

NEUBERGER BERMAN



NEUBERGER BERMAN INVESTMENT FUNDS PLC  
HALBJAHRESBERICHT 2023

UNGEPRÜFTE VERKÜRZTE HALBJAHRESABSCHLUSS  
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

# Inhaltsverzeichnis

|  | SEITE |
|--|-------|
| <b>GESCHÄFTSFÜHRUNG UND VERWALTUNG</b>   | 1     |
| <b>ALLGEMEINE INFORMATIONEN</b>  | 3     |
| <b>BERICHT DES INVESTMENT-MANAGERS</b>   | 5     |
| Neuberger Berman 5G Connectivity Fund (oder „5G Connectivity“)   | 61    |
| Neuberger Berman Absolute Return Multi Strategy Fund (oder „Absolute Return Multi Strategy“)   | 66    |
| Neuberger Berman Asian Debt - Hard Currency Fund (oder „Asian Debt - Hard Currency“)   | 67    |
| Neuberger Berman China A-Share Equity Fund (oder „China A-Share Equity“)   | 75    |
| Neuberger Berman China Bond Fund (oder „China Bond“)   | 77    |
| Neuberger Berman China Equity Fund (oder „China Equity“)   | 81    |
| Neuberger Berman CLO Income Fund (oder „CLO Income“)   | 84    |
| Neuberger Berman Commodities Fund (oder „Commodities“)   | 88    |
| Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund (oder „Corporate Hybrid Bond“)   | 91    |
| Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund (oder „Emerging Market Debt - Hard Currency“)                                       | 95    |
| Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund (oder „Emerging Market Debt - Local Currency“)                                     | 107   |
| Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund (oder „Emerging Market Debt Blend“)   | 121   |
| Neuberger Berman Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend Fund (oder „Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend“) | 145   |
| Neuberger Berman Emerging Markets Equity Fund (oder „Emerging Markets Equity“)   | 159   |
| Neuberger Berman Emerging Markets Select Equity Fund (oder „Emerging Markets Select Equity“)   | 165   |
| Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund (oder „Euro Bond Absolute Return“)   | 169   |
| Neuberger Berman Euro Opportunistic Bond Fund (oder „Euro Opportunistic Bond“)   | 177   |
| Neuberger Berman European High Yield Bond Fund (oder „European High Yield Bond“)   | 182   |
| Neuberger Berman European Sustainable Equity Fund (oder „European Sustainable Equity“)   | 190   |
| Neuberger Berman Event Driven Fund (oder „Event Driven“)   | 192   |
| Neuberger Berman Global Bond Fund (oder „Global Bond“)   | 194   |

## Inhaltsverzeichnis (Fortsetzung)

|  | SEITE |
|--|-------|
| Neuberger Berman Global Diversified Income FMP – 2024 (oder „Global Diversified Income FMP – 2024“)                              | 216   |
| Neuberger Berman Global Equity Megatrends Fund (oder „Global Equity Megatrends“)   | 219   |
| Neuberger Berman Global Flexible Credit Income Fund (oder „Global Flexible Credit Income“)                                       | 221   |
| Neuberger Berman Global High Yield SDG Engagement Fund (oder „Global High Yield SDG Engagement“)                                 | 235   |
| Neuberger Berman Global High Yield Sustainable Action Fund (oder „Global High Yield Sustainable Action“)                         | 251   |
| Neuberger Berman Global Investment Grade Credit Fund (oder „Global Investment Grade Credit“)                                     | 252   |
| Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund (oder „Global Opportunistic Bond“)   | 260   |
| Neuberger Berman Global Real Estate Securities Fund (oder „Global Real Estate Securities“)                                       | 281   |
| Neuberger Berman Global Sustainable Equity Fund (oder „Global Sustainable Equity“)   | 285   |
| Neuberger Berman High Yield Bond Fund (oder „High Yield Bond“)   | 287   |
| Neuberger Berman InnovAsia 5G Fund (oder „InnovAsia 5G“)   | 304   |
| Neuberger Berman Japan Equity Engagement Fund (oder „Japan Equity Engagement“)   | 308   |
| Neuberger Berman Macro Opportunities FX Fund (oder „Macro Opportunities FX“)   | 311   |
| Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund (oder „Multi-Asset Income“)   | 317   |
| Neuberger Berman Next Generation Mobility Fund (oder „Next Generation Mobility“)   | 324   |
| Neuberger Berman Next Generation Space Economy Fund (oder „Next Generation Space Economy“)                                       | 328   |
| Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund (oder „Short Duration Emerging Market Debt“)                           | 330   |
| Neuberger Berman Short Duration High Yield SDG Engagement Fund (oder „Short Duration High Yield SDG Engagement“)                 | 343   |
| Neuberger Berman Strategic Income Fund (oder „Strategic Income“)   | 354   |
| Neuberger Berman Sustainable Asia High Yield Fund (oder „Sustainable Asia High Yield“)   | 386   |
| Neuberger Berman Sustainable Emerging Market Corporate Debt Fund (oder „Sustainable Emerging Market Corporate Debt“)             | 390   |
| Neuberger Berman Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency Fund (oder „Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency“) | 401   |
| Neuberger Berman Systematic Global Sustainable Value Fund (oder „Systematic Global Sustainable Value“)                           | 407   |

## Inhaltsverzeichnis (Fortsetzung)

|   | SEITE |
|---|-------|
| <b>Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund (oder „Ultra Short Term Euro Bond“)</b>                                   | 417   |
| <b>Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (oder „Uncorrelated Strategies“)</b>   | 427   |
| <b>Neuberger Berman US Equity Fund (oder „US Equity“)</b>   | 593   |
| <b>Neuberger Berman US Equity Index PutWrite Fund (oder „US Equity Index PutWrite“)</b>                                       | 596   |
| <b>Neuberger Berman US Large Cap Value Fund (oder „US Large Cap Value“)</b>   | 599   |
| <b>Neuberger Berman US Long Short Equity Fund (oder „US Long Short Equity“)</b>   | 603   |
| <b>Neuberger Berman US Multi Cap Opportunities Fund (oder „US Multi Cap Opportunities“)</b>                                   | 612   |
| <b>Neuberger Berman US Real Estate Securities Fund (oder „US Real Estate Securities“)</b>                                     | 616   |
| <b>Neuberger Berman US Small Cap Fund (oder „US Small Cap“)</b>   | 620   |
| <b>Neuberger Berman US Small Cap Intrinsic Value Fund (oder „US Small Cap Intrinsic Value“)</b>                               | 625   |
| <b>BILANZEN</b>   | 628   |
| <b>GEWINN- UND VERLUSTRECHNUNG</b>  | 643   |
| <b>AUFSTELLUNG ÜBER DIE ENTWICKLUNG DES AUF INHABER RÜCKZAHLBARER, GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDEN NETTOVERMÖGENS</b> | 658   |
| <b>AUFSTELLUNG DER WESENTLICHEN KÄUFE UND VERKÄUFE</b>  | 666   |
| <b>ANMERKUNGEN ZUM UNGEPRÜFTEN VERKÜRZTEN HALBJAHRESABSCHLUSS</b>   |       |
| Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze   | 774   |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 776   |
| Kontenüberziehung   | 776   |
| Anteilkapital   | 776   |
| Gebühren des Managers, der Verwaltungsstelle, der Vertriebsstelle und der Verwahrstelle                                       | 777   |
| Honorare und Aufwendungen der Direktoren  | 801   |
| Sonstige Gebühren und Kosten  | 801   |
| Transaktionen verbundener Parteien  | 802   |
| Vergleichszahlen für den Nettoinventarwert  | 820   |
| Angaben zu Finanzinstrumenten   | 896   |
| Wechselkurse  | 947   |
| Berichtigung der Währungsumrechnung   | 948   |
| Vereinbarungen über Verrechnungsprovisionen (Soft Commissions)  | 949   |
| Getrennte Haftung   | 949   |
| Effizientes Portfoliomanagement   | 949   |
| Kreditfazilität   | 950   |
| Ungedeckte Kreditzusagen  | 950   |

## Inhaltsverzeichnis (Fortsetzung)

|  | SEITE       |
|--|-------------|
| Vergleichszahlen   | 950         |
| Wichtige Ereignisse während des Berichtszeitraums  | 950         |
| Wesentliche Ereignisse seit dem Ende des Berichtszeitraums                                 | 950         |
| Genehmigung des Abschlusses  | 951         |
| <b>ANHANG I – GESAMTKOSTENQUOTEN</b>   | <b>952</b>  |
| <b>ANHANG II – VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN</b>                         | <b>980</b>  |
| <b>ANHANG III – GLOSSAR DER INDIZES</b>  | <b>996</b>  |
| <b>ANHANG IV – INVESTMENT-MANAGER, SUB-INVESTMENT-MANAGER UND UNTERBERATER (UNGEPRÜFT)</b> | <b>1002</b> |

## Geschäftsführung und Verwaltung

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

### Direktoren:

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

\*Nicht geschäftsführender Direktor

\*\*Unabhängiger, nicht geschäftsführender Direktor und ständiger Vorsitzender

\*\*\*Unabhängiger, nicht geschäftsführender Direktor

\*\*\*\*Unabhängiger, nicht geschäftsführender Direktor und Vorsitzender  
 (seit dem 1. Juli 2023)

### Rechtsberater für irisches Recht:

Matheson LLP  
 70 Sir John Rogerson's Quay  
 Dublin 2  
 Irland

### Verwahrstelle:

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

### Manager:

Neuberger Berman Asset Management Ireland Limited  
 2 Central Plaza  
 Dame Street  
 Dublin 2  
 Irland

### Vertriebsstellen und Sub-Investment-Manager:

Neuberger Berman Asia Limited  
 20<sup>th</sup> Floor  
 Jardine House  
 1 Connaught Place  
 Central Hong Kong

Neuberger Berman Singapore Pte. Limited  
 Stufe 15  
 Ocean Financial Centre  
 10 Collyer Quay  
 Singapur 049315

Neuberger Berman Europe Limited  
 The Zig Zag Building  
 70 Victoria Street  
 London SW1E 6SQ  
 England

### Vertriebsstelle:

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

### Nicht verbundener Unterberater:

Neuberger Berman Investment Management  
 (Shanghai) Limited\*\*\*\*\*  
 Room B01 of Units 4205, 4206 and 4207  
 No.479 Lujiazui Ring Road  
 China (Shanghai) Pilot Free Trade Zone, 200120  
 Republik China

\*\*\*\*\*Die Neuberger Berman Fund Management (China) Limited wird die Neuberger Berman Investment Management (Shanghai) Limited bis zum Jahresende als Anlageberater für Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund, Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund und Neuberger Berman China Bond Fund ersetzen.

### Verwaltungsstelle:

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

### Unabhängige Wirtschaftsprüfer:

Ernst & Young  
 Chartered Accountants  
 Harcourt Centre  
 Harcourt Street  
 Dublin 2  
 Irland

### Vertreter in der Schweiz:\*\*\*\*\*

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

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

## Geschäftsführung und Verwaltung (Fortsetzung)

### Secretary des Fonds und eingetragener Geschäftssitz:

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

### Sub-Investment-Manager:

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

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

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

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

### Hauptvertreter und Vertriebsstelle in Taiwan:

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

### Nicht verbundene Unterberater:

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

Soloda Investment Advisers LLP  
3<sup>rd</sup> Floor Strand Bridge House  
138-142 Strand London WC2R 1HH  
Großbritannien

### Nicht verbundene Unterberater (Fortsetzung):

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

Altiq LLP  
29 Farm Street  
London W1J 5RL  
Großbritannien

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

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

Alcova Asset Management LLP  
21 Knightsbridge  
London SW1X 7LY  
Großbritannien

Sandbar Asset Management LLP  
Warnford Court  
14-15 Conduit Street  
London W1S 2XJ  
Großbritannien

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

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

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

## Allgemeine Informationen

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

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

Am 30. Juni 2023 umfasste der Fonds 53 separate Anlageportfolios („Portfolios“), die jeweils eine separate Serie rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile repräsentierten. Diese werden in der nachstehenden Tabelle angegeben:

| Portfolio  | Auflegungsdatum*  | SFDR-Kategorie |
|--|-------------------|----------------|
| 5G Connectivity <sup>1</sup>   | 8. April 2020     | Artikel 8      |
| Asian Debt – Hard Currency <sup>1</sup>                              | 29. Juni 2015     | Artikel 8      |
| China A-Share Equity <sup>2</sup>                                    | 28. Juli 2020     | Artikel 8      |
| China Bond <sup>1</sup>  | 28. August 2015   | Artikel 8      |
| China Equity <sup>1</sup>  | 14. Juli 2009     | Artikel 6      |
| CLO Income <sup>2</sup>  | 12. Juli 2018     | Artikel 6      |
| Commodities <sup>2</sup>   | 9. Februar 2022   | Artikel 6      |
| Corporate Hybrid Bond <sup>2</sup>                                   | 19. November 2015 | Artikel 8      |
| Emerging Market Debt – Hard Currency <sup>1</sup>                    | 31. Mai 2013      | Artikel 8      |
| Emerging Market Debt – Local Currency <sup>1</sup>                   | 28. Juni 2013     | Artikel 8      |
| Emerging Market Debt Blend <sup>1</sup>                              | 23. April 2014    | Artikel 8      |
| Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend <sup>2</sup> | 10. Juli 2017     | Artikel 8      |
| Emerging Markets Equity <sup>1</sup>                                 | 4. Oktober 2010   | Artikel 8      |
| Emerging Markets Select Equity <sup>2</sup>                          | 24. Oktober 2017  | Artikel 8      |
| Euro Bond Absolute Return <sup>2</sup>                               | 29. November 2018 | Artikel 8      |
| Euro Opportunistic Bond <sup>2</sup>                                 | 14. November 2018 | Artikel 8      |
| European High Yield Bond <sup>1</sup>                                | 27. Juni 2014     | Artikel 8      |
| European Sustainable Equity <sup>1</sup>                             | 24. Februar 2021  | Artikel 8      |
| Event Driven <sup>2</sup>  | 26. Oktober 2022  | Artikel 6      |
| Global Bond <sup>1</sup>   | 16. Juli 2012     | Artikel 8      |
| Global Diversified Income FMP – 2024 <sup>2</sup>                    | 22. Juni 2020     | Artikel 8      |
| Global Equity Megatrends <sup>1</sup>                                | 27. April 2018    | Artikel 8      |
| Global Flexible Credit Income <sup>2</sup>                           | 1. Juni 2020      | Artikel 8      |
| Global High Yield SDG Engagement <sup>2</sup>                        | 4. August 2016    | Artikel 8      |
| Global Investment Grade Credit <sup>2</sup>                          | 1. September 2021 | Artikel 8      |
| Global Opportunistic Bond <sup>2</sup>                               | 20. Dezember 2016 | Artikel 8      |
| Global Real Estate Securities <sup>1</sup>                           | 30. Dezember 2014 | Artikel 8      |
| Global Sustainable Equity <sup>1</sup>                               | 24. Februar 2021  | Artikel 8      |
| High Yield Bond <sup>1</sup>   | 3. Mai 2006       | Artikel 8      |
| InnovAsia 5G <sup>2</sup>  | 14. Juli 2021     | Artikel 8      |
| Japan Equity Engagement <sup>2</sup>                                 | 12. Mai 2020      | Artikel 8      |



## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

| Portfolio   | Auflegungsdatum*  | SFDR-Kategorie |
|---|-------------------|----------------|
| Macro Opportunities FX <sup>2</sup>                                       | 4. Dezember 2019  | Artikel 6      |
| Multi-Asset Income <sup>2</sup>   | 28. Dezember 2016 | Artikel 8      |
| Next Generation Mobility <sup>1</sup>                                     | 21. August 2018   | Artikel 8      |
| Next Generation Space Economy <sup>1</sup>                                | 10. Mai 2022      | Artikel 8      |
| Short Duration Emerging Market Debt <sup>1</sup>                          | 31. Oktober 2013  | Artikel 8      |
| Short Duration High Yield SDG Engagement <sup>1</sup>                     | 20. Dezember 2011 | Artikel 8      |
| Strategic Income <sup>1</sup>   | 26. April 2013    | Artikel 8      |
| Sustainable Asia High Yield <sup>1</sup>                                  | 13. Dezember 2021 | Artikel 8      |
| Sustainable Emerging Market Corporate Debt <sup>1</sup>                   | 14. Juni 2013     | Artikel 8      |
| Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency <sup>2</sup>             | 19. Januar 2022   | Artikel 9      |
| Systematic Global Sustainable Value <sup>2</sup>                          | 18. Dezember 2014 | Artikel 8      |
| Neuberger Berman Tactical Macro Fund <sup>2</sup> (oder „Tactical Macro“) | 30. Juni 2023     | Artikel 6      |
| Ultra Short Term Euro Bond <sup>2</sup>                                   | 31. Oktober 2018  | Artikel 8      |
| Uncorrelated Strategies <sup>2</sup>                                      | 22. Mai 2017      | Artikel 6      |
| US Equity <sup>2</sup>  | 18. Dezember 2015 | Artikel 8      |
| US Equity Index PutWrite <sup>2</sup>                                     | 30. Dezember 2016 | Artikel 6      |
| US Large Cap Value <sup>1</sup>   | 20. Dezember 2021 | Artikel 8      |
| US Long Short Equity <sup>2</sup>   | 28. Februar 2014  | Artikel 8      |
| US Multi Cap Opportunities <sup>1</sup>                                   | 13. Juni 2006     | Artikel 8      |
| US Real Estate Securities <sup>1</sup>                                    | 1. Februar 2006   | Artikel 8      |
| US Small Cap <sup>1</sup>   | 1. Juli 2011      | Artikel 8      |
| US Small Cap Intrinsic Value <sup>2</sup>                                 | 30. April 2015    | Artikel 6      |

\*Erster Tag des Geschäftsbetriebs.

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

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

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

Der Neuberger Berman Uncorrelated Trading Fund (oder „Uncorrelated Trading“) und Neuberger Berman Global High Yield Sustainable Action Fund (oder „Global High Yield Sustainable Action“) wurden am 24. Mai 2023 bzw. 16. Juni 2023 aufgelöst und stehen daher nicht mehr zur Zeichnung zur Verfügung. Neuberger Berman Diversified Currency Fund, Neuberger Berman Multi-Style Premia Fund, Neuberger Berman Absolute Return Multi Strategy Fund, Neuberger Berman Global Equity Index PutWrite Fund und Neuberger Berman US Large Cap Growth Fund wurden in den vorangegangenen Berichtsjahren aufgelöst und stehen daher nicht mehr zur Zeichnung zur Verfügung.

## 5G Connectivity – Bericht des Investment-Managers

Für den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 22,37 %. Der als Benchmark dienende MSCI All-Country World Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der „Index“) verbuchte im selben Zeitraum ein Plus von 13,93 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Angesichts der Sorgen um das Wirtschaftswachstum, einer Regionalbankenkrise in den USA und anhaltender geopolitischer Spannungen waren die Märkte volatil.
- Ein langsames Zinserhöhungstempo der US-Notenbank Federal Reserve Board führte zu einer allgemeinen Outperformance von Tech- und Growth-Werten.
- Megacap-Wachstumsaktien dominierten, und die überschwängliche Stimmung in Bezug auf künstliche Intelligenz (KI) löste eine Rallye damit verbundener Engagements aus.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf seine Wertentwicklung auswirkten.

- Positivbeiträge zur relativen Gesamrendite:
  - Die Einzeltitelauswahl und eine Übergewichtung im Halbleitersektor im Vergleich zum Index.
  - Die Einzeltitelauswahl im Software-Segment, insbesondere in Enterprise-Cloud- und Cybersicherheitssoftware
  - KI-Gewinner unter besonders leistungsstarken Anbietern von Halbleitern und Hochgeschwindigkeitsnetzen.
- Negativbeiträge zur relativen Gesamrendite:
  - Die im Vergleich zum Index übergewichtete Position in China wurde dadurch belastet, dass die makroökonomische Erholung langsamer vonstatten ging als erwartet und die Anreize begrenzt blieben.
  - Die relative Untergewichtung in Tech-Megacaps im Vergleich zum Index.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Weiterer Fokus auf führenden Halbleiter- und Geräteanbietern angesichts strategischer Investitionen von Staaten und Unternehmen, des Onshoring von Lieferketten und der strukturellen Trends in der KI.
- Der solide Ausblick in Teilbereichen der Industrie veranlasste uns zu verstärktem Engagement in Wegbereitern der Industrieautomation und Anbietern von Lösungen für das Energiemanagement.
- Verstärktes Engagement in Tech-Large-Caps, Enterprise-Cloud-Software und auf wieder beschleunigtes Wachstum ausgerichtete Internetunternehmen.
- Vermindertes Engagement in China und in Unternehmen mit schwächerem Wachstumsausblick.

Die Zinsen steigen zwar langsamer, doch die makroökonomische Unsicherheit könnte anhalten. Wir setzen daher weiterhin auf Qualität, sind aber durchaus bereit, taktische Gelegenheiten zu nutzen und uns für zyklisches Wachstum zu positionieren. Es herrscht nach wie vor Volatilität, sodass unser Fokus weiter auf Bereichen mit kräftigem Rückenwind für die Erträge und guter Vorhersehbarkeit liegt. Dabei achten wir auf Bewertungsdisziplin. Das 5G-Thema nimmt Fahrt auf, da es zu einer globalen Priorität wurde und die Digitalisierung der Wirtschaft unwiderruflich voranschreitet. Nutznießer der beschleunigten Einführung von KI und 5G, eine strategische Halbleiterindustrie und die Verbreitung des industriellen Internets der Dinge („IoT“) beurteilen wir optimistisch. Flexibilität ist das A und O, und wir beabsichtigen, Verzerrungen an den Märkten zu nutzen, um auf höherwertige Engagements zu setzen, bei denen wir immer bessere Aussichten, mehr Ertragskraft und eine Bestätigung unserer 5G-Anlagethese erkennen.

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

Für den sechsmontatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 betrug die Gesamttrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 3,23 %. Der als Benchmark dienende JPM Asia Hard Currency (Total Return, USD) (der „Index“) verzeichnete im selben Zeitraum ein Plus von 2,92 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamttrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Die Marktstimmung für asiatische Unternehmensanleihen mit Investment Grade („IG“) wurde insgesamt hauptsächlich von Entwicklungen in Bezug auf Inflation und Geldpolitik geprägt, insbesondere mit Blick auf US-Zinsen und deren Auswirkungen auf die Märkte für hochwertige, auf harte Währung lautende asiatische Unternehmensanleihen. Haupttreiber für die asiatischen Hochzinsmärkte („HY“) waren nach wie vor Entwicklungen im chinesischen Hochzins-Immobilienmarkt. Die positive Dynamik vom Jahresbeginn nahm gegen Ende des Berichtszeitraums ab.
- Der Immobiliensektor wartet nach dem im letzten Jahr von den Behörden angekündigten 16-Punkte-Plan nach wie vor auf konkretere Unterstützung.
- Im Segment der Staatsanleihen aus Frontier-Märkten stellten die Behörden Sri Lankas Umschuldungspläne vor. Aus diesen Plänen geht auch eine Umstrukturierung von Auslandsschulden hervor, die günstiger ausfällt als erwartet, was zu positiven Kursentwicklungen bei auf US-Dollar lautenden Anleihen Sri Lankas führte.
- Die Spreads asiatischer IG-Anleihen verengten sich im Berichtszeitraum auf breiter Front. Die Fundamentaldaten für hochwertige Emittenten blieben dabei robust.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf seine Wertentwicklung auswirkten.

- Positivbeiträge zur relativen Gesamttrendite:
  - Die Asset-Allokation wirkte sich insgesamt positiv aus. Dem lagen unter anderem Übergewichtungen in Sri Lanka, Indien und Südkorea zugrunde.
  - Aus Sektorperspektive stammten die höchsten Beiträge zur relativen Rendite gegenüber dem Index aus der Positionierung in Staatsanleihen, Versorgungs- und Industrierwerten.
  - Mit Blick auf das Vorstehende zählen zu den besonderen Highlights unter den Positionen die Übergewichtung des Portfolios im indischen Sektor für erneuerbare Energie, die Wertpapierauswahl in Südkorea, insbesondere im Finanzsektor, sowie die Übergewichtung des Portfolios in Sri Lanka in der Erwartung eines Restwerts (Recovery Value), der über den aktuellen Marktkursen liegt.
- Negativbeiträge zur relativen Gesamttrendite:
  - Die Übergewichtung des Portfolios im Transportsektor schadete der relativen Wertentwicklung, wenn auch nur in geringem Maße.
  - Die untergewichtete Portfolioposition im Öl- und Gassektor minderte den relativen Ertrag geringfügig.
  - Die Untergewichtung des Portfolios in kurz laufenden chinesischen IG-Unternehmensanleihen vergrößerte den Ertragsrückstand.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Portfolio baute seine Allokation in Sri Lanka aus, was den im Vergleich zu den Marktpreisen höheren Restwerten geschuldet war.
- Das Portfolio verstärkte seine Allokation in Macau, weil die Erholung des Tourismus zuversichtlich beurteilt wurde und ein klarer Trend zum Schuldenabbau vorlag.
- Ansonsten wurde auch die Allokation in Südkorea durch bestimmte Finanzwerte und Unternehmensanleihen verstärkt, unter anderem durch attraktiv bepreiste Primäremissionen.
- Wir verringerten unser Engagement in bestimmten hochverzinslichen Emissionen von Bauträgern, da die Kurserholung angesichts der politischen Gerüchte überzogen wirkte.

Nachdem 2023 zur Hälfte vorüber ist, gehen wir davon aus, dass die Aussichten für die Anlageklasse besser geworden sind. Da wir bereits eine erhebliche Straffung der Geldpolitik hinter uns haben und die Inflation sowohl in den USA als auch in großen asiatischen Volkswirtschaften ihren Höhepunkt überschritten haben könnte, sollte der durch steigende Zinssätze bedingte Druck nachlassen und könnte in Zukunft zu einem eher zweischneidigen Risiko werden. Nach den kräftigen Wiederöffnungsimpulsen im ersten Quartal war die Wachstumsdynamik in China im Folgequartal eher verhalten. Bei chinesischen HY-Unternehmensanleihen bestehen weiterhin Ausfallrisiken, was auf neuerliche Schwäche auf dem Immobilienmarkt zurückzuführen ist. Wir rechnen für das Gesamtjahr 2023 dennoch mit niedrigeren Ausfallquoten für asiatischen Hochzinspapiere als 2022.

Die Wiederöffnungsdynamik in China lässt zwar nach, doch wir gehen davon aus, dass das offizielle Wachstumsziel von 5 % für 2023 erreicht wird und dass der breitere China-abhängige Komplex einschließlich Macaus künftig profitieren dürfte.

Wir halten das Engagement in Sri Lanka nach dem jüngsten Aufwärtspotenzial bei den Kursen aufrecht und gehen davon aus, dass die Restwerte über den aktuellen Marktpreisen liegen werden. Andernorts bleiben wir angesichts der attraktiven Fundamentaldaten und der Bewertungen gegenüber Kreditgelegenheiten positiv, insbesondere in Süd- und Südostasien einschließlich Indien. Im IG-Segment wirken koreanische Unternehmensanleihen und Finanztitel im Verhältnis zu ihrem hohen Rating attraktiv bewertet. Finanzwerte beurteilen wir auch deshalb optimistisch, weil sie von robusten heimischen Volkswirtschaften, einem entgegenkommenden aufsichtsrechtlichen Umfeld und einer lockeren Zentralbankpolitik profitieren.

Die Hauptrisiken für unsere insgesamt positive Einschätzung sehen wir entweder in einer möglichen tiefen globalen Rezession, die die Spreads der Schwellenländer erheblich weiten würde, oder in einer unerwarteten Beschleunigung der Inflationsdynamik weltweit, die deutlich mehr Zinserhöhungen erforderlich machen könnte. Der vor allem in den USA potenziell holprige Weg zum Inflationsziel dürfte Zeit in Anspruch nehmen und könnte weitere Zinsvolatilität auslösen. Dennoch halten wir die Bewertungen von auf harte Währungen lautenden asiatischen Anleihen auf absoluter wie relativer Basis im Vergleich zu Unternehmensanleihen aus Industrieländern für attraktiv.

