällig am 15.01.2024	9.000	8.911
			General Motors Financial Co., Inc. 5,100 % fällig am 17.01.2024	8.670	8.622
			Bank of America Corp. 5,791 % fällig am 24.10.2024	7.500	7.502

(a) Der US Short-Term Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Portfolioumschlag

Dieser Bericht wurde zur Unterstützung der Offenlegung gegenüber institutionellen Anlegern gemäß der Zweiten Aktionärsrichtlinie (ARUG II) erstellt.

Die Länge des Zeitraums, über den ein Teilfonds ein bestimmtes Wertpapier enthielt, spielt bei Anlageentscheidungen im Allgemeinen keine Rolle. Eine Veränderung in den von einem Teilfonds gehaltenen Wertpapieren bezeichnet man als „Portfolioumschlag“. Jedes Portfolio kann sich am häufigsten und aktiven Handel der Portfoliowertpapiere beteiligen, um sein Anlageziel zu erreichen, insbesondere in Zeiträumen volatiler Marktbewegungen. Hohe Portfolioumschlagraten beinhalten anteilig höhere Transaktionskosten, einschließlich Maklerprovisionen oder Händleraufschläge sowie sonstige Transaktionskosten für den Verkauf von Wertpapieren und die Wiederanlage in anderen Wertpapieren, die vom Teilfonds getragen werden. Diese Verkäufe können ebenfalls zur Realisierung bestuehbarer Kapitalerträge führen, einschließlich kurzfristiger Kapitalerträge (die gewöhnlich bei Ausschüttung an die Anteilhaber zu den allgemeinen Einkommensteuersätzen besteuert werden). Die Transaktionskosten im Zusammenhang mit dem Portfolioumschlag können die Wertentwicklung eines Teilfonds nachteilig beeinflussen.

Die folgenden Wertpapierarten sind von der Berechnung der Portfolioumschlagsrate ausgeschlossen: verbundene Investmentfonds, derivative Finanzinstrumente, TBA Mortgage Dollar Rolls, Sale-Buyback und andere kurzfristige Instrumente mit einer Laufzeit von weniger als 365 Tagen.

Die Portfolioumschlagsrate für jeden Teilfonds für das am 31. Dezember 2023 abgeschlossene Geschäftsjahr lautet wie folgt:

Teilfondsbezeichnung	2023 Portfolioumschlagsrate
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	45 %
Asia Strategic Interest Bond Fund	69 %
PIMCO Balanced Income and Growth Fund	591 %
PIMCO Capital Securities Fund	50 %
PIMCO Climate Bond Fund	35 %
Commodity Real Return Fund	47 %
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	154 %
Diversified Income Fund	56 %
Diversified Income Duration Hedged Fund	104 %
Diversified Income ESG Fund	29 %
Dynamic Bond Fund	140 %
Dynamic Multi-Asset Fund	91 %
Emerging Local Bond Fund	114 %
Emerging Local Bond ESG Fund	48 %
Emerging Markets Bond Fund	39 %
Emerging Markets Bond ESG Fund	51 %
Emerging Markets Corporate Bond Fund	46 %
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	164 %
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	135 %
PIMCO ESG Income Fund	174 %
Euro Bond Fund	95 %
Euro Credit Fund	104 %
Euro Income Bond Fund	140 %
Euro Long Average Duration Fund	76 %
Euro Short-Term Fund	69 %
PIMCO European High Yield Bond Fund	55 %
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	79 %
Global Advantage Fund	107 %
Global Bond Fund	161 %
Global Bond ESG Fund	59 %
Global Bond Ex-US Fund	91 %
Global High Yield Bond Fund	41 %

Teilfondsbezeichnung	2023 Portfolioumschlagsrate
Global Investment Grade Credit Fund	68 %
Global Investment Grade Credit ESG Fund	71 %
Global Low Duration Real Return Fund	25 %
Global Real Return Fund	28 %
Income Fund	147 %
Income Fund II	57 %
Inflation Multi-Asset Fund	120 %
Low Average Duration Fund	80 %
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	49 %
Low Duration Income Fund	124 %
Low Duration Opportunities Fund	33 %
Low Duration Opportunities ESG Fund	112 %
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	28 %
Mortgage Opportunities Fund	512 %
StocksPLUS™ Fund	77 %
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	222 %
Strategic Income Fund	130 %
Total Return Bond Fund	115 %
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	374 %
UK Corporate Bond Fund	59 %
UK Long Term Corporate Bond Fund	35 %
US High Yield Bond Fund	37 %
US Investment Grade Corporate Bond Fund	55 %
US Short-Term Fund	29 %

Alle in den folgenden Anhängen dargestellten Daten wurden auf Grundlage der Portfoliobestände des betreffenden Fonds zum 31. Dezember 2023 berechnet und sind ungeprüfte Informationen, die nicht von den Wirtschaftsprüfern oder einer dritten Partei bestätigt wurden. Alle in den Anhängen enthaltenen Daten oder sonstigen Informationen wurden im Einklang mit dem von der Verwaltungsgesellschaft und der Anlageberatungsgesellschaft des betreffenden Fonds implementierten firmeneigenen Rahmenwerk zu nachhaltigen Finanzprodukten zusammengestellt. Der PIMCO European High Yield Bond Fund ist seit dem 29. September 2023 gemäß Artikel 8 der Offenlegungsverordnung eingestuft.

Taxonomie-Verordnung

Für gemäß Artikel 8 oder Artikel 9 der Offenlegungsverordnung eingestufte Fonds beachten Sie bitte den beigefügten Anhang für den jeweiligen Fonds in Bezug auf die Konformität mit Verordnung (EU) 2020/852, allgemein als „Taxonomie-Verordnung“ bezeichnet. Für nicht gemäß Artikel 8 (d. h. sie bewerben keine ökologischen und/oder sozialen Merkmale) oder als Artikel 9 (d. h. sie haben kein nachhaltiges Investitionsziel) der Offenlegungsverordnung eingestufte Fonds berücksichtigen die zugrunde liegenden Investitionen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

ANHANG IV

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: PIMCO Capital Securities Fund

Unternehmenskennung: 549300LOUVRKJJGJKO09

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___ %

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___ %

Nein

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds bewarb ökologische und/oder soziale Merkmale, indem er eine Ausschlussstrategie verfolgte. Der Fonds bewarb auch ökologische und/oder soziale Merkmale durch aktive Mitwirkung bei bestimmten Emittenten (Beispiele für eine solche Mitwirkung waren wesentliche klima- und biodiversitätsbezogene Angelegenheiten), indem er beispielsweise die Emittenten dazu ermutigte, sich an das Pariser Abkommen zu halten, wissenschaftlich fundierte Ziele zur

Reduzierung der Kohlenstoffemissionen zu übernehmen und/oder ihre Nachhaltigkeitsverpflichtungen auf breiter Basis voranzutreiben.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wurde auf der Grundlage der Umsetzung der Ausschlussstrategie des Anlageberaters und der Umsetzung seiner Richtlinie zur Mitwirkung bei den Emittenten gemessen. Die Ausschlussstrategie des Fonds gilt für 100 % seiner Direktanlagen.

So führte die Ausschlussstrategie des Fonds zum Beispiel zum Ausschluss bestimmter Sektoren, einschließlich Emittenten, die hauptsächlich in den Bereichen Kohle und unkonventionelles Öl (wie arktisches Öl und Ölsand) tätig sind. Darüber hinaus bezog sich der Anlageberater gegebenenfalls auf weltweit anerkannte Standards wie die UNGC-Grundsätze.

● **...und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Informationen zum historischen Vergleich der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen des Fonds sind unten in der Antwort auf die Frage „Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?“ dargelegt.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Größte Investitionen	Sektor	% des Nettovermögens	Land
Stichting AK Rabobank Certificaten 6,500 %	Investment-Grade-Anleihen	3,23 %	Niederlande
Credit Agricole S.A. 7,250 % fällig am 23.09.2028	Investment-Grade-Anleihen	2,59 %	Frankreich
Santander UK Group Holdings PLC 6,750 % fällig am 24.06.2024	Investment-Grade-Anleihen	2,16 %	Großbritannien
Nationwide Building Society 10,250 %	Investment-Grade-Anleihen	1,83 %	Großbritannien
Bank of Ireland Group PLC 7,500 % fällig am 19.05.2025	Hochverzinsliche Anleihen	1,73 %	Irland
HSBC Bank Capital Funding Sterling LP 5,844 % fällig am 05.11.2031	Investment-Grade-Anleihen	1,73 %	Jersey
Lloyds Banking Group PLC 4,947 % fällig am 27.06.2025	Investment-Grade-Anleihen	1,65 %	Großbritannien
U.S. Treasury Bills 5,489 % fällig am 23.01.2024	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	1,56 %	Vereinigte Staaten
Cooperatieve Rabobank UA 3,100 % fällig am 29.06.2028	Investment-Grade-Anleihen	1,36 %	Niederlande
NatWest Group PLC 6,000 % fällig am 29.12.2025	Investment-Grade-Anleihen	1,34 %	Großbritannien
Lloyds Banking Group PLC 7,875 % fällig am 27.06.2029	Investment-Grade-Anleihen	1,28 %	Großbritannien
KBC Group NV 4,250 % fällig am 24.10.2025	Investment-Grade-Anleihen	1,26 %	Belgien
Erste Group Bank AG 4,250 % fällig am 15.10.2027	Investment-Grade-Anleihen	1,25 %	Österreich
Intesa Sanpaolo SpA 9,125 % fällig am 07.09.2029	Hochverzinsliche Anleihen	1,25 %	Italien
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 8,200 % fällig am 15.01.2029	Investment-Grade-Anleihen	1,21 %	Japan

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum zum 31. Dezember 2023 mit dem Finanzprodukt getätigt wurden

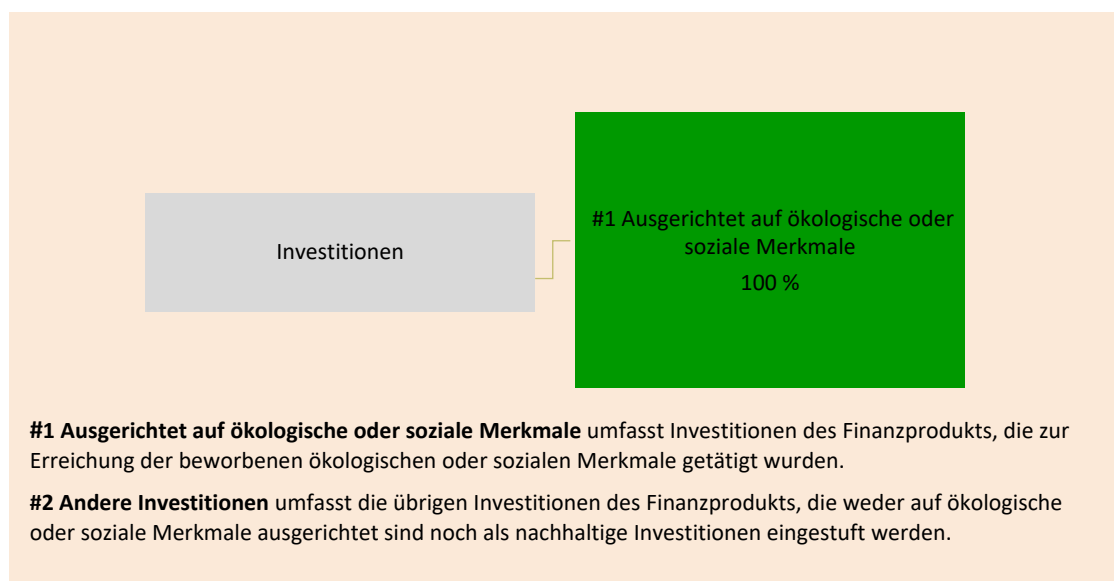
Für die Zwecke der Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Investitionen des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendet.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Informationen über den Anteil des Fonds zum 31. Dezember 2023, mit dem ökologische/soziale Merkmale beworben wurden, sind nachstehend aufgeführt.

● *Wie sah die Vermögensallokation aus?*



Zum 31. Dezember 2023 wurden 100 % der direkten Investitionen des Fonds als Investitionen angesehen, die ökologische und/oder soziale Merkmale bewerben, da die Ausschlussstrategie des Fonds auf alle seine direkten Investitionen angewendet wurde (31. Dezember 2022: 100 %). Ein ökologischer oder sozialer Mindestschutz wurde nur für solche direkten Investitionen vorgesehen und galt nicht für indirekte Investitionen.

● *In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?*

Sektor	% des Nettovermögens
Investment-Grade-Anleihen	63,65 %
Hochverzinsliche Anleihen	27,11 %
Quasi-staatliche Anleihen	13,94 %
Schwellenmärkte, extern	0,02 %
Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	-4,72 %

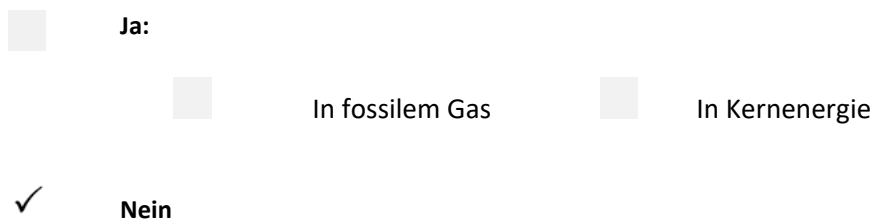
Für die Zwecke der Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Positionen des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendet.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Zum 31. Dezember 2023 lag der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform sind, bei 0 % (31. Dezember 2022: 0 %). Diese Zahl wurde weder von einem Wirtschaftsprüfer noch von sonstigen Dritten überprüft.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?



Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten

wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten

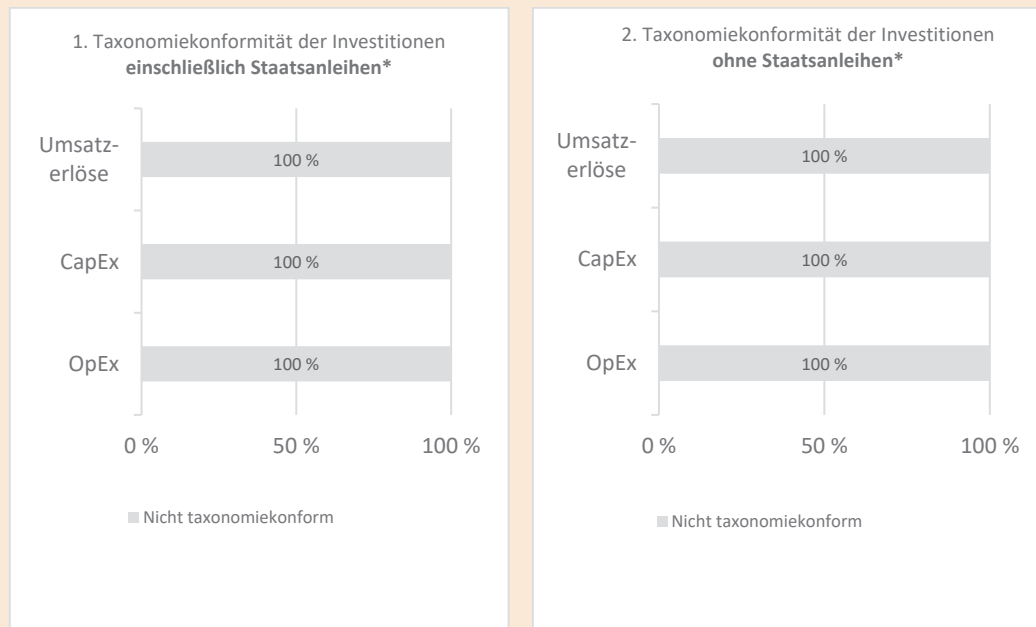
sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Im Bezugszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug der Anteil der Investitionen des Fonds in Übergangs- und ermöglichenden Tätigkeiten 0 % (31. Dezember 2022: 0 %).



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Wie oben dargelegt, wurde zum 31. Dezember 2023 davon ausgegangen, dass 100 % der direkten Investitionen des Fonds ökologische und/oder soziale Merkmale bewerben, da die Ausschlussstrategie des Fonds auf alle seine direkten Investitionen angewendet wurde. (31. Dezember 2022: 100 %).

Ein ökologischer oder sozialer Mindestschutz wurde nur für solche direkten Investitionen vorgesehen und galt nicht für indirekte Investitionen.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Im Bezugszeitraum wirkte der Anlageberater aktiv bei bestimmten Emittenten mit (Beispiele für eine solche aktive Mitwirkung waren wesentliche klima- und biodiversitätsbezogene Angelegenheiten), indem er insbesondere die Emittenten ermutigte, sich an das Pariser Abkommen zu halten, wissenschaftlich fundierte Ziele zur Reduzierung von Kohlenstoffemissionen zu übernehmen und/oder ihre Nachhaltigkeitsverpflichtungen auf breiter Basis voranzutreiben.

ANHANG V

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 9, Absätze 1 bis 4a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 5 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: PIMCO Climate Bond Fund Unternehmenskennung: 549300KBV832SKE8DW37

Nachhaltiges Investitionsziel

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: 92 %**

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: 1 %****

**Der Fonds hat während des Berichtszeitraums zwar nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt, er hat sich jedoch nicht dazu verpflichtet, in diese Anlagekategorie zu investieren. Daher sollten derartige Investitionen des Fonds als gelegentliche Investitionen betrachtet werden.

Nein

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Inwieweit wurde das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzprodukts erreicht?

Während des Berichtszeitraums strebte der Fonds an, optimale risikobereinigte Renditen zu erzielen, die mit einer umsichtigen Anlageverwaltung vereinbar sind, und gleichzeitig die langfristigen klimabezogenen Risiken und Chancen zu berücksichtigen.

Wie im Folgenden im Abschnitt „Vermögensallokation“ näher ausgeführt, umfassten die nachhaltigen Investitionen des Fonds festverzinsliche ESG-Wertpapiere (wie im Abschnitt „**Festverzinsliche ESG-Wertpapiere**“ ausführlich beschrieben), die es den Emittenten ermöglichen, Kapital für die Finanzierung von Projekten mit positiven Auswirkungen auf die Umwelt zu beschaffen, und die zu den Umweltzielen Klimaschutz und Anpassung an den Klimawandel beitragen.

Die vom Fonds während des Berichtszeitraums gehaltenen Derivate wurden anhand der vom Anlageberater umgesetzten Ausschlussstrategie geprüft und dementsprechend zur Erreichung des nachhaltigen Anlageziels des Fonds verwendet.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die nachhaltigen Ziele dieses Finanzprodukts erreicht werden.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Das Erreichen des nachhaltigen Anlageziels des Fonds wurde auf der Grundlage der Umsetzung der Richtlinie zur Mitwirkung bei den Emittenten des Anlageberaters und seiner Ausschlussstrategie gemessen sowie anhand der Investitionen in festverzinsliche ESG-Wertpapiere (wie im Abschnitt „**Festverzinsliche ESG-Papiere**“ näher beschrieben).

Beispielsweise führte das Screening-Verfahren des Fonds zum Ausschluss bestimmter Sektoren, darunter Emittenten, die in Sektoren im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind. Darüber hinaus bezog sich der Anlageberater des Fonds gegebenenfalls auf weltweit anerkannte Standards wie die UNGC-Grundsätze und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte.

● **...und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Informationen zum historischen Vergleich der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen des Fonds sind unten in der Antwort auf die Frage „*Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?*“ dargelegt.

● **Inwiefern wurden nachhaltige Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen nicht erheblich beeinträchtigt?**

Die nachhaltigen Investitionen des Fonds wurden dahingehend bewertet, dass sie keinen wesentlichen Schaden für ökologische oder sozial nachhaltige Anlageziele verursachen. Diese Bewertung erfolgte durch die Anwendung verschiedener negativer Nachhaltigkeitsindikatoren durch den Anlageberater, darunter das Engagement in Sektoren im Bereich der fossilen Brennstoffe sowie Treibhausgasemissionen.

— **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Die Wertpapiere wurden gemäß dem internen Nachhaltigkeits-Screening-Verfahren des Anlageberaters ausgewählt. Dieses Screening-Verfahren beinhaltete die Berücksichtigung negativer Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren, insbesondere das

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Offenlegungen gemäß der Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor und der Taxonomie-Verordnung (ungeprüft) (Forts.)

Engagement in Sektoren, die mit fossilen Brennstoffen in Zusammenhang stehen. Der Anlageberater war bestrebt, die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen zu mindern, unter anderem durch seine Mitwirkung bei Emittenten und seine Ausschlussstrategie.

- *Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:*

Der Anlageberater vergewisserte sich, dass die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Richtlinien für multinationale Unternehmen und den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte im Einklang stehen, indem er ein UNGC (UN Global Compact)-Kontroversen-Screening zusammen mit anderen Instrumenten, einschließlich ESG-Scores und Research im Rahmen des Due-Diligence-Prozesses für Anlagen einsetzte.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen werden als die Auswirkungen von Anlageentscheidungen beschrieben, die „negative Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren nach sich ziehen“, während Nachhaltigkeitsfaktoren als „Umwelt-, Sozial- und Mitarbeiterangelegenheiten, Achtung der Menschenrechte, Bekämpfung von Korruption und Bekämpfung von Bestechung“ definiert werden.

Der Fonds berücksichtigte im Bezugszeitraum die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen von Anlageentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (insbesondere das Engagement in Sektoren im Bereich der fossilen Brennstoffe und Treibhausgasemissionen).

Der Anlageberater war bestrebt, die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen im Rahmen des Anlageprozesses zu berücksichtigen, und setzte eine Kombination von Methoden ein, einschließlich Engagement und Ausschlüsse von Emittenten, um die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen zu mindern.



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Größte Investitionen	Sektor	% des Nettovermögens	Land
Kreditanstalt für Wiederaufbau 1,375 % fällig am 07.06.2032	Quasi-staatliche Anleihen	6,02 %	Deutschland
Kreditanstalt für Wiederaufbau 2,000 % fällig am 15.11.2029	Quasi-staatliche Anleihen	4,28 %	Deutschland
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.10.2053	Verbriefungen	2,40 %	Vereinigte Staaten
Europäische Investitionsbank 1,500 % fällig am 15.06.2032	Quasi-staatliche Anleihen	2,17 %	Supranationale Anleihen
Europäische Investitionsbank 3,750 % fällig am 14.02.2033	Quasi-staatliche Anleihen	1,87 %	Supranationale Anleihen
Canada Government International Bond 2,250 % fällig am 01.12.2029	Quasi-staatliche Anleihen	1,77 %	Kanada
United Kingdom Gilt 0,875 % fällig am 31.07.2033	Quasi-staatliche Anleihen	1,41 %	Großbritannien
NTT Finance Corp. 4,239 % fällig am 25.07.2025	Investment-Grade-Anleihen	1,09 %	Japan
UniCredit SpA 5,850 % fällig am 15.11.2027	Investment-Grade-Anleihen	0,98 %	Italien
Verizon Communications, Inc. 1,500 % fällig am 18.09.2030	Investment-Grade-Anleihen	0,98 %	Vereinigte Staaten
New York State Electric & Gas Corp. 5,650 % fällig am 15.08.2028	Investment-Grade-Anleihen	0,90 %	Vereinigte Staaten
Caja Rural de Navarra SCC 3,000 % fällig am 26.04.2027	Gedekte Anleihen und Pfandbriefe	0,89 %	Spanien
Nordea Bank Abp 6,000 % fällig am 02.06.2026	Investment-Grade-Anleihen	0,88 %	Finnland
TDC Net A/S 5,618 % fällig am 06.02.2030	Investment-Grade-Anleihen	0,83 %	Dänemark
CaixaBank S.A. 3,750 % fällig am 07.09.2029	Investment-Grade-Anleihen	0,82 %	Spanien

Für die Zwecke der Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Investitionen des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendet.

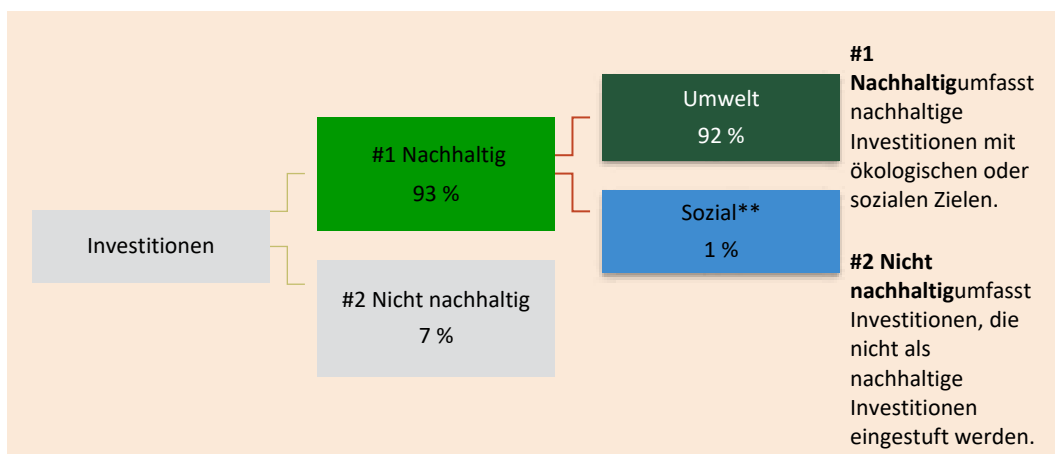
Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum zum 31. Dezember 2023 mit dem Finanzprodukt getätigt wurden



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Informationen über den Anteil der nachhaltigen Investitionen des Fonds zum 31. Dezember 2023 sind nachfolgend aufgeführt.

● *Wie sah die Vermögensallokation aus?*



Zum 31. Dezember 2023 war der Fonds vollständig in nachhaltigen Investitionen investiert, mit Ausnahme der Anlagen, die zu anderen Zwecken wie Liquidität oder Absicherung gehalten wurden.

Zum 31. Dezember 2023 lag der Anteil der nachhaltigen Investitionen bei 93 % des Nettovermögens des Fonds (31. Dezember 2022: 81 %). 92 % des Nettovermögens umfassten nachhaltige Investitionen, die zu einem Umweltziel beitrugen (31. Dezember 2022: 80 %).

**Der Fonds hielt auch 1 % seines Nettovermögens in nachhaltigen Investitionen, die zu einem sozialen Ziel beitragen (31. Dezember 2022: 1 %). Es wird darauf hingewiesen, dass der Fonds sich nicht zu nachhaltigen Investitionen, die zu einem sozialen Ziel beitragen, verpflichtet hat. Daher sollten solche Investitionen als gelegentliche Investitionen betrachtet werden.

Der Fonds investierte 7 % seines Nettovermögens in Anlagen des Fonds, die keine „nachhaltigen Investitionen“ darstellen und für das allgemeine Risikomanagement wie Liquidität oder Absicherung eingesetzt wurden (31. Dezember 2022: 19 %).

● *In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?*

Sektor	% des Nettovermögens
Investment-Grade-Anleihen	49,48 %
Quasi-staatliche Anleihen	42,43 %
Schwellenmärkte, extern	5,47 %
Verbriefungen	4,33 %
Hochverzinsliche Anleihen	3,67 %
Gedeckte Anleihen und Pfandbriefe	1,53 %
Kommunalobligationen	0,17 %
Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	-7,08 %

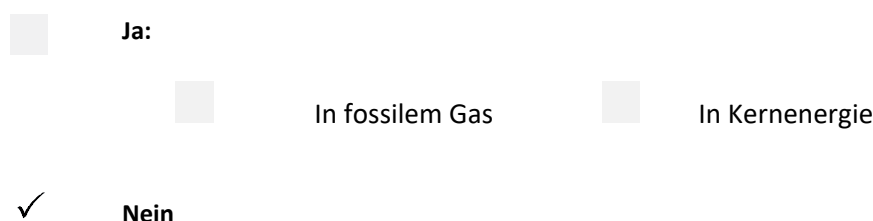
Für die Zwecke der Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Investitionen des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendet.



Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform sind, lag zum 31. Dezember 2023 bei 0 % (31. Dezember 2022: 0 %). Diese Zahl wurde weder von einem Wirtschaftsprüfer noch von sonstigen Dritten überprüft.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?



Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

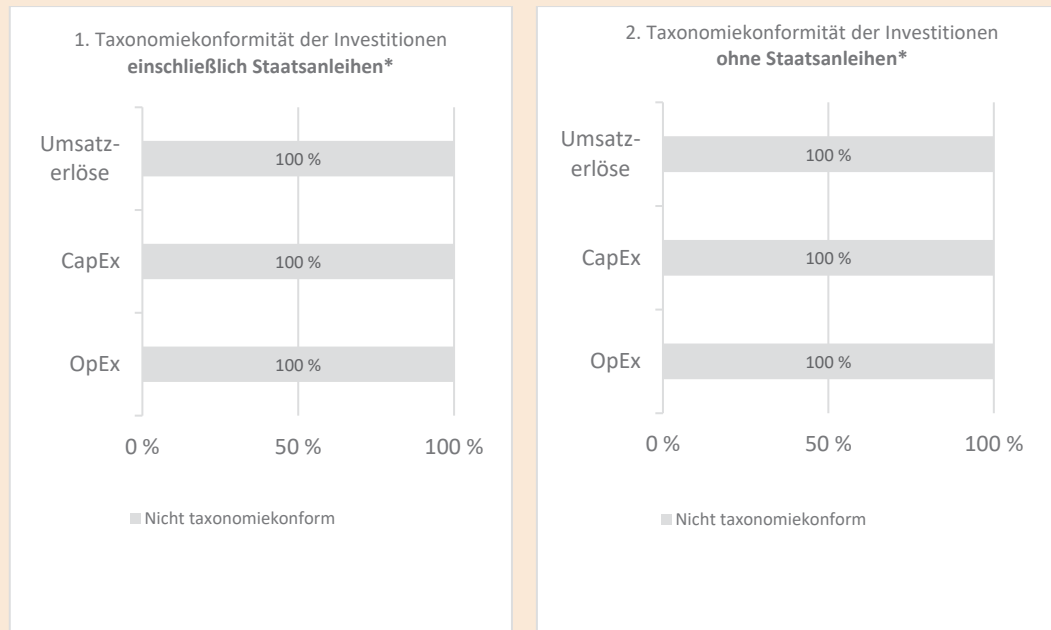
Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Offenlegungen gemäß der Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor und der Taxonomie-Verordnung (ungenüft)

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-Taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Im Bezugszeitraum zum 31. Dezember 2023 lag der Anteil der Investitionen des Fonds in Übergangs- und ermöglichenden Tätigkeiten bei 0 % (31. Dezember 2022: 0 %).



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden?

Der Fonds verpflichtet sich nicht, in Anlagen zu investieren, die mit der EU-Taxonomie konform sind, aber er verpflichtet sich, nachhaltige Investitionen zu tätigen, die zu einem Umweltziel beitragen. Zum 31. Dezember 2023 lag der Anteil der nachhaltigen Investitionen des Fonds, die einen Beitrag zu einem Umweltziel leisteten und nicht gemäß der EU-Taxonomie bewertet wurden, sodass sie oben unter „Andere ökologische Investitionen“ eingestuft wurden, bei 92 % (31. Dezember 2022: 80 %). Weitere Informationen zur Verfügbarkeit nachhaltigkeitsbezogener Daten und der damit verbundenen Herausforderungen finden Sie unter <https://europe.pimco.com/en-eu/our-firm/global-advisors-ireland>.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-Taxonomie nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Wie oben dargelegt, entfielen im Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023, 1 % des Nettovermögens des Fonds auf nachhaltige Investitionen, die zu einem sozialen Ziel beitrugen (31. Dezember 2022: 1 %). Da sich der Fonds nicht zu nachhaltigen Investitionen, die zu einem sozialen Ziel beitragen, verpflichtet hat, sollten solche Anlagen als gelegentliche Anlagen betrachtet werden.