## China A-Share Equity – Bericht des Investment-Managers

Für den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 betrug die Gesamttrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse CNY I -3,85 %. Der als Benchmark dienende MSCI China A Onshore Net Index (Total Return, CNY) (der „Index“) verzeichnete im selben Zeitraum -0,12 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamttrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Chinesische A-Aktien gaben nach, weil Anzeichen für eine Abschwächung der Konjunkturerholung sowie ein Mangel an ernstzunehmenden staatlichen Anreizen vorlagen.
- Die Aktivität im Zusammenhang mit Immobilien sowie die privatwirtschaftlichen Investitionen zeigten ebenfalls Schwäche.
- Kommunikationsdienste, IT und Energie erzielten die höchsten Renditevorsprünge, Immobilien, Basiskonsumgüter und Gesundheitswesen brachen am stärksten ein.
- Die Spannungen zwischen den USA und China, die die Anlegerstimmung belastet hatten, zeigten angesichts jüngster hochkarätiger Kontakte erste Anzeichen für eine Stabilisierung.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf seine Wertentwicklung auswirkten.

- Positivbeiträge zur relativen Gesamttrendite:
  - Die Einzeltitelauswahl in den Sektoren Werkstoffe, Gesundheitswesen und Basiskonsumgüter.
  - Eine Untergewichtung im rückständigen Werkstoffsektor und eine Übergewichtung im besonders leistungsstarken Kommunikationsdienstesektor.
  - Nachdem das Portfolio über den größten Teil des Berichtszeitraums in Rückstand gelegen hatte, entwickelte es sich im letzten Monat besser als der Index.
- Negativbeiträge zur relativen Gesamttrendite:
  - Die Einzeltitelauswahl in den Sektoren Informationstechnologie und Finanzen.
  - Eine Übergewichtung im schwachen Basiskonsumgütersektor.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Portfolio blieb auf Binnenwachstum fokussiert durch hochwertige Unternehmen aus dem gesamten Marktkapitalisierungsspektrum.
- Der Schwerpunkt lag weiter auf Unternehmen, die wir als Quality Compounds bezeichnen – also Aktien mit beständigen, verlässlichen hohen Renditen in der Vergangenheit – und auf sogenannten Secular Growth Beneficiaries: auf den Binnenmarkt orientierte Unternehmen, die von langfristigen Trends und von politischer Unterstützung profitieren.
- Bei der Einflussnahme auf Managementteams in ESG-Fragen machten wir Fortschritte, bei mehr Klarheit in Bezug auf die Unternehmensführung und Vorteilen gegenüber der Vergleichsgruppe in den Bereichen Umwelt und Soziales.

Mit Blick auf die Zukunft sind die makroökonomischen Bedenken um die Beständigkeit der chinesischen Erholung von COVID und der Mangel an energischen Anreizen, die in diesem Zeitraum vorlagen, vom Markt inzwischen eingepreist. Daher meinen wir, der Markt für chinesische A-Aktien könnte sich erholen, wenn sich die Wirtschaft allmählich stabilisiert oder mehr Unterstützungsmaßnahmen eingeleitet werden. Darüber hinaus sind manche hochwertige Titel nach den jüngsten Rücksetzern mittlerweile ausgesprochen attraktiv bewertet, und auch in vielen kontaktintensiven Bereichen geht es nach unserem Eindruck nach den COVID-Shutdowns aufwärts.

Das Portfolio bleibt auf binnenwirtschaftlich orientierte Unternehmen aus Bereichen fokussiert, in denen Verbesserungen anstehen, weil es politische Veränderungen gegeben hat, weil sich die Nachfrage von niedrigem Ausgangsniveau erholt oder weil längerfristiges nachhaltiges Wachstum vorliegt. Am Ende des Berichtszeitraums waren wir in Titeln aus den Sektoren Basiskonsumgüter, Nicht-Basiskonsumgüter und Kommunikationsdienste übergewichtet und in Werkstoff-, IT- und Energiewerten untergewichtet.

Das Portfolio wird auch künftig um Einzelunternehmen mit soliden Fundamentaldaten und attraktiven Bewertungen herumgebaut, und wir erkennen ansprechende auf mittlere und längere Sicht reizvolle Gelegenheiten, die sich im gesamten Anlageuniversum ergeben.

## China Bond – Bericht des Investment-Managers

Für den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 betrug die Gesamttrendite für Anteile der Ausschüttenden Klasse CNY I 3,20 %. Der als Referenzindex dienende FTSE Chinese Government and Policy Bank Bond 0-1 Year Select Index (der „Index“) verbuchte im selben Zeitraum 1,19 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamttrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Die chinesischen Märkte starteten recht konstruktiv ins Jahr 2023. Das BIP wies für das erste Quartal im Jahresvergleich ein Wachstum von 4,5 % aus. Der neue Ministerpräsident Li Qiang bekräftigte die Vision der neuen Regierung (wie von Präsident Xi auf dem 20. Parteikongress Ende 2022 dargelegt) mit Fokus auf hochwertigem Wachstum und weiterer Verpflichtung zu Strukturreformen und zur Wiederöffnung. Insbesondere betonte er die Bedeutung makroökonomischer Stabilität, der Verhinderung systemischer Risiken im Finanzsektor sowie der Verpflichtung zur weiteren Unterstützung von Privatunternehmen. Als BIP-Zielwert wurden „rund 5 %“ vorgegeben.
- Im zweiten Quartal 2023 beobachteten wir jedoch, dass der Konjunkturaufschwung in China an Fahrt verlor. Sowohl im Produktionssektor als auch im Dienstleistungsgewerbe ließ die Dynamik spürbar nach. Eine Erholung im angeschlagenen Immobiliensektor blieb aus. Daten zu Kreditimpulsen belegten einen breit angelegten Abwärtstrend bei Krediten und die Stimmung blieb mau. Das blieb der Politik nicht verborgen und führte zu einer von der Regierung orchestrierten De-facto-Herabsetzung der Einlagenzinsen. Im Anschluss erlebten wir eine Senkung der 7-Tages-Reverse-Repo-Rate von 2 % auf 1,9 %, des Zinssatzes für die 1-jährige mittelfristige Kreditfazilität („MLF“) von 2,75 % auf 2,65 % sowie symmetrische Verringerungen der 1- und 5-jährigen Loan Prime Rate („LPR“). Die Liquiditätssituation blieb entspannt. Die Rendite 10-jähriger chinesischer Staatsanleihen („CGB“) neigte sich den 2022 verzeichneten Tiefs zu, nachdem sie 2023 zunächst im Wiederöffnungsoptimismus kurz in Richtung 2,95 % ausgeschlagen hatte.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf seine Wertentwicklung auswirkten.

- Positivbeiträge zur relativen Gesamttrendite:
  - Onshore-Unternehmensanleihen lieferten positive Beiträge, da Zinsen und Kreditspreads querbeet kräftig anstiegen.
  - Offshore-Unternehmensanleihen leisteten aufgrund des vorteilhaften Renditegefälles ebenfalls Positivbeiträge.
  - Die Zinspositionierung wirkte sich insgesamt positiv aus. Dem lag während des Regionalbanken-Sell-offs im März taktische USD-Duration zugrunde.
- Negativbeiträge zur relativen Gesamttrendite:
  - Die größten Wertabzüge entfielen unter anderem auf unsere USD-Immobilienpositionen.
  - Zu den größten Verlustbringern zählten unsere Onshore-Wandelanleihen.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Die Rally bei Onshore-Kreditspreads im laufenden Jahr veranlasste uns aus Bewertungsperspektive zur Vorsicht, obwohl Onshore-Anleger auf der Jagd nach Rendite sind. Wir konnten zwar keinen Katalysator für eine wesentliche Weitung der Kreditspreads erkennen, doch der derzeit unsichere globale Makrointergrund und die angespannten Bewertungen gaben uns Anlass, unsere Onshore-Kreditspread-Duration gering zu halten.
- Abgesehen von den knappen Onshore-Kreditspreads blieb das Zinsgefälle zwischen CNY und USD erheblich, woraus sich ein attraktives relatives Wertangebot chinesischer USD-Unternehmensanleihen ergab.
- Im Fremdwährungssegment tendierte USDCNY im ersten Quartal eher seitwärts. Im Mai folgte dann allerdings aufgrund der Eintrübung des Konjunkturausblicks ein überzeugender Ausbruch aus der Spanne. Diesen Ausbruch nutzten wir, um verschiedene aktive USDCNH-Long-Positionen aufzustoßen.

Nach unserer Auffassung haben wir bereits eine erhebliche Straffung der Geldpolitik hinter uns. Die Inflation dürfte sowohl in den USA als auch in großen asiatischen Volkswirtschaften ihren Höhepunkt überschritten haben. Daher sollte der durch steigende Zinssätze bedingte Druck nachlassen und könnte in Zukunft zu einem eher zweischneidigen Risiko werden. In China macht die Schuldendienstfähigkeit der chinesischen lokalen Finanzierungsplattformen (Local Government Financing Vehicles, „LGFVs“) in letzter Zeit Schlagzeilen. Deshalb sorgen sich Marktteilnehmer um die finanzielle Gesundheit von Kommunalverwaltungen, die angesichts der rückläufigen Grundstücksverkäufe (auf die ein großer Teil der kommunalen Einkünfte entfällt) und der während der Lockdown-Phase gebremsten Konjunktur wohl geschwächt ist.

Wir sind jedoch der Ansicht, dass die Zentralregierung sowohl willens als auch in der Lage ist, mit den Schuldenrisiken der LGFVs angemessen umzugehen. Nach unserer Einschätzung dürften LGFVs auch künftig noch Schlagzeilen machen. Wir schließen nicht aus, dass es zu weiteren Ausfällen kommt.

## China Equity – Bericht des Investment-Managers

Für den sechsmönatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I -9,70 %. Der als Benchmark dienende MSCI China All Shares Net Total Return Index (der „Index“) verzeichnete im selben Zeitraum ein Minus von 5,36 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Die Aktienmärkte Großchinas blieben im ersten Halbjahr 2023 volatil. Auf hoher Ebene besserten sich in China die Wachstumsbedingungen im eigenen Land, wenngleich nicht unbedingt in einem vom Markt erwarteten Tempo.
- Auf dem Nationalen Volkskongress im März setzte die Regierung mit 5 % ein bewusst konservatives Wachstumsziel (gegenüber Konsenserwartungen von 5,5 %). Dem lagen vor allem ihre Sorgen um potenziell schwächere Auslandsnachfrage und deren mögliche Auswirkungen auf die Exporte zugrunde.
- Im Zusammenspiel wurde das Vertrauen der Investoren durch die Wirtschaftsdaten des laufenden Jahres und die Vorgaben der Politik belastet.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf seine Wertentwicklung auswirkten.

- Positivbeiträge zur relativen Gesamtrendite:
  - Wesentliche Positivbeiträge zur Wertentwicklung im Vergleich zum Index leisteten unter anderem Basiskonsumgüter (Einzeltitelauswahl bei Getränken und Nahrungsmittelprodukten), Immobilien (Einzeltitelauswahl) und Industrie (Einzeltitelauswahl bei Luftfracht und Logistik).
- Negativbeiträge zur relativen Gesamtrendite:
  - Wesentliche Negativbeiträge zur Wertentwicklung im Vergleich zum Index leisteten unter anderem Werkstoffe (Einzeltitelauswahl bei Chemiewerten), Informationstechnologie (Einzeltitelauswahl bei Technologie-Hardware und -peripherie sowie elektrotechnische Instrumente und Komponenten) und Kommunikationsdienste (deutliche Untergewichtung).

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Wir ermittelten weiterhin qualitativ hochwertige Unternehmen mit gut vorhersehbarer Ertragsentwicklung. Insgesamt gilt für die Kernpositionen des Portfolios, dass sich die meisten auch angesichts der wirtschaftlichen Herausforderungen des Jahres 2022 erfolgreich weitere Marktanteile sichern konnten. Dadurch sind sie besser aufgestellt, um von einer potenziellen Erholung zu profitieren, die wir für den weiteren Verlauf von 2023 erwarten.
- Am Ende des Berichtszeitraums waren Kommunikationsdienste der im Vergleich zum Index am stärksten untergewichtete Sektor im Portfolio (4,24 % gegenüber 12,53 %). Der gegenüber dem Index am stärksten übergewichtete Sektor im Portfolio waren Werkstoffe (18,12 % gegenüber 6,58 %).

Chinas Wachstum nach der Wiederöffnung entwickelt sich ungleichmäßig. Ein starker Aufschwung setzte zunächst in Sektoren ein, die durch antizyklische politische Maßnahmen und aufgestaute Nachfrage gestützt wurden. Insbesondere die Sektoren Konsum und Dienstleistungen konnten sich bisher gut behaupten, wenngleich die Investitionen im produzierenden Gewerbe und das Geschäftsklima in der Privatwirtschaft vergleichsweise schwach blieben. Während die Marktteilnehmer darauf warten darauf, dass die Gesamtkonjunkturdaten wieder mehr Dynamik des makroökonomischen Aufschwungs anzeigen, haben die für unsere Kernpositionen zuständigen Managementteams auf eine bessere Vorhersehbarkeit steigender Erträge hingewiesen. Die Politik zeigt sich mittlerweile ebenfalls deutlich unternehmensfreundlicher und dürfte noch weitere substantielle politische Lockerungsmaßnahmen einführen, um das Geschäfts- und Konsumklima zu beleben und einer breiteren, konsumgetriebenen Erholung Vorschub zu leisten. Auch die verstärkte Kommunikation zwischen maßgeblichen Staatsvertretern aus China und deren Amtskollegen mit Wirtschaftslenkern aus aller Welt trägt zur Stabilisierung der geopolitischen Spannungen und zur Verbesserung des Wirtschaftsumfelds bei. Abschließend ist festzustellen, dass die Bewertungen nach wie vor attraktiv sind. Das Forward-KGV des MSCI China All Shares Index und des CSI 300 beträgt 9,8 beziehungsweise 10,5 gegenüber 16,5 beziehungsweise 18,5 für den MSCI World und den S&P 500. Daher beurteilen wir die in China gebotenen Anlagegelegenheiten weiterhin konstruktiv.