Welche Investitionen fallen unter „nicht nachhaltige Investitionen“, welcher Anlagezweck wird mit ihnen verfolgt und gibt es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

war der Fonds zum 31. Dezember 2023 vollständig in nachhaltigen Investitionen investiert, mit Ausnahme der Anlagen, die zu anderen Zwecken wie Liquidität oder Absicherung gehalten wurden. Wie vorstehend näher ausgeführt, belief sich der Anteil an nachhaltigen Investitionen zum 31. Dezember 2023 auf 93 % des Nettovermögens des Fonds (31. Dezember 2022: 81 %).

Der Anteil der Anlagen des Fonds, der keine „nachhaltigen Investitionen“ darstellte, wurde für das allgemeine Risikomanagement, wie z. B. Liquidität oder Absicherung, eingesetzt. Die zur Erreichung dieser Zwecke eingesetzten Emittenten und Derivate wurden einem ESG-bezogenen Screening unterzogen, um sicherzustellen, dass die relevanten ökologischen und/oder sozialen Mindestschutzmaßnahmen erfüllt werden.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung des nachhaltigen Investitionsziels ergriffen?

Während des Bezugszeitraums wirkte der Anlageberater bei Unternehmen und Emittenten zu wesentlichen klimabezogenen Angelegenheiten mit und versuchte, die Unternehmen zu ermutigen, sich an das Pariser Abkommen zu halten, wissenschaftlich fundierte Ziele zur Reduzierung von Kohlenstoffemissionen zu übernehmen und/oder ihre Nachhaltigkeitsverpflichtungen auf breiter Basis voranzubringen.

ANHANG IV

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Diversified Income ESG Fund

Unternehmenskennung: 549300ECS7VMY4LHDC04

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Ja	<input type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> Nein
<p><input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___ %</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___ %</p>	<p><input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 35% an nachhaltigen Investitionen</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel** <p>**Der Fonds hat während des Berichtszeitraums zwar nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt, er hat sich jedoch nicht dazu verpflichtet, in diese Anlagekategorie zu investieren. Daher sollten derartige Investitionen des Fonds als gelegentliche Investitionen betrachtet werden.</p> <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt</p>

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Ansatz des Fonds für nachhaltige Investitionen besteht in der Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale (auch wenn der Fonds keine nachhaltigen Investitionen zum Ziel hat, ist er bestrebt, einen Teil seines Vermögens in nachhaltige Investitionen zu investieren).

Wie nachstehend näher erläutert, leisteten die vom Fonds im Bezugszeitraum gehaltenen nachhaltigen Investitionen einen Beitrag zu den Umweltzielen der Anpassung an den Klimawandel und/oder des Klimaschutzes.

Die während des Berichtszeitraums vom Fonds gehaltenen Derivate (mit Ausnahme von Indexderivaten) wurden anhand der vom Anlageberater implementierten Ausschlussstrategie überprüft und dementsprechend zur Bewerbung der vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale eingesetzt.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wurde anhand der Umsetzung der Ausschlussstrategie des Anlageberaters, seiner Richtlinie zur Mitwirkung bei den Emittenten und auf der Grundlage der Investitionen in bestimmte festverzinsliche ESG-Wertpapiere (wie im Abschnitt „**Festverzinsliche ESG-Wertpapiere**“ des Prospekts näher beschrieben), die es den Emittenten ermöglichen, Kapital zur Finanzierung von Projekten mit positiven Auswirkungen auf die Umwelt zu beschaffen, gemessen, sowie basierend auf den Investitionen in Schuldtiteln von Emittenten, die bei der Bewältigung von Risiken und Chancen im Zusammenhang mit dem Klimawandel eine Führungsrolle übernehmen.

Beispielsweise führte die Ausschlussstrategie des Fonds zum Ausschluss bestimmter Sektoren, darunter Emittenten, die in Sektoren im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind (einschließlich Emittenten, die hauptsächlich in der Ölindustrie, einschließlich Förderung, Produktion, Raffinerie, Transport oder im Abbau, im Verkauf von Kohle und in der Kohleverstromung tätig sind).

Darüber hinaus bezog sich der Anlageberater im Rahmen des Screening-Verfahrens des Fonds gegebenenfalls auf weltweit anerkannte Standards wie die UNGC-Grundsätze und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte.

● **...und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Informationen zum historischen Vergleich der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen des Fonds sind unten in der Antwort auf die Frage „*Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?*“ dargelegt.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die dem Fonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen trugen im Bezugszeitraum in unterschiedlicher Weise zu den Umweltzielen Klimaschutz und Anpassung an den Klimawandel bei, unter anderem durch Anlagen in festverzinsliche ESG-Wertpapiere (wie im Abschnitt „**Festverzinsliche Wertpapiere**“ des Prospekts näher beschrieben), einschließlich grüner Anleihen.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Die nachhaltigen Investitionen des Fonds wurden dahingehend bewertet, dass sie keinen wesentlichen Schaden für ökologische oder soziale Ziele verursachen. Diese Bewertung erfolgte durch die Anwendung verschiedener negativer Nachhaltigkeitsindikatoren durch den Anlageberater, darunter das Engagement in Sektoren im Bereich der fossilen Brennstoffe (wie oben beschrieben) und Treibhausgasemissionen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Wertpapiere wurden gemäß dem internen Nachhaltigkeits-Screening-Verfahren des Anlageberaters ausgewählt. Dieses Screening-Verfahren beinhaltet die Berücksichtigung nachteiliger Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren, insbesondere das Engagement in Sektoren, die mit fossilen Brennstoffen in Zusammenhang stehen (wie oben beschrieben) und das Engagement im Bereich militärische Waffen. Der Anlageberater war bestrebt, die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen zu mindern, unter anderem durch seine Ausschlussstrategie und seine Mitwirkung bei Emittenten.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Der Anlageberater vergewisserte sich, dass die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Richtlinien für multinationale Unternehmen und den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang stehen, indem er ein UNGC (UN Global Compact)-Kontroversen-Screening zusammen mit anderen Instrumenten, einschließlich ESG-Scores und Research im Rahmen des Due-Diligence-Prozesses für Anlagen einsetzte.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigelegt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen werden als die Auswirkungen von Anlageentscheidungen beschrieben, die „negative Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren nach sich ziehen“, während Nachhaltigkeitsfaktoren als „Umwelt-, Sozial- und Mitarbeiterangelegenheiten, Achtung der Menschenrechte, Bekämpfung von Korruption und Bekämpfung von Bestechung“ definiert werden. Der Anlageberater war bestrebt, die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen im Rahmen des Anlageprozesses zu berücksichtigen, und setzte eine Kombination von Methoden ein, einschließlich Engagement und Ausschlüsse von Emittenten, um die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen zu mindern.

Der Fonds berücksichtigte im Bezugszeitraum die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen von Anlageentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (insbesondere das Engagement in Sektoren im Bereich der fossilen Brennstoffe (wie oben beschrieben), im Sektor der militärischen Waffen und Treibhausgasemissionen).



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Größte Investitionen	Sektor	% des Nettovermögens	Land
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Emerging Markets Bond ESG Fund	Sonstige	6,77 %	Irland
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Global Investment Grade Credit ESG Fund	Investment-Grade-Anleihen	2,73 %	Irland
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 6,500 % fällig am 01.02.2054	Verbriefungen	2,67 %	Vereinigte Staaten
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 6,000% fällig am 01.02.2054	Verbriefungen	1,76 %	Vereinigte Staaten
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.03.2053	Verbriefungen	1,68 %	Vereinigte Staaten
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.04.2053	Verbriefungen	1,65 %	Vereinigte Staaten
Uniform Mortgage-Backed Security 5,500 % fällig am 01.05.2053	Verbriefungen	1,52 %	Vereinigte Staaten
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500% fällig am 01.02.2054	Verbriefungen	1,40 %	Vereinigte Staaten
Panama Government International Bond 6,700 % fällig am 26.01.2036	Schwellenmärkte, extern	1,21 %	Panama
Bank of America Corp. 6,204 % fällig am 10.11.2028	Investment-Grade-Anleihen	1,10 %	Vereinigte Staaten
JPMorgan Chase & Co. 2,580 % fällig am 22.04.2032	Investment-Grade-Anleihen	0,88 %	Vereinigte Staaten
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 4,700 % fällig am 06.06.2032	Schwellenmärkte, extern	0,88 %	Indonesien
Sprint Capital Corp. 8,750 % fällig am 15.03.2032	Investment-Grade-Anleihen	0,86 %	Vereinigte Staaten
U.S. Treasury Bonds 3,875 % fällig am 15.05.2043	Quasi-staatliche Anleihen	0,83 %	Vereinigte Staaten
SBA Communications Corp. 3,125 % fällig am 01.02.2029	Hochverzinsliche Anleihen	0,78 %	Vereinigte Staaten

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum zum 31. Dezember 2023 mit dem Finanzprodukt getätigt wurden

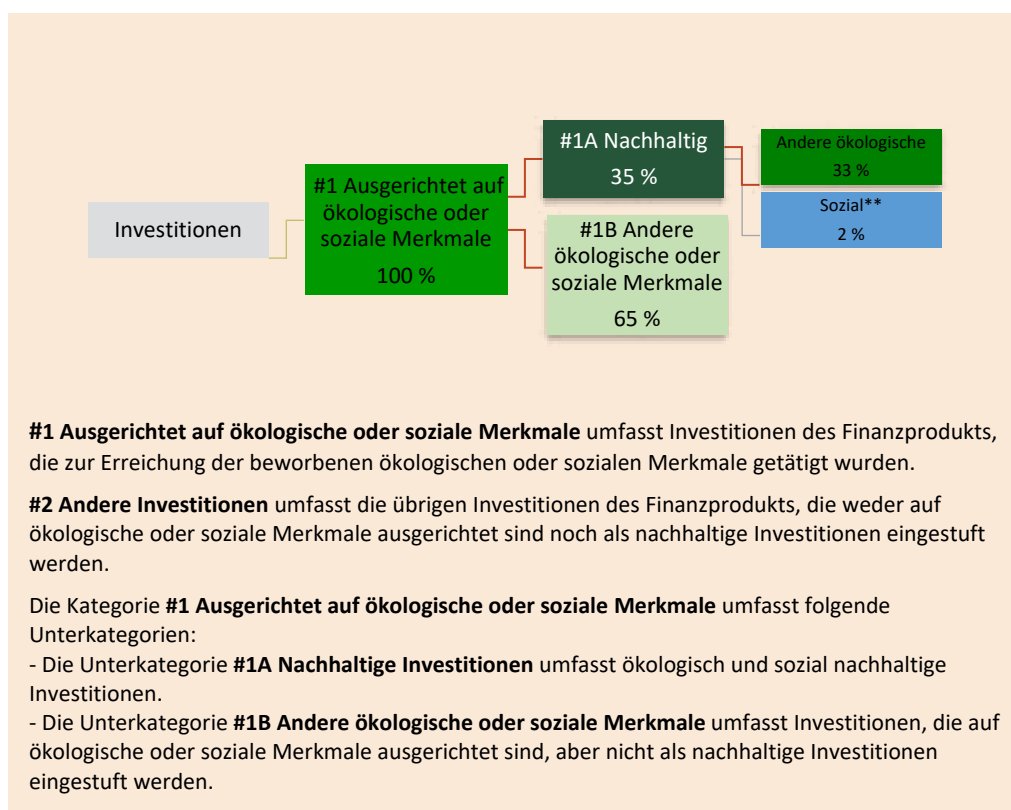
Für die Zwecke der Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Investitionen des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendet.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Informationen über den Anteil des Fonds, mit dem ökologische/soziale Merkmale beworben wurden, und den Anteil an nachhaltigen Investitionen zum 31. Dezember 2023 sind nachfolgend aufgeführt.

● Wie sah die Vermögensallokation aus?



Zum 31. Dezember 2023 wurden 100 % der Investitionen des Fonds als Investitionen angesehen, die ökologische und/oder soziale Merkmale bewerben, da alle Investitionen des Fonds (mit Ausnahme von Indexderivaten) anhand der Ausschlussstrategie geprüft wurden (31. Dezember 2022: 100 %).

Zum 31. Dezember 2023 lag der Anteil der nachhaltigen Investitionen bei 35 % des Nettovermögens des Fonds (31. Dezember 2022: 47 %). 33 % des Nettovermögens umfassten nachhaltige Investitionen, die zu einem Umweltziel beitragen (31. Dezember 2022: 45 %).

**Der Fonds hielt auch 2 % seines Nettovermögens in nachhaltigen Investitionen, die zu einem sozialen Ziel beitragen (31. Dezember 2022: 2 %). Es wird darauf hingewiesen, dass der Fonds sich nicht zu nachhaltigen Investitionen, die zu einem sozialen Ziel beitragen, verpflichtet hat. Daher sollten solche Investitionen als gelegentliche Investitionen betrachtet werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Sektor	% des Nettovermögens
Investment-Grade-Anleihen	34,81 %
Hochverzinsliche Anleihen	27,23 %
Schwellenmärkte, extern	16,79 %
Verbriefungen	11,52 %
Sonstige	6,79 %
Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	1,78 %
Quasi-staatliche Anleihen	0,67 %
Schwellenmärkte, lokal	0,41 %

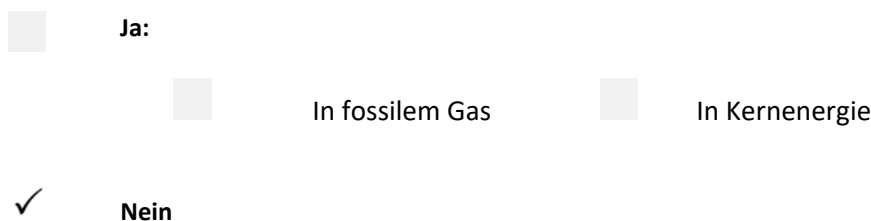
Für die Zwecke der Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Investitionen des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendet.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform sind, lag zum 31. Dezember 2023 bei 0 % (31. Dezember 2022: 0 %). Diese Zahl wurde weder von einem Wirtschaftsprüfer noch von sonstigen Dritten überprüft.

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?**



¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

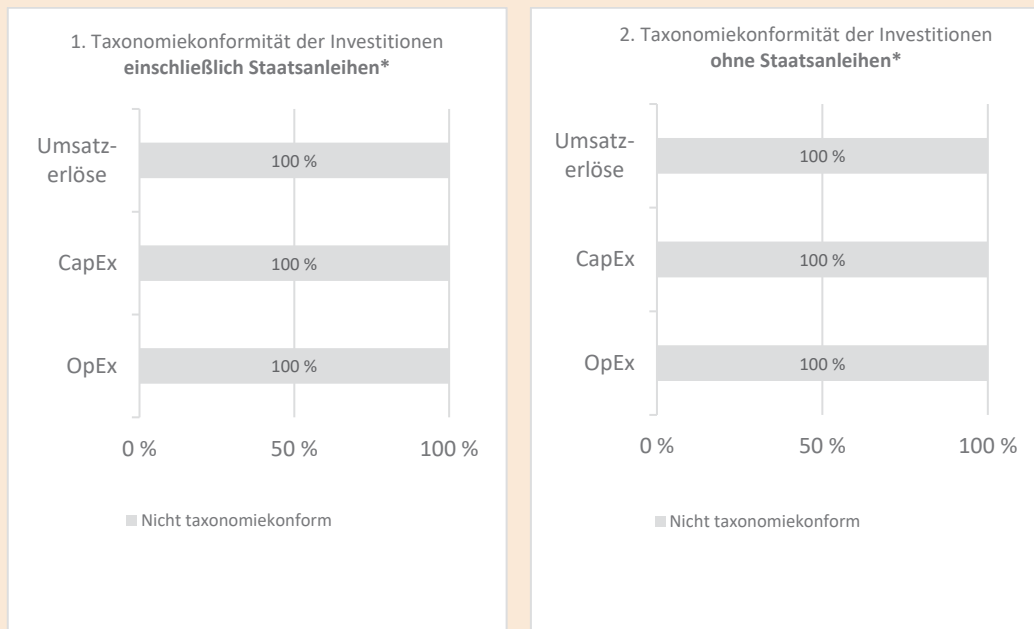
Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Im Bezugszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug der Anteil der Investitionen des Fonds in Übergangs- und ermöglichenden Tätigkeiten 0 % (31. Dezember 2022: 0 %).



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Fonds verpflichtet sich nicht, in Anlagen zu investieren, die mit der EU-Taxonomie konform sind, aber er verpflichtet sich, nachhaltige Investitionen zu tätigen, die zu einem Umweltziel beitragen. Zum 31. Dezember 2023 lag der Anteil der nachhaltigen Investitionen des Fonds, die einen Beitrag zu einem Umweltziel leisteten und nicht gemäß der EU-Taxonomie bewertet wurden, sodass sie oben unter „Andere ökologische Investitionen“ eingestuft wurden, bei 33 % (31. Dezember 2022: 45 %). Weitere Informationen zur Verfügbarkeit nachhaltigkeitsbezogener Daten und der damit verbundenen Herausforderungen finden Sie unter <https://europe.pimco.com/en-eu/our-firm/global-advisors-ireland>.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien nicht berücksichtigen, die für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 erforderlich sind.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Wie oben dargelegt, entfielen im Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 2 % des Nettovermögens des Fonds auf nachhaltige Investitionen, die zu einem sozialen Ziel beitragen (31. Dezember 2022: 2 %). Da sich der Fonds nicht zu nachhaltigen Investitionen, die zu einem sozialen Ziel beitragen, verpflichtet hat, sollten solche Anlagen als gelegentliche Anlagen betrachtet werden.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Wie oben erwähnt, wurde zum 31. Dezember 2023 davon ausgegangen, dass 100 % der Investitionen des Fonds ökologische und/oder soziale Merkmale bewerben, da alle Investitionen des Fonds (mit Ausnahme von Indexderivaten) anhand der Ausschlussstrategie geprüft wurden (31. Dezember 2022: 100 %).

Wie vorstehend näher ausgeführt, belief sich der Anteil an nachhaltigen Investitionen zum 31. Dezember 2023 auf 35 % des Nettovermögens des Fonds (31. Dezember 2022: 47 %).



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Im Bezugszeitraum wirkte der Anlageberater aktiv bei bestimmten Emittenten mit (Beispiele für eine solche aktive Mitwirkung waren wesentliche klima- und biodiversitätsbezogene Angelegenheiten), indem er insbesondere die Emittenten ermutigte, sich an das Pariser Abkommen zu halten, wissenschaftlich fundierte Ziele zur Reduzierung von Kohlenstoffemissionen zu übernehmen und/oder ihre Nachhaltigkeitsverpflichtungen auf breiter Basis voranzutreiben.

ANHANG IV

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Dynamic Multi-Asset Fund

Unternehmenskennung: 549300ZZOV14P64W6594

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___ %

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___ %

Nein

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds bewarb ökologische und/oder soziale Merkmale, indem er eine Ausschlussstrategie verfolgte. Der Fonds bewarb auch ökologische und/oder soziale Merkmale durch aktive Mitwirkung bei bestimmten Emittenten (Beispiele für eine solche Mitwirkung waren wesentliche klima- und biodiversitätsbezogene Angelegenheiten), indem er beispielsweise die Emittenten dazu ermutigte, sich an das Pariser Abkommen zu halten, wissenschaftlich fundierte Ziele zur Reduzierung der Kohlenstoffemissionen zu übernehmen und/oder ihre Nachhaltigkeitsverpflichtungen auf breiter Basis voranzutreiben.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wurde auf der Grundlage der Umsetzung der Ausschlussstrategie des Anlageberaters und der Umsetzung seiner Richtlinie zur Mitwirkung bei den Emittenten gemessen. Die Ausschlussstrategie des Fonds gilt für 100 % seiner Direktanlagen.

So führte die Ausschlussstrategie des Fonds zum Beispiel zum Ausschluss bestimmter Sektoren, einschließlich Emittenten, die hauptsächlich in den Bereichen Kohle und unkonventionelles Öl (wie arktisches Öl und Ölsand) tätig sind. Darüber hinaus bezog sich der Anlageberater gegebenenfalls auf weltweit anerkannte Standards wie die UNGC-Grundsätze.

● **...und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Informationen zum historischen Vergleich der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen des Fonds sind unten in der Antwort auf die Frage „Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?“ dargelegt.



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Größte Investitionen	Sektor	% des Nettovermögens	Land
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2054	Verbriefungen	9,26 %	Vereinigte Staaten
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.02.2054	Verbriefungen	6,19 %	Vereinigte Staaten
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.02.2054	Verbriefungen	5,58 %	Vereinigte Staaten
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 6,000 % fällig am 01.02.2054	Verbriefungen	4,60 %	Vereinigte Staaten
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	4,60 %	Irland
SNCF Reseau 4,500 % fällig am 30.01.2024	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	3,66 %	Frankreich
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Income Fund	Kommunalobligationen/ Sonstige	3,27 %	Irland
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.07.2032	Quasi-staatliche Anleihen	3,22 %	Vereinigte Staaten
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.01.2054	Verbriefungen	3,15 %	Vereinigte Staaten
Japan Treasury Bills (0,257) % fällig am 04.04.2024	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	2,79 %	Japan
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.02.2054	Verbriefungen	2,39 %	Vereinigte Staaten
Oesterreichische Kontrollbank AG 3,990 % fällig am 22.01.2024	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	1,99 %	Österreich
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.01.2054	Verbriefungen	1,78 %	Vereinigte Staaten
Japan Treasury Bills (0,238) % fällig am 15.01.2024	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	1,27 %	Japan
Switzerland Treasury Bills 1,697 % fällig am 14.03.2024	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	0,99 %	Schweiz

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum zum 31. Dezember 2023 mit dem Finanzprodukt getätigt wurden

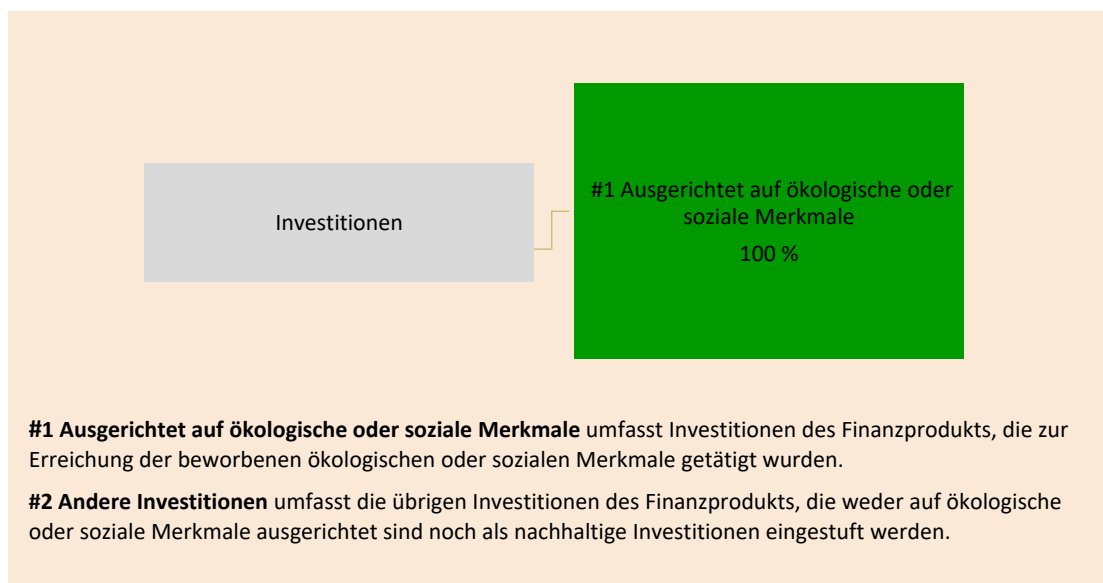
Für die Zwecke der Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Investitionen des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendet.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Informationen über den Anteil des Fonds zum 31. Dezember 2023, mit dem ökologische/soziale Merkmale beworben wurden, sind nachstehend aufgeführt.

● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**



Zum 31. Dezember 2023 wurden 100 % der direkten Investitionen des Fonds als Investitionen angesehen, die ökologische und/oder soziale Merkmale bewerben, da die Ausschlussstrategie des Fonds auf alle seine direkten Investitionen angewendet wurde (31. Dezember 2022: 100 %). Ein ökologischer oder sozialer Mindestschutz wurde nur für solche direkten Investitionen vorgesehen und galt nicht für indirekte Investitionen.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Sektor	% des Nettovermögens
Quasi-staatliche Anleihen	43,53 %
Kommunalobligationen/Sonstige	38,40 %
Verbriefungen	37,84 %
Investment-Grade-Anleihen	8,86 %
Schwellenländer	1,90 %
Hochverzinsliche Anleihen	0,67 %
Kurzfristige Netto-Instrumente	-31,20 %

Für die Zwecke der Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Positionen des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendet.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Zum 31. Dezember 2023 lag der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform sind, bei 0 % (31. Dezember 2022: 0 %). Diese Zahl wurde weder von einem Wirtschaftsprüfer noch von sonstigen Dritten überprüft.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?

Ja:

In fossilem Gas

In Kernenergie

Nein

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

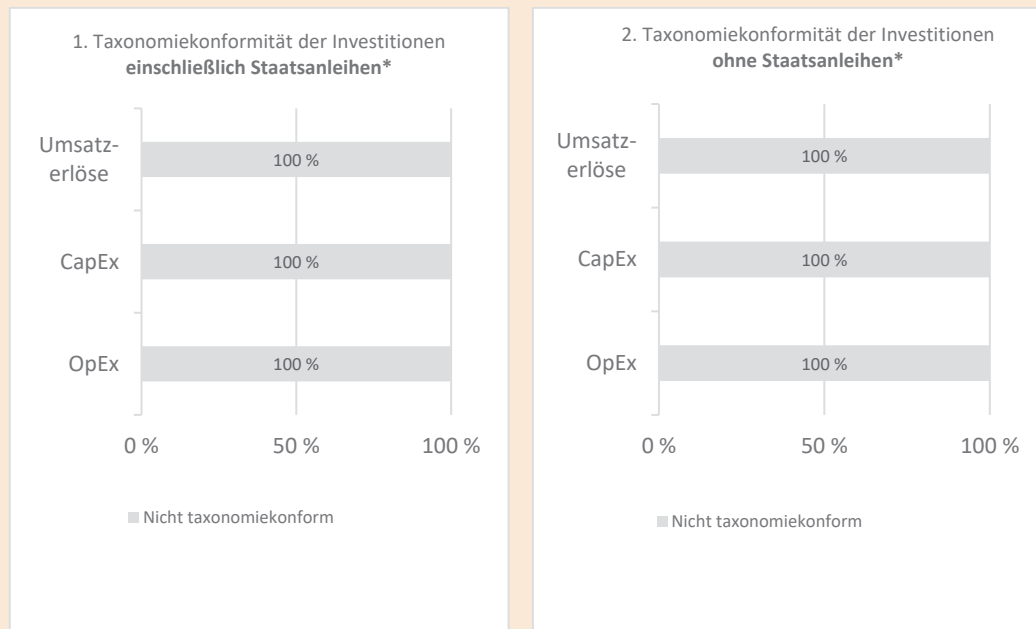
Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Im Bezugszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug der Anteil der Investitionen des Fonds in Übergangs- und ermöglichenden Tätigkeiten 0 % (31. Dezember 2022: 0 %).



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Wie oben dargelegt, wurde zum 31. Dezember 2023 davon ausgegangen, dass 100 % der direkten Investitionen des Fonds ökologische und/oder soziale Merkmale bewerben, da die Ausschlussstrategie des Fonds auf alle seine direkten Investitionen angewendet wurde. (31. Dezember 2022: 100 %).

Ein ökologischer oder sozialer Mindestschutz wurde nur für solche direkten Investitionen vorgesehen und galt nicht für indirekte Investitionen.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Im Bezugszeitraum wirkte der Anlageberater aktiv bei bestimmten Emittenten mit (Beispiele für eine solche aktive Mitwirkung waren wesentliche klima- und biodiversitätsbezogene Angelegenheiten), indem er insbesondere die Emittenten ermutigte, sich an das Pariser Abkommen zu halten, wissenschaftlich fundierte Ziele zur Reduzierung von Kohlenstoffemissionen zu übernehmen und/oder ihre Nachhaltigkeitsverpflichtungen auf breiter Basis voranzutreiben.

ANHANG IV

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Emerging Local Bond ESG Fund Unternehmenskennung: 549300XJ4S7ZD2HUGI18

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___ %

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___ %

Nein

Es wurden damit **ökologische/soziale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 19% an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel**

**Der Fonds hat während des Berichtszeitraums zwar nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt, er hat sich jedoch nicht dazu verpflichtet, in diese Anlagekategorie zu investieren. Daher sollten derartige Investitionen des Fonds als gelegentliche Investitionen betrachtet werden.

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Ansatz des Fonds für nachhaltige Investitionen besteht in der Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale (auch wenn der Fonds keine nachhaltigen Investitionen zum Ziel hat, ist er bestrebt, einen Teil seines Vermögens in nachhaltige Investitionen zu investieren).

Wie nachstehend näher erläutert, leisteten die vom Fonds im Bezugszeitraum gehaltenen nachhaltigen Investitionen einen Beitrag zu den Umweltzielen der Anpassung an den Klimawandel und/oder des Klimaschutzes.

Die während des Berichtszeitraums vom Fonds gehaltenen Derivate (mit Ausnahme von Indexderivaten) wurden anhand der vom Anlageberater implementierten Ausschlussstrategie überprüft und dementsprechend zur Bewerbung der vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale eingesetzt.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wurde anhand der Umsetzung der Ausschlussstrategie des Anlageberaters, seiner Richtlinie zur Mitwirkung bei den Emittenten und auf der Grundlage der Investitionen in bestimmte festverzinsliche ESG-Wertpapiere (wie im Abschnitt „**Festverzinsliche ESG-Wertpapiere**“ des Prospekts näher beschrieben), die es den Emittenten ermöglichen, Kapital zur Finanzierung von Projekten mit positiven Auswirkungen auf die Umwelt zu beschaffen, gemessen, sowie basierend auf den Investitionen in Schuldtiteln von Emittenten, die bei der Bewältigung von Risiken und Chancen im Zusammenhang mit dem Klimawandel eine Führungsrolle übernehmen.

Beispielsweise führte die Ausschlussstrategie des Fonds zum Ausschluss bestimmter Sektoren, darunter Emittenten, die in Sektoren im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind (einschließlich Emittenten, die hauptsächlich in der Ölindustrie, einschließlich Förderung, Produktion, Raffinerie, Transport oder im Abbau, im Verkauf von Kohle und in der Kohleverstromung tätig sind).

Darüber hinaus bezog sich der Anlageberater im Rahmen des Screening-Verfahrens des Fonds gegebenenfalls auf weltweit anerkannte Standards wie die UNGC-Grundsätze und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte.

● **...und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Informationen zum historischen Vergleich der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen des Fonds sind unten in der Antwort auf die Frage „*Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?*“ dargelegt.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die dem Fonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen leisteten im Bezugszeitraum Beiträge zu den Umweltzielen Klimaschutz und Anpassung an den Klimawandel, die unter anderem durch Investitionen in festverzinsliche ESG-Wertpapiere (wie im Abschnitt „**Festverzinsliche ESG-Wertpapiere**“ des Prospekts näher beschrieben), einschließlich grüner Anleihen, erreicht wurden.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Die nachhaltigen Investitionen des Fonds wurden dahingehend bewertet, dass sie keinen wesentlichen Schaden für ökologische oder soziale Ziele verursachen. Diese Bewertung erfolgte durch die Anwendung verschiedener negativer Nachhaltigkeitsindikatoren durch den Anlageberater, darunter das Engagement in Sektoren im Bereich der fossilen Brennstoffe (wie oben beschrieben) und Treibhausgasemissionen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Wertpapiere wurden gemäß dem internen Nachhaltigkeits-Screening-Verfahren des Anlageberaters ausgewählt. Dieses Screening-Verfahren beinhaltet die Berücksichtigung nachteiliger Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren, insbesondere das Engagement in Sektoren, die mit fossilen Brennstoffen in Zusammenhang stehen (wie oben beschrieben) und das Engagement im Bereich militärische Waffen. Der Anlageberater war bestrebt, die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen zu mindern, unter anderem durch seine Ausschlussstrategie und seine Mitwirkung bei Emittenten.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte im Einklang? Nähere Angaben:

Der Anlageberater vergewisserte sich, dass die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Richtlinien für multinationale Unternehmen und den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte im Einklang stehen, indem er ein UNGC (UN Global Compact)-Kontroversen-Screening zusammen mit anderen Instrumenten, einschließlich ESG-Scores und Research im Rahmen des Due-Diligence-Prozesses für Anlagen einsetzte.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen werden als die Auswirkungen von Anlageentscheidungen beschrieben, die „negative Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren nach sich ziehen“, während Nachhaltigkeitsfaktoren als „Umwelt-, Sozial- und Mitarbeiterangelegenheiten, Achtung der Menschenrechte, Bekämpfung von Korruption und Bekämpfung von Bestechung“ definiert werden. Der Anlageberater war bestrebt, die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen im Rahmen des Anlageprozesses zu berücksichtigen, und setzte eine Kombination von Methoden ein, einschließlich Engagement und Ausschlüsse von Emittenten, um die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen zu mindern.

Der Fonds berücksichtigte im Bezugszeitraum die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen von Anlageentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (insbesondere das Engagement in Sektoren im Bereich der fossilen Brennstoffe (wie oben beschrieben), im Sektor der militärischen Waffen und Treibhausgasemissionen).



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Größte Investitionen	Sektor	% des Nettovermögens	Land
South Africa Government International Bond 8,000 % fällig am 31.01.2030	Schwellenländer	3,82 %	Südafrika
Colombian TES 7,000 % fällig am 26.03.2031	Schwellenländer	3,58 %	Kolumbien
Poland Government International Bond 3,750 % fällig am 25.05.2027	Quasi-staatliche Anleihen	2,15 %	Polen
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	Schwellenländer	1,96 %	Südafrika
Hungary Treasury Bills 10,900 % fällig am 04.01.2024	Schwellenländer	1,96 %	Ungarn
Thailand Government International Bond 2,650 % fällig am 17.06.2028	Schwellenländer	1,73 %	Thailand
Thailand Government International Bond 3,390 % fällig am 17.06.2037	Schwellenländer	1,71 %	Thailand
Mexico Government International Bond 7,750 % fällig am 29.05.2031	Schwellenländer	1,69 %	Mexiko
Hungary Government International Bond 4,500 % fällig am 27.05.2032	Schwellenländer	1,67 %	Ungarn
U.S. Treasury Bills 2,070 % fällig am 23.01.2024	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	1,65 %	Vereinigte Staaten
Indonesia Government International Bond 8,250 % fällig am 15.05.2036	Schwellenländer	1,65 %	Indonesien
Peru Government International Bond 7,300 % fällig am 12.08.2033	Schwellenländer	1,65 %	Peru
Mexico Government International Bond 2,750 % fällig am 27.11.2031	Schwellenländer	1,60 %	Mexiko
Czech Republic Government International Bond 0,050 % fällig am 29.11.2029	Quasi-staatliche Anleihen	1,60 %	Tschechien
Poland Government International Bond 6,000 % fällig am 25.10.2033	Quasi-staatliche Anleihen	1,58 %	Polen

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum zum 31. Dezember 2023 mit dem Finanzprodukt getätigt wurden

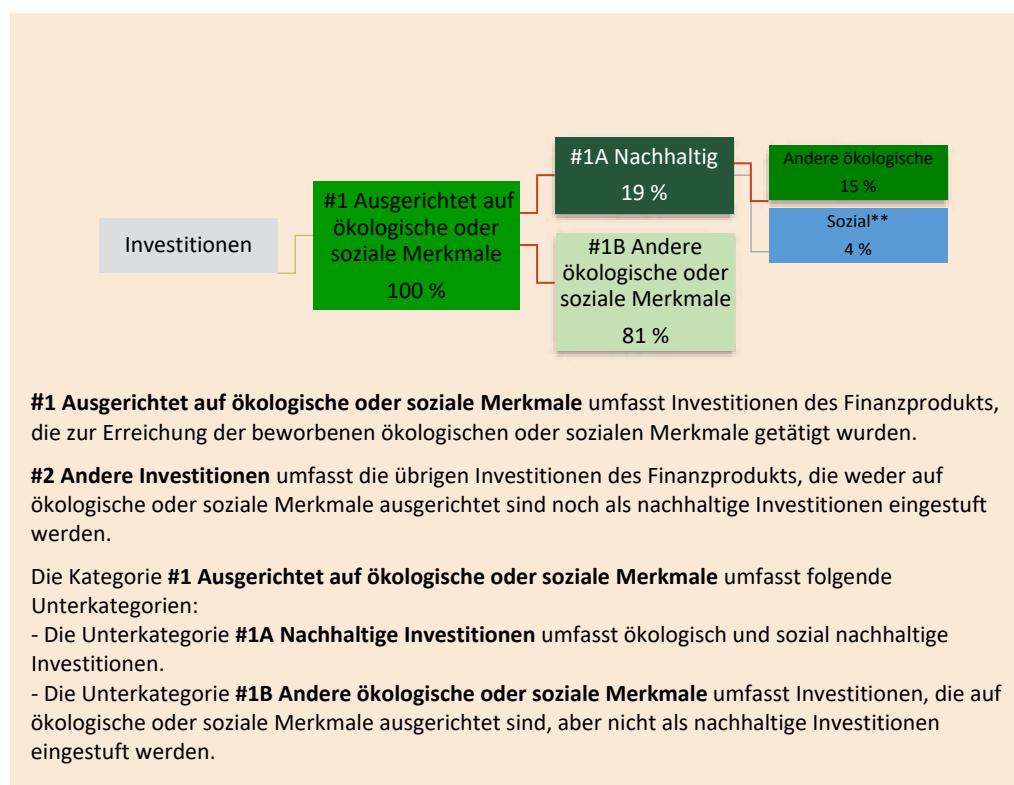
Für die Zwecke der Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Investitionen des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendet.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Informationen über den Anteil des Fonds, mit dem ökologische/soziale Merkmale beworben wurden, und den Anteil an nachhaltigen Investitionen zum 31. Dezember 2023 sind nachfolgend aufgeführt.

● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**



Zum 31. Dezember 2023 wurden 100 % der Investitionen des Fonds als Investitionen angesehen, die ökologische und/oder soziale Merkmale bewerben, da alle Investitionen des Fonds (mit Ausnahme von Indexderivaten) anhand der Ausschlussstrategie geprüft wurden (31. Dezember 2022: 100 %).

Zum 31. Dezember 2023 lag der Anteil der nachhaltigen Investitionen bei 19 % des Nettovermögens des Fonds (31. Dezember 2022: 27 %). 15 % des Nettovermögens umfassten nachhaltige Investitionen, die zu einem Umweltziel beitragen (31. Dezember 2022: 21 %).

**Der Fonds hielt auch 4 % seines Nettovermögens in nachhaltigen Investitionen, die zu einem sozialen Ziel beitragen (31. Dezember 2022: 6 %). Es wird darauf hingewiesen, dass der Fonds sich nicht zu nachhaltigen Investitionen, die zu einem sozialen Ziel beitragen, verpflichtet hat. Daher sollten solche Investitionen als gelegentliche Investitionen betrachtet werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Sektor	% des Nettovermögens
Schwellenländer	59,89 %
Quasi-staatliche Anleihen	28,64 %
Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	11,47 %

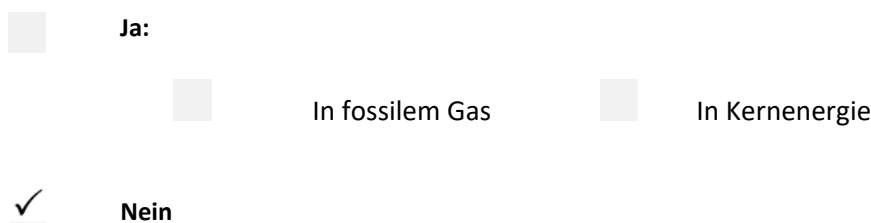
Für die Zwecke der Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Investitionen des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendet.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Zum 31. Dezember 2023 lag der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform sind, bei 0 % (31. Dezember 2022: 0 %). Diese Zahl wurde weder von einem Wirtschaftsprüfer noch von sonstigen Dritten überprüft.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?



Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

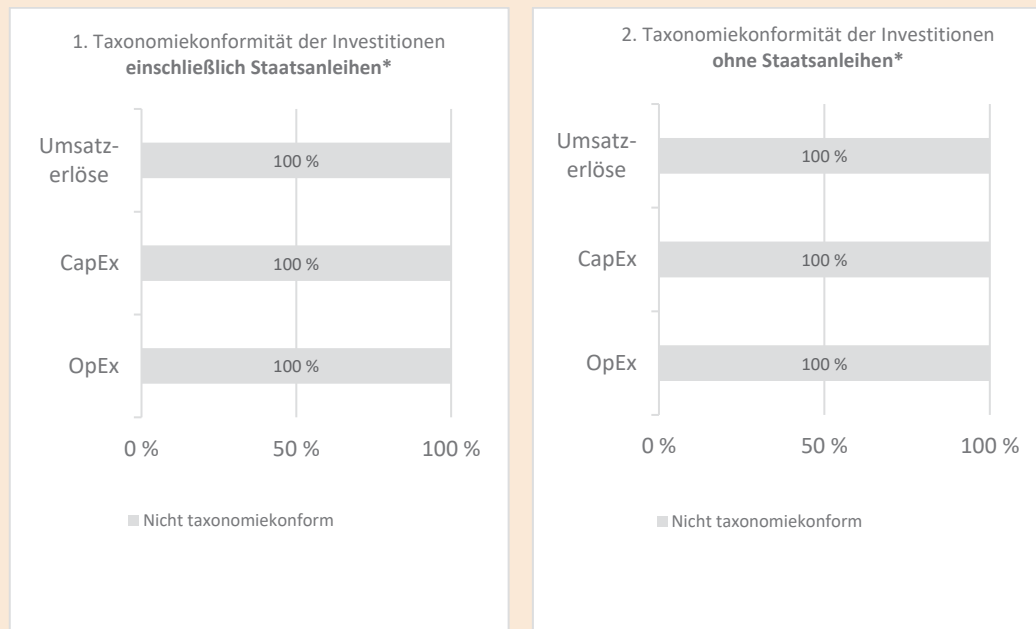
Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Im Bezugszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug der Anteil der Investitionen des Fonds in Übergangs- und ermöglichenden Tätigkeiten 0 % (31. Dezember 2022: 0 %).



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien nicht berücksichtigen**, die für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 erforderlich sind.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Fonds verpflichtet sich nicht, in Anlagen zu investieren, die mit der EU-Taxonomie konform sind, aber er verpflichtet sich, nachhaltige Investitionen zu tätigen, die zu einem Umweltziel beitragen. Zum 31. Dezember 2023 lag der Anteil der nachhaltigen Investitionen des Fonds, die einen Beitrag zu einem Umweltziel leisteten und nicht gemäß der EU-Taxonomie bewertet wurden, sodass sie oben unter „Andere ökologische Investitionen“ eingestuft wurden, bei 15 % (31. Dezember 2022: 21 %). Weitere Informationen zur Verfügbarkeit nachhaltigkeitsbezogener Daten und der damit verbundenen Herausforderungen finden Sie unter <https://europe.pimco.com/en-eu/our-firm/global-advisors-ireland>.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Wie oben dargelegt, entfielen im Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 4 % des Nettovermögens des Fonds auf nachhaltige Investitionen, die zu einem sozialen Ziel beitrugen (31. Dezember 2022: 6 %). Da sich der Fonds nicht zu nachhaltigen Investitionen, die zu einem sozialen Ziel beitragen, verpflichtet hat, sollten solche Anlagen als gelegentliche Anlagen betrachtet werden.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Wie oben erwähnt, wurde zum 31. Dezember 2023 davon ausgegangen, dass 100 % der Investitionen des Fonds ökologische und/oder soziale Merkmale bewerben, da alle Investitionen des Fonds (mit Ausnahme von Indexderivaten) anhand der Ausschlussstrategie geprüft wurden (31. Dezember 2022: 100 %).

Wie vorstehend näher ausgeführt, belief sich der Anteil an nachhaltigen Investitionen zum 31. Dezember 2023 auf 19 % des Nettovermögens des Fonds (31. Dezember 2022: 27 %).



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Im Bezugszeitraum wirkte der Anlageberater aktiv bei bestimmten Emittenten mit (Beispiele für eine solche aktive Mitwirkung waren wesentliche klima- und biodiversitätsbezogene Angelegenheiten), indem er insbesondere die Emittenten ermutigte, sich an das Pariser Abkommen zu halten, wissenschaftlich fundierte Ziele zur Reduzierung von Kohlenstoffemissionen zu übernehmen und/oder ihre Nachhaltigkeitsverpflichtungen auf breiter Basis voranzutreiben.

ANHANG IV

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Emerging Markets Bond ESG Fund Unternehmenskennung: IU161HZ5QHJ5X3UAQ421

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

●● <input type="checkbox"/> Ja	●○ <input checked="" type="checkbox"/> Nein
<p><input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___ %</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___ %</p>	<p><input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 34% an nachhaltigen Investitionen</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel** <p>**Der Fonds hat während des Berichtszeitraums zwar nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt, er hat sich jedoch nicht dazu verpflichtet, in diese Anlagekategorie zu investieren. Daher sollten derartige Investitionen des Fonds als gelegentliche Investitionen betrachtet werden.</p> <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt</p>

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Ansatz des Fonds für nachhaltige Investitionen besteht in der Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale (auch wenn der Fonds keine nachhaltigen Investitionen zum Ziel hat, ist er bestrebt, einen Teil seines Vermögens in nachhaltige Investitionen zu investieren).

Wie nachstehend näher erläutert, leisteten die vom Fonds im Bezugszeitraum gehaltenen nachhaltigen Investitionen einen Beitrag zu den Umweltzielen der Anpassung an den Klimawandel und/oder des Klimaschutzes.

Die während des Berichtszeitraums vom Fonds gehaltenen Derivate (mit Ausnahme von Indexderivaten) wurden anhand der vom Anlageberater implementierten Ausschlussstrategie überprüft und dementsprechend zur Bewerbung der vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale eingesetzt.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wurde anhand der Umsetzung der Ausschlussstrategie des Anlageberaters, seiner Richtlinie zur Mitwirkung bei den Emittenten und auf der Grundlage der Investitionen in bestimmte festverzinsliche ESG-Wertpapiere (wie im Abschnitt „**Festverzinsliche ESG-Wertpapiere**“ des Prospekts näher beschrieben), die es den Emittenten ermöglichen, Kapital zur Finanzierung von Projekten mit positiven Auswirkungen auf die Umwelt zu beschaffen, gemessen, sowie basierend auf den Investitionen in Schuldtiteln von Emittenten, die bei der Bewältigung von Risiken und Chancen im Zusammenhang mit dem Klimawandel eine Führungsrolle übernehmen.

Beispielsweise führte die Ausschlussstrategie des Fonds zum Ausschluss bestimmter Sektoren, darunter Emittenten, die in Sektoren im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind (einschließlich Emittenten, die hauptsächlich in der Ölindustrie, einschließlich Förderung, Produktion, Raffinerie, Transport oder im Abbau, im Verkauf von Kohle und in der Kohleverstromung tätig sind).

Darüber hinaus bezog sich der Anlageberater im Rahmen des Screening-Verfahrens des Fonds gegebenenfalls auf weltweit anerkannte Standards wie die UNGC-Grundsätze und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte.

● **...und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Informationen zum historischen Vergleich der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen des Fonds sind unten in der Antwort auf die Frage „*Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?*“ dargelegt.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die dem Fonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen leisteten im Bezugszeitraum Beiträge zu den Umweltzielen Klimaschutz und Anpassung an den Klimawandel, die unter anderem durch Investitionen in festverzinsliche ESG-Wertpapiere (wie im Abschnitt „**Festverzinsliche ESG-Wertpapiere**“ des Prospekts näher beschrieben), einschließlich grüner Anleihen, erreicht wurden.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Die nachhaltigen Investitionen des Fonds wurden dahingehend bewertet, dass sie keinen wesentlichen Schaden für ökologische oder soziale Ziele verursachen. Diese Bewertung erfolgte durch die Anwendung verschiedener negativer Nachhaltigkeitsindikatoren durch den Anlageberater, darunter das Engagement in Sektoren im Bereich der fossilen Brennstoffe (wie oben beschrieben) und Treibhausgasemissionen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Wertpapiere wurden gemäß dem internen Nachhaltigkeits-Screening-Verfahren des Anlageberaters ausgewählt. Dieses Screening-Verfahren beinhaltet die Berücksichtigung nachteiliger Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren, insbesondere das Engagement in Sektoren, die mit fossilen Brennstoffen in Zusammenhang stehen (wie oben beschrieben) und das Engagement im Bereich militärische Waffen. Der Anlageberater war bestrebt, die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen zu mindern, unter anderem durch seine Ausschlussstrategie und seine Mitwirkung bei Emittenten.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechtein Einklang? Nähere Angaben:

Der Anlageberater vergewisserte sich, dass die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Richtlinien für multinationale Unternehmen und den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte im Einklang stehen, indem er ein UNGC (UN Global Compact)-Kontroversen-Screening zusammen mit anderen Instrumenten, einschließlich ESG-Scores und Research im Rahmen des Due-Diligence-Prozesses für Anlagen einsetzte.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen werden als die Auswirkungen von Anlageentscheidungen beschrieben, die „negative Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren nach sich ziehen“, während Nachhaltigkeitsfaktoren als „Umwelt-, Sozial- und Mitarbeiterangelegenheiten, Achtung der Menschenrechte, Bekämpfung von Korruption und Bekämpfung von Bestechung“ definiert werden. Der Anlageberater war bestrebt, die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen im Rahmen des Anlageprozesses zu berücksichtigen, und setzte eine Kombination von Methoden ein, einschließlich Engagement und Ausschlüsse von Emittenten, um die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen zu mindern.

Der Fonds berücksichtigte im Bezugszeitraum die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen von Anlageentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (insbesondere das Engagement in Sektoren im Bereich der fossilen Brennstoffe (wie oben beschrieben), im Sektor der militärischen Waffen und Treibhausgasemissionen).



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Größte Investitionen	Sektor	% des Nettovermögens	Land
U.S. Treasury Bonds 3,250 % fällig am 15.05.2042	US-Staatsanleihen	1,90 %	Vereinigte Staaten
Hungary Treasury Bills 10,900 % fällig am 04.01.2024	Schwellenländer	1,54 %	Ungarn
Argentina Government International Bond 3,500 % fällig am 09.07.2041	Schwellenländer	1,32 %	Argentinien
Mexico Government International Bond 3,000 % fällig am 03.12.2026	Schwellenländer	1,25 %	Mexiko
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	Schwellenländer	1,20 %	Südafrika
Dominican Republic Government International Bond 5,875 % fällig am 30.01.2060	Schwellenländer	1,01 %	Dominikanische Republik
U.S. Treasury Notes 3,125 % fällig am 31.08.2029	US-Staatsanleihen	0,98 %	Vereinigte Staaten
Mexico Government International Bond 4,875 % fällig am 19.05.2033	Schwellenländer	0,92 %	Mexiko
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.10.2053	Verbriefungen	0,92 %	Vereinigte Staaten
Romania Government International Bond 2,124 % fällig am 16.07.2031	Schwellenländer	0,90 %	Rumänien
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 4,700 % fällig am 06.06.2032	Schwellenländer	0,89 %	Indonesien
Ecuador Government International Bond 3,500 % fällig am 31.07.2035	Schwellenländer	0,88 %	Ecuador
U.S. Treasury Bonds 3,375 % fällig am 15.08.2042	US-Staatsanleihen	0,84 %	Vereinigte Staaten
Uruguay Government International Bond 5,750 % fällig am 28.10.2034	Sonstige	0,84 %	Uruguay
Poland Government International Bond 4,875 % fällig am 04.10.2033	Sonstige	0,83 %	Polen

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum zum 31. Dezember 2023 mit dem Finanzprodukt getätigt wurden

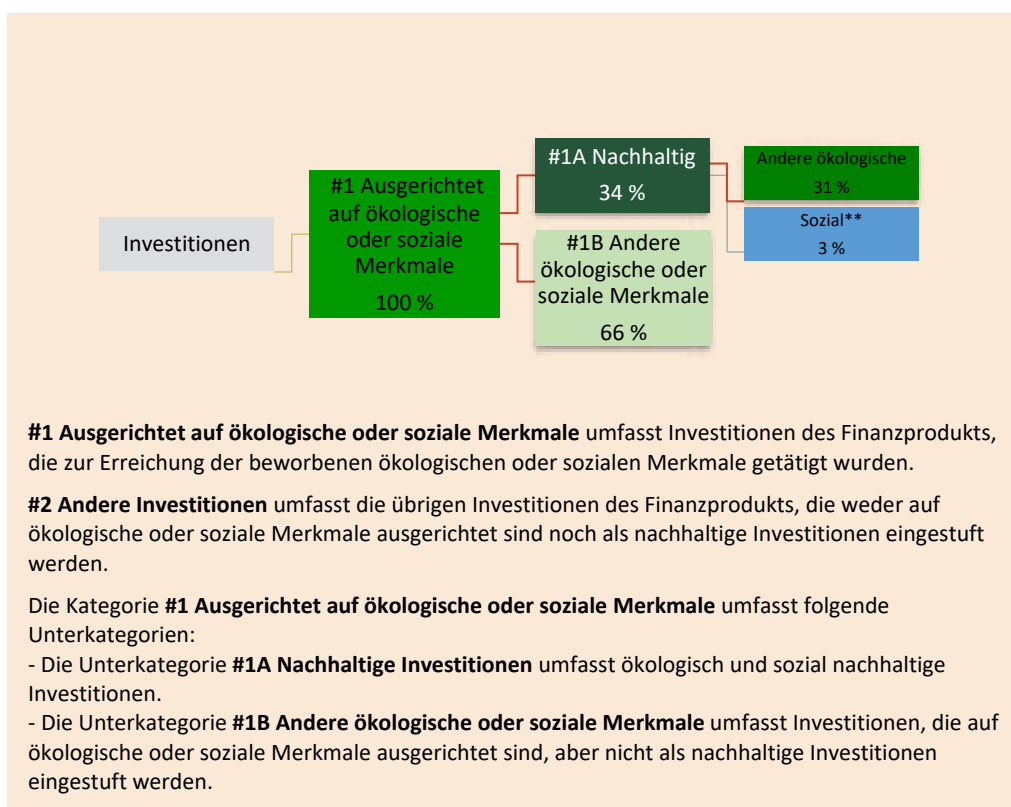
Für die Zwecke der Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Investitionen des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendet.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Informationen über den Anteil des Fonds, mit dem ökologische/soziale Merkmale beworben wurden, und den Anteil an nachhaltigen Investitionen zum 31. Dezember 2023 sind nachfolgend aufgeführt.

● Wie sah die Vermögensallokation aus?



Zum 31. Dezember 2023 wurden 100 % der Investitionen des Fonds als Investitionen angesehen, die ökologische und/oder soziale Merkmale bewerben, da alle Investitionen des Fonds (mit Ausnahme von Indexderivaten) anhand der Ausschlussstrategie geprüft wurden (zum 31. Dezember 2022 betrug der Anteil 100 %).

Zum 31. Dezember 2023 lag der Anteil der nachhaltigen Investitionen bei 34 % des Nettovermögens des Fonds (31. Dezember 2022: 25 %). 31 % des Nettovermögens umfassten nachhaltige Investitionen, die zu einem Umweltziel beitragen (31. Dezember 2022: 23 %).

**Der Fonds hielt auch 3 % seines Nettovermögens in nachhaltigen Investitionen, die zu einem sozialen Ziel beitragen (31. Dezember 2022: 2 %). Es wird darauf hingewiesen, dass der Fonds sich nicht zu nachhaltigen Investitionen, die zu einem sozialen Ziel beitragen, verpflichtet hat. Daher sollten solche Investitionen als gelegentliche Investitionen betrachtet werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Sektor	% des Nettovermögens
Schwellenländer	72,00 %
US-Staatsanleihen	18,30 %
Sonstige	14,05 %
Investment-Grade-Anleihen	11,91 %
Emissionen außerhalb der USA, Industrieländer	4,85 %
Verbriefungen	3,80 %
Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	-24,91 %

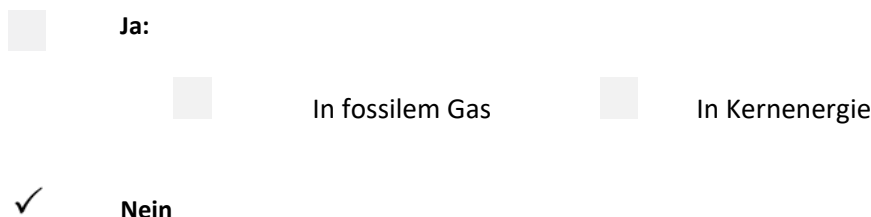
Für die Zwecke der Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Investitionen des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendet.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Zum 31. Dezember 2023 lag der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform sind, bei 0 % (31. Dezember 2022: 0 %). Diese Zahl wurde weder von einem Wirtschaftsprüfer noch von sonstigen Dritten überprüft.

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?**



¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

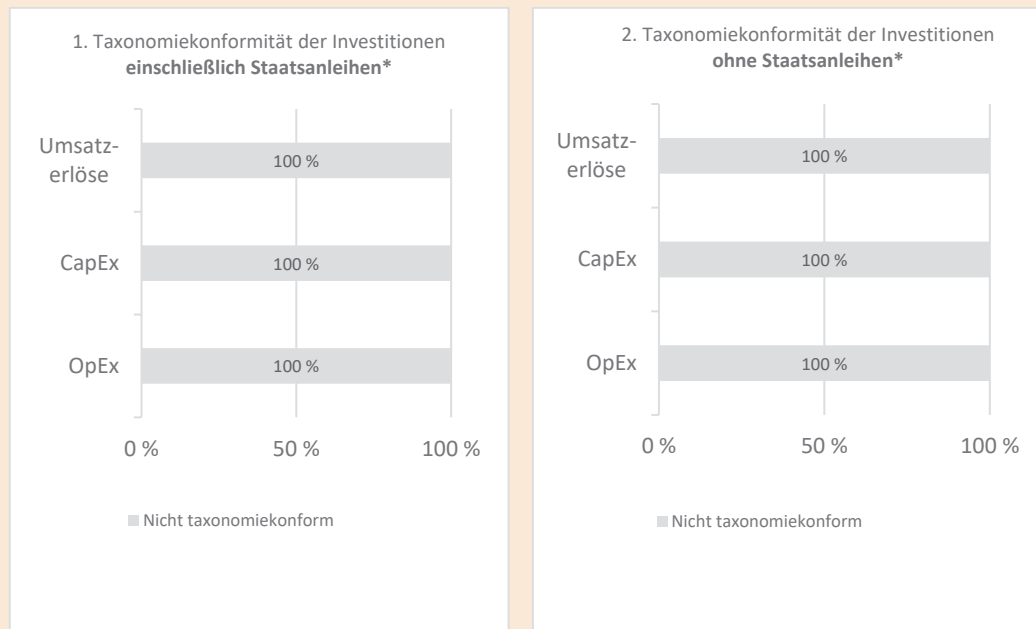
Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Im Bezugszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug der Anteil der Investitionen des Fonds in Übergangs- und ermöglichenden Tätigkeiten 0 % (31. Dezember 2022: 0 %).



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Fonds verpflichtet sich nicht, in Anlagen zu investieren, die mit der EU-Taxonomie konform sind, aber er verpflichtet sich, nachhaltige Investitionen zu tätigen, die zu einem Umweltziel beitragen. Zum 31. Dezember 2023 lag der Anteil der nachhaltigen Investitionen des Fonds, die einen Beitrag zu einem Umweltziel leisteten und nicht gemäß der EU-Taxonomie bewertet wurden, sodass sie oben unter „Andere ökologische Investitionen“ eingestuft wurden, bei 31 % (31. Dezember 2022: 23 %). Weitere Informationen zur Verfügbarkeit nachhaltigkeitsbezogener Daten und der damit verbundenen Herausforderungen finden Sie unter <https://europe.pimco.com/en-eu/our-firm/global-advisors-ireland>.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien nicht berücksichtigen**, die für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 erforderlich sind.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Wie oben dargelegt, entfielen im Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 3 % des Nettovermögens des Fonds auf nachhaltige Investitionen, die zu einem sozialen Ziel beitragen (31. Dezember 2022: 2 %). Da sich der Fonds nicht zu nachhaltigen Investitionen, die zu einem sozialen Ziel beitragen, verpflichtet hat, sollten solche Anlagen als gelegentliche Anlagen betrachtet werden.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Wie oben erwähnt, wurde zum 31. Dezember 2023 davon ausgegangen, dass 100 % der Investitionen des Fonds ökologische und/oder soziale Merkmale bewerben, da alle Investitionen des Fonds (mit Ausnahme von Indexderivaten) anhand der Ausschlussstrategie geprüft wurden (31. Dezember 2022: 100 %).

Wie vorstehend näher ausgeführt, belief sich der Anteil an nachhaltigen Investitionen zum 31. Dezember 2023 auf 34 % des Nettovermögens des Fonds (31. Dezember 2022: 25 %).



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Im Bezugszeitraum wirkte der Anlageberater aktiv bei bestimmten Emittenten mit (Beispiele für eine solche aktive Mitwirkung waren wesentliche klima- und biodiversitätsbezogene Angelegenheiten), indem er insbesondere die Emittenten ermutigte, sich an das Pariser Abkommen zu halten, wissenschaftlich fundierte Ziele zur Reduzierung von Kohlenstoffemissionen zu übernehmen und/oder ihre Nachhaltigkeitsverpflichtungen auf breiter Basis voranzutreiben.