## CLO Income – Bericht des Investment-Managers

Für den sechsmontatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 betrug die Gesamttrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 8,31 %. Der ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return, USD) (der „Index“) rentierte im selben Zeitraum 2,32 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamttrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Nachdem die Kreditspreads für Collateralised Loan Obligations („CLO“) von höherer Qualität mit BB-Rating das Jahr 2022 im Kontext von Secured Overnight Financing Rate („SOFR“)+850 beschlossen, verengten sich die CLO-Kreditspreads im Januar, als nachlassende Rezessionsorgen und nachgebende Inflationsindikatoren bei den Spreads für BB-CLOs höherer Qualität zu einer Verengung auf rund SOFR+775 geführt hatten. Das sorgte auf dem Markt für CLO-Neuemissionen für zusätzliche Dynamik, da CLO-Manager versuchten, aus knapperen Kreditspreads für CLOs Kapital zu schlagen.
- Diese Verengung der Kreditspreads zum Jahresanfang kehrte sich im Februar und März rasch wieder um, da unerwartet solide Wirtschaftsdaten die Spekulationen der Anleger um mögliche weitere – und vielleicht beschleunigte – Zinserhöhungen anheizten. Noch verstärkt wurden diese Sorgen Anfang bis Mitte März durch Pleiten von Regionalbanken und Bedenken, die die Kreditspreads von CLOs mit BB-Rating Mitte März über das Ende 2022 verzeichnete Niveau in hinaus in den Kontext von SOFR+900 trieben, bevor bessere Stimmung infolge von Zusicherungen der US-Regierung, den Bankensektor zu stabilisieren, Ende März und Anfang April zu einer deutlichen Verengung der Spreads führte. Diese stabilisierten sich den Mai hindurch für CLOs mit BB-Rating generell im Bereich von SOFR+800 bis +825.
- Im Juni verengten sich die Spreads für CLOs aus dem BB-Segment, da verschiedene Wirtschaftsdaten weiterhin auf eine Tendenz zu langsameren Zinserhöhungen hinwiesen. Auch verteuerten sich die Papiere im Verlauf des Monats um rund 1,5 Punkte und das Handelsniveau näherte sich den bisherigen Jahreshochs. Ende Juni lagen die Kreditspreads für CLOs mit BB-Rating auf dem Sekundärmarkt im Kontext von SOFR+775.
- Zum 30. Juni 2023 betrug ihre nennwertgewichtete Ausfallquote für die vorhergehenden zwölf Monate 1,71 % und damit 246 Basispunkte weniger als der Höchststand bei 4,17 % von September 2020. Im bisherigen Jahresverlauf hat das Neuemissionsvolumen im Vergleich zum Vorjahr um 34 % nachgegeben. Trotz des unserer Einschätzung nach schwierigeren Umfelds für Aktienarbitrage im bisherigen Berichtszeitraum des laufenden Jahres ist der Primärmarkt für CLOs aktiv, da die Manager die etwas engeren CLO-Kreditspreads nutzen.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf seine Wertentwicklung auswirkten.

- Positivbeiträge zur Gesamttrendite:
  - Einzeltitelauswahl auf dem Markt für die auf USD lautende Mezzanine-Tranche des CLO-Marktes.
  - Allokation in auf Euro lautende CLOs mit B-Rating.
- Negativbeiträge zur Gesamttrendite:
  - Allokation auf den USD-Hochzinsmarkt.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Während wir unser Engagement in europäischen CLOs im Berichtszeitraum nach und nach aufgestockt haben, ist das Portfolio nach wie vor überwiegend in US-Krediten engagiert: ca. 75 % der CLO-Positionen lauten auf US-Dollar.
- Im Berichtszeitraum nutzten wir im Juni die Rally bei CLOs, um unser Engagement in einer Reihe von CLOs zurückzufahren, deren Emission bereits länger zurücklag.

Trotz makroökonomischer Bedenken vertrauen wir grundsätzlich weiterhin auf die beträchtliche strukturelle Absicherung, die gegen Kreditverluste in den zugrunde liegenden Kreditportfolios besteht. CLO-Strukturen im Allgemeinen und CLO-Schuldtitel mit BB-Rating im Besonderen haben sich angesichts einer erheblichen Rezession im Jahr 2020 einmal mehr als sehr robust erwiesen. Unser Fokus auf Anlagen in erstklassigen zugrunde liegenden Kredit-Portfolios wird nach unserer Überzeugung auch weiterhin zu einer Outperformance gegenüber dem allgemeinen CLO-Markt führen.

## Commodities – Berichts des Investment-Managers

Für den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 betrug die Gesamttrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I -7,23 %. Im selben Zeitraum betrug die Rendite des Bloomberg Commodity Index (der „Index“) -7,79 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamttrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Im ersten Halbjahr legten die Märkte zu, getragen von robustem Beschäftigungswachstum, nachlassender Inflation und freudiger Erwartung des von Fortschritten in der künstlichen Intelligenz gebotenen langfristigen Ertragssteigerungspotenzials.
- Die US-Notenbank Federal Reserve Board (die „Fed“) und andere Institute sprangen ein, um die Märkte zu stabilisieren, als nach zügigen Zinserhöhungen Banken in Schieflage gerieten. Im Juni setzte die Fed erstmals Zinserhöhungen aus.
- Der S&P 500 Index und der Bloomberg US Aggregate Bond Index legten 16,89 % bzw. 2,09 % zu. Der Index gab mit 7,79 % nach, weil der Verbraucherpreisindex (VPI) im Jahresvergleich auf 3,0 % zurückging. Den größten Anteil an der Teuerung hatten weiter die Wohnkosten.
- Im Rohstoffbereich entwickelten sich Palladium und Erdgas am schwächsten. Kakao und Zucker verteuerten sich im bisherigen Jahresverlauf.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf seine Wertentwicklung auswirkten.

Nach Sektoren legten Edelmetalle, weiche Rohstoffe und Nutztiere im Berichtszeitraum zu, während Energie, Industriemetalle und Agrarrohstoffe nachgaben.

- Positivbeiträge zur relativen Gesamttrendite:
  - Die Untergewichtung des Portfolios im Erdgassegment des Energierohstoffsektors, die dazu beitrug, dass in der ersten Jahreshälfte ein erheblicher Teil des Einbruchs bei Erdgas um 50 % vermieden werden konnte.
  - Der positive Wertentwicklungsbeitrag von Gold, als der Dollar schwächelte und die Anleger in der Bankenkrise im ersten Quartal in sichere Häfen flüchteten.
  - Die Untergewichtung des Portfolios im Silbersegment des Edelmetallsektors, die die Wertentwicklung des Sektors steigerte.
  - Die Portfoliopositionierung in weichen Rohstoffen, die im Quartal absolute und relative Zugewinne brachten. Dem lagen Zuwächse einer nicht in der Benchmark erfassten Position in Kakao sowie eine untergewichtete Position in Kaffee zugrunde.
  - Die Gewinne des Portfolios aus seiner nicht in der Benchmark enthaltenen Position in Mastriern im Nutztiersektor.
- Negativbeiträge zur relativen Gesamttrendite:
  - Die übergewichtete Position des Portfolios im Sektor Industriemetalle, die ihm einen Rückstand gegenüber der Benchmark bescherte, trotz relativer Gewinne aus der Untergewichtung in Kupfer, die allerdings durch eine Übergewichtung in Zink aufgezehrt wurden.
  - Eine negative Wertentwicklung durch nicht in der Benchmark enthaltene Positionen in Palladium und Platin im Edelmetallsektor, die den positiven Beitrag von Gold und Silber zunichtemachte.
  - Übergewichtete Positionen in Agrarrohstoffen, die Wertentwicklung auf absoluter wie relativer Basis belasteten. Das Portfolio entwickelte sich aufgrund der Verluste aus einer Übergewichtung in Mais schwächer als der Index. Gewinne aus einer Untergewichtung in Weizen wurden dadurch aufgezehrt.
  - Verluste aus der Kontraktwahl des Portfolios, die im Nutztiersektor auf Kontrakte mit längerer Laufzeit setzte, welche nicht so stark anzogen wie die im Index enthaltenen rasch steigenden spotmarktnahen Monatskontrakte.
  - Die übergewichtete Portfolioposition in Baumwolle im Sektor weiche Rohstoffe, die Gewinne aus einer nicht in der Benchmark enthaltenen Kakaoposition und einem untergewichteten Engagement in Kaffee zunichtemachte.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

2023 war das Investmentgeschäft unberechenbar, denn trotz aggressiver Geldpolitik zeigten sich die Arbeitsmärkte robust und die Wirtschaft wuchs. Bis zum Jahresende dürften sich vermutlich unerwartete Ergebnisse einstellen. Die potenziellen Szenarios rangieren von einer leichten Rezession bis hin zu einem weltweit synchronisierten Rückpralleffekt. Angesichts der Kurse, die unseres Erachtens derzeit auf Rezessionsniveau liegen, ist unser Ausblick positiv.

Unter Makro- und Nachfrageaspekten könnte der geldpolitische Straffungskurs der Fed bald enden, was Druck vom Rohstoffmarkt nehmen würde. Die Maßnahmen der Fed stoßen möglicherweise an ihre Grenzen, was die Kreditvergabe dämpfen und systemische Anfälligkeiten im Banken- und Immobiliensektor offenbaren könnte. Werden die Anleger wieder risikobereiter, könnte eine ausbleibende Rezession dem Rohstoffsektor zugute kommen, wo sich Rezessionen am stärksten in der Preisbildung niederschlagen. Die Impulse für Aktien und festverzinsliche Wertpapiere könnten im Vergleich schwächer ausfallen.

Unter Angebotsaspekten tragen die Produktionskürzungen der OPEC+ sowie die begrenzte Reaktion der Schieferölproduzenten zur Verringerung der Abwärtsrisiken bei. Im Metallsektor könnten knappe Lagerbestände für Aufwärtspotenzial sorgen, während staatliche Mandate für umweltfreundlichere Verfahrensweisen durch Gesetze wie den Inflation Reduction Act in den USA und den Net-Zero Investment Act in Europa die Nachfrage überraschend stark anheizen, was ein Aufwärtsrisiko darstellt, falls China Anreize bietet.

Insgesamt besteht zunehmend der Konsens, dass es nicht unbedingt zu der lange erwarteten Rezession in Industrieländern kommen muss beziehungsweise dass diese, wenn es doch dazu kommt, sehr schwach ausfallen könnte. Diese Konsensverschiebung könnte den Rohstoffmärkten ausgesprochen gut tun, vor allem mit Blick auf die Absicherung gegen potenzielle Entwicklungen bei Aktien und Anleihen. Rohstoffe waren die Waffe der Wahl im Kampf gegen Rezessionsrisiken – die Renditen von Staatsanleihen gaben dagegen leicht nach. Sie profitierten von wachsender Angst vor einer Abschwächung, während Aktien überhaupt nicht betroffen waren, da die Anleger zögerten, Vermögenswerte abzustoßen, die allgemein aufwärts tendierten – vor allem während eines neu einsetzenden Tech-Booms. Sollten die Rezessionsrisiken nunmehr zurückgehen, können die Zinsen steigen, was Anleihen Verluste bescheren würde. Zinnsensible Tech-Aktien könnten aufgrund ihrer empfindlichen Reaktionen auf Renditeveränderungen stark in Mitleidenschaft gezogen werden. Rohstoffe könnten dagegen ein spürbares Comeback erleben, wenn Anlegern bewusst wird, dass die physische Knappheit real ist und die Nachfrage in einem Umfeld ohne Rezession steigt.

Wir empfehlen, weiter auf Nummer sicher zu gehen und sich gegen solche Zins- und Inflationsrisiken abzusichern, solange der Schutz billig zu haben ist.



## Corporate Hybrid Bond – Bericht des Investment-Managers

Für den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse EUR I 1,99 %. Der als Benchmark dienende ICE BofA Global Hybrid Non-Financial 5 % Constrained Custom Index (Total Return, Hedged, Euro) (der „Index“) verbuchte im selben Zeitraum ein Plus von 2,73 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Die insgesamt risikoscheue Marktstimmung ging auf Probleme bei US-Regionalbanken sowie bei der Credit Suisse im ersten Quartal zurück, gefolgt von einem neuerlichen Fokus auf der Inflation im zweiten Quartal.
- Die Anlageklasse der hybriden Unternehmensanleihen wurde weiterhin durch den Immobiliensektor beeinträchtigt – und durch die Frage, ob die Emittenten ihre anstehenden Anleihen kündigen oder verlängern werden.
- Vor diesem Hintergrund zeichnete sich das erste Halbjahr durch rege Primäraktivität aus. Im laufenden Jahr gab es bisher Emissionen im Volumen von 12,3 Mrd. EUR, was dem Aufkommen des gesamten Vorjahres entspricht. Die Kündigungs- und Ablösungsaktivität bleibt weiter hoch – auch unter risikoträchtigeren Emittenten von geringerer Bonität.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf seine Wertentwicklung auswirkten.

- Positivbeiträge zur relativen und absoluten Gesamtrendite:
  - Die positive Einzeltitelauswahl im gesamten Versorgungssektor, insbesondere EDF, National Grid und Centrica.
  - Die positive Einzeltitelauswahl im gesamten Telekommunikationssektor, insbesondere Vodafone, Rogers und Telia.
  - Die positive Einzeltitelauswahl im gesamten Gesundheitssektor, insbesondere Bayer.
- Negativbeiträge zur relativen und absoluten Gesamtrendite:
  - Der „Cash-Drag“; in einem steigenden Markt Liquidität vorzuhalten, ist kostspielig.
  - Die negative Einzeltitelauswahl in Bezug auf unser Immobilienengagement, insbesondere Aroundtown und Heimstaden.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Bei hochwertigen, hochverzinsten Unternehmensanleihen mit Einstiegsbarrieren und Unterstützung der Beteiligengruppen blieben wir defensiv, d. h. in den Sektoren Versorgung und Telekommunikation.
- Unser zyklisches Engagement haben wir zuletzt zurückgefahren – und unser Engagement in Volkswagen und Solvay zum Teil veräußert. Wir sind nicht der Ansicht, dass wir für Engagement in Zykliker angemessen entschädigt werden. Derzeit liegen die Chancen in defensiven Titeln aus den Sektoren Telekommunikation und Versorgung. Daher haben wir unser Engagement in BT, Vodafone, Stedin und Vattenfall ausgebaut.
- Die größten Portfoliopositionen entfallen auf regulierte Versorgungsunternehmen, große Telekommunikationsanbieter, integrierte Energieriesen und große Blue-Chip-Industriewerte mit starker Marktführung und erheblicher Preismacht.