ANHANG IV

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: PIMCO ESG Income Fund

Unternehmenskennung: 549300TKMFF4LMUCRB73

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___ %

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___ %

Nein

Es wurden damit **ökologische/soziale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 57 % an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel*

**Der Fonds hat während des Berichtszeitraums zwar nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt, er hat sich jedoch nicht dazu verpflichtet, in diese Anlagekategorie zu investieren. Daher sollten derartige Investitionen des Fonds als gelegentliche Investitionen betrachtet werden.

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Ansatz des Fonds für nachhaltige Investitionen besteht in der Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale (auch wenn der Fonds keine nachhaltigen Investitionen zum Ziel hat, ist er bestrebt, einen Teil seines Vermögens in nachhaltige Investitionen zu investieren).

Wie nachstehend näher erläutert, leisteten die vom Fonds im Bezugszeitraum gehaltenen nachhaltigen Investitionen einen Beitrag zu den Umweltzielen der Anpassung an den Klimawandel und/oder des Klimaschutzes.

Die während des Berichtszeitraums vom Fonds gehaltenen Derivate (mit Ausnahme von Indexderivaten) wurden anhand der vom Anlageberater implementierten Ausschlussstrategie überprüft und dementsprechend zur Bewerbung der vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale eingesetzt.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wurde anhand der Umsetzung der Ausschlussstrategie des Anlageberaters, seiner Richtlinie zur Mitwirkung bei den Emittenten und auf der Grundlage der Investitionen in bestimmte festverzinsliche ESG-Wertpapiere (wie im Abschnitt „**Festverzinsliche ESG-Wertpapiere**“ des Prospekts näher beschrieben), die es den Emittenten ermöglichen, Kapital zur Finanzierung von Projekten mit positiven Auswirkungen auf die Umwelt zu beschaffen, gemessen, sowie basierend auf den Investitionen in Schuldtiteln von Emittenten, die bei der Bewältigung von Risiken und Chancen im Zusammenhang mit dem Klimawandel eine Führungsrolle übernehmen.

Beispielsweise führte die Ausschlussstrategie des Fonds zum Ausschluss bestimmter Sektoren, darunter Emittenten, die in Sektoren im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind (einschließlich Emittenten, die hauptsächlich in der Ölindustrie, einschließlich Förderung, Produktion, Raffinerie, Transport oder im Abbau, im Verkauf von Kohle und in der Kohleverstromung tätig sind).

Darüber hinaus bezog sich der Anlageberater im Rahmen des Screening-Verfahrens des Fonds gegebenenfalls auf weltweit anerkannte Standards wie die UNGC-Grundsätze und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte.

● **...und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Informationen zum historischen Vergleich der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen des Fonds sind unten in der Antwort auf die Frage „*Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?*“ dargelegt.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die dem Fonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen leisteten im Bezugszeitraum Beiträge zu den Umweltzielen Klimaschutz und Anpassung an den Klimawandel, die unter anderem durch Investitionen in festverzinsliche ESG-Wertpapiere (wie im Abschnitt „**Festverzinsliche ESG-Wertpapiere**“ des Prospekts näher beschrieben), einschließlich grüner Anleihen, erreicht wurden.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Die nachhaltigen Investitionen des Fonds wurden dahingehend bewertet, dass sie keinen wesentlichen Schaden für ökologische oder soziale Ziele verursachen. Diese Bewertung erfolgte durch die Anwendung verschiedener negativer Nachhaltigkeitsindikatoren durch den Anlageberater, darunter das Engagement in Sektoren im Bereich der fossilen Brennstoffe (wie oben beschrieben) und Treibhausgasemissionen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Wertpapiere wurden gemäß dem internen Nachhaltigkeits-Screening-Verfahren des Anlageberaters ausgewählt. Dieses Screening-Verfahren beinhaltet die Berücksichtigung nachteiliger Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren, insbesondere das Engagement in Sektoren, die mit fossilen Brennstoffen in Zusammenhang stehen (wie oben beschrieben) und das Engagement im Bereich militärische Waffen. Der Anlageberater war bestrebt, die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen zu mindern, unter anderem durch seine Ausschlussstrategie und seine Mitwirkung bei Emittenten.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Der Anlageberater vergewisserte sich, dass die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Richtlinien für multinationale Unternehmen und den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang stehen, indem er ein UNGC (UN Global Compact)-Kontroversen-Screening zusammen mit anderen Instrumenten, einschließlich ESG-Scores und Research im Rahmen des Due-Diligence-Prozesses für Anlagen einsetzte.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen werden als die Auswirkungen von Anlageentscheidungen beschrieben, die „negative Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren nach sich ziehen“, während Nachhaltigkeitsfaktoren als „Umwelt-, Sozial- und Mitarbeiterangelegenheiten, Achtung der Menschenrechte, Bekämpfung von Korruption und Bekämpfung von Bestechung“ definiert werden. Der Anlageberater war bestrebt, die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen im Rahmen des Anlageprozesses zu berücksichtigen, und setzte eine Kombination von Methoden ein, einschließlich Engagement und Ausschlüsse von Emittenten, um die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen zu mindern.

Der Fonds berücksichtigte im Bezugszeitraum die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen von Anlageentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (insbesondere das Engagement in Sektoren im Bereich der fossilen Brennstoffe (wie oben beschrieben), im Sektor der militärischen Waffen und Treibhausgasemissionen).



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Größte Investitionen	Sektor	% des Nettovermögens	Land
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.08.2053	Verbriefungen	8,51 %	Vereinigte Staaten
Uniform Mortgage-Backed Security 5,500 % fällig am 01.06.2053	Verbriefungen	7,76 %	Vereinigte Staaten
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.08.2053	Verbriefungen	5,11 %	Vereinigte Staaten
Uniform Mortgage-Backed Security 5,500 % fällig am 01.08.2053	Verbriefungen	2,88 %	Vereinigte Staaten
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 6,000% fällig am 01.02.2054	Verbriefungen	2,77 %	Vereinigte Staaten
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125% fällig am 15.01.2032	US-Staatsanleihen	2,23 %	Vereinigte Staaten
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 6,500 % fällig am 01.02.2054	Verbriefungen	2,08 %	Vereinigte Staaten
Towd Point Mortgage Funding PLC 5,891 % fällig am 20.10.2051	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	1,41 %	Großbritannien
EMF-UK PLC 6,319 % fällig am 13.03.2046	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	1,32 %	Großbritannien
TDC Net A/S 5,618 % fällig am 06.02.2030	Emissionen außerhalb der USA, Industrieländer	1,14 %	Dänemark
Fannie Mae 3,500 % fällig am 01.08.2059	Verbriefungen	1,00 %	Vereinigte Staaten
Great Hall Mortgages PLC 5,599 % fällig am 18.06.2038	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	0,93 %	Großbritannien
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.01.2025	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	0,93 %	Vereinigte Staaten
Ginnie Mae 5,500 % fällig am 20.07.2053	Verbriefungen	0,92 %	Vereinigte Staaten
Ginnie Mae, TBA 5,000 % fällig am 01.01.2054	Verbriefungen	0,92 %	Vereinigte Staaten

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum zum 31. Dezember 2023 mit dem Finanzprodukt getätigt wurden

Für die Zwecke der Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Investitionen des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendet.

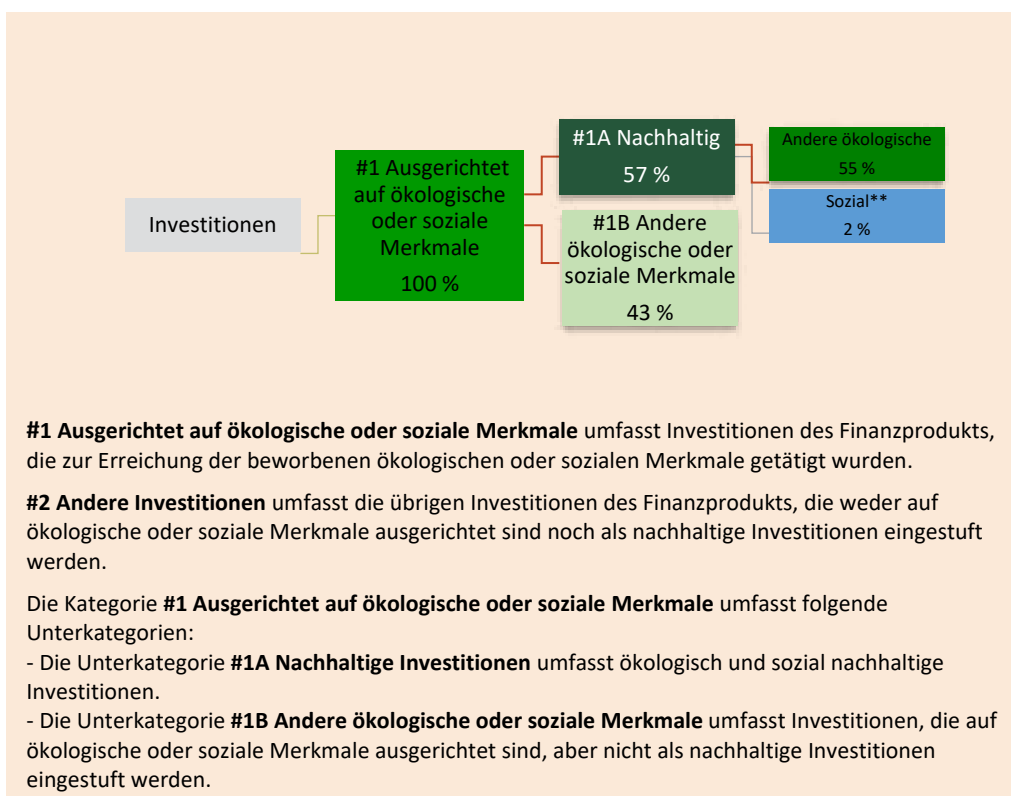


Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Informationen über den Anteil des Fonds, mit dem ökologische/soziale Merkmale beworben wurden, und den Anteil an nachhaltigen Investitionen zum 31. Dezember 2023 sind nachfolgend aufgeführt.

● Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.



Zum 31. Dezember 2023 wurden 100 % der Investitionen des Fonds als Investitionen angesehen, die ökologische und/oder soziale Merkmale bewerben, da alle Investitionen des Fonds (mit Ausnahme von Indexderivaten) anhand der Ausschlussstrategie geprüft wurden (31. Dezember 2022: 100 %).

Zum 31. Dezember 2023 lag der Anteil der nachhaltigen Investitionen bei 57 % des Nettovermögens des Fonds (31. Dezember 2022: 32 %). 55 % des Nettovermögens umfassten nachhaltige Investitionen, die zu einem Umweltziel beitragen (31. Dezember 2022: 30 %).

**Der Fonds hielt auch 2 % seines Nettovermögens in nachhaltigen Investitionen, die zu einem sozialen Ziel beitragen (31. Dezember 2022: 2 %). Es wird darauf hingewiesen, dass der Fonds sich nicht zu nachhaltigen Investitionen, die zu einem sozialen Ziel beitragen, verpflichtet hat. Daher sollten solche Investitionen als gelegentliche Investitionen betrachtet werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Sektor	% des Nettovermögens
Verbriefungen	53,29 %
US-Staatsanleihen	27,99 %
Investment-Grade-Anleihen	19,03 %
Hochverzinsliche Anleihen	3,32 %
Schwellenländer	2,91 %
Sonstige	0,21 %
Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	-0,48 %
Emissionen außerhalb der USA, Industrieländer	-6,27 %

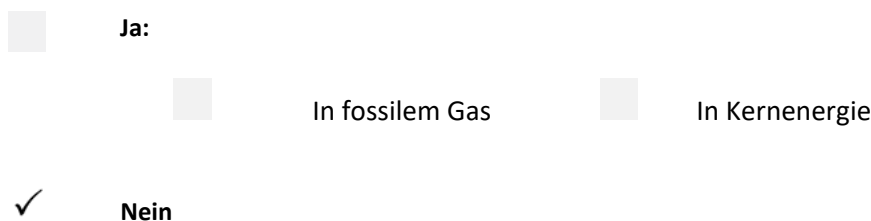
Für die Zwecke der Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Investitionen des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendet.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Zum 31. Dezember 2023 lag der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform sind, bei 0 % (31. Dezember 2022: 0 %). Diese Zahl wurde weder von einem Wirtschaftsprüfer noch von sonstigen Dritten überprüft.

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?**



¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

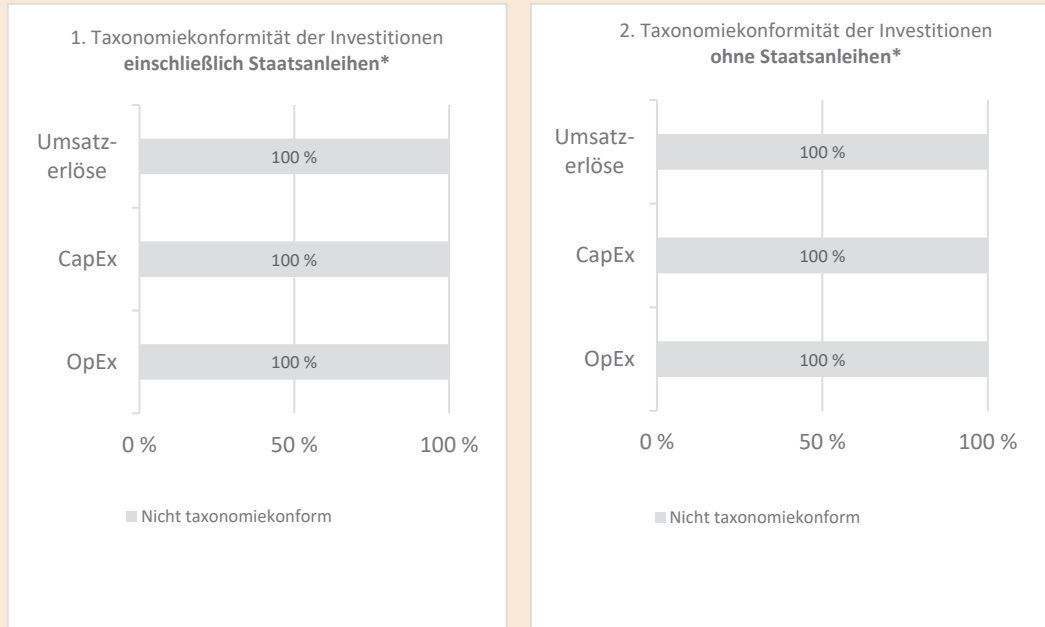
Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.


● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Im Bezugszeitraum zum 31. Dezember 2023 lag der Anteil der Investitionen des Fonds in Übergangs- und ermöglichenden Tätigkeiten bei 0 % (zum 31. Dezember 2022 betrug er 0 %).



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Fonds verpflichtet sich nicht, in Anlagen zu investieren, die mit der EU-Taxonomie konform sind, aber er verpflichtet sich, nachhaltige Investitionen zu tätigen, die zu einem Umweltziel beitragen. Zum 31. Dezember 2023 lag der Anteil der nachhaltigen Investitionen des Fonds, die einen Beitrag zu einem Umweltziel leisteten und nicht gemäß der EU-Taxonomie bewertet wurden, sodass sie oben unter „Andere ökologische Investitionen“ eingestuft wurden, bei 55 % (31. Dezember 2022: 30 %). Weitere Informationen zur Verfügbarkeit nachhaltigkeitsbezogener Daten und der damit verbundenen Herausforderungen finden Sie unter <https://europe.pimco.com/en-eu/our-firm/global-advisors-ireland>.

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien nicht berücksichtigen**, die für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 erforderlich sind.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Wie oben dargelegt, entfielen im Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 2 % des Nettovermögens des Fonds auf nachhaltige Investitionen, die zu einem sozialen Ziel beitragen (31. Dezember 2022: 2 %). Da sich der Fonds nicht zu nachhaltigen Investitionen, die zu einem sozialen Ziel beitragen, verpflichtet hat, sollten solche Anlagen als gelegentliche Anlagen betrachtet werden.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Wie oben erwähnt, wurde zum 31. Dezember 2023 davon ausgegangen, dass 100 % der Investitionen des Fonds ökologische und/oder soziale Merkmale bewerben, da alle Investitionen des Fonds (mit Ausnahme von Indexderivaten) anhand der Ausschlussstrategie geprüft wurden (31. Dezember 2022: 100 %).

Wie vorstehend näher ausgeführt, belief sich der Anteil an nachhaltigen Investitionen zum 31. Dezember 2023 auf 57 % des Nettovermögens des Fonds (31. Dezember 2022: 32 %).



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Im Bezugszeitraum wirkte der Anlageberater aktiv bei bestimmten Emittenten mit (Beispiele für eine solche aktive Mitwirkung waren wesentliche klima- und biodiversitätsbezogene Angelegenheiten), indem er insbesondere die Emittenten ermutigte, sich an das Pariser Abkommen zu halten, wissenschaftlich fundierte Ziele zur Reduzierung von Kohlenstoffemissionen zu übernehmen und/oder ihre Nachhaltigkeitsverpflichtungen auf breiter Basis voranzutreiben.

ANHANG IV

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Euro Bond Fund

Unternehmenskennung: U8E5120AOPVSYI2B4U46

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___ %

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___ %

Nein

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds bewarb ökologische und/oder soziale Merkmale, indem er eine Ausschlussstrategie verfolgte. Der Fonds bewarb auch ökologische und/oder soziale Merkmale durch aktive Mitwirkung bei bestimmten Emittenten (Beispiele für eine solche Mitwirkung waren wesentliche klima- und biodiversitätsbezogene Angelegenheiten), indem er beispielsweise die Emittenten dazu ermutigte, sich an das Pariser Abkommen zu halten, wissenschaftlich fundierte Ziele zur Reduzierung der Kohlenstoffemissionen zu übernehmen und/oder ihre Nachhaltigkeitsverpflichtungen auf breiter Basis voranzutreiben.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wurde auf der Grundlage der Umsetzung der Ausschlussstrategie des Anlageberaters und der Umsetzung seiner Richtlinie zur Mitwirkung bei den Emittenten gemessen. Die Ausschlussstrategie des Fonds gilt für 100 % seiner Direktanlagen.

So führte die Ausschlussstrategie des Fonds zum Beispiel zum Ausschluss bestimmter Sektoren, einschließlich Emittenten, die hauptsächlich in den Bereichen Kohle und unkonventionelles Öl (wie arktisches Öl und Ölsand) tätig sind. Darüber hinaus bezog sich der Anlageberater gegebenenfalls auf weltweit anerkannte Standards wie die UNGC-Grundsätze.

● **...und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Informationen zum historischen Vergleich der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen des Fonds sind unten in der Antwort auf die Frage „Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?“ dargelegt.



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Größte Investitionen	Sektor	% des Nettovermögens	Land
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	9,82 %	Irland
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 6,000 % fällig am 01.02.2054	Verbriefungen	3,07 %	Vereinigte Staaten
France Government International Bond 2,750 % fällig am 25.02.2029	Quasi-staatliche Anleihen	2,99 %	Frankreich
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.02.2054	Verbriefungen	2,90 %	Vereinigte Staaten
Japan Treasury Bills (0,245) % fällig am 04.03.2024	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	2,78 %	Japan
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.02.2054	Verbriefungen	2,55 %	Vereinigte Staaten
Japan Treasury Bills (0,216) % fällig am 22.01.2024	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	2,20 %	Japan
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,100 % fällig am 01.02.2029	Quasi-staatliche Anleihen	2,18 %	Italien
France Government International Bond 2,500 % fällig am 24.09.2026	Quasi-staatliche Anleihen	2,00 %	Frankreich
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 6,500 % fällig am 01.02.2054	Verbriefungen	1,97 %	Vereinigte Staaten
Japan Treasury Bills (0,174) % fällig am 18.03.2024	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	1,84 %	Japan
Spain Government International Bond 0,600 % fällig am 31.10.2029	Quasi-staatliche Anleihen	1,70 %	Spanien
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,625 % fällig am 15.10.2027	Quasi-staatliche Anleihen	1,58 %	Vereinigte Staaten
Japan Treasury Bills (0,206) % fällig am 13.02.2024	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	1,28 %	Japan
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,750 % fällig am 01.07.2024	Quasi-staatliche Anleihen	1,20 %	Italien

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum zum 31. Dezember 2023 mit dem Finanzprodukt getätigt wurden

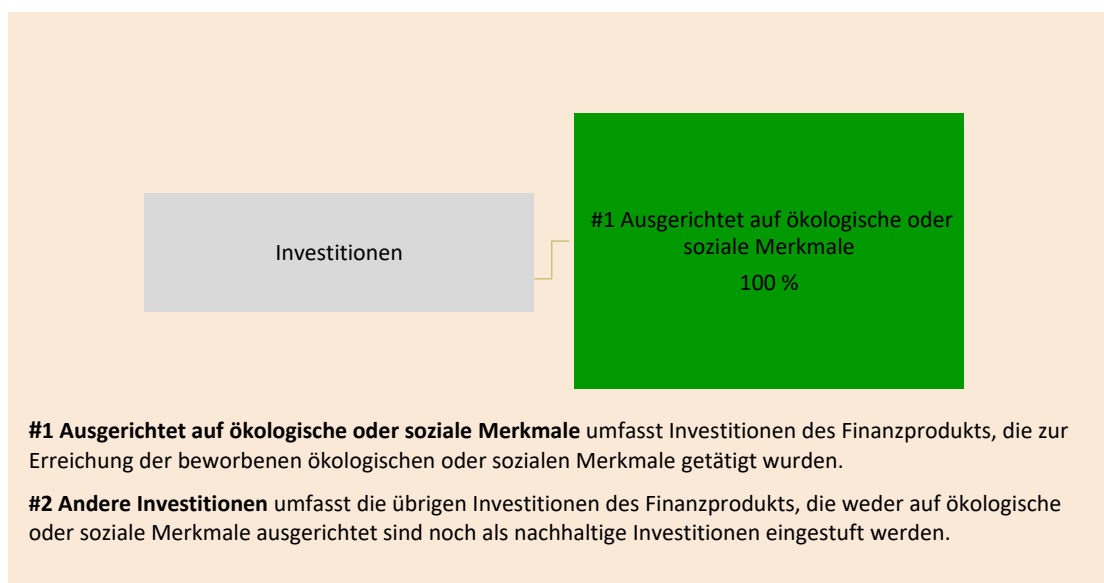
Für die Zwecke der Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Investitionen des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendet.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Informationen über den Anteil des Fonds zum 31. Dezember 2023, mit dem ökologische/soziale Merkmale beworben wurden, sind nachstehend aufgeführt.

● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**



Zum 31. Dezember 2023 wurden 100 % der direkten Investitionen des Fonds als Investitionen angesehen, die ökologische und/oder soziale Merkmale bewerben, da die Ausschlussstrategie des Fonds auf alle seine direkten Investitionen angewendet wurde (31. Dezember 2022: 100 %). Ein ökologischer oder sozialer Mindestschutz wurde nur für solche direkten Investitionen vorgesehen und galt nicht für indirekte Investitionen.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Sektor	% des Nettovermögens
Quasi-staatliche Anleihen	66,02 %
Verbriefungen	12,81 %
Investment-Grade-Anleihen	11,84 %
Hochverzinsliche Anleihen	1,31 %
Schwellenländer	1,88 %
Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	6,14 %

Für die Zwecke der Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Positionen des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendet.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Zum 31. Dezember 2023 lag der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform sind, bei 0 % (31. Dezember 2022: 0 %). Diese Zahl wurde weder von einem Wirtschaftsprüfer noch von sonstigen Dritten überprüft.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?

Ja:

In fossilem Gas

In Kernenergie

Nein

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

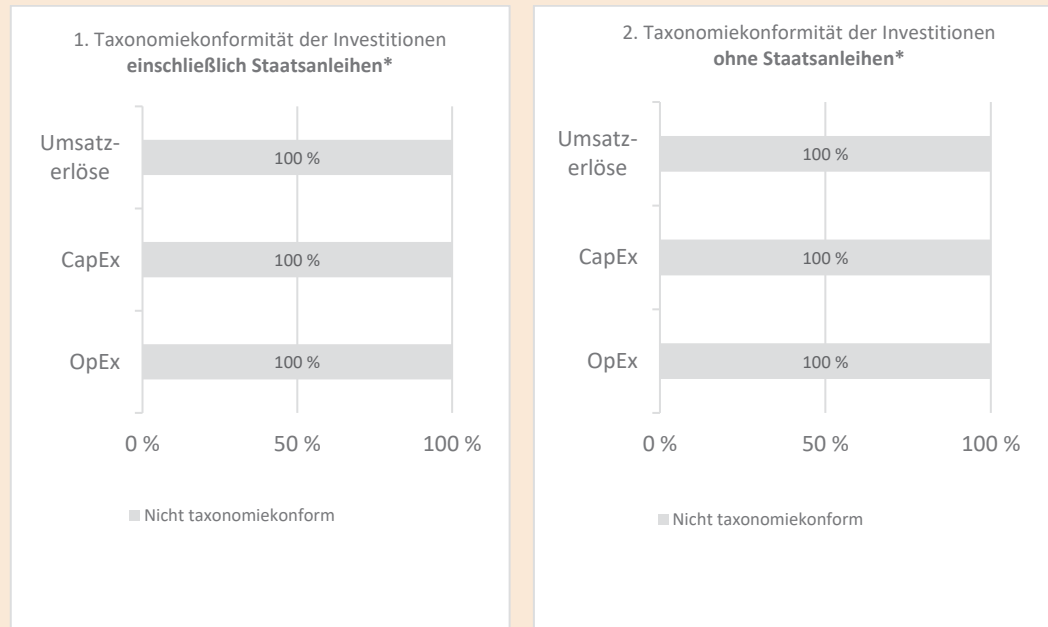
Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Im Bezugszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug der Anteil der Investitionen des Fonds in Übergangs- und ermöglichenden Tätigkeiten 0 % (31. Dezember 2022: 0 %).



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Wie oben dargelegt, wurde zum 31. Dezember 2023 davon ausgegangen, dass 100 % der direkten Investitionen des Fonds ökologische und/oder soziale Merkmale bewerben, da die Ausschlussstrategie des Fonds auf alle seine direkten Investitionen angewendet wurde. (31. Dezember 2022: 100 %).

Ein ökologischer oder sozialer Mindestschutz wurde nur für solche direkten Investitionen vorgesehen und galt nicht für indirekte Investitionen.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Im Bezugszeitraum wirkte der Anlageberater aktiv bei bestimmten Emittenten mit (Beispiele für eine solche aktive Mitwirkung waren wesentliche klima- und biodiversitätsbezogene Angelegenheiten), indem er insbesondere die Emittenten ermutigte, sich an das Pariser Abkommen zu halten, wissenschaftlich fundierte Ziele zur Reduzierung von Kohlenstoffemissionen zu übernehmen und/oder ihre Nachhaltigkeitsverpflichtungen auf breiter Basis voranzutreiben.

ANHANG IV

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Euro Credit Fund

Unternehmenskennung: RJV2Q25HZY9ZSGZSMB60

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___ %

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___ %

Nein

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds bewarb ökologische und/oder soziale Merkmale, indem er eine Ausschlussstrategie verfolgte. Der Fonds bewarb auch ökologische und/oder soziale Merkmale durch aktive Mitwirkung bei bestimmten Emittenten (Beispiele für eine solche Mitwirkung waren wesentliche klima- und biodiversitätsbezogene Angelegenheiten), indem er beispielsweise die Emittenten dazu ermutigte, sich an das Pariser Abkommen zu halten, wissenschaftlich fundierte Ziele zur Reduzierung der Kohlenstoffemissionen zu übernehmen und/oder ihre Nachhaltigkeitsverpflichtungen auf breiter Basis voranzutreiben.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wurde auf der Grundlage der Umsetzung der Ausschlussstrategie des Anlageberaters und der Umsetzung seiner Richtlinie zur Mitwirkung bei den Emittenten gemessen. Die Ausschlussstrategie des Fonds gilt für 100 % seiner Direktanlagen.

So führte die Ausschlussstrategie des Fonds zum Beispiel zum Ausschluss bestimmter Sektoren, einschließlich Emittenten, die hauptsächlich in den Bereichen Kohle und unkonventionelles Öl (wie arktisches Öl und Ölsand) tätig sind. Darüber hinaus bezog sich der Anlageberater gegebenenfalls auf weltweit anerkannte Standards wie die UNGC-Grundsätze.

● **...und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Informationen zum historischen Vergleich der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen des Fonds sind unten in der Antwort auf die Frage „Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?“ dargelegt.



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Größte Investitionen	Sektor	% des Nettovermögens	Land
Europäische Union 0,000 % fällig am 04.10.2030	Quasi-staatliche Anleihen	2,44 %	Supranationale Anleihen
Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 3,000 % fällig am 15.12.2028	Quasi-staatliche Anleihen	2,10 %	Luxemburg
BNP Paribas S.A. 2,750 % fällig am 25.07.2028	Investment-Grade-Anleihen	1,95 %	Frankreich
Europäische Investitionsbank 0,050 % fällig am 13.10.2034	Quasi-staatliche Anleihen	1,79 %	Supranationale Anleihen
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	1,77 %	Irland
Europäische Union 2,750 % fällig am 04.02.2033	Quasi-staatliche Anleihen	1,43 %	Supranationale Anleihen
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.02.2054	Verbriefungen	1,37 %	Vereinigte Staaten
Region Ile de France 3,050 % fällig am 03.02.2033	Quasi-staatliche Anleihen	1,36 %	Frankreich
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 6,500 % fällig am 01.02.2054	Verbriefungen	1,26 %	Vereinigte Staaten
BPCE S.A. 0,500 % fällig am 15.09.2027	Investment-Grade-Anleihen	1,24 %	Frankreich
Europäische Union 0,400 % fällig am 04.02.2037	Quasi-staatliche Anleihen	1,23 %	Supranationale Anleihen
Europäische Investitionsbank 2,250 % fällig am 15.03.2030	Quasi-staatliche Anleihen	1,22 %	Supranationale Anleihen
International Development Association 1,750 % fällig am 05.05.2037	Quasi-staatliche Anleihen	1,21 %	Supranationale Anleihen
Europäische Union 1,500 % fällig am 04.10.2035	Quasi-staatliche Anleihen	1,21 %	Supranationale Anleihen
Europäische Union 0,450 % fällig am 04.07.2041	Quasi-staatliche Anleihen	1,19 %	Supranationale Anleihen

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum zum 31. Dezember 2023 mit dem Finanzprodukt getätigt wurden

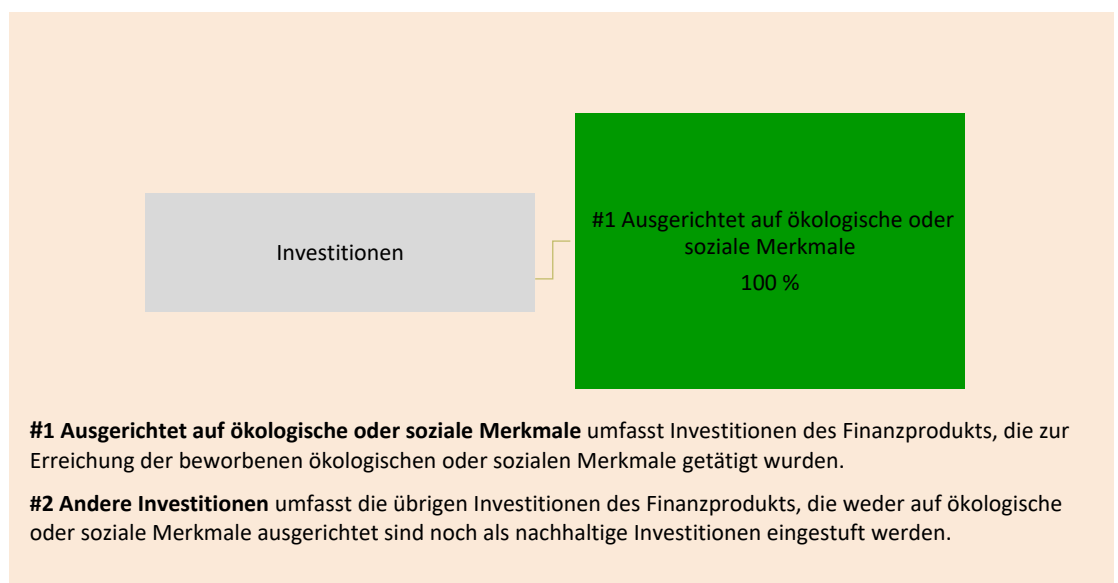
Für die Zwecke der Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Investitionen des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendet.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Informationen über den Anteil des Fonds zum 31. Dezember 2023, mit dem ökologische/soziale Merkmale beworben wurden, sind nachstehend aufgeführt.

● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**



Zum 31. Dezember 2023 wurden 100 % der direkten Investitionen des Fonds als Investitionen angesehen, die ökologische und/oder soziale Merkmale bewerben, da die Ausschlussstrategie des Fonds auf alle seine direkten Investitionen angewendet wurde (31. Dezember 2022: 100 %). Ein ökologischer oder sozialer Mindestschutz wurde nur für solche direkten Investitionen vorgesehen und galt nicht für indirekte Investitionen.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Sektor	% des Nettovermögens
Investment-Grade-Anleihen	58,29 %
Quasi-staatliche Anleihen	37,71 %
Verbriefungen	6,37 %
Schwellenländer	2,11 %
Hochverzinsliche Anleihen	1,51 %
Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	-5,99 %

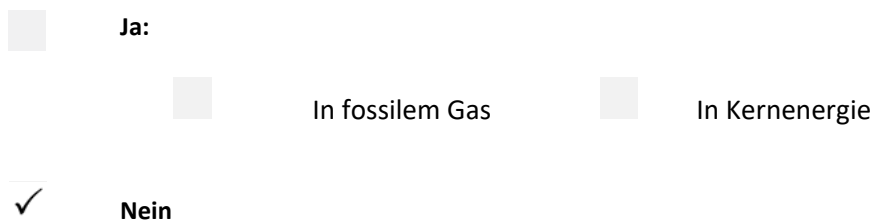
Für die Zwecke der Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Positionen des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendet.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Zum 31. Dezember 2023 lag der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform sind, bei 0 % (zum 31. Dezember 2022 betrug der Anteil 0 %). Diese Zahl wurde weder von einem Wirtschaftsprüfer noch von sonstigen Dritten überprüft.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?



Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

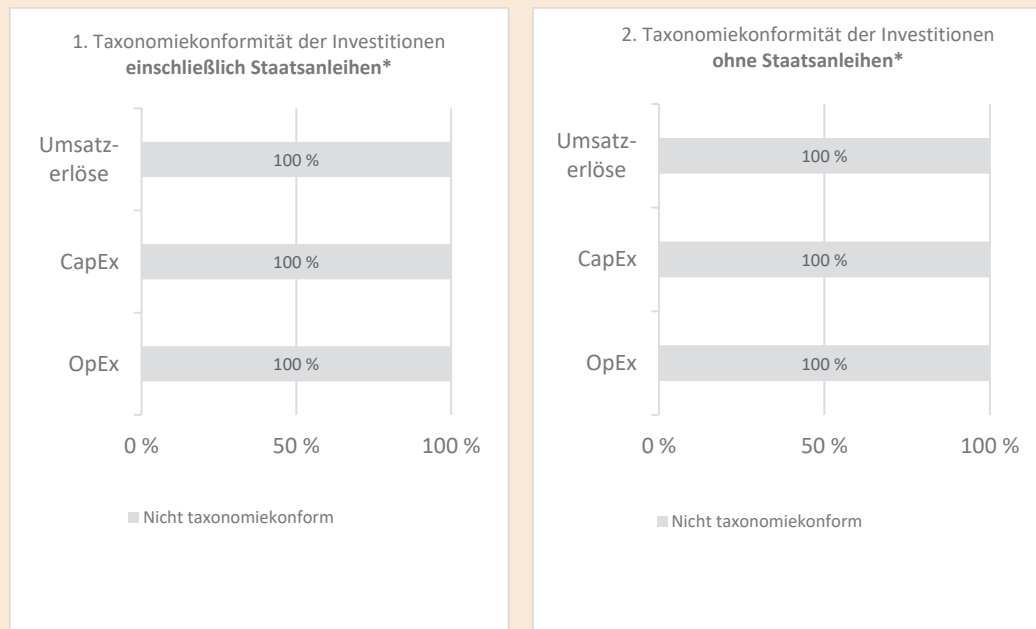
Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Im Bezugszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug der Anteil der Investitionen des Fonds in Übergangs- und ermöglichenden Tätigkeiten 0 % (31. Dezember 2022: 0 %).



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Wie oben dargelegt, wurde zum 31. Dezember 2023 davon ausgegangen, dass 100 % der direkten Investitionen des Fonds ökologische und/oder soziale Merkmale bewerben, da die Ausschlussstrategie des Fonds auf alle seine direkten Investitionen angewendet wurde. (31. Dezember 2022: 100 %).

Ein ökologischer oder sozialer Mindestschutz wurde nur für solche direkten Investitionen vorgesehen und galt nicht für indirekte Investitionen.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Im Bezugszeitraum wirkte der Anlageberater aktiv bei bestimmten Emittenten mit (Beispiele für eine solche aktive Mitwirkung waren wesentliche klima- und biodiversitätsbezogene Angelegenheiten), indem er insbesondere die Emittenten ermutigte, sich an das Pariser Abkommen zu halten, wissenschaftlich fundierte Ziele zur Reduzierung von Kohlenstoffemissionen zu übernehmen und/oder ihre Nachhaltigkeitsverpflichtungen auf breiter Basis voranzutreiben.

ANHANG IV

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Euro Income Bond Fund

Unternehmenskennung: SEK18YSZLD2OP25KSR60

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

●● <input type="checkbox"/> Ja	●○ <input checked="" type="checkbox"/> Nein
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___ % <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind 	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___ %	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds bewarb ökologische und/oder soziale Merkmale, indem er eine Ausschlussstrategie verfolgte. Der Fonds bewarb auch ökologische und/oder soziale Merkmale durch aktive Mitwirkung bei bestimmten Emittenten (Beispiele für eine solche Mitwirkung waren wesentliche klima- und biodiversitätsbezogene Angelegenheiten), indem er beispielsweise die Emittenten dazu ermutigte, sich an das Pariser Abkommen zu halten, wissenschaftlich fundierte Ziele zur

Reduzierung der Kohlenstoffemissionen zu übernehmen und/oder ihre Nachhaltigkeitsverpflichtungen auf breiter Basis voranzutreiben.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wurde auf der Grundlage der Umsetzung der Ausschlussstrategie des Anlageberaters und der Umsetzung seiner Richtlinie zur Mitwirkung bei den Emittenten gemessen. Die Ausschlussstrategie des Fonds gilt für 100 % seiner Direktanlagen.

So führte die Ausschlussstrategie des Fonds zum Beispiel zum Ausschluss bestimmter Sektoren, einschließlich Emittenten, die hauptsächlich in den Bereichen Kohle und unkonventionelles Öl (wie arktisches Öl und Ölsand) tätig sind. Darüber hinaus bezog sich der Anlageberater gegebenenfalls auf weltweit anerkannte Standards wie die UNGC-Grundsätze.

● **...und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Informationen zum historischen Vergleich der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen des Fonds sind unten in der Antwort auf die Frage „Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?“ dargelegt.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Größte Investitionen	Sektor	% des Nettovermögens	Land
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 6,000 % fällig am 01.02.2054	Verbriefungen	17,77 %	Vereinigte Staaten
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.01.2054	Verbriefungen	12,01 %	Vereinigte Staaten
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.01.2054	Verbriefungen	9,81 %	Vereinigte Staaten
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	8,37 %	Irland
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 6,500 % fällig am 01.02.2054	Verbriefungen	3,70 %	Vereinigte Staaten
Japan Treasury Bills (0,271) % fällig am 09.01.2024	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	3,38 %	Japan
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2054	Verbriefungen	2,18 %	Vereinigte Staaten
Jupiter Mortgage PLC 6,621 % fällig am 20.07.2060	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	2,06 %	Großbritannien
Bridgeway Funding PLC 7,470 % fällig am 16.10.2062	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	2,02 %	Großbritannien
Barclays PLC 7,437 % fällig am 02.11.2033	Investment-Grade-Anleihen	1,76 %	Großbritannien
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO European High Yield Bond Fund	Hochverzinsliche Anleihen	1,22 %	Irland
Japan Treasury Bills (0,305) % fällig am 09.01.2024	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	1,16 %	Japan
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.03.2054	Verbriefungen	1,12 %	Vereinigte Staaten
Dutch Property Finance BV 4,852 % fällig am 28.04.2064	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	1,11 %	Niederlande
Intesa Sanpaolo SpA 8,248 % fällig am 21.11.2033	Investment-Grade-Anleihen	1,01 %	Italien

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum zum 31. Dezember 2023 mit dem Finanzprodukt getätigt wurden

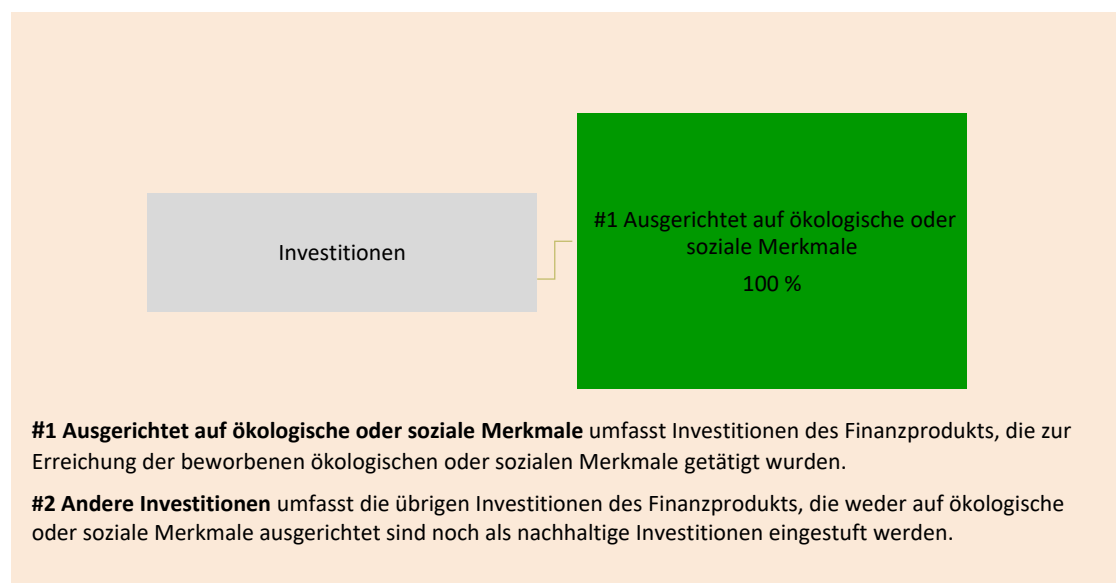
Für die Zwecke der Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Investitionen des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendet.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Informationen über den Anteil des Fonds zum 31. Dezember 2023, mit dem ökologische/soziale Merkmale beworben wurden, sind nachstehend aufgeführt.

● *Wie sah die Vermögensallokation aus?*



Zum 31. Dezember 2023 wurden 100 % der direkten Investitionen des Fonds als Investitionen angesehen, die ökologische und/oder soziale Merkmale bewerben, da die Ausschlussstrategie des Fonds auf alle seine direkten Investitionen angewendet wurde (31. Dezember 2022: 100 %). Ein ökologischer oder sozialer Mindestschutz wurde nur für solche direkten Investitionen vorgesehen und galt nicht für indirekte Investitionen.

● *In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?*

Sektor	% des Nettovermögens
Investment-Grade-Anleihen	25,56 %
Quasi-staatliche Anleihen	7,37 %
Hochverzinsliche Anleihen	6,64 %
Schwellenländer	5,70 %
Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	-2,89 %

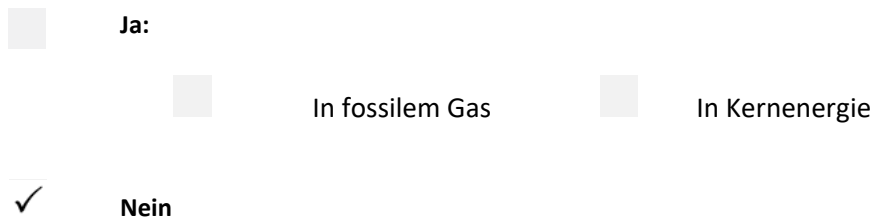
Für die Zwecke der Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Positionen des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendet.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Zum 31. Dezember 2023 lag der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform sind, bei 0 % (31. Dezember 2022: 0 %). Diese Zahl wurde weder von einem Wirtschaftsprüfer noch von sonstigen Dritten überprüft.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?



¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten

wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

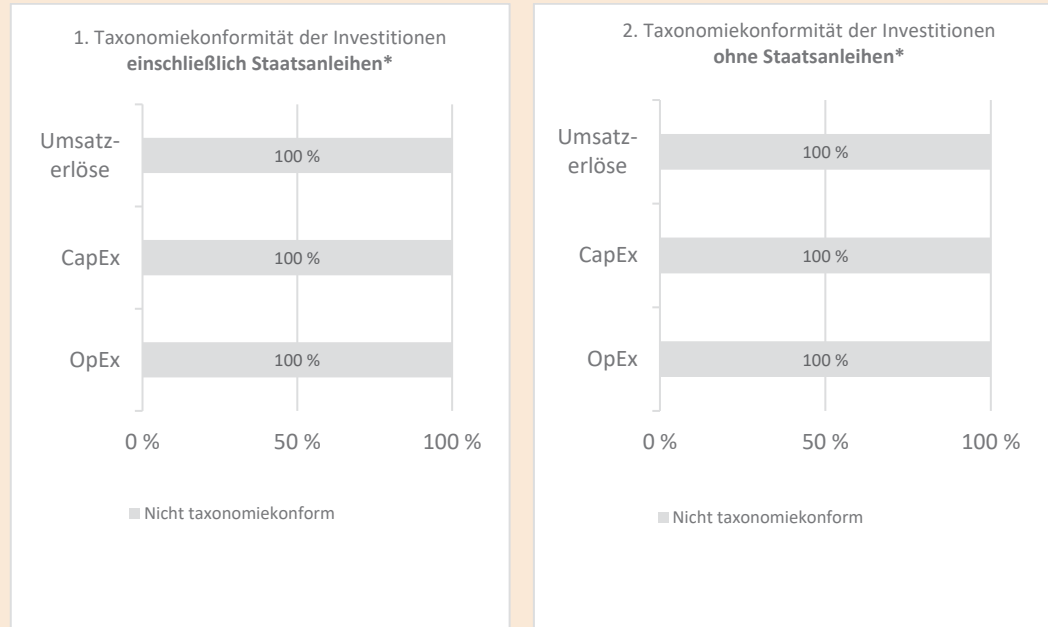
Übergangstätigkeiten

sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Im Bezugszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug der Anteil der Investitionen des Fonds in Übergangs- und ermöglichenden Tätigkeiten 0 % (31. Dezember 2022: 0 %).



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Wie oben dargelegt, wurde zum 31. Dezember 2023 davon ausgegangen, dass 100 % der direkten Investitionen des Fonds ökologische und/oder soziale Merkmale bewerben, da die Ausschlussstrategie des Fonds auf alle seine direkten Investitionen angewendet wurde (31. Dezember 2022: 100 %).

Ein ökologischer oder sozialer Mindestschutz wurde nur für solche direkten Investitionen vorgesehen und galt nicht für indirekte Investitionen.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Im Bezugszeitraum wirkte der Anlageberater aktiv bei bestimmten Emittenten mit (Beispiele für eine solche aktive Mitwirkung waren wesentliche klima- und biodiversitätsbezogene Angelegenheiten), indem er insbesondere die Emittenten ermutigte, sich an das Pariser Abkommen zu halten, wissenschaftlich fundierte Ziele zur Reduzierung von Kohlenstoffemissionen zu übernehmen und/oder ihre Nachhaltigkeitsverpflichtungen auf breiter Basis voranzutreiben.

ANHANG IV

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Euro Short-Term Fund

Unternehmenskennung: U9SVFXJNHHFXARCR1V87

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___ %

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___ %

Nein

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds bewarb ökologische und/oder soziale Merkmale, indem er eine Ausschlussstrategie verfolgte. Der Fonds bewarb auch ökologische und/oder soziale Merkmale durch aktive Mitwirkung bei bestimmten Emittenten (Beispiele für eine solche Mitwirkung waren wesentliche klima- und biodiversitätsbezogene Angelegenheiten), indem er beispielsweise die Emittenten dazu ermutigte, sich an das Pariser Abkommen zu halten, wissenschaftlich fundierte Ziele zur Reduzierung der Kohlenstoffemissionen zu übernehmen und/oder ihre Nachhaltigkeitsverpflichtungen auf breiter Basis voranzutreiben.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wurde auf der Grundlage der Umsetzung der Ausschlussstrategie des Anlageberaters und der Umsetzung seiner Richtlinie zur Mitwirkung bei den Emittenten gemessen. Die Ausschlussstrategie des Fonds gilt für 100 % seiner Direktanlagen.

So führte die Ausschlussstrategie des Fonds zum Beispiel zum Ausschluss bestimmter Sektoren, einschließlich Emittenten, die hauptsächlich in den Bereichen Kohle und unkonventionelles Öl (wie arktisches Öl und Ölsand) tätig sind. Darüber hinaus bezog sich der Anlageberater gegebenenfalls auf weltweit anerkannte Standards wie die UNGC-Grundsätze.

● **...und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Informationen zum historischen Vergleich der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen des Fonds sind unten in der Antwort auf die Frage „Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?“ dargelegt.



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Größte Investitionen	Sektor	% des Nettovermögens	Land
Switzerland Treasury Bills 1,625 % fällig am 29.02.2024	Quasi-staatliche Anleihen	2,11 %	Schweiz
Japan Treasury Bills (0,217) % fällig am 19/02/2024	Quasi-staatliche Anleihen	1,76 %	Japan
Accunia European CLO DAC 4,863 % fällig am 20.01.2031	Verbriefungen	1,50 %	Irland
Cedulas TDA Fondo de Titulizacion de Activos 3,875 % fällig am 23.05.2025	Investment-Grade-Anleihen	1,45 %	Spanien
Französische Schatzwechsel 3,867 % fällig am 04.04.2024	Quasi-staatliche Anleihen	1,42 %	Frankreich
BNZ International Funding Ltd. 0,625 % fällig am 03.07.2025	Investment-Grade-Anleihen	1,34 %	Neuseeland
Revocar UG 4,513 % fällig am 21.04.2036	Verbriefungen	1,32 %	Deutschland
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 2,875 % fällig am 16.07.2024	Investment-Grade-Anleihen	1,28 %	Italien
Commonwealth Bank of Australia 4,928 % fällig am 09.12.2026	Investment-Grade-Anleihen	1,22 %	Australien
Stratton Mortgage Funding PLC 6,069 % fällig am 25.09.2051	Verbriefungen	1,21 %	Großbritannien
Towd Point Mortgage Funding PLC 6,690 % fällig am 20.02.2045	Verbriefungen	1,18 %	Großbritannien
Towd Point Mortgage Funding PLC 5,891 % fällig am 20.10.2051	Verbriefungen	1,01 %	Großbritannien
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % fällig am 01.10.2024	Investment-Grade-Anleihen	0,92 %	Dänemark
Deutsche Pfandbriefbank AG 6,220 % fällig am 26.04.2024	Investment-Grade-Anleihen	0,90 %	Deutschland
Japan Treasury Bills (0,226) % fällig am 15/01/2024	Quasi-staatliche Anleihen	0,89 %	Japan

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum zum 31. Dezember 2023 mit dem Finanzprodukt getätigt wurden

Für die Zwecke der Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Investitionen des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendet.

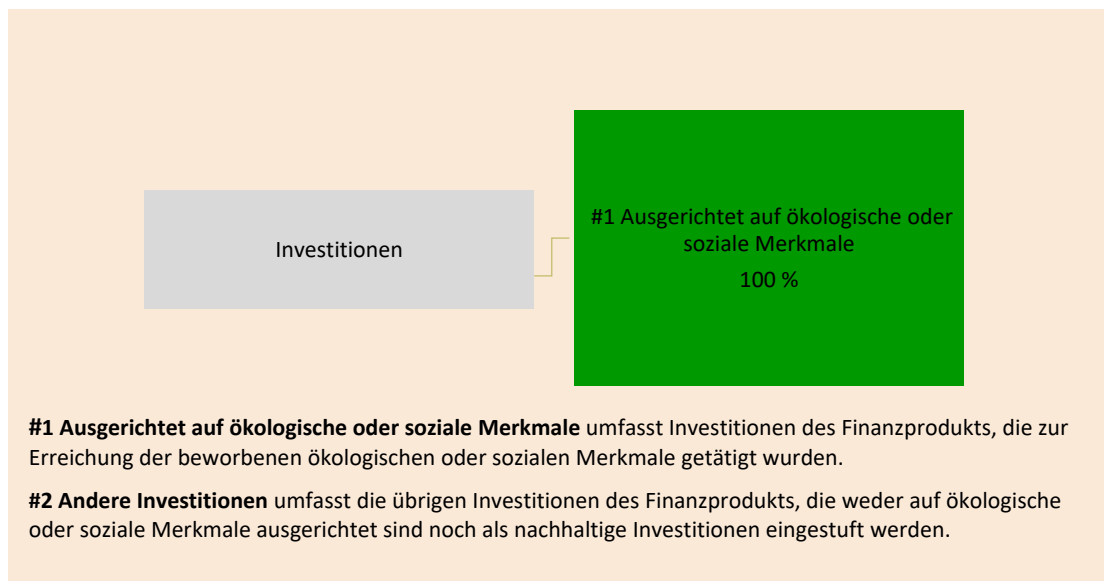


Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Informationen über den Anteil des Fonds zum 31. Dezember 2023, mit dem ökologische/soziale Merkmale beworben wurden, sind nachstehend aufgeführt.

● *Wie sah die Vermögensallokation aus?*

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.



Zum 31. Dezember 2023 wurden 100 % der direkten Investitionen des Fonds als Investitionen angesehen, die ökologische und/oder soziale Merkmale bewerben, da die Ausschlussstrategie des Fonds auf alle seine direkten Investitionen angewendet wurde (31. Dezember 2022: 100 %). Ein ökologischer oder sozialer Mindestschutz wurde nur für solche direkten Investitionen vorgesehen und galt nicht für indirekte Investitionen.

● *In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?*

Sektor	% des Nettovermögens
Investment-Grade-Anleihen	52,17 %
Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	42,09 %
Verbriefungen	26,25 %
Schwellenländer	0,18 %
Quasi-staatliche Anleihen	-20,69 %

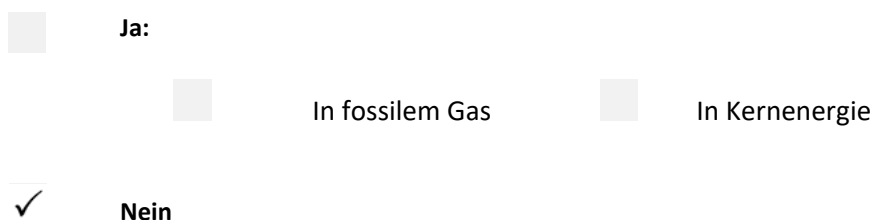
Für die Zwecke der Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Positionen des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendet.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Zum 31. Dezember 2023 lag der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform sind, bei 0 % (31. Dezember 2022: 0 %). Diese Zahl wurde weder von einem Wirtschaftsprüfer noch von sonstigen Dritten überprüft.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?



Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten

wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten

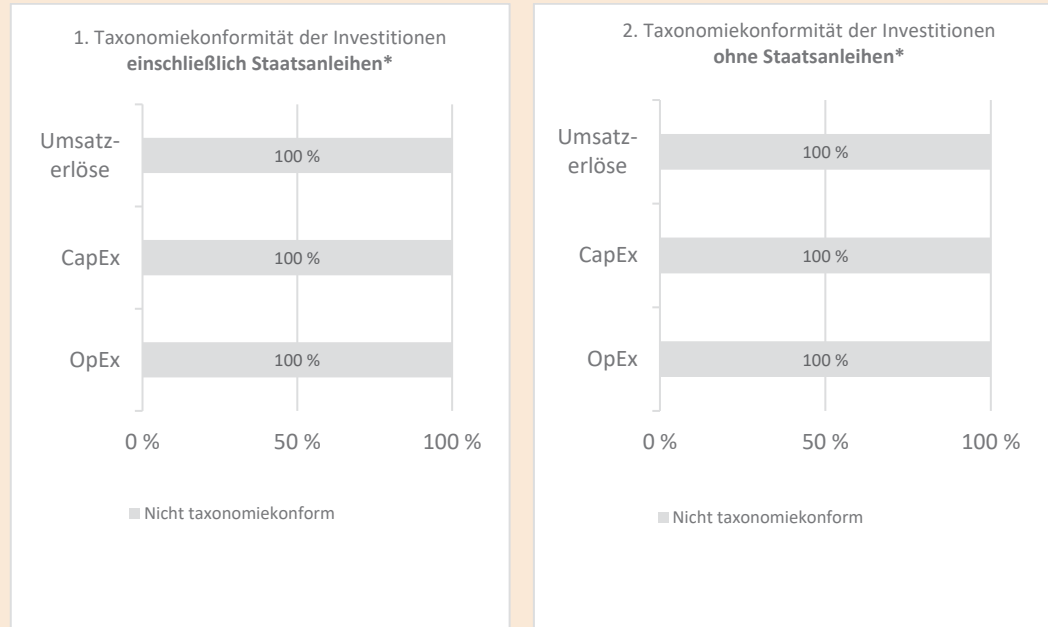
sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Im Bezugszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug der Anteil der Investitionen des Fonds in Übergangs- und ermöglichenden Tätigkeiten 0 % (31. Dezember 2022: 0 %).



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Wie oben dargelegt, wurde zum 31. Dezember 2023 davon ausgegangen, dass 100 % der direkten Investitionen des Fonds ökologische und/oder soziale Merkmale bewerben, da die Ausschlussstrategie des Fonds auf alle seine direkten Investitionen angewendet wurde. (31. Dezember 2022: 100 %).

Ein ökologischer oder sozialer Mindestschutz wurde nur für solche direkten Investitionen vorgesehen und galt nicht für indirekte Investitionen.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Im Bezugszeitraum wirkte der Anlageberater aktiv bei bestimmten Emittenten mit (Beispiele für eine solche aktive Mitwirkung waren wesentliche klima- und biodiversitätsbezogene Angelegenheiten), indem er insbesondere die Emittenten ermutigte, sich an das Pariser Abkommen zu halten, wissenschaftlich fundierte Ziele zur Reduzierung von Kohlenstoffemissionen zu übernehmen und/oder ihre Nachhaltigkeitsverpflichtungen auf breiter Basis voranzutreiben.

ANHANG IV

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: PIMCO European High Yield Bond Fund Unternehmenskennung: 549300HILDNB781VVQ39

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Ja	<input type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> Nein
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___ % <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind 	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___ %	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds bewarb ökologische und/oder soziale Merkmale, indem er eine Ausschlussstrategie verfolgte. Der Fonds bewarb auch ökologische und/oder soziale Merkmale durch aktive Mitwirkung bei bestimmten Emittenten (Beispiele für eine solche Mitwirkung waren wesentliche klima- und biodiversitätsbezogene Angelegenheiten), indem er beispielsweise die Emittenten dazu ermutigte, sich an das Pariser Abkommen zu halten, wissenschaftlich fundierte Ziele zur

Reduzierung der Kohlenstoffemissionen zu übernehmen und/oder ihre Nachhaltigkeitsverpflichtungen auf breiter Basis voranzutreiben.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wurde auf der Grundlage der Umsetzung der Ausschlussstrategie des Anlageberaters und der Umsetzung seiner Richtlinie zur Mitwirkung bei den Emittenten gemessen. Die Ausschlussstrategie des Fonds gilt für 100 % seiner Direktanlagen.