Für die Hybridoption werden Anleger unseres Erachtens übermäßig entschädigt. Mit Ausnahme von Immobilien-Hybridanleihen liegt der Spread für nachrangige Titel derzeit im Durchschnitt bei rund 210 Basispunkten („Bp“). Auf dem niedrigsten Stand von 2021 war er mit rund 127 Bp knapper (bei im Schnitt rund 150 Bp). Mittelfristig rechnen wir für das nachrangige Segment noch mit einem etwas stärkeren Gefälle. Der gewichtete durchschnittliche Portfoliokurs liegt derzeit um 85, wobei der erste Kündigungstermin kurz nach Ablauf von drei Jahren noch nicht unmittelbar ansteht. Wir gehen daher davon aus, dass die Kapitalwertsteigerung eine maßgebliche Quelle für Portfolioerträge darstellt, da unsere Positionen in den kommenden Monaten von allmählichen „Pull-to-Par“-Effekten profitieren dürften. Darüber hinaus kommt dem Portfolio ein attraktives Ertragsniveau von knapp vier Prozent zugute. Wir beabsichtigen, das Ertragsprofil durch die Einzeltitelauswahl, die aktive Beteiligung am Primärmarkt und ein gewisses Maß an Market-Timing noch weiter zu verbessern.

## Emerging Market Debt - Hard Currency – Bericht des Investment-Managers

Für den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 betrug die Gesamttrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 4,98 %. Der als Benchmark dienende JPM EMBI Global Diversified Index (Total Return, USD) verbuchte im selben Zeitraum ein Plus von 4,09 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamttrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Die Marktstimmung wurde generell von Entwicklungen im Zusammenhang mit Inflation und Geldpolitik geprägt. Die Wiederöffnung Chinas war ein Thema, das Unterstützung bot. Gleichzeitig gab es Fortschritte bei der Umschuldung ausgefallener Titel durch Vereinbarungen mit öffentlichen und privaten Gläubigern.
- Die Renditen zehnjähriger US-Staatsanleihen beschlossen den Zeitraum mit 3,85 % seit Jahresbeginn mehr oder minder unverändert, verzeichneten aber so kräftige Volatilität, wie sie zuletzt während der Finanzkrise 2008 zu beobachten war.
- Die Spreads für Referenzanleihen aus Schwellenländern („EM“) verengten sich von 452 auf 432 Bp mit einem Höchststand von 510 Bp im März. El Salvador schnitt mit einer Rendite von 57,84 % am besten ab, da sich seine fiskalpolitischen Aussichten besserten. Schwächstes Land war Ecuador mit -21,74 %, weil es mit erhöhter politischer Volatilität konfrontiert war.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf seine Wertentwicklung auswirkten.

- Positivbeiträge zur relativen Gesamttrendite:
  - Die Länderallokation insgesamt, mit Übergewichtungen in Hochzins-Unternehmensanleihen, beispielsweise in Sri Lanka, El Salvador, Argentinien und Sambia.
  - Die Einzeltitelauswahl leistete per saldo einen Positivbeitrag.
- Negativbeiträge zur relativen Gesamttrendite:
  - Übergewichtungen in höher rentierlichen Märkten wie Ecuador und Ägypten, die vor landesspezifischen politischen Herausforderungen und Finanzierungsproblemen standen, sowie der Verzicht auf das renditestärkere Pakistan.
  - Die Top-down-Positionierung wirkte per saldo ertragsmindernd.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Portfolio hielt an einer Tendenz zu Hochzinstiteln (gegenüber Unternehmensanleihen mit Investment Grade) fest. Wir stockten unsere übergewichteten Allokationen in Kolumbien, El Salvador, Côte d'Ivoire, Serbien und Sambia auf. Dort nehmen wir Widerstandskraft gegen schärfere globale Finanzierungsbedingungen wahr.
- Unsere übergewichtete Allokation in Ecuador verringerten wir und stellten uns im Irak angesichts zunehmender politischer und finanzieller Risiken auf eine Untergewichtung um.
- Die Allokation in auf EUR lautende Anleihen und Unternehmensanleihen betrug am Ende des Berichtszeitraums 17,7 % beziehungsweise 12,6 %.

Wir rechnen bis Ende des Jahres mit günstigen Rahmenbedingungen für Schwellenländeranleihen aufgrund besserer technischer Voraussetzungen, stabiler Fundamentaldaten und einigermaßen attraktiver Bewertungen, verbunden mit dem Auslaufen der aggressiven Geldpolitik in den USA. Das Wachstum in China sollte sich mäßig und ungleichmäßig, aber per saldo letztlich positiv auf das Schwellenländeruniversum auswirken. Wir erwarten, dass die Ausfallraten für Staatsanleihen bis 2023 auf einen niedrigen einstelligen Prozentsatz sinken werden, während das zunehmende Engagement des IWF in verschiedenen Schwellenländern den Finanzierungsbedarf und die Reformagenden unterstützen dürfte. Die Hauptrisiken für unsere positive Einschätzung sehen wir entweder in einer möglichen globalen Rezession, die die Risikoprämie für Schwellenländer erheblich in die Höhe treiben würde, oder in einer unerwarteten Beschleunigung der Inflationsdynamik weltweit, die deutlich mehr Zinserhöhungen erforderlich machen würde.

## Emerging Market Debt - Local Currency – Bericht des Investment-Managers

Für den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 betrug die Gesamttrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 8,97 %. Der als Benchmark dienende JPMorgan GBI Emerging Markets Global Diversified Index (Total Return, Unhedged, USD) rentierte im selben Zeitraum 7,79 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamttrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Insgesamt wurde die Marktstimmung in erster Linie von Entwicklungen im Zusammenhang mit Inflation und Geldpolitik geprägt. Anzeichen für einen Zinsgipfel und nachlassende Inflation in verschiedenen Schwellenländern stützten die Renditen lokaler Anleihen im Berichtszeitraum.
- Die Währungen von Schwellenländern („EM“) stiegen gegenüber dem US-Dollar im Durchschnitt an. Währungen mit hohem Carry wie der kolumbianische Peso, der mexikanische Peso und der ungarische Forint führten diese Entwicklung mit zweistelligen Renditen an.
- Den größten Rückstand verzeichnete währenddessen der türkische Lokalmarkt, hauptsächlich getrieben vom Wertverfall der türkischen Lira angesichts zunehmender außenwirtschaftlicher Ungleichgewichte, niedriger Realzinsen und hoher Inflation, gefolgt von Ägypten, das seine Währung im Januar abwertete.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf seine Wertentwicklung auswirkten.

- Positivbeiträge zur relativen Gesamttrendite:
  - Die Zinspositionierung fiel insgesamt positiv aus. Dem lagen die Durationsübergewichtungen im gesamten Portfolio zugrunde, beispielsweise in Kolumbien, in Ungarn und Indonesien, aber auch Positionen in argentinischen Staatsanleihen.
  - Die Zinspositionierung in der Türkei wirkte sich ebenfalls vorteilhaft aus, was unserer Untergewichtung der Duration sowie Positionen in inflationsindexierten Anleihen anstelle solcher mit Nominalverzinsung zu verdanken war.
  - Die Fremdwährungsallokation wirkte wertsteigernd, und zwar durch Untergewichtungen in der türkische Lira und im englischen Pfund sowie durch Übergewichtungen in Lateinamerika, unter anderem im uruguayischen Peso, im mexikanischen Peso und im brasilianischen Real.
- Negativbeiträge zur relativen Gesamttrendite:
  - Die Durationsübergewichtung in Israel zählte zu den hauptsächlichen Negativfaktoren bei der Zinspositionierung.
  - Im Währungssegment war die Übergewichtung im südafrikanischen Rand für die größten Wertabzüge verantwortlich, gefolgt von der Untergewichtung im polnischen Zloty.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Portfolio baute nach der jüngsten Rally gewisse mit Schwellenländerwährungen verbundene Risiken ab, bleibt aber leicht übergewichtet, insbesondere in Währungen mit hohem Carry wie dem kolumbianischen Peso, dem brasilianischen Real und dem ungarischen Forint.
- Unter Zinsaspekten hält das Portfolio weiterhin eine übergewichtete Durationsposition, da sich Hinweise auf nachlassende Inflation mehren und in verschiedenen Schwellenländern der Zinsgipfel überschritten ist. Zu maßgeblich übergewichteten Durationspositionen zählen Brasilien, Mexiko, Tschechien, Indonesien, Südkorea, Israel und Südafrika.
- In ein paar Ländern mit niedrigen Renditen halten wir eine untergewichtete Durationsposition, sofern wir nur begrenztes Aufwärtspotenzial erkennen – beispielsweise in China und Thailand, aber auch in Polen. Unsere Durations- und Währungsposition in der Türkei ist untergewichtet. Dort nehmen wir weiteres Abwärtspotenzial wahr, während die Politik gegen außenwirtschaftliche Ungleichgewichte und Inflationsdruck kämpft.

Wir rechnen für die Anlageklasse bis Ende des Jahres mit günstigen Rahmenbedingungen aufgrund besserer technischer Voraussetzungen, stabiler Fundamentaldaten und einigermaßen attraktiver Bewertungen auf verschiedenen Zins- und Währungsmärkten, verbunden mit dem Auslaufen der aggressiven Geldpolitik in den USA. Chinas ins Stocken geratener Aufschwung wirft weitere Fragen auf, doch wir halten das Wachstumsziel des Landes von 5 % für erreichbar, selbst wenn nur gezielt und in Maßen stimuliert wird, wie es die jüngste geldpolitische Lockerung signalisiert. Das Wachstum in China sollte sich mäßig und ungleichmäßig, aber per saldo letztlich positiv auf das Schwellenländeruniversum auswirken. Vor allem steigt die Inflation in den meisten Schwellenländern immer langsamer. Nach langen geldpolitischen Atempausen auf erhöhtem Zinsniveau sind Lockerungszyklen abzusehen, was Währungen und Lokalwährungsanleihen Unterstützung bieten sollte. Die Hauptrisiken für unsere positive Einschätzung sehen wir entweder in einer möglichen globalen Rezession, die die Risikoprämie für Schwellenländer erheblich in die Höhe treiben würde, oder in einer unerwarteten Beschleunigung der Inflationsdynamik weltweit, die deutlich mehr Zinserhöhungen erforderlich machen würde.

## Emerging Market Debt Blend – Bericht des Investment-Managers

Für den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 6,09 %. Der als Benchmark dienende Index, eine gewichtete Mischung aus 50 % JP Morgan GBI Emerging Markets Global Diversified Index (Total Return, Unhedged, USD), 25 % JPMorgan EMBI Global Diversified Index (Total Return, USD) und 25 % JPMorgan CEMBI Diversified Index (Total Return, USD) verbuchte im selben Zeitraum 5,74 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Insgesamt wurde die Marktstimmung von Entwicklungen im Zusammenhang mit Inflation und Geldpolitik geprägt. Anzeichen für Gipfelbildung bei den Zinsen und nachlassende Inflation in verschiedenen Schwellenländern stützten die Renditen lokaler Anleihen im Berichtszeitraum. Die Wiederöffnung Chinas war ein Thema, das Unterstützung bot. Gleichzeitig gab es Fortschritte bei der Umschuldung ausgefallener Titel durch Vereinbarungen mit öffentlichen und privaten Gläubigern.
- Die Renditen zehnjähriger US-Staatsanleihen beschlossen den Berichtszeitraum mit 3,85 % seit Jahresbeginn mehr oder minder unverändert, verzeichneten aber so kräftige Volatilität, wie sie zuletzt während der Finanzkrise 2008 zu beobachten war. Die Spreads für Referenzanleihen aus Schwellenländern („EM“) verengten sich von 452 auf 432 Bp mit einem Höchststand von 510 Bp im März.
- EM-Währungen legten im Durchschnitt gegenüber dem USD zu. Währungen mit hohem Carry hatten dabei die Nase vorn. Sie verbuchten zum Teil zweistellige Renditen.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf seine Wertentwicklung auswirkten.

- Positivbeiträge zur relativen Gesamtrendite:
  - Die Lokalwährungspositionierung für alle Zinssätze und Währungen, insbesondere in der Türkei, in Kolumbien und Ägypten.
  - Insgesamt die auf harte Währungen lautende Länderallokation mit Übergewichtungen in Hochzins-Unternehmensanleihen, beispielsweise in Sri Lanka, El Salvador, Argentinien und Sambia
- Negativbeiträge zur relativen Gesamtrendite:
  - Die Asset-Allokation wirkte aufgrund der durchschnittlichen Untergewichtung in überdurchschnittlichen Lokalwährungen ertragsmindernd. Das Engagement im CDX, das wir als defensive Absicherung halten, und die übergewichtete Zinsdurationsposition im Overlay wirkten ebenfalls abträglich.
  - Die Einzeltitelauswahl bei Unternehmensanleihen brasilianischer Industrieunternehmen und chinesischer Immobiliengesellschaften.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Portfolio nahm im Berichtszeitraum taktische Veränderungen an der Allokation in allen Segmenten vor, um das Zinsprofil zu steuern und die Marktvolatilität zu nutzen. Wir beschlossen den Zeitraum mit einem neutralen Engagement in Hartwährungen und einer Untergewichtung in den Segmenten Lokalwährungen und Unternehmensanleihen. Wir beschlossen den Zeitraum mit einer übergewichteten Zinsdurationsposition in Industrieländern.
- Im Lokalwährungssegment verringerte das Portfolio seine EM-Währungsrisiken im Vergleich zum Jahresbeginn, ist aber nach wie vor moderat übergewichtet – vor allem in Währungen mit hohem Carry. In Bezug auf Zinsen behält das Portfolio eine Übergewichtung bei. In ein paar Ländern mit niedrigen Renditen halten wir eine untergewichtete Durationsposition, sofern wir nur begrenztes Aufwärtspotenzial erkennen.
- Das Portfolio hielt im Hartwährungssegment an einer Tendenz zu Hochzinstiteln (gegenüber Unternehmensanleihen mit Investment Grade) fest.
- Im Segment der Unternehmensanleihen engagierte sich das Portfolio verstärkt in Finanzwerten, aber auch in Öl- und Gasgesellschaften. Wir verringerten das Engagement in den Sektoren Konsum und Transport gegenüber dem Jahresbeginn, da das nach dem Wegfall der COVID-Einschränkungen erfolgte Wiedererstarben des Tourismus in allen Schwellenländern nachließ.