So führte die Ausschlussstrategie des Fonds zum Beispiel zum Ausschluss bestimmter Sektoren, einschließlich Emittenten, die hauptsächlich in den Bereichen Kohle und unkonventionelles Öl (wie arktisches Öl und Ölsand) tätig sind. Darüber hinaus bezog sich der Anlageberater gegebenenfalls auf weltweit anerkannte Standards wie die UNGC-Grundsätze.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Größte Investitionen	Sektor	% des Nettovermögens	Land
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	4,81 %	Irland
Treasury Bills des europäischen Stabilitätsmechanismus 3,849 % fällig am 23.05.2024	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	1,86 %	International
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV 1,875 % fällig am 31.03.2027	Hochverzinsliche Anleihen	1,54 %	Niederlande
Telecom Italia Spa 7,875 % fällig am 31.07.2028	Hochverzinsliche Anleihen	1,45 %	Italien
Virgin Media Secured Finance Plc 4,250 % fällig am 15.01.2030	Hochverzinsliche Anleihen	1,38 %	Großbritannien
Forvia SE 2,750 % fällig am 15.02.2027	Hochverzinsliche Anleihen	1,14 %	Frankreich
Cirsa Finance International SARL 4,500 % fällig am 15.03.2027	Hochverzinsliche Anleihen	1,08 %	Luxemburg
AT&T, Inc. 2,875 % fällig am 02.03.2025	Investment-Grade-Anleihen	1,07 %	Vereinigte Staaten
Nexi Spa 2,125 % fällig am 30.04.2029	Hochverzinsliche Anleihen	1,06 %	Italien
Wintershall Dea Finance BV 2,499 % fällig am 20.04.2026	Hochverzinsliche Anleihen	1,01 %	Niederlande
Gatwick Airport Finance PLC 4,375 % fällig am 07.04.2026	Hochverzinsliche Anleihen	0,96 %	Großbritannien
Grifols S.A. 3,200 % fällig am 01.05.2025	Hochverzinsliche Anleihen	0,96 %	Spanien
Verisure Holding AB 3,250 % fällig am 15.02.2027	Hochverzinsliche Anleihen	0,94 %	Schweden
Electricite de France S.A. 2,875 % fällig am 15.12.2026	Investment-Grade-Anleihen	0,91 %	Frankreich
EP Infrastructure A/S 1,816 % fällig am 02.03.2031	Investment-Grade-Anleihen	0,91 %	Tschechien

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum zum 31. Dezember 2023 mit dem Finanzprodukt getätigt wurden

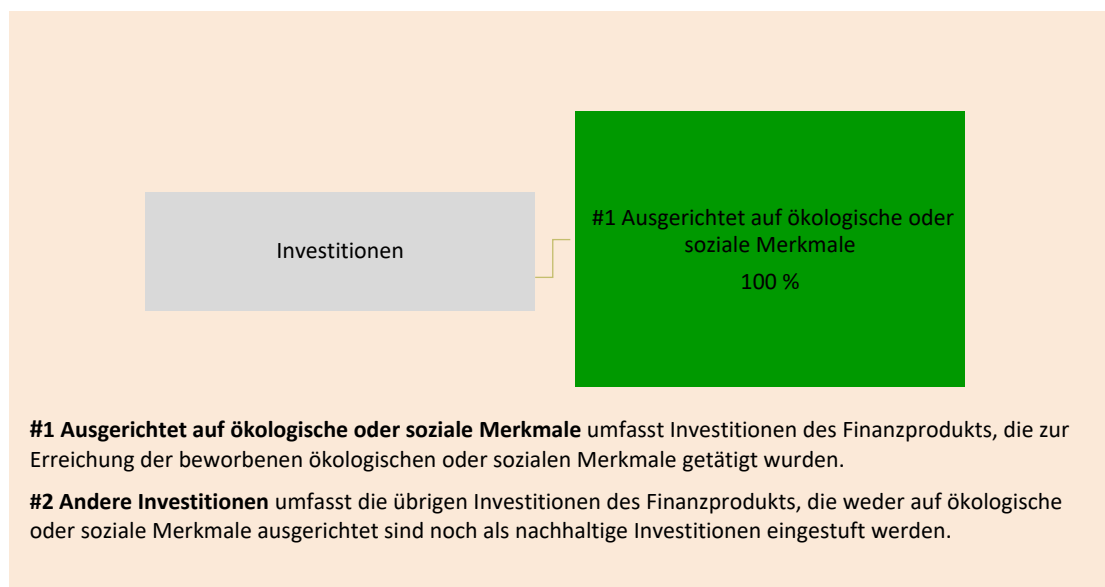
Für die Zwecke der Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Investitionen des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendet.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Informationen über den Anteil des Fonds zum 31. Dezember 2023, mit dem ökologische/soziale Merkmale beworben wurden, sind nachstehend aufgeführt.

● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**



Zum 31. Dezember 2023 wurden 100 % der Investitionen des Fonds als Investitionen angesehen, die ökologische und/oder soziale Merkmale bewerben, da die Ausschlussstrategie des Fonds auf alle seine direkten Investitionen angewendet wurde. Ein ökologischer oder sozialer Mindestschutz wurde nur für solche direkten Investitionen vorgesehen und galt nicht für indirekte Investitionen.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Sektor	% des Nettovermögens
Hochverzinsliche Anleihen	72,33 %
Quasi-staatliche Anleihen	20,87 %
Investment-Grade-Anleihen	18,25 %
Schwellenländer	0,32 %
Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	-11,77 %

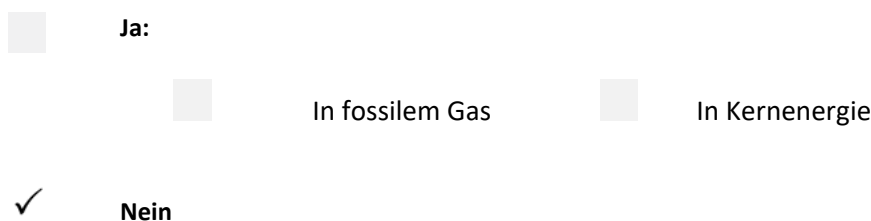
Für die Zwecke der Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Positionen des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendet.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Zum 31. Dezember 2023 lag der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform sind, bei 0 %. Diese Zahl wurde weder von einem Wirtschaftsprüfer noch von sonstigen Dritten überprüft.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?



Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

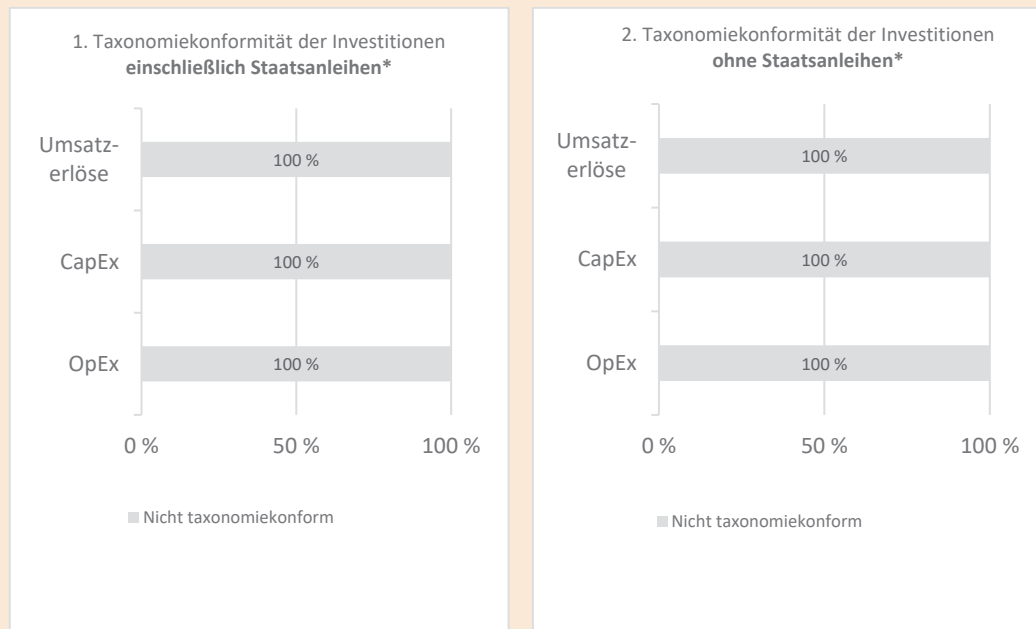
Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Im Bezugszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug der Anteil der Investitionen des Fonds in Übergangs- und ermöglichenden Tätigkeiten 0 %.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Wie oben dargelegt, wurde zum 31. Dezember 2023 davon ausgegangen, dass 100 % der direkten Investitionen des Fonds ökologische und/oder soziale Merkmale bewerben, da die Ausschlussstrategie des Fonds auf alle seine direkten Investitionen angewendet wurde.

Ein ökologischer oder sozialer Mindestschutz wurde nur für solche direkten Investitionen vorgesehen und galt nicht für indirekte Investitionen.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Im Bezugszeitraum wirkte der Anlageberater aktiv bei bestimmten Emittenten mit (Beispiele für eine solche aktive Mitwirkung waren wesentliche klima- und biodiversitätsbezogene Angelegenheiten), indem er insbesondere die Emittenten ermutigte, sich an das Pariser Abkommen zu halten, wissenschaftlich fundierte Ziele zur Reduzierung von Kohlenstoffemissionen zu übernehmen und/oder ihre Nachhaltigkeitsverpflichtungen auf breiter Basis voranzutreiben.

ANHANG IV

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Global Bond ESG Fund

Unternehmenskennung: 549300PFJAUUMMOPU079

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___ %

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___ %

Nein

Es wurden damit **ökologische/soziale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 18% an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel**

**Der Fonds hat während des Berichtszeitraums zwar nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt, er hat sich jedoch nicht dazu verpflichtet, in diese Anlagekategorie zu investieren. Daher sollten derartige Investitionen des Fonds als gelegentliche Investitionen betrachtet werden.

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Ansatz des Fonds für nachhaltige Investitionen besteht in der Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale (auch wenn der Fonds keine nachhaltigen Investitionen zum Ziel hat, ist er bestrebt, einen Teil seines Vermögens in nachhaltige Investitionen zu investieren).

Wie nachstehend näher erläutert, leisteten die vom Fonds im Bezugszeitraum gehaltenen nachhaltigen Investitionen einen Beitrag zu den Umweltzielen der Anpassung an den Klimawandel und/oder des Klimaschutzes.

Die während des Berichtszeitraums vom Fonds gehaltenen Derivate (mit Ausnahme von Indexderivaten) wurden anhand der vom Anlageberater implementierten Ausschlussstrategie überprüft und dementsprechend zur Bewerbung der vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale eingesetzt.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wurde anhand der Umsetzung der Ausschlussstrategie des Anlageberaters, seiner Richtlinie zur Mitwirkung bei den Emittenten und auf der Grundlage der Investitionen in bestimmte festverzinsliche ESG-Wertpapiere (wie im Abschnitt „**Festverzinsliche ESG-Wertpapiere**“ des Prospekts näher beschrieben), die es den Emittenten ermöglichen, Kapital zur Finanzierung von Projekten mit positiven Auswirkungen auf die Umwelt zu beschaffen, gemessen, sowie basierend auf den Investitionen in Schuldtiteln von Emittenten, die bei der Bewältigung von Risiken und Chancen im Zusammenhang mit dem Klimawandel eine Führungsrolle übernehmen.

Beispielsweise führte die Ausschlussstrategie des Fonds zum Ausschluss bestimmter Sektoren, darunter Emittenten, die in Sektoren im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind (einschließlich Emittenten, die hauptsächlich in der Ölindustrie, einschließlich Förderung, Produktion, Raffinerie, Transport oder im Abbau, im Verkauf von Kohle und in der Kohleverstromung tätig sind).

Darüber hinaus bezog sich der Anlageberater im Rahmen des Screening-Verfahrens des Fonds gegebenenfalls auf weltweit anerkannte Standards wie die UNGC-Grundsätze und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte.

● **...und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Informationen zum historischen Vergleich der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen des Fonds sind unten in der Antwort auf die Frage „*Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?*“ dargelegt.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die dem Fonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen leisteten im Bezugszeitraum Beiträge zu den Umweltzielen Klimaschutz und Anpassung an den Klimawandel, die unter anderem durch Investitionen in festverzinsliche ESG-Wertpapiere (wie im Abschnitt „**Festverzinsliche ESG-Wertpapiere**“ des Prospekts näher beschrieben), einschließlich grüner Anleihen, erreicht wurden.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Die nachhaltigen Investitionen des Fonds wurden dahingehend bewertet, dass sie keinen wesentlichen Schaden für ökologische oder soziale Ziele verursachen. Diese Bewertung erfolgte durch die Anwendung verschiedener negativer Nachhaltigkeitsindikatoren durch den Anlageberater, darunter das Engagement in Sektoren im Bereich der fossilen Brennstoffe (wie oben beschrieben) und Treibhausgasemissionen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Wertpapiere wurden gemäß dem internen Nachhaltigkeits-Screening-Verfahren des Anlageberaters ausgewählt. Dieses Screening-Verfahren beinhaltet die Berücksichtigung nachteiliger Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren, insbesondere das Engagement in Sektoren, die mit fossilen Brennstoffen in Zusammenhang stehen (wie oben beschrieben) und das Engagement im Bereich militärische Waffen. Der Anlageberater war bestrebt, die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen zu mindern, unter anderem durch seine Ausschlussstrategie und seine Mitwirkung bei Emittenten.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechtein Einklang? Nähere Angaben:

Der Anlageberater vergewisserte sich, dass die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Richtlinien für multinationale Unternehmen und den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte im Einklang stehen, indem er ein UNGC (UN Global Compact)-Kontroversen-Screening zusammen mit anderen Instrumenten, einschließlich ESG-Scores und Research im Rahmen des Due-Diligence-Prozesses für Anlagen einsetzte.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen werden als die Auswirkungen von Anlageentscheidungen beschrieben, die „negative Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren nach sich ziehen“, während Nachhaltigkeitsfaktoren als „Umwelt-, Sozial- und Mitarbeiterangelegenheiten, Achtung der Menschenrechte, Bekämpfung von Korruption und Bekämpfung von Bestechung“ definiert werden. Der Anlageberater war bestrebt, die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen im Rahmen des Anlageprozesses zu berücksichtigen, und setzte eine Kombination von Methoden ein, einschließlich Engagement und Ausschlüsse von Emittenten, um die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen zu mindern.

Der Fonds berücksichtigte im Bezugszeitraum die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen von Anlageentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (insbesondere das Engagement in Sektoren im Bereich der fossilen Brennstoffe (wie oben beschrieben), im Sektor der militärischen Waffen und Treibhausgasemissionen).



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Größte Investitionen	Sektor	% des Nettovermögens	Land
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 6,500 % fällig am 01.02.2054	Verbriefungen	9,20 %	Vereinigte Staaten
Japan Treasury Bills (0,253) % fällig am 26.02.2024	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	5,19 %	Japan
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 6,000 % fällig am 01.02.2054	Verbriefungen	3,70 %	Vereinigte Staaten
Japan Treasury Bills (0,245) % fällig am 04.03.2024	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	2,96 %	Japan
Japan Treasury Bills (0,216) % fällig am 22.01.2024	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	2,29 %	Japan
Japan Treasury Bills (0,211) % fällig am 29.01.2024	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	2,22 %	Japan
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2054	Verbriefungen	1,79 %	Vereinigte Staaten
Japan Treasury Bills (0,225) % fällig am 26.02.2024	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	1,48 %	Japan
Bundesrepublik Deutschland 0,000 % fällig am 15.08.2031	Quasi-staatliche Anleihen	1,45 %	Deutschland
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.04.2053	Verbriefungen	1,39 %	Vereinigte Staaten
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.10.2052	Verbriefungen	1,36 %	Vereinigte Staaten
Japan Government International Bond 0,005 % fällig am 01.10.2024	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	1,36 %	Japan
Japan Treasury Bills (0,271) % fällig am 09.01.2024	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	1,35 %	Japan
Uniform Mortgage-Backed Security 5,500 % fällig am 01.05.2053	Verbriefungen	1,29 %	Vereinigte Staaten
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.01.2054	Verbriefungen	1,13 %	Vereinigte Staaten

Für die Zwecke der Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Investitionen des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendet.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum zum 31. Dezember 2023 mit dem Finanzprodukt getätigt wurden

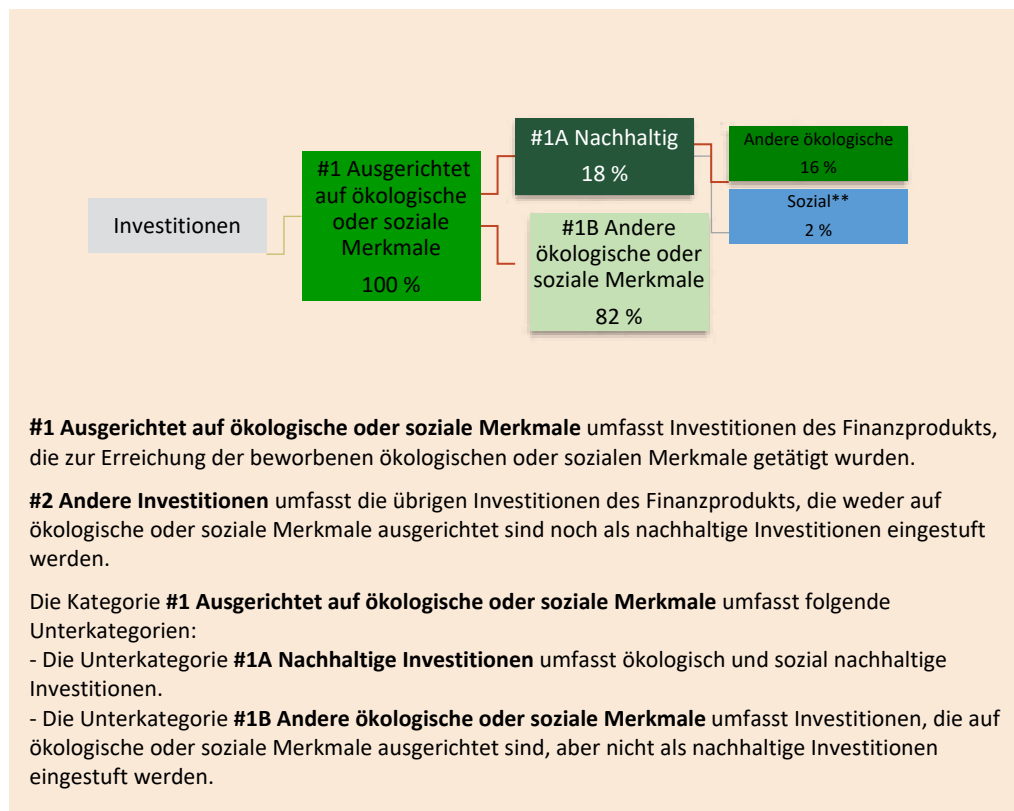


Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Informationen über den Anteil des Fonds, mit dem ökologische/soziale Merkmale beworben wurden, und den Anteil an nachhaltigen Investitionen zum 31. Dezember 2023 sind nachfolgend aufgeführt.

● *Wie sah die Vermögensallokation aus?*

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.



Zum 31. Dezember 2023 wurden 100 % der Investitionen des Fonds als Investitionen angesehen, die ökologische und/oder soziale Merkmale bewerben, da alle Investitionen des Fonds (mit Ausnahme von Indexderivaten) anhand der Ausschlussstrategie geprüft wurden (31. Dezember 2022: 100 %).

Zum 31. Dezember 2023 lag der Anteil der nachhaltigen Investitionen bei 18 % des Nettovermögens des Fonds (31. Dezember 2022: 15 %). 16 % des Nettovermögens umfassten nachhaltige Investitionen, die zu einem Umweltziel beitragen (31. Dezember 2022: 14 %).

**Der Fonds hielt auch 2 % seines Nettovermögens in nachhaltigen Investitionen, die zu einem sozialen Ziel beitragen (31. Dezember 2022: 1 %). Es wird darauf hingewiesen, dass der Fonds sich nicht zu nachhaltigen Investitionen, die zu einem sozialen Ziel beitragen, verpflichtet hat. Daher sollten solche Investitionen als gelegentliche Investitionen betrachtet werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Sektor	% des Nettovermögens
Quasi-staatliche Anleihen	52,34 %
Verbriefungen	31,33 %
Investment-Grade-Anleihen	13,30 %
Inflationsgebundene Anleihen	4,05 %
Schwellenmärkte, extern	3,64 %
Gedekte Anleihen und Pfandbriefe	2,00 %
Sonstige	0,17 %
Kommunalobligationen	0,10 %
Schwellenmärkte, lokal	-0,71 %
Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	-6,22 %

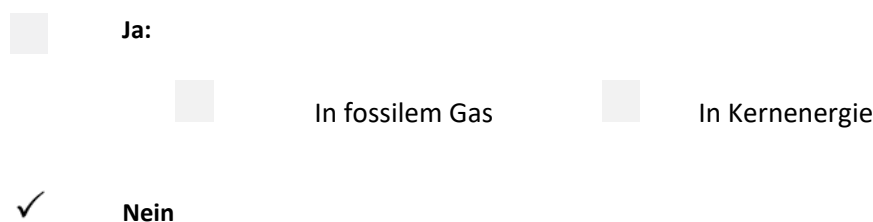
Für die Zwecke der Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Investitionen des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendet.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Zum 31. Dezember 2023 lag der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform sind, bei 0 % (31. Dezember 2022: 0 %). Diese Zahl wurde weder von einem Wirtschaftsprüfer noch von sonstigen Dritten überprüft.

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?**



¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten

wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

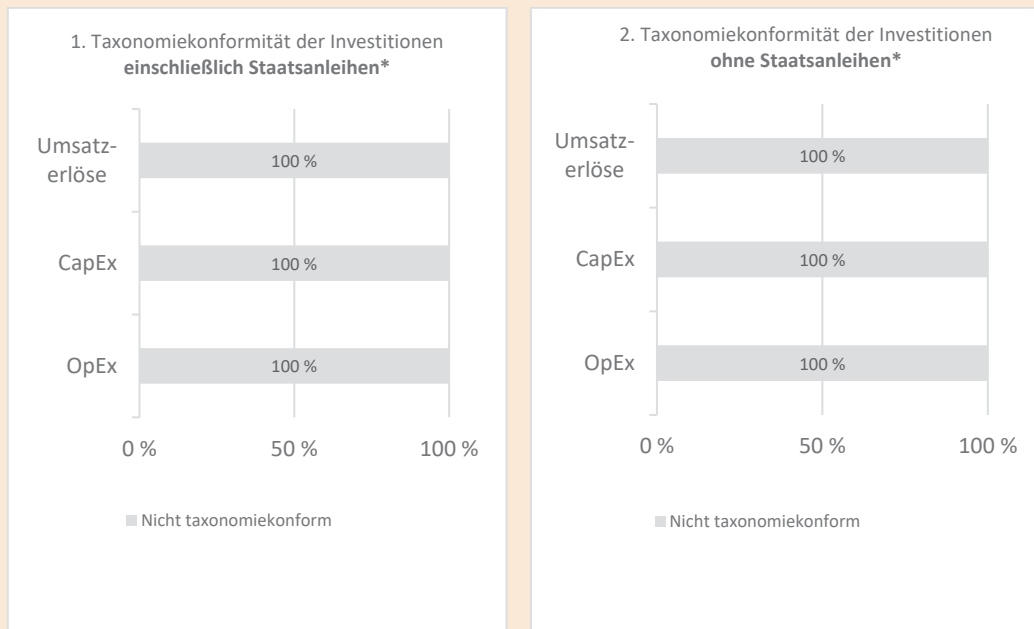
Übergangstätigkeiten

sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Im Bezugszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug der Anteil der Investitionen des Fonds in Übergangs- und ermöglichenden Tätigkeiten 0 % (31. Dezember 2022: 0 %).



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Fonds verpflichtet sich nicht, in Anlagen zu investieren, die mit der EU-Taxonomie konform sind, aber er verpflichtet sich, nachhaltige Investitionen zu tätigen, die zu einem Umweltziel beitragen. Zum 31. Dezember 2023 lag der Anteil der nachhaltigen Investitionen des Fonds, die einen Beitrag zu einem Umweltziel leisteten und nicht gemäß der EU-Taxonomie bewertet wurden, sodass sie oben unter „Andere ökologische Investitionen“ eingestuft wurden, bei 16 % (31. Dezember 2022: 14 %). Weitere Informationen zur Verfügbarkeit nachhaltigkeitsbezogener Daten und der damit verbundenen Herausforderungen finden Sie unter <https://europe.pimco.com/en-eu/our-firm/global-advisors-ireland>.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien nicht berücksichtigen**, die für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 erforderlich sind.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Wie oben dargelegt, entfielen im Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 2 % des Nettovermögens des Fonds auf nachhaltige Investitionen, die zu einem sozialen Ziel beitragen (31. Dezember 2022: 1 %). Da sich der Fonds nicht zu nachhaltigen Investitionen, die zu einem sozialen Ziel beitragen, verpflichtet hat, sollten solche Anlagen als gelegentliche Anlagen betrachtet werden.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Wie oben erwähnt, wurde zum 31. Dezember 2023 davon ausgegangen, dass 100 % der Investitionen des Fonds ökologische und/oder soziale Merkmale bewerben, da alle Investitionen des Fonds (mit Ausnahme von Indexderivaten) anhand der Ausschlussstrategie geprüft wurden (31. Dezember 2022: 100 %).

Wie vorstehend näher ausgeführt, belief sich der Anteil an nachhaltigen Investitionen zum 31. Dezember 2023 auf 18 % des Nettovermögens des Fonds (31. Dezember 2022: 15 %).



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Im Bezugszeitraum wirkte der Anlageberater aktiv bei bestimmten Emittenten mit (Beispiele für eine solche aktive Mitwirkung waren wesentliche klima- und biodiversitätsbezogene Angelegenheiten), indem er insbesondere die Emittenten ermutigte, sich an das Pariser Abkommen zu halten, wissenschaftlich fundierte Ziele zur Reduzierung von Kohlenstoffemissionen zu übernehmen und/oder ihre Nachhaltigkeitsverpflichtungen auf breiter Basis voranzutreiben.

ANHANG IV

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Global Investment Grade Credit ESG Fund Unternehmenskennung: 5493005HZUTWLN5JSJ59

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___ %

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___ %

Nein

Es wurden damit **ökologische/soziale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 57 % an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel**

**Der Fonds hat während des Berichtszeitraums zwar nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt, er hat sich jedoch nicht dazu verpflichtet, in diese Anlagekategorie zu investieren. Daher sollten derartige Investitionen des Fonds als gelegentliche Investitionen betrachtet werden.

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Ansatz des Fonds für nachhaltige Investitionen besteht in der Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale (auch wenn der Fonds keine nachhaltigen Investitionen zum Ziel hat, ist er bestrebt, einen Teil seines Vermögens in nachhaltige Investitionen zu investieren).

Wie nachstehend näher erläutert, leisteten die vom Fonds im Bezugszeitraum gehaltenen nachhaltigen Investitionen einen Beitrag zu den Umweltzielen der Anpassung an den Klimawandel und/oder des Klimaschutzes.

Die während des Berichtszeitraums vom Fonds gehaltenen Derivate (mit Ausnahme von Indexderivaten) wurden anhand der vom Anlageberater implementierten Ausschlussstrategie überprüft und dementsprechend zur Bewerbung der vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale eingesetzt.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wurde anhand der Umsetzung der Ausschlussstrategie des Anlageberaters, seiner Richtlinie zur Mitwirkung bei den Emittenten und auf der Grundlage der Investitionen in bestimmte festverzinsliche ESG-Wertpapiere (wie im Abschnitt „**Festverzinsliche ESG-Wertpapiere**“ des Prospekts näher beschrieben), die es den Emittenten ermöglichen, Kapital zur Finanzierung von Projekten mit positiven Auswirkungen auf die Umwelt zu beschaffen, gemessen, sowie basierend auf den Investitionen in Schuldtiteln von Emittenten, die bei der Bewältigung von Risiken und Chancen im Zusammenhang mit dem Klimawandel eine Führungsrolle übernehmen.

Beispielsweise führte die Ausschlussstrategie des Fonds zum Ausschluss bestimmter Sektoren, darunter Emittenten, die in Sektoren im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind (einschließlich Emittenten, die hauptsächlich in der Ölindustrie, einschließlich Förderung, Produktion, Raffinerie, Transport oder im Abbau, im Verkauf von Kohle und in der Kohleverstromung tätig sind).

Darüber hinaus bezog sich der Anlageberater im Rahmen des Screening-Verfahrens des Fonds gegebenenfalls auf weltweit anerkannte Standards wie die UNGC-Grundsätze und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte.

● **...und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Informationen zum historischen Vergleich der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen des Fonds sind unten in der Antwort auf die Frage „*Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?*“ dargelegt.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die dem Fonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen leisteten im Bezugszeitraum Beiträge zu den Umweltzielen Klimaschutz und Anpassung an den Klimawandel, die unter anderem durch Investitionen in festverzinsliche ESG-Wertpapiere (wie im Abschnitt „**Festverzinsliche ESG-Wertpapiere**“ des Prospekts näher beschrieben), einschließlich grüner Anleihen, erreicht wurden.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Die nachhaltigen Investitionen des Fonds wurden dahingehend bewertet, dass sie keinen wesentlichen Schaden für ökologische oder soziale Ziele verursachen. Diese Bewertung erfolgte durch die Anwendung verschiedener negativer Nachhaltigkeitsindikatoren durch den Anlageberater, darunter das Engagement in Sektoren im Bereich der fossilen Brennstoffe (wie oben beschrieben) und Treibhausgasemissionen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Wertpapiere wurden gemäß dem internen Nachhaltigkeits-Screening-Verfahren des Anlageberaters ausgewählt. Dieses Screening-Verfahren beinhaltet die Berücksichtigung nachteiliger Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren, insbesondere das Engagement in Sektoren, die mit fossilen Brennstoffen in Zusammenhang stehen (wie oben beschrieben) und das Engagement im Bereich militärische Waffen. Der Anlageberater war bestrebt, die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen zu mindern, unter anderem durch seine Ausschlussstrategie und seine Mitwirkung bei Emittenten.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Der Anlageberater vergewisserte sich, dass die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Richtlinien für multinationale Unternehmen und den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte im Einklang stehen, indem er ein UNGC (UN Global Compact)-Kontroversen-Screening zusammen mit anderen Instrumenten, einschließlich ESG-Scores und Research im Rahmen des Due-Diligence-Prozesses für Anlagen einsetzte.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen werden als die Auswirkungen von Anlageentscheidungen beschrieben, die „negative Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren nach sich ziehen“, während Nachhaltigkeitsfaktoren als „Umwelt-, Sozial- und Mitarbeiterangelegenheiten, Achtung der Menschenrechte, Bekämpfung von Korruption und Bekämpfung von Bestechung“ definiert werden. Der Anlageberater war bestrebt, die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen im Rahmen des Anlageprozesses zu berücksichtigen, und setzte eine Kombination von Methoden ein, einschließlich Engagement und Ausschlüsse von Emittenten, um die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen zu mindern.

Der Fonds berücksichtigte im Bezugszeitraum die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen von Anlageentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (insbesondere das Engagement in Sektoren im Bereich der fossilen Brennstoffe (wie oben beschrieben), im Sektor der militärischen Waffen und Treibhausgasemissionen).



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Größte Investitionen	Sektor	% des Nettovermögens	Land
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 6,000 % fällig am 01.02.2054	Verbriefungen	5,22 %	Vereinigte Staaten
U.S. Treasury Bonds 2,375 % fällig am 15.02.2042	Quasi-staatliche Anleihen	2,08 %	Vereinigte Staaten
U.S. Treasury Bonds 4,750 % fällig am 15.11.2043	Quasi-staatliche Anleihen	1,67 %	Vereinigte Staaten
U.S. Treasury Bonds 3,250 % fällig am 15.05.2042	Quasi-staatliche Anleihen	1,57 %	Vereinigte Staaten
U.S. Treasury Notes 4,250 % fällig am 31.05.2025	Quasi-staatliche Anleihen	1,41 %	Vereinigte Staaten
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.07.2032	Quasi-staatliche Anleihen	1,34 %	Vereinigte Staaten
U.S. Treasury Bonds 2,000 % fällig am 15.11.2041	Quasi-staatliche Anleihen	1,32 %	Vereinigte Staaten
Europäische Union 2,750 % fällig am 04.12.2037	Quasi-staatliche Anleihen	1,26 %	Supranationale Anleihen
U.S. Treasury Bonds 4,000 % fällig am 15.11.2042	Quasi-staatliche Anleihen	1,24 %	Vereinigte Staaten
U.S. Treasury Bonds 2,250 % fällig am 15.05.2041	Quasi-staatliche Anleihen	1,02 %	Vereinigte Staaten
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.02.2054	Verbriefungen	0,94 %	Vereinigte Staaten
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.07.2053	Verbriefungen	0,90 %	Vereinigte Staaten
BNG Bank NV 3,250 % fällig am 29.08.2033	Quasi-staatliche Anleihen	0,75 %	Niederlande
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.01.2054	Verbriefungen	0,61 %	Vereinigte Staaten
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,375 % fällig am 15.07.2033	Quasi-staatliche Anleihen	0,56 %	Vereinigte Staaten

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum zum 31. Dezember 2023 mit dem Finanzprodukt getätigt wurden

Für die Zwecke der Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Investitionen des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendet.

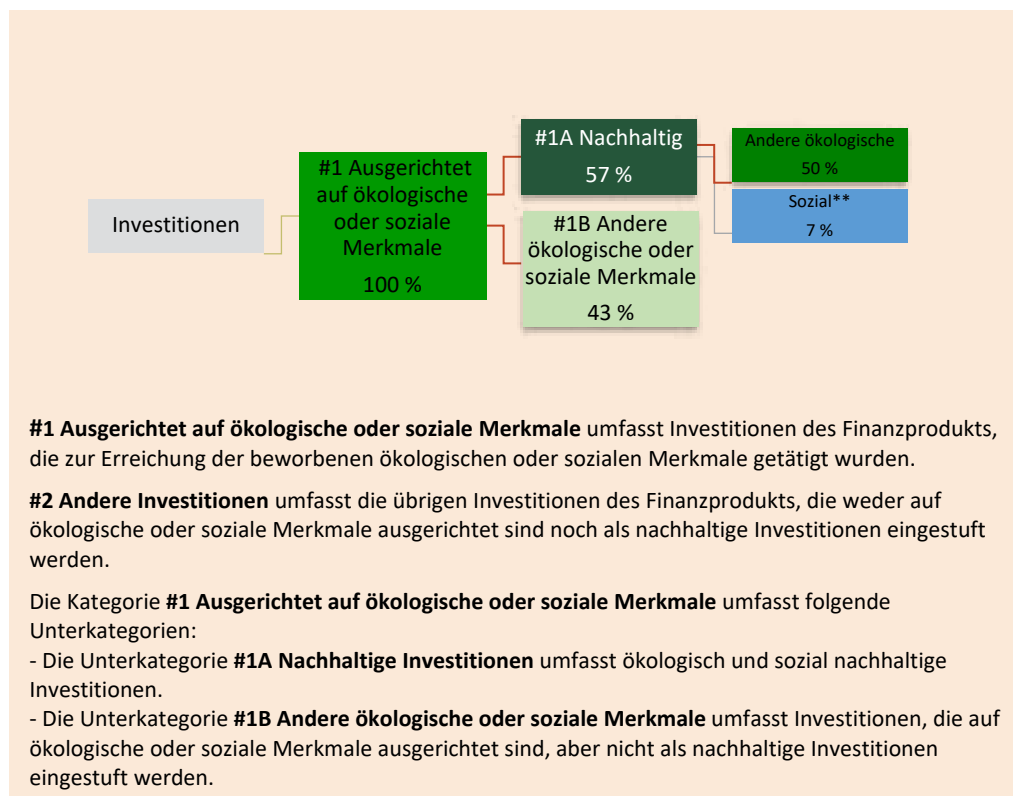


Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Informationen über den Anteil des Fonds, mit dem ökologische/soziale Merkmale beworben wurden, und den Anteil an nachhaltigen Investitionen zum 31. Dezember 2023 sind nachfolgend aufgeführt.

● Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.



Zum 31. Dezember 2023 wurden 100 % der Investitionen des Fonds als Investitionen angesehen, die ökologische und/oder soziale Merkmale bewerben, da alle Investitionen des Fonds (mit Ausnahme von Indexderivaten) anhand der Ausschlussstrategie geprüft wurden (31. Dezember 2022: 100 %).

Zum 31. Dezember 2023 lag der Anteil der nachhaltigen Investitionen bei 57 % des Nettovermögens des Fonds (31. Dezember 2022: 60 %). 50 % des Nettovermögens umfassten nachhaltige Investitionen, die zu einem Umweltziel beitragen (31. Dezember 2022: 55 %).

**Der Fonds hielt auch 7 % seines Nettovermögens in nachhaltigen Investitionen, die zu einem sozialen Ziel beitragen (31. Dezember 2022: 5 %). Es wird darauf hingewiesen, dass der Fonds sich nicht zu nachhaltigen Investitionen, die zu einem sozialen Ziel beitragen, verpflichtet hat. Daher sollten solche Investitionen als gelegentliche Investitionen betrachtet werden.

● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Sektor	% des Nettovermögens
Investment-Grade-Anleihen	67,29 %
Quasi-staatliche Anleihen	28,55 %
Verbriefungen	11,45 %
Hochverzinsliche Anleihen	2,21 %
Schwellenländer	1,96 %
Kommunalobligationen/Sonstige	0,22 %
Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	-11,68 %

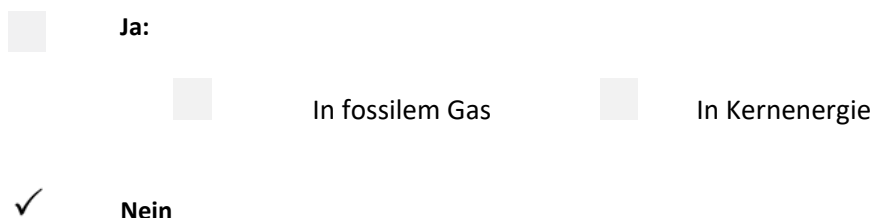
Für die Zwecke der Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Investitionen des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendet.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Zum 31. Dezember 2023 lag der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform sind, bei 0 % (31. Dezember 2022: 0 %). Diese Zahl wurde weder von einem Wirtschaftsprüfer noch von sonstigen Dritten überprüft.

● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?



¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

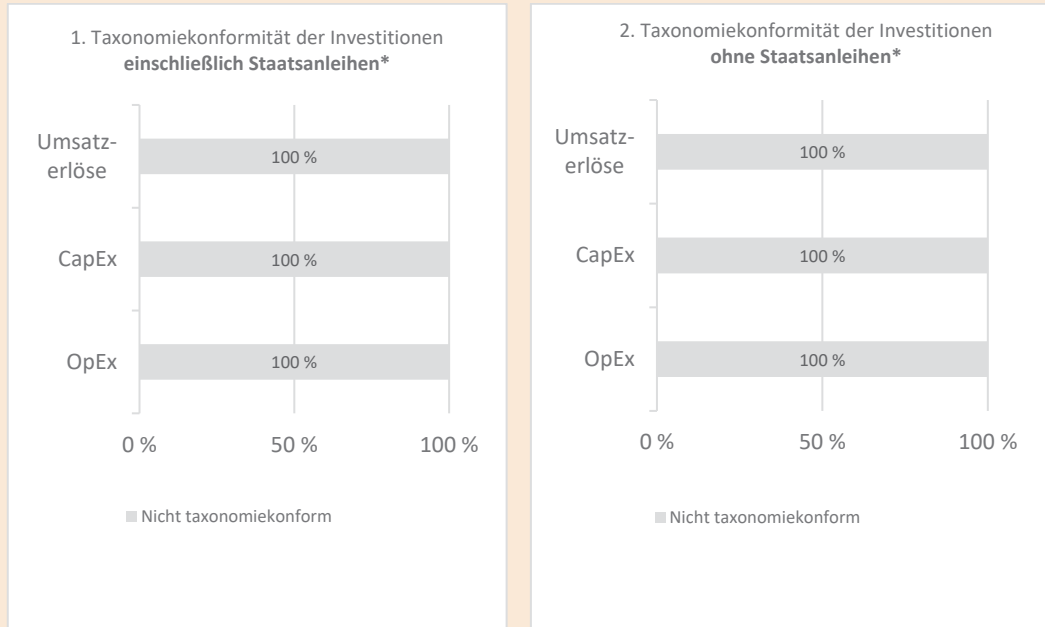
Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Im Bezugszeitraum zum 31. Dezember 2023 lag der Anteil der Investitionen des Fonds in Übergangs- und ermöglichenden Tätigkeiten bei 0 % (zum 31. Dezember 2022 betrug er 0 %).



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien nicht berücksichtigen**, die für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 erforderlich sind.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Fonds verpflichtet sich nicht, in Anlagen zu investieren, die mit der EU-Taxonomie konform sind, aber er verpflichtet sich, nachhaltige Investitionen zu tätigen, die zu einem Umweltziel beitragen. Zum 31. Dezember 2023 lag der Anteil der nachhaltigen Investitionen des Fonds, die einen Beitrag zu einem Umweltziel leisteten und nicht gemäß der EU-Taxonomie bewertet wurden, sodass sie oben unter „Andere ökologische Investitionen“ eingestuft wurden, bei 50 % (31. Dezember 2022: 55 %). Weitere Informationen zur Verfügbarkeit nachhaltigkeitsbezogener Daten und der damit verbundenen Herausforderungen finden Sie unter <https://europe.pimco.com/en-eu/our-firm/global-advisors-ireland>.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Wie oben dargelegt, entfielen im Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023, 7 % des Nettovermögens des Fonds auf nachhaltige Investitionen, die zu einem sozialen Ziel beitragen (zum 31. Dezember 2022 betrug der Anteil 5 %). Da sich der Fonds nicht zu nachhaltigen Investitionen, die zu einem sozialen Ziel beitragen, verpflichtet hat, sollten solche Anlagen als gelegentliche Anlagen betrachtet werden.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Wie oben erwähnt, wurde zum 31. Dezember 2023 davon ausgegangen, dass 100 % der Investitionen des Fonds ökologische und/oder soziale Merkmale bewerben, da alle Investitionen des Fonds (mit Ausnahme von Indexderivaten) anhand der Ausschlussstrategie geprüft wurden (31. Dezember 2022: 100 %).

Wie vorstehend näher ausgeführt, belief sich der Anteil an nachhaltigen Investitionen zum 31. Dezember 2023 auf 57 % des Nettovermögens des Fonds (31. Dezember 2022: 60 %).



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Im Bezugszeitraum wirkte der Anlageberater aktiv bei bestimmten Emittenten mit (Beispiele für eine solche aktive Mitwirkung waren wesentliche klima- und biodiversitätsbezogene Angelegenheiten), indem er insbesondere die Emittenten ermutigte, sich an das Pariser Abkommen zu halten, wissenschaftlich fundierte Ziele zur Reduzierung von Kohlenstoffemissionen zu übernehmen und/oder ihre Nachhaltigkeitsverpflichtungen auf breiter Basis voranzutreiben.

ANHANG IV

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Global Low Duration Real Return Fund Unternehmenskennung: 5493004EUSX3DN7B3B79

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

●● <input type="checkbox"/> Ja	●● <input checked="" type="checkbox"/> Nein
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___ % <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind 	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___ %	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds bewarb ökologische und/oder soziale Merkmale, indem er eine Ausschlussstrategie verfolgte. Der Fonds bewarb auch ökologische und/oder soziale Merkmale durch aktive Mitwirkung bei bestimmten Emittenten (Beispiele für eine solche Mitwirkung waren wesentliche klima- und biodiversitätsbezogene Angelegenheiten), indem er beispielsweise die Emittenten dazu ermutigte, sich an das Pariser Abkommen zu halten, wissenschaftlich fundierte Ziele zur

Reduzierung der Kohlenstoffemissionen zu übernehmen und/oder ihre Nachhaltigkeitsverpflichtungen auf breiter Basis voranzutreiben.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wurde auf der Grundlage der Umsetzung der Ausschlussstrategie des Anlageberaters und der Umsetzung seiner Richtlinie zur Mitwirkung bei den Emittenten gemessen. Die Ausschlussstrategie des Fonds gilt für 100 % seiner Direktanlagen.

So führte die Ausschlussstrategie des Fonds zum Beispiel zum Ausschluss bestimmter Sektoren, einschließlich Emittenten, die hauptsächlich in den Bereichen Kohle und unkonventionelles Öl (wie arktisches Öl und Ölsand) tätig sind. Darüber hinaus bezog sich der Anlageberater gegebenenfalls auf weltweit anerkannte Standards wie die UNGC-Grundsätze.

● **...und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Informationen zum historischen Vergleich der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen des Fonds sind unten in der Antwort auf die Frage „Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?“ dargelegt.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Größte Investitionen	Sektor	% des Nettovermögens	Land
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.01.2028	Inflationsgebundene Anleihen	8,69 %	Vereinigte Staaten
United Kingdom Gilt 1,250 % fällig am 22.11.2027	Inflationsgebundene Anleihen	6,93 %	Großbritannien
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.01.2025	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	6,07 %	Vereinigte Staaten
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2026	Inflationsgebundene Anleihen	5,85 %	Vereinigte Staaten
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.10.2026	Inflationsgebundene Anleihen	5,74 %	Vereinigte Staaten
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.01.2027	Inflationsgebundene Anleihen	5,67 %	Vereinigte Staaten
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026	Inflationsgebundene Anleihen	5,46 %	Vereinigte Staaten
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,625 % fällig am 15.10.2027	Inflationsgebundene Anleihen	5,43 %	Vereinigte Staaten
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,350 % fällig am 15.09.2024	Inflationsgebundene Anleihen	5,40 %	Italien
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2025	Inflationsgebundene Anleihen	4,83 %	Vereinigte Staaten
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.10.2024	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	4,76 %	Vereinigte Staaten
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.02.2054	Verbriefungen	4,63 %	Vereinigte Staaten
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2025	Inflationsgebundene Anleihen	4,54 %	Vereinigte Staaten
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,875 % fällig am 15.01.2029	Inflationsgebundene Anleihen	4,40 %	Vereinigte Staaten
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2026	Inflationsgebundene Anleihen	4,37 %	Vereinigte Staaten

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum zum 31. Dezember 2023 mit dem Finanzprodukt getätigt wurden

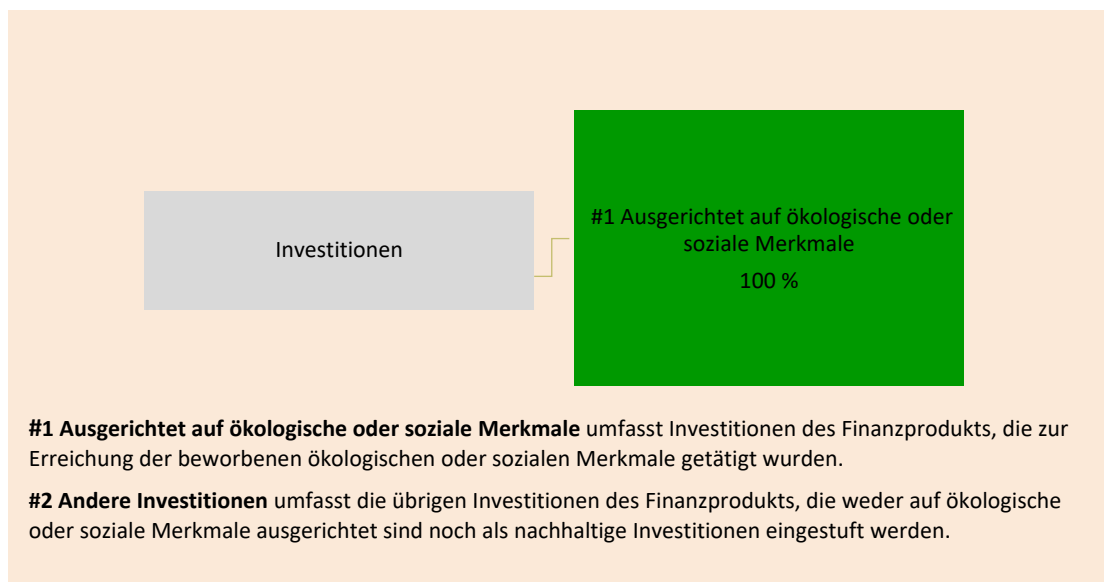
Für die Zwecke der Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Investitionen des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendet.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Informationen über den Anteil des Fonds zum 31. Dezember 2023, mit dem ökologische/soziale Merkmale beworben wurden, sind nachstehend aufgeführt.

● *Wie sah die Vermögensallokation aus?*



Zum 31. Dezember 2023 wurden 100 % der direkten Investitionen des Fonds als Investitionen angesehen, die ökologische und/oder soziale Merkmale bewerben, da die Ausschlussstrategie des Fonds auf alle seine direkten Investitionen angewendet wurde (31. Dezember 2022: 100 %). Ein ökologischer oder sozialer Mindestschutz wurde nur für solche direkten Investitionen vorgesehen und galt nicht für indirekte Investitionen.

● *In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?*

Sektor	% des Nettovermögens
Inflationsgebundene Anleihen	108,39 %
Verbriefungen	11,69 %
Gedekte Anleihen und Pfandbriefe	2,95 %
Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	2,79 %
Schwellenmärkte, lokal	0,25 %
Investment-Grade-Anleihen	0,08 %
Hochverzinsliche Anleihen	0,05 %

Quasi-staatliche Anleihen	-26,20 %
---------------------------	----------

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten

wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten

sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

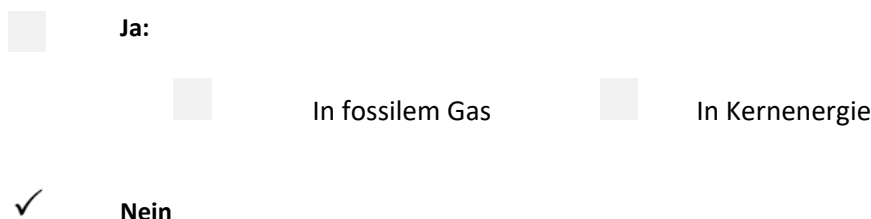
Für die Zwecke der Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Positionen des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendet.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Zum 31. Dezember 2023 lag der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform sind, bei 0 % (31. Dezember 2022: 0 %). Diese Zahl wurde weder von einem Wirtschaftsprüfer noch von sonstigen Dritten überprüft.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?

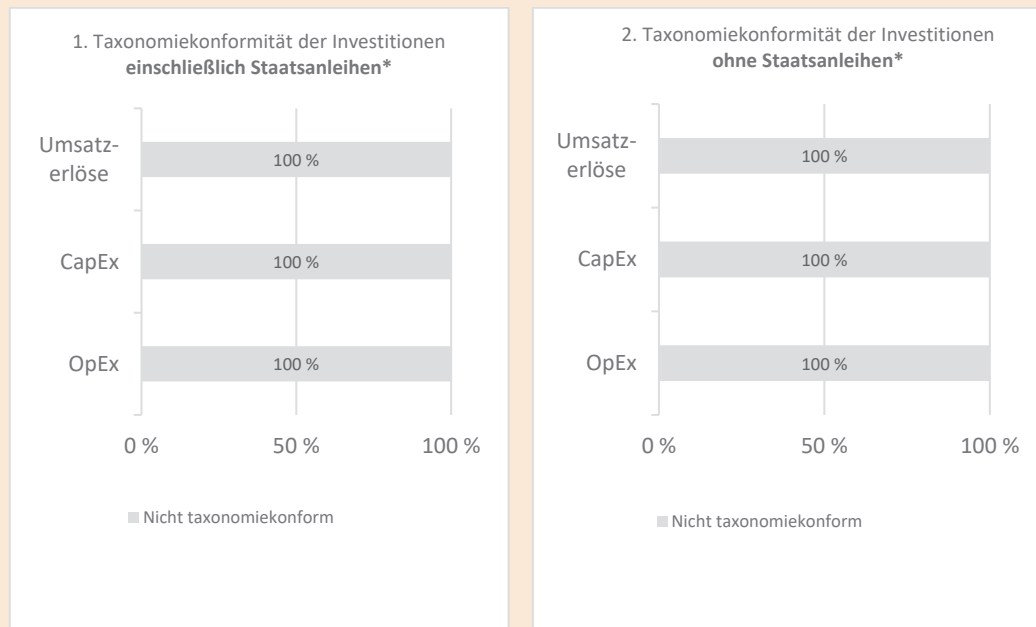


¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Im Bezugszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug der Anteil der Investitionen des Fonds in Übergangs- und ermöglichenden Tätigkeiten 0 % (31. Dezember 2022: 0 %).



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Wie oben dargelegt, wurde zum 31. Dezember 2023 davon ausgegangen, dass 100 % der direkten Investitionen des Fonds ökologische und/oder soziale Merkmale bewerben, da die Ausschlussstrategie des Fonds auf alle seine direkten Investitionen angewendet wurde. (31. Dezember 2022: 100 %).

Ein ökologischer oder sozialer Mindestschutz wurde nur für solche direkten Investitionen vorgesehen und galt nicht für indirekte Investitionen.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Im Bezugszeitraum wirkte der Anlageberater aktiv bei bestimmten Emittenten mit (Beispiele für eine solche aktive Mitwirkung waren wesentliche klima- und biodiversitätsbezogene Angelegenheiten), indem er insbesondere die Emittenten ermutigte, sich an das Pariser Abkommen zu halten, wissenschaftlich fundierte Ziele zur Reduzierung von Kohlenstoffemissionen zu übernehmen und/oder ihre Nachhaltigkeitsverpflichtungen auf breiter Basis voranzutreiben.

ANHANG IV

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Global Real Return Fund

Unternehmenskennung: TJC21SOQHOBNO288A280

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___ %

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___ %

Nein

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds bewarb ökologische und/oder soziale Merkmale, indem er eine Ausschlussstrategie verfolgte. Der Fonds bewarb auch ökologische und/oder soziale Merkmale durch aktive Mitwirkung bei bestimmten Emittenten (Beispiele für eine solche Mitwirkung waren wesentliche klima- und biodiversitätsbezogene Angelegenheiten), indem er beispielsweise die Emittenten dazu ermutigte, sich an das Pariser Abkommen zu halten, wissenschaftlich fundierte Ziele zur Reduzierung der Kohlenstoffemissionen zu übernehmen und/oder ihre Nachhaltigkeitsverpflichtungen auf breiter Basis voranzutreiben.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wurde auf der Grundlage der Umsetzung der Ausschlussstrategie des Anlageberaters und der Umsetzung seiner Richtlinie zur Mitwirkung bei den Emittenten gemessen. Die Ausschlussstrategie des Fonds gilt für 100 % seiner Direktanlagen.

So führte die Ausschlussstrategie des Fonds zum Beispiel zum Ausschluss bestimmter Sektoren, einschließlich Emittenten, die hauptsächlich in den Bereichen Kohle und unkonventionelles Öl (wie arktisches Öl und Ölsand) tätig sind. Darüber hinaus bezog sich der Anlageberater gegebenenfalls auf weltweit anerkannte Standards wie die UNGC-Grundsätze.

● **...und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Informationen zum historischen Vergleich der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen des Fonds sind unten in der Antwort auf die Frage „Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?“ dargelegt.



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Größte Investitionen	Sektor	% des Nettovermögens	Land
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2031	Inflationsgebundene Anleihen	7,10 %	Vereinigte Staaten
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.01.2028	Inflationsgebundene Anleihen	4,20 %	Vereinigte Staaten
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.02.2054	Verbriefungen	4,01 %	Vereinigte Staaten
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2025	Inflationsgebundene Anleihen	3,24 %	Vereinigte Staaten
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,400 % fällig am 26.05.2025	Inflationsgebundene Anleihen	3,20 %	Italien
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,625 % fällig am 15.10.2027	Inflationsgebundene Anleihen	3,17 %	Vereinigte Staaten
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.07.2032	Inflationsgebundene Anleihen	3,02 %	Vereinigte Staaten
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.07.2029	Inflationsgebundene Anleihen	2,88 %	Vereinigte Staaten
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,300 % fällig am 15.05.2028	Inflationsgebundene Anleihen	2,75 %	Italien
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 6,500 % fällig am 01.02.2054	Verbriefungen	2,51 %	Vereinigte Staaten
United Kingdom Gilt 1,250 % fällig am 22.11.2032	Inflationsgebundene Anleihen	2,39 %	Großbritannien
Kreditanstalt für Wiederaufbau 3,125 % fällig am 10.10.2028	Quasi-staatliche Anleihen	2,38 %	Deutschland
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2030	Inflationsgebundene Anleihen	2,32 %	Vereinigte Staaten
Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 10.03.2029	Inflationsgebundene Anleihen	2,32 %	Japan
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2026	Inflationsgebundene Anleihen	2,27 %	Vereinigte Staaten

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum zum 31. Dezember 2023 mit dem Finanzprodukt getätigt wurden

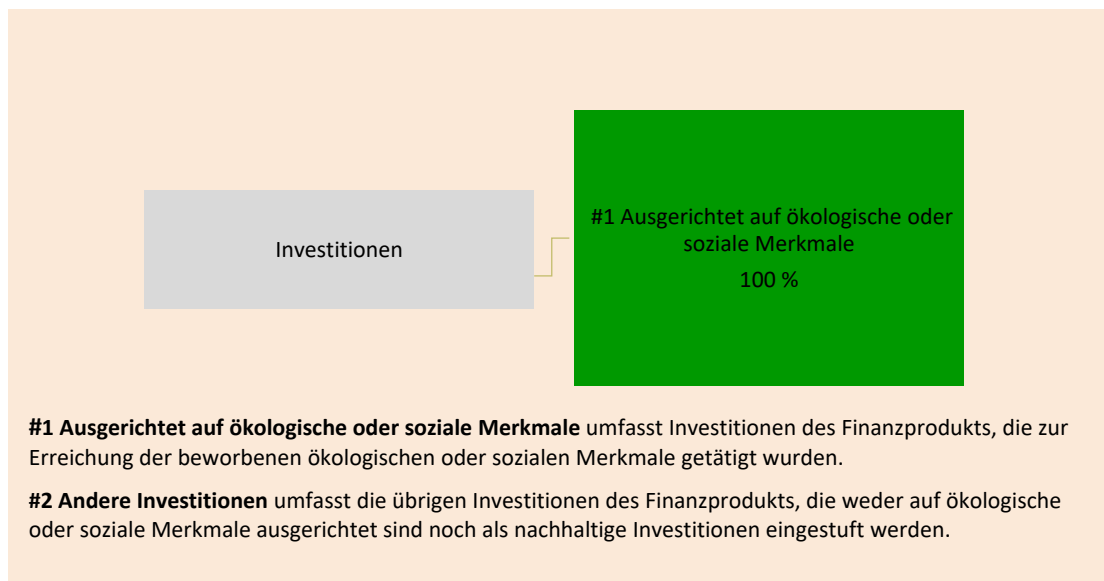
Für die Zwecke der Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Investitionen des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendet.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Informationen über den Anteil des Fonds zum 31. Dezember 2023, mit dem ökologische/soziale Merkmale beworben wurden, sind nachstehend aufgeführt.

● *Wie sah die Vermögensallokation aus?*



Zum 31. Dezember 2023 wurden 100 % der direkten Investitionen des Fonds als Investitionen angesehen, die ökologische und/oder soziale Merkmale bewerben, da die Ausschlussstrategie des Fonds auf alle seine direkten Investitionen angewendet wurde (31. Dezember 2022: 100 %). Ein ökologischer oder sozialer Mindestschutz wurde nur für solche direkten Investitionen vorgesehen und galt nicht für indirekte Investitionen.

● *In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?*

Sektor	% des Nettovermögens
Inflationsgebundene Anleihen	108,31 %
Verbriefungen	14,16 %
Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	4,35 %
Gedeckte Anleihen und Pfandbriefe	2,71 %
Schwellenmarkt, lokal	0,24 %
Investment-Grade-Anleihen	0,16 %
Hochverzinsliche Anleihen	0,04 %
Schwellenmarkt, extern	0,01 %
Quasi-staatliche Anleihen	-29,98 %

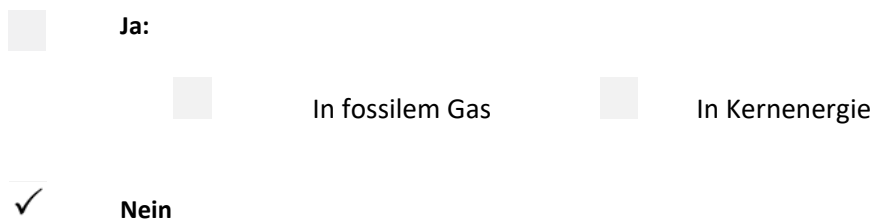
Für die Zwecke der Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Positionen des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendet.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Zum 31. Dezember 2023 lag der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform sind, bei 0 % (31. Dezember 2022: 0 %). Diese Zahl wurde weder von einem Wirtschaftsprüfer noch von sonstigen Dritten überprüft.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxoniekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?



Mit Blick auf die EU-Taxoniekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

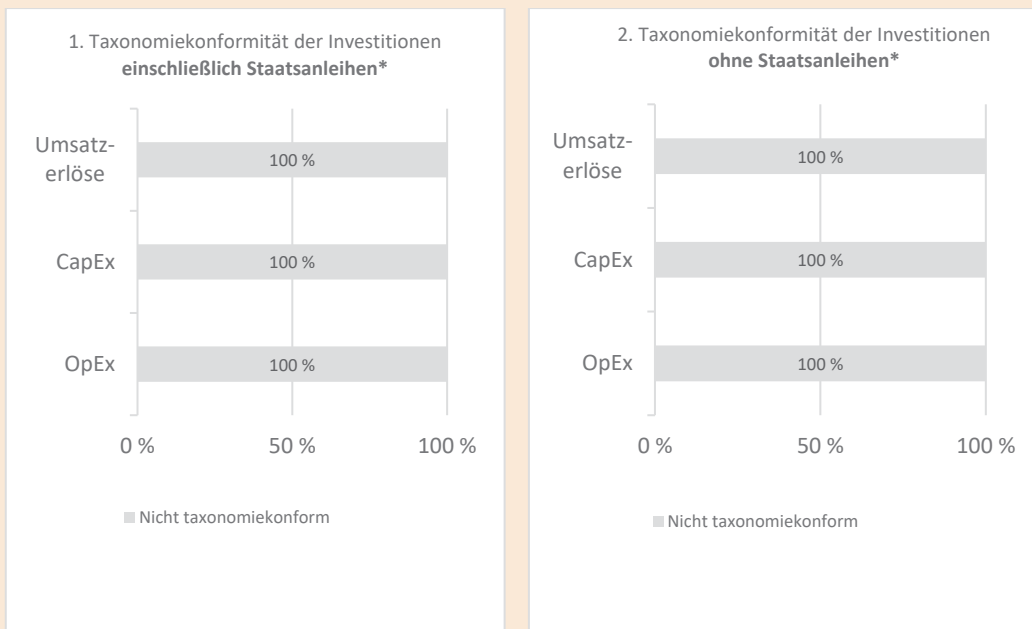
Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxoniekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxoniekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Im Bezugszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug der Anteil der Investitionen des Fonds in Übergangs- und ermöglichenden Tätigkeiten 0 % (31. Dezember 2022: 0 %).



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Wie oben dargelegt, wurde zum 31. Dezember 2023 davon ausgegangen, dass 100 % der direkten Investitionen des Fonds ökologische und/oder soziale Merkmale bewerben, da die Ausschlussstrategie des Fonds auf alle seine direkten Investitionen angewendet wurde. (31. Dezember 2022: 100 %).