Wir rechnen bis Ende des Jahres mit günstigen Rahmenbedingungen für Schwellenländeranleihen aufgrund besserer technischer Voraussetzungen, stabiler Fundamentaldaten und einigermaßen attraktiver Bewertungen, verbunden mit dem Auslaufen der aggressiven Geldpolitik in den USA. Das Wachstum in China sollte sich mäßig und ungleichmäßig, aber per saldo letztlich positiv auf das Schwellenländeruniversum auswirken. Wir erwarten, dass die Ausfallraten für Staatsanleihen bis 2023 auf einen niedrigen einstelligen Prozentsatz sinken werden, während das zunehmende Engagement des IWF in verschiedenen Schwellenländern den Finanzierungsbedarf und die Reformagenden unterstützen dürfte. Die Hauptrisiken für unsere positive Einschätzung sehen wir entweder in einer möglichen globalen Rezession, die die Risikoprämie für Schwellenländer erheblich in die Höhe treiben würde, oder in einer unerwarteten Beschleunigung der Inflationsdynamik weltweit, die deutlich mehr Zinserhöhungen erforderlich machen würde.

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend – Bericht des Investment-Managers

Für den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 betrug die Gesamttrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 4,93 %. Im selben Zeitraum verbuchte die zusammengesetzte Benchmark –, ein Drittel JPMorgan GBI Emerging Markets Global Diversified Investment Grade 15 % Cap Index (Total Return, Unhedged, USD) und zwei Drittel JPMorgan EMBI Global Diversified Investment Grade Index (Total Return, USD) – ein Plus von 5,29 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamttrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Insgesamt wurde die Marktstimmung von Entwicklungen im Zusammenhang mit Inflation und Geldpolitik geprägt. Anzeichen für einen Zinsgipfel und nachlassende Inflation in verschiedenen Schwellenländern stützten die Renditen lokaler Anleihen im Berichtszeitraum. Die Wiederöffnung Chinas war ein Thema, das Unterstützung bot. Gleichzeitig gab es Fortschritte bei der Umschuldung ausgefallener Titel durch Vereinbarungen mit öffentlichen und privaten Gläubigern.
- Die Renditen zehnjähriger US-Staatsanleihen beschlossen den Zeitraum mit 3,85 % seit Jahresbeginn mehr oder minder unverändert, verzeichneten aber so kräftige Volatilität, wie sie zuletzt während der Finanzkrise 2008 zu beobachten war. Die Spreads für Referenzanleihen aus Schwellenländern („EM“) mit Investment Grade blieben quasi unverändert: Sie weiteten sich von 136 auf 139 Bp mit einem Höchststand von 165 Bp im März.
- EM-Währungen legten im Durchschnitt gegenüber dem USD zu. Währungen mit hohem Carry hatten dabei die Nase vorn. Sie verbuchten zum Teil zweistellige Renditen.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf seine Wertentwicklung auswirkten.

- Positivbeiträge zur relativen Gesamttrendite:
  - Die Lokalwährungspositionierung für alle Zinssätze und Währungen, insbesondere in Kolumbien, Mexiko und Ungarn.
  - Die Allokation auf Hartwährungsländer mit Übergewichtungen in Rumänien und Untergewichtungen in Saudi-Arabien (aus ESG-Beweggründen) und Katar. Die Einzeltitelauswahl in Peru, Panama und Indonesien.
  - Die Einzeltitelauswahl in Peru, Panama und Indonesien.
- Negativbeiträge zur relativen Gesamttrendite:
  - Die Asset-Allokation wirkte aufgrund der durchschnittlichen Untergewichtung in überdurchschnittlichen Lokalwährungen ertragsmindernd. Die Übergewichtung der Zinsdurationsposition in Industrieländern („DM“) im Overlay.
  - Die Top-down-Positionierung im Hartwährungssegment.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Portfolio nahm im Berichtszeitraum taktische Veränderungen an der Allokation in allen Segmenten vor, um das Zinsprofil zu steuern und die Marktvolatilität zu nutzen. Wir beschlossen den Berichtszeitraum in Hartwährungen untergewichtet und mit neutralem Engagement im Lokalwährungssegment sowie einer übergewichteten Zinsdurationsposition in Industrieländern.
- Im Lokalwährungssegment verringerte das Portfolio seine EM-Währungsrisiken im Vergleich zum Jahresbeginn, ist aber nach wie vor moderat übergewichtet – vor allem in Währungen mit hohem Carry. In Bezug auf Zinsen behält das Portfolio eine Übergewichtung bei. In ein paar Ländern mit niedrigen Renditen halten wir eine untergewichtete Durationsposition, sofern wir nur begrenztes Aufwärtspotenzial erkennen.
- Das Portfolio hielt im Hartwährungssegment an einer Tendenz zu Hochzinstiteln (gegenüber Unternehmensanleihen mit Investment Grade) fest.

Wir rechnen bis Ende des Jahres mit günstigen Rahmenbedingungen für Schwellenländeranleihen aufgrund besserer technischer Voraussetzungen, stabiler Fundamentaldaten und einigermaßen attraktiver Bewertungen, verbunden mit dem Auslaufen der aggressiven Geldpolitik in den USA. Das Wachstum in China sollte sich mäßig und ungleichmäßig, aber per saldo letztlich positiv auf das Schwellenländeruniversum auswirken. Wir erwarten, dass die Ausfallraten für Staatsanleihen bis 2023 auf einen niedrigen einstelligen Prozentsatz sinken werden, während das zunehmende Engagement des IWF in verschiedenen Schwellenländern den Finanzierungsbedarf und die Reformagenden unterstützen dürfte. Die Hauptrisiken für unsere positive Einschätzung sehen wir entweder in einer möglichen globalen Rezession, die die Risikoprämie für Schwellenländer erheblich in die Höhe treiben würde, oder in einer unerwarteten Beschleunigung der Inflationsdynamik weltweit, die deutlich mehr Zinserhöhungen erforderlich machen würde.

## Emerging Markets Equity – Bericht des Investment-Managers

Für den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 4,97 %. Der als Benchmark dienende MSCI Emerging Markets Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) verzeichnete im selben Zeitraum ein Plus von 4,89 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Aktien aus Schwellenländern („EM“) legten in diesem Zeitraum zu, hinkten aber hinter Titeln aus den Industrieländern her, weil bessere Zinssichten für die USA gegen einen Aufschwung in China abgewogen wurden, der sich langsamer vollzog als erwartet.
- Nach Sektoren schnitten Informationstechnologie („IT“), Energie und Kommunikationsdienste besser ab als der Durchschnitt. Die größten Einbußen erlitten Gesundheits-, Versorgungs- und Immobilienwerte.
- Im Einzelnen wiesen Griechenland, Ungarn und Mexiko die höchsten Gewinne aus, die Türkei, Malaysia und Thailand die größten Verluste.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf seine Wertentwicklung auswirkten.

- Positivbeiträge zur relativen Gesamrendite:
  - Die Einzeltitelauswahl in den Sektoren Gesundheitswesen, IT und Immobilien.
  - Die Sektorpositionierung einschließlich einer Übergewichtung in IT und einer Untergewichtung in Versorgung.
  - Positionen in Taiwan, den VAE und Südafrika.
- Negativbeiträge zur relativen Gesamrendite:
  - Die Einzeltitelauswahl in den Sektoren Nicht-Basiskonsumgüter, Finanzen und Werkstoffe.
  - Übergewichtungen in Basiskonsum- und Gesundheitswerten.
  - Positionen in China, in nicht in der Benchmark erfassten Bergbauunternehmen mit Verbindungen in Schwellenländer und Sitz im Vereinigten Königreich sowie in Mexiko.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Infolge der Bottom-up-Einzeltitelauswahl beschloss das Portfolio den Berichtszeitraum mit Übergewichtungen in den Sektoren IT, Basiskonsumgüter und Gesundheitswesen und Untergewichtungen in den Sektoren Nicht-Basiskonsumgüter, Versorgung und Werkstoffe.
- Nach Ländern bestanden die größten Übergewichtungen am Ende des Berichtszeitraums in nicht in der Benchmark enthaltenen Positionen in Hongkong (mit Verbindungen zu China), in Bergbauunternehmen mit Verbindungen in Schwellenländer und Sitz im Vereinigten Königreich sowie in Indien. Die größten Untergewichtungen bestanden in China, Saudi-Arabien und Taiwan.

Das Team ging zwar von einer holprigen Konjunkturerholung in China aus, doch wie pessimistisch sich das Anlegerpublikum zuletzt zeigte, kam unerwartet, sodass bestimmte Wertpapiere auf einem ausgesprochen attraktivem Niveau zu haben sind. Dem Team ist durchaus bewusst, dass die laufenden politischen Querelen zwischen den Regierungen der USA und Chinas negative Effekte haben, doch es geht davon aus, dass die Länder die Möglichkeit haben, in ihre Beziehung „Leitplanken“ einzuziehen, wie auf den letzten Besuchen diplomatischer Vertreter aus den USA in China zu beobachten war. Da sich die Rahmenbedingungen ständig weiterentwickeln, passt das Team sein Engagement in China kontinuierlich an, und zwar auf der Grundlage von Unternehmenserträgen und Veränderungen beim Überzeugungsgrad von Einzeltiteln. Es behält dabei die politischen Entwicklungen im Auge.

Ansonsten bestärkt die gegen Ende des Berichtszeitraums einsetzende Rally in Brasilien das Team in seiner Überzeugung, dass die nachlassende Inflation in Schwellenländern in den nächsten Quartalen zu positiven Renditen einzelner Märkte beitragen könnte. Das könnte auch zinssensiblen Bereichen des Portfolios zugutekommen, etwa im Finanzsektor, in dem das Portfolio in Banken übergewichtet ist. Ansonsten geht das Team zwar davon aus, dass der Hype um künstliche Intelligenz etwas überzogen sein könnte, hat aber in verschiedenen IT-Segmenten Chancen in anderen Nischen erkannt, was zur neuerlichen Übergewichtung dieses Sektors beitrug – auf Kosten der zuvor bestehenden höheren Übergewichtung in Basiskonsumwerten. Das Team bleibt in stärker konjunkturabhängigen Segmenten wie Metallen und Bergbau untergewichtet.

Durch diese Positionierungsentscheidungen ist das Portfolio so aufgestellt, dass es eher von unternehmensspezifischen Chancen profitieren kann, weniger von einer zyklischen Erholung. Das erscheint angesichts des weltweit langsameren Wachstums angebracht.

## Emerging Markets Select Equity – Bericht des Investment-Managers

Für den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 2,71 %. Der als Benchmark dienende MSCI Emerging Markets Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) verzeichnete im selben Zeitraum ein Plus von 4,89 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Aktien aus Schwellenländern („EM“) legten in diesem Zeitraum zu, hinkten aber hinter Titeln aus Industrieländern her, weil bessere Zinssichten für die USA gegen einen Aufschwung in China abgewogen wurden, der sich langsamer vollzog als erwartet.
- Nach Sektoren schnitten Informationstechnologie („IT“), Energie und Kommunikationsdienste besser ab als der Durchschnitt. Die größten Einbußen erlitten Gesundheits-, Versorgungs- und Immobilienwerte.
- Im Einzelnen wiesen Griechenland, Ungarn und Mexiko die höchsten Gewinne aus, die Türkei, Malaysia und Thailand die größten Verluste.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf seine Wertentwicklung auswirkten.

- Positivbeiträge zur relativen Gesamrendite:
  - Die Einzeltitelauswahl in den Sektoren Gesundheitswesen, Industrie und Immobilien.
  - Die Sektorpositionierung einschließlich einer Übergewichtung in IT und einer Untergewichtung in Versorgung und Werkstoffen.
  - Positionen in Taiwan, Polen und Südafrika.
- Negativbeiträge zur relativen Gesamrendite:
  - Die Einzeltitelauswahl in den Sektoren Nicht-Basiskonsumgüter, Finanzen und Kommunikationsdienste.
  - Eine Übergewichtung in Basiskonsumwerten und eine Untergewichtung im Energiesektor.
  - Positionen in China, in nicht in der Benchmark erfassten Bergbauunternehmen mit Verbindungen in Schwellenländer und Sitz im Vereinigten Königreich sowie in Mexiko.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Infolge der Bottom-up-Einzeltitelauswahl beschloss das Portfolio den Berichtszeitraum mit Übergewichtungen in den Sektoren Finanzen, Basiskonsumgüter und IT und Untergewichtungen in den Sektoren Werkstoffe, Energie und Versorgung.
- Nach Ländern bestanden die größten Übergewichtungen am Ende des Berichtszeitraums in nicht in der Benchmark enthaltenen Positionen in Hongkong (mit Verbindungen zu China), in Bergbauunternehmen mit Verbindungen in Schwellenländer und Sitz im Vereinigten Königreich sowie in Korea. Die größten Untergewichtungen bestanden in China, Saudi-Arabien und Brasilien.

Das Team ging zwar von einer holprigen Konjunkturerholung in China aus, doch wie pessimistisch sich das Anlegerpublikum zuletzt zeigte, kam unerwartet, sodass bestimmte Wertpapiere auf einem ausgesprochen attraktivem Niveau zu haben sind. Dem Team ist durchaus bewusst, dass die laufenden politischen Querelen zwischen den Regierungen der USA und Chinas negative Effekte haben, doch es geht davon aus, dass beide Länder die Möglichkeit haben, in ihre Beziehung „Leitplanken“ einzuziehen, wie auf den letzten Besuchen diplomatischer Vertreter aus den USA in China zu beobachten war. Da sich die Rahmenbedingungen ständig weiterentwickeln, passt das Team sein Engagement in China kontinuierlich an, und zwar auf der Grundlage von Unternehmenserträgen und Veränderungen beim Überzeugungsgrad von Einzeltiteln. Es behält dabei die politischen Entwicklungen im Auge.

Ansonsten bestärkt die gegen Ende des Berichtszeitraums einsetzende Rally in Brasilien das Team in seiner Überzeugung, dass die nachlassende Inflation in Schwellenländern in den nächsten Quartalen zu positiven Renditen einzelner Märkte beitragen könnte. Das könnte auch zinssensiblen Bereichen des Portfolios zugutekommen, etwa im Finanzsektor, in dem das Portfolio in Banken übergewichtet ist. Ansonsten geht das Team zwar davon aus, dass der Hype um künstliche Intelligenz etwas überzogen sein könnte, hat aber in verschiedenen IT-Segmenten Chancen in anderen Nischen erkannt, was zur neuerlichen Übergewichtung dieses Sektors beitrug – auf Kosten der zuvor bestehenden höheren Übergewichtung in Basiskonsumwerten. Das Team bleibt in stärker konjunkturabhängigen Segmenten wie Metallen und Bergbau untergewichtet.

Durch diese Positionierungsentscheidungen ist das Portfolio so aufgestellt, dass es eher von unternehmensspezifischen Chancen profitieren kann, weniger von einer zyklischen Erholung. Das erscheint angesichts des weltweit langsameren Wachstums angebracht.

## Euro Bond Absolute Return – Bericht des Investment-Managers

Für den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 betrug die Gesamttrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse EUR I 1,52 %. Der ICE BofA 0-1 Year AAA Euro Government Index (Total Return, EUR) (der „Index“) verzeichnete im selben Zeitraum 0,79 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamttrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Auf den raschen Anstieg wichtiger Leitzinssätze der Europäischen Zentralbank („EZB“) folgte eine hohe Volatilität der Anleiherenditen. Die EZB schlug restriktivere Töne an, weil keine eindeutigen Belege dafür vorlagen, dass die zugrunde liegende Inflation ihren Höchststand bereits überschritten hatte. Überdies konnte sich die Wirtschaft während der Turbulenzen im Bankensystem gut behaupten. Eine derart restriktive EZB-Politik führte zur Inversion der Renditekurve. Die 2-jährige deutsche Bundesanleihe legte mit 45 Bp deutlich zu, während die 10-jährige ein Minus von 17 Bp verbuchte. Der Markt befürchtete, die Zentralbank könne auf den sprunghaften Inflationsanstieg überreagiert haben.
- Die Inflationszahlen für die Eurozone bestimmten die EZB-Politik und die Marktbewegungen. Nachdem zunächst die Energiepreise und dann auch die Lebensmittelpreise gefallen waren, ging die Gesamtinflationsrate deutlich zurück: von 9,2 % im Dezember 2022 auf 5,5 % im Juni. Die Kerninflationsrate ohne Energie und Nahrungsmittel erhöhte sich im Zeitraum von Dezember 2022 bis Juni 2023 allerdings leicht: von 5,2 % auf 5,4 %. Die Dienstleistungskomponente steigt noch an.
- Dessen ungeachtet befand sich die Wirtschaft vom vierten Quartal 2022 bis ins erste Quartal 2023 in einer leichten Rezession. Das Wachstum des deutschen BIP betrug im ersten Quartal 2023 im Quartalsvergleich -0,3 %. Vorausgegangen war eine Kontraktion im vierten Quartal 2022. Im Quartalsvergleich ging der private Konsum um spürbare 1,2 % zurück, während die Investitionen wieder um 3,9 % anzogen. Die Staatsausgaben verringerten sich aufgrund weggefallener staatlich finanzierter COVID-Maßnahmen um 4,9 %. Der Nettoexport steigerte das BIP-Wachstum, als die Importe um 0,9 % abnahmen. Im Dienstleistungssektor war die Aktivität weiter ausgesprochen robust, während das produzierende Gewerbe einen drastischen Rückgang verbuchte – mit 43,4 im Juni auf ein sehr niedriges Niveau. Solides BIP-Wachstum für Südeuropa in Verbindung mit dem Eindruck, dass der Zinserhöhungszyklus seinen Höhepunkt überschritten hat, führte zu starker Wertentwicklung von Staatsanleihen aus der Peripherie und auch auf dem Markt für Unternehmensanleihen.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf seine Wertentwicklung auswirkten.

- Positivbeiträge zur relativen Gesamttrendite:
  - Unser Long-Engagement in Unternehmensanleihen, insbesondere im Bankensektor, aber auch in Emittenten mit niedrigem Rating (aus dem Hochzinssegment).
  - Long-Swap-Spreads über IRS und Proxy-Swaps.
  - Long-Positionen in Ländern auf der iberischen Halbinsel und in Osteuropa.
- Negativbeiträge zur relativen Gesamttrendite:
  - Absicherung des Engagements in Unternehmensanleihen mit iTraxx Crossover.
  - Zinskurven-Steepener (allen voran das Renditegefälle zwischen 30-jährigen und 5-jährigen US-Staatsanleihen bzw. 5s30s).

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Im zweiten Quartal erhöhten wir das Durationsengagement, da wir davon ausgingen, dass der Leitzins der EZB in Kürze seinen Höchststand erreicht haben dürfte – vor allem angesichts der Spannungen im Bankensystem. Wir erwarben überwiegend Papiere mit 5-jähriger Laufzeit. Das Engagement in sehr langen Laufzeiten verringerten wir dagegen.
- Wir führen unser Engagement in Unternehmensanleihen zurück – eine Vorsichtsmaßnahme für den Fall einer langwierigen Rezession. Nach der Regionalbankenkrise schichteten wir Kapital aus Industrierwerten in den Bankensektor um. Außerdem sicherten wir uns am Ende des Berichtszeitraums über iTraxx Crossover ab, um unser Long-Engagement in Unternehmensanleihen besser zu schützen.

Mit Blick auf die Zukunft wollen wir nach einer kräftigen Spread-Rally bei europäischen Unternehmensanleihen im ersten Halbjahr 2023 das Portfolio-Beta verringern, um die Spread-Duration abzubauen, falls sich die Spreads in den nächsten Monaten weiten sollten. Wir gehen davon aus, dass die Transmission der EZB-Geldpolitik funktioniert und sich früher oder später auf die Kreditspreads auswirken könnte. Die Effekte dürften für HY und nachrangige Anleihen stärker ausfallen. Wir sind der Ansicht, dass sich die Kerninflation ihrem Gipfel nähert, und tendieren zu langer Duration bei Laufzeiten über 3 Jahren über Receiver-Zinsswaps.



## Euro Opportunistic Bond – Bericht des Investment-Managers

Für den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse EUR I 3,21 %. Der Bloomberg Euro Aggregate Index (Total Return, Hedged, EUR) (der „Index“) rentierte im selben Zeitraum 2,25 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Auf den raschen Anstieg wichtiger Leitzinssätze der Europäischen Zentralbank („EZB“) folgte eine hohe Volatilität der Anleihenrenditen. Die EZB schlug restriktivere Töne an, weil keine eindeutigen Belege dafür vorlagen, dass die zugrunde liegende Inflation ihren Höchststand bereits überschritten hatte. Überdies konnte sich die Wirtschaft während der Turbulenzen im Bankensystem gut behaupten. Eine derart restriktive EZB-Politik führte zur Inversion der Renditekurve. Die 2-jährige deutsche Bundesanleihe legte mit 45 Bp deutlich zu, während die 10-jährige ein Minus von 17 Bp verbuchte. Der Markt befürchtete, die Zentralbank könne auf den sprunghaften Inflationsanstieg überreagiert haben.
- Die Inflationszahlen für die Eurozone bestimmten die EZB-Politik und die Marktbewegungen. Nachdem zunächst die Energiepreise und dann auch die Lebensmittelpreise gefallen waren, ging die Gesamtinflationsrate deutlich zurück: von 9,2 % im Dezember 2022 auf 5,5 % im Juni. Die Kerninflationsrate ohne Energie und Nahrungsmittel erhöhte sich im Zeitraum von Dezember 2022 bis Juni 2023 allerdings leicht: von 5,2 % auf 5,4 %. Die Dienstleistungskomponente steigt noch an.
- Dessen ungeachtet befand sich die Wirtschaft vom vierten Quartal 2022 bis ins erste Quartal 2023 in einer leichten Rezession. Das Wachstum des deutschen BIP betrug im ersten Quartal 2023 im Quartalsvergleich -0,3 %. Vorausgegangen war eine Kontraktion im vierten Quartal 2022. Im Quartalsvergleich ging der private Konsum um spürbare 1,2 % zurück, während die Investitionen wieder um 3,9 % anzogen. Die Staatsausgaben verringerten sich aufgrund weggefallener staatlich finanzierter COVID-Maßnahmen um 4,9 %. Der Nettoexport steigerte das BIP-Wachstum, als die Importe um 0,9 % abnahmen. Im Dienstleistungssektor war die Aktivität weiter ausgesprochen robust, während das produzierende Gewerbe einen drastischen Rückgang verbuchte – mit 43,4 im Juni auf ein sehr niedriges Niveau. Solides BIP-Wachstum für Südeuropa in Verbindung mit dem Eindruck, dass der Zinserhöhungszyklus seinen Höhepunkt überschritten hat, führte zu starker Wertentwicklung von Staatsanleihen aus der Peripherie und auch auf dem Markt für Unternehmensanleihen.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf seine Wertentwicklung auswirkten.

- Der relative Vorsprung des Portfolios vor dem Index ergab sich aus dem Long-Engagement in Unternehmensanleihen durch unser übergewichtetes Engagement im Bankensektor und in Emittenten mit niedriger Bonität („High Yield“-Segment).
- Long-Swap-Spreads durch Zins- und Proxy-Swaps gegenüber Staatsanleihen leisteten Positivbeiträge zur Wertentwicklung.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Ein leichtes Long-Durationsengagement, seit wir angesichts der Spannungen im Bankensystem mit einem Gipfel des EZB-Leitzinses rechnen. Wir kauften überwiegend Papiere mit fünfjähriger Laufzeit und bauten unsere Untergewichtung in ausgesprochen lang laufenden Titeln aus.
- Unsere Übergewichtung in Unternehmensanleihen fuhren wir zurück, um dem Risiko einer langwierigen Rezession Rechnung zu tragen. Nach der Regionalbankenkrise schichteten wir Kapital aus Industrierwerten in den Bankensektor um. Außerdem sicherten wir uns am Ende des Berichtszeitraums über iTraxx Crossover ab, um unser Long-Engagement in Unternehmensanleihen besser zu schützen, was der Wertentwicklung schadete.

Über die kommenden Monate sollte sich der Anleihenmarkt darauf fokussieren, wie schnell die Inflation zurückgeht und auf welches Niveau. Das wird vom Ergebnis der Tarifverhandlungen abhängen. Es besteht nach wie vor das Risiko einer Rezession, weil der Konsum schwächelt: Die Wahrscheinlichkeit einer wachstumsschwachen Phase nimmt im Kontext nach wie vor hoher Energiepreise, einer Weitung der Kreditspreads, des sprunghaften Anstiegs der Renditen und des anhaltenden Kriegs in der Ukraine weiter zu.

Die EZB hat sich dazu bekannt, die Zinsen solange zu erhöhen, bis die Kerninflation spürbar zurückgeht. Dadurch steigt das Risiko, dass die Zinsen zu stark heraufgesetzt werden könnten. Ein solches Szenario könnte den Anstieg der Realrenditen begrenzen, was dem Rentenmarkt Rückhalt geben würde.

Abschließend lässt sich feststellen, dass es nur eine Frage der Zeit ist, bis die Inflation auf ihr übliches Niveau zurückgeht, da wir davon ausgehen, dass die Eurozinsen ihren Gipfel bereits überschritten haben.

## European High Yield Bond – Bericht des Investment-Managers

Für den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 betrug die Gesamttrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse EUR I 4,78 %. Im selben Zeitraum verzeichnete der als Benchmark dienende ICE BofA European Currency Non-Financial High Yield 3% Constrained Index (Total Return, EUR) (der „Index“), 4,38 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamttrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Der europäische Markt für Hochzinsanleihen beschloss den Berichtszeitraum mit soliden Renditen, die vor allem darauf beruhten, dass die Wirtschaftsdaten robuster ausfielen als erwartet, aber auch auf den Erträgen der meisten Emittenten. Das galt ungeachtet der Volatilitätsschübe, die von Sorgen um höhere Inflation ausgelöst wurden, der restriktiveren Zentralbankpolitik, der Minibankenkrise und eines zunehmenden Rezessionsrisikos im ersten Halbjahr.
- Aus makroökonomischer Sicht rechnen wir mit einem Wachstumsniveau unter dem Trend, noch verschärft durch härtere Bedingungen im Bankensektor, sodass das Rezessionsrisiko in westlichen Volkswirtschaften bedenklich hoch bleibt. Abgesehen davon gilt: Angesichts des Umstands, dass sich Unternehmen und Verbraucher recht stoisch auf die Herausforderungen eingestellt haben, mit denen sie in den letzten 18 Monaten konfrontiert wurden, gehen wir nicht von einer Entwicklung in Richtung eines stärker rezessionsgeprägten Umfelds aus. Stattdessen und mit Blick auf die aktuellen Bewertungen, insbesondere auf die beachtliche Umlaufrendite im europäischen Hochzinssegment, beurteilen wir die Anlageklasse vorsichtig optimistisch.
- Die Ausfälle sind vom niedrigen Vorjahresniveau zwar angestiegen, doch die Ausfallquote ist nach wie vor vergleichsweise niedrig und die Emittenten halten sich aus fundamentaler Sicht bei freiem Cashflow, Zinsdeckung und Verschuldung bisher in einer einigermaßen günstigen Bandbreite. Der Ausblick für die Ausfälle im Jahr 2023 entspricht nach wie vor den langfristigen Durchschnittswerten.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf seine Wertentwicklung auswirkten.