Ein ökologischer oder sozialer Mindestschutz wurde nur für solche direkten Investitionen vorgesehen und galt nicht für indirekte Investitionen.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Im Bezugszeitraum wirkte der Anlageberater aktiv bei bestimmten Emittenten mit (Beispiele für eine solche aktive Mitwirkung waren wesentliche klima- und biodiversitätsbezogene Angelegenheiten), indem er insbesondere die Emittenten ermutigte, sich an das Pariser Abkommen zu halten, wissenschaftlich fundierte Ziele zur Reduzierung von Kohlenstoffemissionen zu übernehmen und/oder ihre Nachhaltigkeitsverpflichtungen auf breiter Basis voranzutreiben.

ANHANG IV

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Low Duration Opportunities ESG Fund Unternehmenskennung: 549300M7ZPBX56GB2C41

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___ %

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___ %

Nein

Es wurden damit **ökologische/soziale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 60% an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel**

**Der Fonds hat während des Berichtszeitraums zwar nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt, er hat sich jedoch nicht dazu verpflichtet, in diese Anlagekategorie zu investieren. Daher sollten derartige Investitionen des Fonds als gelegentliche Investitionen betrachtet werden.

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Ansatz des Fonds für nachhaltige Investitionen besteht in der Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale (auch wenn der Fonds keine nachhaltigen Investitionen zum Ziel hat, ist er bestrebt, einen Teil seines Vermögens in nachhaltige Investitionen zu investieren).

Wie nachstehend näher erläutert, leisteten die vom Fonds im Bezugszeitraum gehaltenen nachhaltigen Investitionen einen Beitrag zu den Umweltzielen der Anpassung an den Klimawandel und/oder des Klimaschutzes.

Die während des Berichtszeitraums vom Fonds gehaltenen Derivate (mit Ausnahme von Indexderivaten) wurden anhand der vom Anlageberater implementierten Ausschlussstrategie überprüft und dementsprechend zur Bewerbung der vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale eingesetzt.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wurde anhand der Umsetzung der Ausschlussstrategie des Anlageberaters, seiner Richtlinie zur Mitwirkung bei den Emittenten und auf der Grundlage der Investitionen in bestimmte festverzinsliche ESG-Wertpapiere (wie im Abschnitt „**Festverzinsliche ESG-Wertpapiere**“ des Prospekts näher beschrieben), die es den Emittenten ermöglichen, Kapital zur Finanzierung von Projekten mit positiven Auswirkungen auf die Umwelt zu beschaffen, gemessen, sowie basierend auf den Investitionen in Schuldtiteln von Emittenten, die bei der Bewältigung von Risiken und Chancen im Zusammenhang mit dem Klimawandel eine Führungsrolle übernehmen.

Beispielsweise führte die Ausschlussstrategie des Fonds zum Ausschluss bestimmter Sektoren, darunter Emittenten, die in Sektoren im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind (einschließlich Emittenten, die hauptsächlich in der Ölindustrie, einschließlich Förderung, Produktion, Raffinerie, Transport oder im Abbau, im Verkauf von Kohle und in der Kohleverstromung tätig sind).

Darüber hinaus bezog sich der Anlageberater im Rahmen des Screening-Verfahrens des Fonds gegebenenfalls auf weltweit anerkannte Standards wie die UNGC-Grundsätze und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte.

● **...und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Informationen zum historischen Vergleich der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen des Fonds sind unten in der Antwort auf die Frage „*Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?*“ dargelegt.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die dem Fonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen leisteten im Bezugszeitraum Beiträge zu den Umweltzielen Klimaschutz und Anpassung an den Klimawandel, die unter anderem durch Investitionen in festverzinsliche ESG-Wertpapiere (wie im Abschnitt „**Festverzinsliche ESG-Wertpapiere**“ des Prospekts näher beschrieben), einschließlich grüner Anleihen, erreicht wurden.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Die nachhaltigen Investitionen des Fonds wurden dahingehend bewertet, dass sie keinen wesentlichen Schaden für ökologische oder soziale Ziele verursachen. Diese Bewertung erfolgte durch die Anwendung verschiedener negativer Nachhaltigkeitsindikatoren durch den Anlageberater, darunter das Engagement in Sektoren im Bereich der fossilen Brennstoffe (wie oben beschrieben) und Treibhausgasemissionen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Wertpapiere wurden gemäß dem internen Nachhaltigkeits-Screening-Verfahren des Anlageberaters ausgewählt. Dieses Screening-Verfahren beinhaltet die Berücksichtigung nachteiliger Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren, insbesondere das Engagement in Sektoren, die mit fossilen Brennstoffen in Zusammenhang stehen (wie oben beschrieben) und das Engagement im Bereich militärische Waffen. Der Anlageberater war bestrebt, die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen zu mindern, unter anderem durch seine Ausschlussstrategie und seine Mitwirkung bei Emittenten.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Der Anlageberater vergewisserte sich, dass die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Richtlinien für multinationale Unternehmen und den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte im Einklang stehen, indem er ein UNGC (UN Global Compact)-Kontroversen-Screening zusammen mit anderen Instrumenten, einschließlich ESG-Scores und Research im Rahmen des Due-Diligence-Prozesses für Anlagen einsetzte.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen werden als die Auswirkungen von Anlageentscheidungen beschrieben, die „negative Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren nach sich ziehen“, während Nachhaltigkeitsfaktoren als „Umwelt-, Sozial- und Mitarbeiterangelegenheiten, Achtung der Menschenrechte, Bekämpfung von Korruption und Bekämpfung von Bestechung“ definiert werden. Der Anlageberater war bestrebt, die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen im Rahmen des Anlageprozesses zu berücksichtigen, und setzte eine Kombination von Methoden ein, einschließlich Engagement und Ausschlüsse von Emittenten, um die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen zu mindern.

Der Fonds berücksichtigte im Bezugszeitraum die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen von Anlageentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (insbesondere das Engagement in Sektoren im Bereich der fossilen Brennstoffe (wie oben beschrieben), im Sektor der militärischen Waffen und Treibhausgasemissionen).



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Größte Investitionen	Sektor	% des Nettovermögens	Land
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.10.2053	Verbriefungen	18,83 %	Vereinigte Staaten
U.S. Treasury Notes 5,000 % fällig am 30.09.2025	Quasi-staatliche Anleihen	7,75 %	Vereinigte Staaten
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.05.2053	Verbriefungen	7,57 %	Vereinigte Staaten
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 5,500 % fällig am 09.03.2028	Investment-Grade-Anleihen	3,93 %	Japan
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,500 % fällig am 01.02.2054	Verbriefungen	3,88 %	Vereinigte Staaten
NatWest Group PLC 4,067 % fällig am 06.09.2028	Investment-Grade-Anleihen	2,16 %	Großbritannien
Mizuho Financial Group, Inc. 3,490 % fällig am 05.09.2027	Investment-Grade-Anleihen	2,13 %	Japan
St. Paul's CLO DAC 4,715 % fällig am 15.01.2032	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	2,08 %	Irland
Mizuho Financial Group, Inc. 0,214 % fällig am 07.10.2025	Investment-Grade-Anleihen	2,01 %	Japan
NTT Finance Corp. 0,082 % fällig am 13.12.2025	Investment-Grade-Anleihen	2,00 %	Japan
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.10.2053	Verbriefungen	1,90 %	Vereinigte Staaten
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,375 % fällig am 15.07.2033	Inflationsgebundene Anleihen	1,89 %	Vereinigte Staaten
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,125 % fällig am 15.01.2033	Inflationsgebundene Anleihen	1,88 %	Vereinigte Staaten
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.07.2032	Inflationsgebundene Anleihen	1,86 %	Vereinigte Staaten
Uniform Mortgage-Backed Security 5,500 % fällig am 01.08.2053	Verbriefungen	1,85 %	Vereinigte Staaten

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum zum 31. Dezember 2023 mit dem Finanzprodukt getätigt wurden

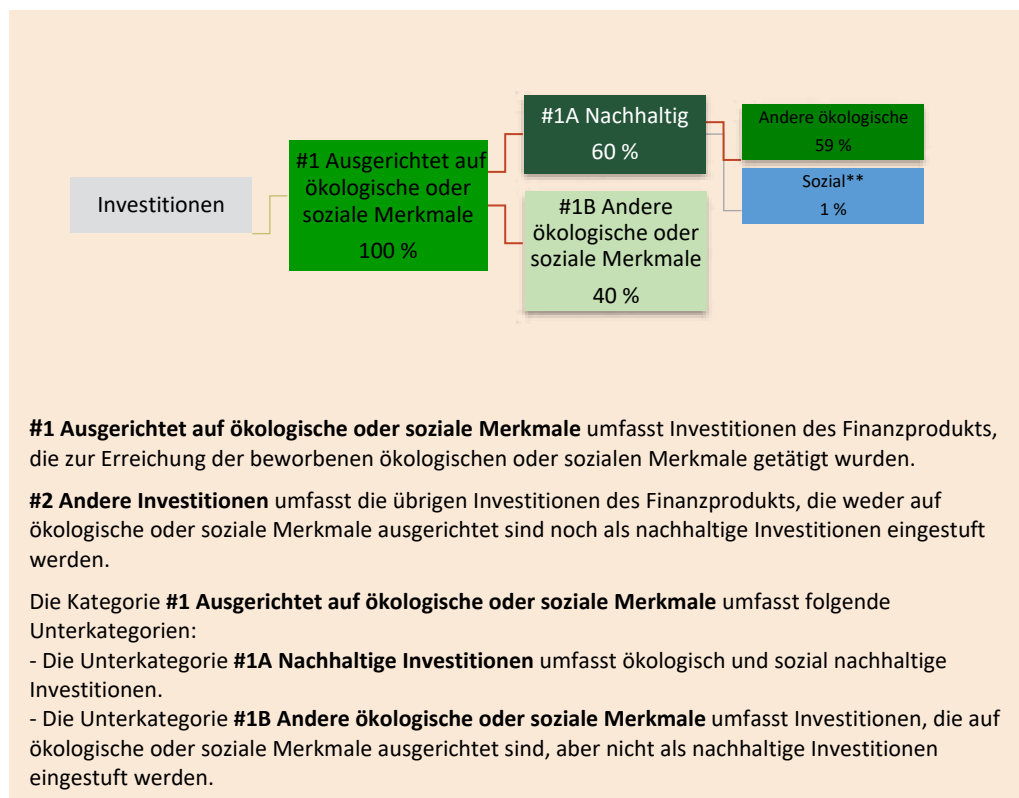
Für die Zwecke der Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Investitionen des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendet.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Informationen über den Anteil des Fonds, mit dem ökologische/soziale Merkmale beworben wurden, und den Anteil an nachhaltigen Investitionen zum 31. Dezember 2023 sind nachfolgend aufgeführt.

● *Wie sah die Vermögensallokation aus?*



Zum 31. Dezember 2023 wurden 100 % der Investitionen des Fonds als Investitionen angesehen, die ökologische und/oder soziale Merkmale bewerben, da alle Investitionen des Fonds (mit Ausnahme von Indexderivaten) anhand der Ausschlussstrategie geprüft wurden (31. Dezember 2022: 100 %).

Zum 31. Dezember 2023 lag der Anteil der nachhaltigen Investitionen bei 60 % des Nettovermögens des Fonds (31. Dezember 2022: 29 %). 59 % des Nettovermögens umfassten nachhaltige Investitionen, die zu einem Umweltziel beitragen (31. Dezember 2022: 28 %).

**Der Fonds hielt auch 1 % seines Nettovermögens in nachhaltigen Investitionen, die zu einem sozialen Ziel beitragen (31. Dezember 2022: 1 %). Es wird darauf hingewiesen, dass der Fonds sich nicht zu nachhaltigen Investitionen, die zu einem sozialen Ziel beitragen, verpflichtet hat. Daher sollten solche Investitionen als gelegentliche Investitionen betrachtet werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Sektor	% des Nettovermögens
Verbriefungen	35,24 %
Investment-Grade-Anleihen	34,35 %
Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	33,25 %
Inflationsgebundene Anleihen	5,63 %
Hochverzinsliche Anleihen	2,05 %
Schwellenmärkte, extern	0,01 %
Quasi-staatliche Anleihen	-10,53 %

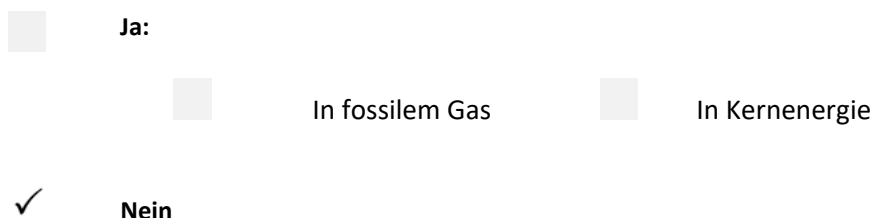
Für die Zwecke der Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Investitionen des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendet.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Zum 31. Dezember 2023 lag der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform sind, bei 0 % (31. Dezember 2022: 0 %). Diese Zahl wurde weder von einem Wirtschaftsprüfer noch von sonstigen Dritten überprüft.

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?**



¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

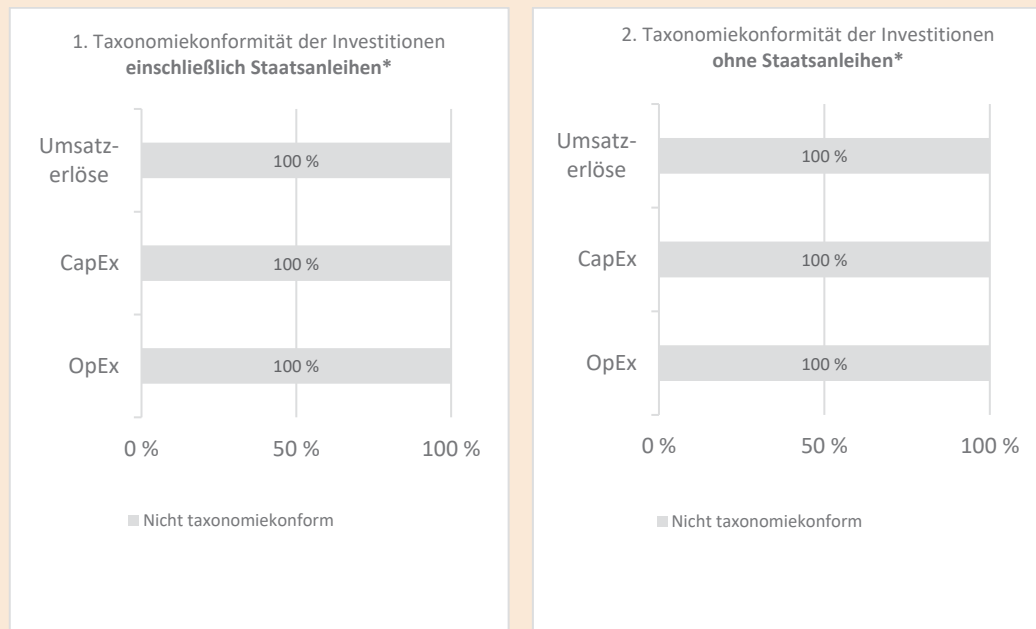
Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Im Bezugszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug der Anteil der Investitionen des Fonds in Übergangs- und ermöglichenden Tätigkeiten 0 % (31. Dezember 2022: 0 %).



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien nicht berücksichtigen**, die für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 erforderlich sind.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Fonds verpflichtet sich nicht, in Anlagen zu investieren, die mit der EU-Taxonomie konform sind, aber er verpflichtet sich, nachhaltige Investitionen zu tätigen, die zu einem Umweltziel beitragen. Zum 31. Dezember 2023 lag der Anteil der nachhaltigen Investitionen des Fonds, die einen Beitrag zu einem Umweltziel leisteten und nicht gemäß der EU-Taxonomie bewertet wurden, sodass sie oben unter „Andere ökologische Investitionen“ eingestuft wurden, bei 59 % (31. Dezember 2022: 28 %). Weitere Informationen zur Verfügbarkeit nachhaltigkeitsbezogener Daten und der damit verbundenen Herausforderungen finden Sie unter <https://europe.pimco.com/en-eu/our-firm/global-advisors-ireland>.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Wie oben dargelegt, entfielen im Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 1 % des Nettovermögens des Fonds auf nachhaltige Investitionen, die zu einem sozialen Ziel beitragen (zum 31. Dezember 2022 betrug der Anteil 1 %). Da sich der Fonds nicht zu nachhaltigen Investitionen, die zu einem sozialen Ziel beitragen, verpflichtet hat, sollten solche Anlagen als gelegentliche Anlagen betrachtet werden.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Wie oben erwähnt, wurde zum 31. Dezember 2023 davon ausgegangen, dass 100 % der Investitionen des Fonds ökologische und/oder soziale Merkmale bewerben, da alle Investitionen des Fonds (mit Ausnahme von Indexderivaten) anhand der Ausschlussstrategie geprüft wurden (31. Dezember 2022: 100 %).

Wie vorstehend näher ausgeführt, belief sich der Anteil an nachhaltigen Investitionen zum 31. Dezember 2023 auf 60 % des Nettovermögens des Fonds (31. Dezember 2022: 29 %).



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Im Bezugszeitraum wirkte der Anlageberater aktiv bei bestimmten Emittenten mit (Beispiele für eine solche aktive Mitwirkung waren wesentliche klima- und biodiversitätsbezogene Angelegenheiten), indem er insbesondere die Emittenten ermutigte, sich an das Pariser Abkommen zu halten, wissenschaftlich fundierte Ziele zur Reduzierung von Kohlenstoffemissionen zu übernehmen und/oder ihre Nachhaltigkeitsverpflichtungen auf breiter Basis voranzutreiben.

Abkürzungen der Kontrahenten:

AZD	Australia and New Zealand Banking Group	CSN	Credit Suisse AG (New York)	MEI	Merrill Lynch International
BOA	Bank of America N.A.	DBL	Deutsche Bank AG London	MSC	Morgan Stanley & Co. LLC.
BOM	Bank of Montreal	DEU	Deutsche Bank Securities, Inc.	MYC	Morgan Stanley Capital Services LLC
BOS	BofA Securities, Inc.	DUB	Deutsche Bank AG	MYI	Morgan Stanley & Co. International PLC
BPG	BNP Paribas Securities Corp.	FAR	Wells Fargo Bank National Association	NGF	Nomura Global Financial Products, Inc.
BPS	BNP Paribas S.A.	FBF	Credit Suisse International	NOM	Nomura Securities International, Inc.
BRC	Barclays Bank PLC	FCT	Credit Suisse Capital LLC	RBC	Royal Bank of Canada
BSH	Banco Santander S.A. - New York Branch	FICC	Fixed Income Clearing Corporation	RCY	Royal Bank of Canada
BSN	The Bank of Nova Scotia - Toronto	GLM	Goldman Sachs Bank USA	RCE	Royal Bank of Canada Europe Limited
BSS	Banco Santander S.A.	GRE	NatWest Markets Securities, Inc.	RYL	NatWest Markets Plc
BYL	Barclays Bank Plc London Branch	GSC	Goldman Sachs & Co. LLC	SAL	Citigroup Global Markets, Inc.
BYR	The Bank of Nova Scotia - Toronto	GST	Goldman Sachs International	SCX	Standard Chartered Bank, London
CBK	Citibank N.A.	HUS	HSBC Bank USA N.A.	SGY	Societe Generale, NY
CDI	Natixis Singapore	IND	Crédit Agricole Corporate and Investment Bank S.A.	SOG	Societe Generale Paris
CEW	Canadian Imperial Bank of Commerce World Markets	JLN	JP Morgan Chase Bank N.A. London	SSB	State Street Bank and Trust Co.
CIB	Canadian Imperial Bank of Commerce	JML	JP Morgan Securities Plc	STR	State Street FICC Repo
CKL	Citibank N.A. London	JPM	JP Morgan Chase Bank N.A.	TDM	TD Securities (USA) LLC
CLY	Crédit Agricole Corporate and Investment Bank	JPS	J.P. Morgan Securities LLC	TOR	The Toronto-Dominion Bank
COM	Commerz Bank AG	MAC	Macquarie Bank Limited	UAG	UBS AG Stamford
		MBC	HSBC Bank Plc	UBS	UBS Securities LLC
				WFS	Wells Fargo Securities, LLC

Währungskürzel:

AED	Dirham der Vereinigten Arabischen Emirate	HKD	Hongkong-Dollar	QAR	Qatari Riyal
ARS	Argentinischer Peso	HUF	Ungarischer Forint	RON	Rumänischer neuer Leu
AUD	Australischer Dollar	IDR	Indonesische Rupie	RSD	Serbischer Dinar
BRL	Brasilianischer Real	ILS	Israelischer Shekel	RUB	Russischer Rubel
CAD	Kanadischer Dollar	INR	Indische Rupie	SEK	Schwedische Krone
CHF	Schweizer Franken	JPY (oder ¥)	Japanischer Yen	SGD	Singapur-Dollar
CLP	Chilenischer Peso	KES	Kenia-Schilling	THB	Thailändischer Baht
CNH	Chinesische Renminbi (Offshore)	KRW	Südkoreanischer Won	TRY	Türkische neue Lira
CNY	Chinesische Renminbi (Mainland)	KZT	Kasachischer Tenge	TWD	Taiwanesischer Dollar
COP	Kolumbianischer Peso	MXN	Mexikanischer Peso	UGX	Uganda-Schilling
CZK	Tschechische Krone	MYR	Malaysischer Ringgit	USD (oder \$)	US-Dollar
DKK	Dänische Krone	NGN	Nigerianische Naira	UYU	Uruguayischer Peso
DOP	Dominikanischer Peso	NOK	Norwegische Krone	VND	Vietnamesischer Dong
EGP	Ägyptisches Pfund	NZD	Neuseeländischer Dollar	ZAR	Südafrikanischer Rand
EUR (oder €)	Euro	PEN	Peruanischer neuer Sol	ZMW	Sambischer Kwacha
GBP (oder £)	Britisches Pfund	PHP	Philippinischer Peso		
GHS	Ghanaischer Cedi	PLN	Polnischer Zloty		

Börsenkürzel:

BIST	Borsa Istanbul Exchange	EUREX	Eurex Exchange	ICE	IntercontinentalExchange®
CBOE	Chicago Board Options Exchange	FTSE	Financial Times Stock Exchange	OTC	Over the Counter

Index-/Spread-Kürzel:

ABX.HE	Asset-Backed Securities Index - Home Equity	CPTFEMU	Eurozone HICP ex-Tobacco Index	PrimeX.ARM	Prime Mortgage-Backed Securities Index - Adjustable Rate Mortgage
ACS	Algonquin Cityfates Natural Gas Basis Futures Index	CPURNSA	Consumer Price All Urban Non-Seasonally Adjusted Index	S&P 500	Standard & Poor's 500 Index
AMNAX	Alerian Midstream Energy Total Return Index	DAX	Deutscher Aktien Index 30	S&P CNX NIFTY	Standard & Poor's Nifty 50 Index
		FRCPXTOB	Französischer Verbraucherpreisindex ohne Tabak	SARON	Swiss Average Rate Overnight
		FTSE/JSE	South African Performance Index	SET 50	Thailand Equity Index
BCOMF1TC	Bloomberg Commodity Index 1-Month Forward Total Return	FTSE/MIB	Index der 40 italienischen Aktien mit der höchsten Liquidität/Marktkapitalisierung der Borsa Italiana	SIBCSORA	Singapore Overnight Rate Average
BCOMTR	Bloomberg Commodity Index Total Return	IBEX 35	Spanish Continuous Exchange Index	SOFR	Secured Overnight Financing Rate
BCOMTR1	Bloomberg Custom Commodity Index	IBR	Indicador Bancario de Referencia	SONIA	Sterling Overnight Interbank Average Rate
BOVESPA	Brazil Bovespa Index	IXUTR	Utilities Select Sector Total Return Index	SOR	Singapore Overnight Rate Average
CAC	Cotation Assistée en Continu	JMABDEWU	J.P. Morgan Custom Commodity Index	SPI 200	Australian Equity Futures Index
CAONREPO	Canadian Overnight Repo Rate Average	JMABNIU5	J.P. Morgan Custom Commodity Index	SPSIHOTR	S&P Homebuilders Select Industry
CDX.EM	Credit Derivatives Index — Emerging Markets	KOSPI	Korea Composite Stock Price Index	SRFXON3	Swiss Overnight Rate Average (6PM)
		KOSPI2	Korea Stock Exchange KOSPI 200 Index	TOPIX	Tokyo Price Index
CDX.HY	Credit Derivatives Index - High Yield	MUTKCALM	Tokyo Overnight Average Rate	TRNGLU	FTSE EPRA/NAREIT Developed Index Net TRI USD
CDX.IG	Credit Derivatives Index – Investment Grade	NASDAQ	National Association of Securities Dealers Automated Quotations	UKRPI	United Kingdom Retail Prices Index
				VSTOXX	Euro Stoxx 50 Volatility Index
				WIG20	Nach Marktkapitalisierung gewichteter Börsenindex der 20 größten Unternehmen an der Warschauer Börse
CIXBSTR3	Individuell zusammengestellter Rohstoffindex	NDUEACWF	MSCI ACWI Index Future		
CMBX	Commercial Mortgage-Backed Index	OMXS30	Stockholm 30 Index		
CNREPOFIX	China Fixing Repo Rates 7-Day	PIMCOBUB	PIMCO Custom Commodity Basket		
CPALEMU	Euro Area All Items Non-Seasonally Adjusted Index				

Kommunalanleihen- oder Behördenkürzel:

AGM	Assured Guaranty Municipal	ST	State		
-----	----------------------------	----	-------	--	--

Sonstige Kürzel:

ABS	Asset-Backed Security (forderungsbesichertes Wertpapier)	HIBOR	Hong Kong Interbank Offered Rate	RMBS	Residential Mortgage-Backed Security (durch Wohnimmobilienkredite besichertes Wertpapier)
ALT	Alternate Loan Trust	JIBAR	Johannesburg Interbank Agreed Rate	SHIR	Shekel Overnight Interest Rate
BABs	Build America Bonds	JSC	Joint Stock Company	STIBOR	Stockholm Interbank Offered Rate
BBR	Bank Bill Rate	KLIBOR	Kuala Lumpur Interbank Offered Rate	STRIPS	Getrennter Handel von Zinszahlungen (Coupon Stripping) und Rückzahlungsbetrag (Mantel)
BBSW	Bank Bill Swap Reference Rate	KORIBOR	Korea Interbank Offered Rate	TAIBOR	Taipei Interbank Offered Rate
BRL-CDI	Brazil Interbank Deposit Rate	LIBOR	London Interbank Offered Rate	TBA	To-Be-Announced
BTP	Buoni del Tesoro Poliennali „Long-term Treasury Bond“	MIBOR	Mumbai Interbank Offered Rate	TBD	To-Be-Determined
CBO	Collateralized Bond Obligation	MSCI	Morgan Stanley Capital International	TBD%	Bei Abrechnung des Darlehens oder zum Zeitpunkt der Finanzierung zu ermittelnder Zinssatz
CDI	Brazil Interbank Deposit Rate	NIBOR	Norwegian Interbank Offered Rate	TELBOR	Tel Aviv Inter-Bank Offered Rate
CDO	Collateralised Debt Obligation (besicherte Schuldverschreibungen)	OAT	Obligations Assimilables du Trésor	THB-THORON	Thai Overnight Repurchase Rate
CHILIBOR	Chile Interbank Offered Rate	PIK	Payment-in-Kind (Sachauschüttung)	TIIE	Tasa de Interés Interbancaria de Equilibrio „Gleichgewichtszinssatz im Interbankengeschäft“
CLO	Collateralised Loan Obligation (durch Kreditportfolio besichertes Wertpapier)	PRIBOR	Prague Interbank Offered Rate		
CMBS	Collateralised Mortgage-Backed Security	REIT	Real Estate Investment Trust (Immobilieninvestmentfonds)		
DAC	Designated Activity Company	REMIC	Real Estate Mortgage Investment Conduit	WIBOR	Warsaw Interbank Offered Rate
EURIBOR	Euro 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,
Mantova
Italien.

RBC Investor Services Bank S.A.,
Zweigniederlassung Mailand,
Via Vittor Pisani, 26,
20124 Mailand,
Italien.

CACEIS Bank, Zweigniederlassung 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.

ZAHLSTELLE UND REPRÄSENTANT IN DER SCHWEIZ

BNP PARIBAS Paris,
Zweigniederlassung 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 INFORMATIONSTELLE

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.,
Herrngasse 12,
FL-9490 Vaduz,
Liechtenstein.

ZAHLSTELLE IN ZYPERN

EUROBANK CYPRUS LTD.,
28, Spyrou Kyprianou Avenue,
1075 Nicosia
Zypern.

RECHTSBERATER FÜR IRISCHES RECHT

Dillon Eustace LLP,
33 Sir John Rogerson's Quay,
Dublin 2,
D02 XK09,
Irland.

RECHTSBERATER FÜR US-RECHT

Dechert LLP,
1900 K Street N.W.,
Washington, D.C. 20006,
USA.

UNABHÄNGIGE ABSCHLUSSPRÜFER

PricewaterhouseCoopers
Chartered Accountants und Statutory
Audit Firm,
One Spencer Dock,
North Wall Quay,
Dublin 1,
D01 X9R7,
Irland.

SEKRETÄR

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 Ananthanarayanan¹ (Indien)
Ryan P. Blute¹ (USA)
Craig A. Dawson¹ (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 31. Dezember 2023 abgelaufenen Geschäftsjahr kann von den Anteilhabern kostenlos bei der Verwahrstelle oder den Zahlstellen sowie bei der Zahl- und Informationsstelle in Deutschland und der Vertretungsstelle in der Schweiz bezogen werden.

¹ Mitarbeiter von PIMCO.

PIMCO Europe Ltd (Registernummer 2604517) wurde von der Financial Conduct Authority (12 Endeavour Square, London, E20 1JN) in Großbritannien zugelassen und stehen unter deren Aufsicht. Die von PIMCO Europe Ltd erbrachten Dienstleistungen sind nicht für Kleinanleger verfügbar, die sich nicht auf diese Unterlagen verlassen sollten, sondern ihren Finanzberater kontaktieren sollten.

PIMCO Europe GmbH (Registernummer 192083, Seidlstr. 24-24a, 80335 München, Deutschland), die italienische Zweigniederlassung der PIMCO Europe GmbH (Gesellschaftsnummer 10005170963), die irische Zweigniederlassung der PIMCO Europe GmbH (Gesellschaftsnummer 909462), die britische Zweigniederlassung der PIMCO Europe GmbH (N.I.F. W2765338E) und die spanische Zweigniederlassung der PIMCO Europe GmbH (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 Wertpapierinstitutsgesetzes (WpIG) reguliert. Die italienische Zweigniederlassung, die irische Zweigniederlassung, die britische Zweigniederlassung und die spanische Zweigniederlassung werden zusätzlich überwacht von: (1) italienische Zweigniederlassung: der Commissione Nazionale per le Società e la Borsa (CONSOB) gemäß Artikel 27 des italienischen konsolidierten Finanzgesetzes; (2) irische Zweigniederlassung: der Zentralbank von Irland gemäß Vorschrift 43 der Verordnung der Europäischen Union über Märkte für Finanzinstrumente von 2017 in der jeweils gültigen Fassung; (3) britische Zweigniederlassung: der Financial Conduct Authority und (4) spanische Zweigniederlassung: 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 sollten, sondern ihren Finanzberater kontaktieren sollten.