- Positivbeiträge zur relativen Gesamttrendite:
  - Die Einzeltitelauswahl bei Wertpapieren mit B-Rating sowie deren Übergewichtung gegenüber dem Index, die Einzeltitelauswahl bei Wertpapieren mit Ratings von BB, CCC und darunter sowie deren Untergewichtung und die Einzeltitelauswahl bei Emittenten ohne Rating
  - Die Einzeltitelauswahl im Sektor Autos und Autoteile, die Einzeltitelauswahl im Verpackungssektor sowie dessen Übergewichtung und die Untergewichtung und Einzeltitelauswahl im Sektor Lebensmitteleinzel- und Drogeriefachhandel (das Portfolio profitierte davon, dass das Team den ausgefallenen Emittenten Casino gemieden hatte)
- Negativbeiträge zur relativen Gesamttrendite:
  - Die Einzeltitelauswahl bei Wertpapieren mit Ratings von BBB und darüber sowie deren Übergewichtung im Verhältnis zum Index und die Einzeltitelauswahl bei Wertpapieren mit Ratings von CCC und darunter
  - Die Einzeltitelauswahl im Sektor Immobilien und Bauunternehmen, die Einzeltitelauswahl im Gaming-Sektor sowie dessen Untergewichtung im Verhältnis zum Index und die Einzeltitelauswahl im Freizeitsektor sowie dessen Übergewichtung

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Portfolio blieb bei der Gewichtung der Emissionen ausgesprochen EUR- und GBP-lastig. Auf diese Währungen entfielen am Ende des Berichtszeitraums rund 99 % des Portfolios.
- Die Anleihenallokation betrug am Ende des Berichtszeitraums ungefähr 95 %.
- Veränderungen des Kreditrating-Engagements ergaben sich in erster Linie aus Entscheidungen für Einzeltitel, aber auch im Kontext der weiteren Entwicklung des Kreditzyklus und des gesamtwirtschaftlichen Ausblicks. Im Berichtszeitraum wurde das Engagement des Portfolios in Wertpapiere mit B-Rating, ohne Rating und mit BB-Rating ausgebaut, das Engagement in Wertpapieren mit CCC- und BBB-Rating zurückgefahren.

Wir rechnen weiter mit einer hohen Spreadstreuung zwischen Emittenten, Sektoren, Ratingkategorien und geografischen Regionen, aus der sich nach unserem Dafürhalten Chancen auf höhere Renditen durch die Wertpapierauswahl ergeben dürften. Wir sind ferner der Überzeugung, dass die technischen Marktdaten auch künftig für Rückenwind sorgen werden, da die Primäremissionen ohne Zins- und Rückzahlungen unserer Erwartung nach vernachlässigbar, wenn nicht gar negativ ausfallen dürften. In diesem Marktumfeld dürften sorgfältige Bottom-up-Kreditanalyse und weiterhin enge Kontakte zu Managementteams, Sponsoren und Gegenparteien an der Börse unseres Erachtens auch künftig entscheidend dafür bleiben, dass es gelingen kann, unsere Portfolios zu optimieren, um aus den gebotenen Chancen Kapital zu schlagen.

## European Sustainable Equity – Bericht des Investment-Managers

Für den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse EUR I 13,83 %. Der als Benchmark dienende MSCI Europe Index (Total Return, abzüglich Steuern, EUR) (der „Index“) verzeichnete im selben Zeitraum 11,12 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse.

- Insgesamt lagen der risikoscheuen Marktstimmung durchwachsene Konjunkturdaten, hohe Zinsen, erhöhte Inflation sowie eine nach wie vor restriktive Zentralbankpolitik zugrunde.
- Die Renditen fielen weltweit in allen größeren Volkswirtschaften höher aus. Die Verzinsung 10-jähriger US-Staatsanleihen kletterte auf 3,85%.
- Die Europäische Zentralbank („EZB“) hob die Zinsen um 0,25 % an, sodass der Satz für Hauptrefinanzierungsgeschäfte auf 4 % stieg: das höchste Niveau seit der Finanzkrise von 2008.
- In China fiel die Inflation im Jahresvergleich moderat aus. Die wiederöffnungsbedingte Konjunkturdynamik scheint aber nachzulassen.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf seine Wertentwicklung auswirkten.

- Positivbeiträge zur Gesamtrendite:
  - Die Einzeltitelauswahl in den Sektoren Finanzen, Industrie und Kommunikationsdienste steigerte die relative Wertentwicklung spürbar, da sich diese dank ihrer robusten Geschäftsmodelle im Kontext einer Konjunkturabschwächung besser entwickelten als ihre Vergleichsgruppe. Der Verzicht auf klassische Banken und Versicherungen kam der Wertentwicklung zugute, da diese Segmente zunehmend unter Druck standen, weil die Zentralbanken die geldpolitischen Zügel anzogen.
  - Die Resilienz der Geschäftsmodelle schlug sich auch in den neuesten Ergebnissen nieder, die für Portfoliopositionen in diesen Sektoren ausgewiesen wurden, denn diese stellten die Konsenserwartungen in den Schatten.
  - Im Berichtszeitraum lieferten Large-Caps aus den USA die stärkste Wertentwicklung, gefolgt von Aktien aus anderen Industrieländern und aus Schwellenländern.
- Negativbeiträge zur relativen Gesamtrendite:
  - Die Einzeltitelauswahl bei Nicht-Basiskonsumwerten belastete die Wertentwicklung, da die Konsumausgaben zurückgingen, als nachgebende makroökonomische Indikatoren für einen eingetrübten Ausblick sprachen.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Wir gingen im Berichtszeitraum zwei neue Positionen in der Wertschöpfungskette „Digitale Unternehmen“ sowie eine neue Position in der Wertschöpfungskette „Bewusster Konsum“ ein.
- Unseren Restbestand in einem Wertpapier der Wertschöpfungskette „Fintech und finanzielle Integration“ stießen wir ab. Der Erlös wurde zur Finanzierung attraktiverer Anlagen mit stärkeren Kapitalmehrungsmerkmalen verwendet.
- Das Portfolio musste entsprechend einer Neugewichtung seines Index neu ausgerichtet werden. Dabei mussten wir uns auf die Umstufung von Zahlungsdienstleistern aus dem Informationstechnologiesektor in den Finanzsektor einstellen.

Unsere Analysten rechnen mit stärkerem konjunkturellem Gegenwind, da sich die restriktiveren geldpolitischen Rahmenbedingungen allmählich bemerkbar machen. Nachgebende Immobilienpreise stellen ein potenzielles Risiko dar. Wir halten an unserer Einschätzung fest, dass sich stabile, hochwertige Aktien weiter besser entwickeln dürften als riskantere Papiere. Angesichts des schwierigen Markthintergrunds hängt der Erfolg der meisten Qualitätsunternehmen in unseren Augen mehr und mehr von der Entwicklung immateriellen Kapitals ab – innovative Technologie, Forschung & Entwicklung, Humankapital und Marken- oder Plattformreputation –, um eine dauerhafte Wettbewerbsposition zu schaffen. Diese dauerhafte Wettbewerbsposition kann durch eine gute Corporate Citizenship gestärkt werden, indem ESG-Praktiken (Umwelt, Soziales und Governance) sorgfältig gemanagt werden. Wir denken, dass eine vorausschauende Analyse dieser Kombination aus Qualitätsmerkmalen, ESG-Faktoren und idiosynkratischen Merkmalen der Schlüssel zur Identifizierung der „Transition Winners“ der neuen Wirtschaft ist.

## Event Driven – Bericht des Investment-Managers

Für den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 0,20 %. Der S&P 500 Index\* (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der „Index“) rentierte im selben Zeitraum 16,60 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Im Großen und Ganzen war Merger Arbitrage im vergangenen Jahr ein problematisches Segment. Angesichts verstärkter Marktvolatilität ließ das Transaktionsaufkommen 2022 drastisch nach, wodurch das investierbare Universum Anfang 2023 eingegrenzt wurde.
- Ab Ende 2022 sind auch mehrere Transaktionen gescheitert (Rogers/DuPont, Tegna/Standard General und First Horizon/Toronto Dominion („Deal Breaks“)), sodass höhere Verluste realisiert wurden, und weltweit wurden verschiedene Zusammenschlüsse von Aufsichtsbehörden beanstandet, was sowohl das Spread-Niveau als auch die Volatilität für die Strategie in die Höhe trieb.
- Das Fusions- und Übernahmegeschehen nimmt derzeit rasant zu. Noch bedeutsamer ist, dass Spreads neuerdings attraktive Aufschläge auf den risikolosen Zinssatz beinhalten – oftmals in der Größenordnung von jährlichen Renditen im hohen einstelligen oder niedrigen zweistelligen Bereich.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf seine Wertentwicklung auswirkten.

- Positivbeiträge zur absoluten Gesamtrendite:
  - Die beiden hauptsächlichen Teilstrategien, Risk-Arbitrage und Market Neutral Catalyst, trugen positiv zur Rendite bei.
  - Option Care Health, Liberty Media und Apollo Global Management leisteten Spitzenbeiträge zur Wertentwicklung.
- Negativbeiträge zur absoluten Gesamtrendite:
  - Salesforce, Western Digital und Ferguson PLC minderten die Wertentwicklung.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Durch unseren disziplinierten philosophischen Ansatz konnten wir alle drei seit November 2022 gescheiterten Transaktionen meiden.
- Außerdem hat das Team im Verlauf der Transaktionen durch aktive Handelspositionen aus Verzerrungen Kapital geschlagen.
- Wir fokussieren uns nach Kräften auf Situationen, in denen 1) wir den Übernahmekandidaten als fundamental stark einschätzen und neben dem unmittelbaren aufsichtsrechtlichen Ergebnis gleich mehrere Möglichkeiten sehen, Gewinn zu erzielen; 2) das Risiko-/Ertragsprofil Rechtsstreitigkeiten einkalkuliert und der Fall unseres Erachtens (ex-ante) so liegen könnte, dass der Spread den voraussichtlichen Ausgang des Verfahrens angemessen berücksichtigt und 3) bestimmte Situationen mit klareren aufsichtsrechtlichen Risiken vorliegen. Da sich Merger Arbitrage so asymmetrisch auszahlt, sind wir bereit, auf das Aufwärtspotenzial von Transaktionen zu verzichten, die möglicherweise zum Abschluss kommen, in die wir aber nur begrenztes Vertrauen haben, um ein Engagement in gescheiterten Transaktionen zu vermeiden, die unser Vertrauen womöglich nicht gerechtfertigt hätten. Dieser Ansatz und die damit einhergehende Disziplin, die er fördert, haben uns dieses Jahr bislang gute Dienste geleistet.

Wir verfolgen einen Risiko-/Ertrags-orientierten Ansatz mit Schwerpunkt auf dem Aufbau eines Portfolios aus fehlbewerteten Positionen mit positiver Werterwartung, bei denen wir unserer Ansicht nach Art und Umfang der damit verbundenen Risiken bestimmen können. „Risiko/Ertrag“ steht dabei für eine komplexe Bewertung der Art und Weise, wie der Markt die Risiken bei einer Transaktion bepreist. Wir interessieren uns für Situationen, in denen wir, nachdem wir die Art der potenziellen Risiken genauer bestimmt haben, darauf vertrauen, dass die vom Markt implizierte Wahrscheinlichkeit des Eintritts eines Ereignisses auf dem Markt (gewöhnlich der Abschluss einer Fusion, aber auch zwischengeschaltete Ereignisse im Zuge des Lebenszyklus einer Transaktion) zu niedrig ist. Ist die vom Markt implizierte Wahrscheinlichkeit geringer als unsere Erwartung, hat die Transaktion für uns ein vorteilhaftes Risiko-/Ertragsverhältnis beziehungsweise einen positiven Erwartungswert. Da sich die aufsichtsrechtlichen Rahmenbedingungen weltweit weiterentwickeln, haben wir in manche Genehmigungsverfahren weniger Zutrauen. Bei der Catalyst-Strategie haben wir für eine Reihe von Positionen kleine Gewinne verbucht, da sich manche unserer Thesen wie geplant entwickeln. Wir beobachten ein extrem hohes Niveau von Kapitalmaßnahmen. Managementteams, die noch keine strategischen Maßnahmen ergriffen haben, haben zumindest etliche „Hebel“ ermittelt, die sie wertsteigernd einsetzen können. Das eröffnet der Strategie vielversprechende Möglichkeiten zur Entwicklung von Ideen. Die Unternehmen merken, dass die makroökonomischen Bedingungen schwierig sind, und sehen sich gezwungen, auf andere Weise Wert zu generieren. Und danach halten wir in der Strategie Ausschau. Da wir uns engmaschig absichern, können wir uns in Geduld üben, während die Managementteams solche Initiativen betreiben, die letztlich Wert erschließen. Unserer Ansicht nach sind die Märkte nach wie vor schwach bestückt und hoch bewertet.

Die Marktzuwächse konzentrieren sich überwiegend auf eine Handvoll Large-Caps aus dem Technologiesektor, wenngleich die Breite im vergangenen Monat zugenommen hat, da Anzeichen dafür vorliegen, dass die Aussicht auf eine sanfte Landung bei den Anlegern Begeisterung hervorruft. Wir befürchten nach wie vor, dass die Bandbreite möglicher Ergebnisse für die Märkte groß ist und gehen davon aus, dass wir am besten fahren, wenn wir uns weiter auf idiosynkratische Ideen fokussieren, die mit Bedacht abgesichert werden.

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

## Global Bond – Bericht des Investment-Managers

Für den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 1,56 %. Der als Benchmark dienende Bloomberg Global Aggregate Index (Total Return, Unhedged, USD) (der „Index“) verbuchte im selben Zeitraum 1,43 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Rentenmärkte und Wirtschaft entwickelten sich weltweit auseinander, da sich der Anlegerfokus von Sorgen um den Bankensektor auf die restriktive Haltung von Zentralbanken in Industrieländern verlagerte – und darauf, wie Unternehmen und Verbraucher für das zweite Halbjahr aufgestellt sind.
- In den Industrieländern erhöhten sich die Zinsen im Berichtszeitraum, angeführt vom vorderen Ende.
- Die Kreditspreads von Titeln mit und ohne Investment Grade verengten sich im Berichtszeitraum, woraus solide Nachfrage für diese Anlagen sprach.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf seine Wertentwicklung auswirkten.

- Positivbeiträge zur relativen Gesamtrendite:
  - Engagement in globalen inflationsindexierten Anleihen, Kreditrisikotransfer und Schwellenländeranleihen.
  - Einzeltitelauswahl bei globalen Unternehmensanleihen mit Investment Grade und quasistaatlichen Mortgage Backed Securities („MBS“).
  - Positionierung und Zinsen in den USA, Norwegen und im Vereinigten Königreich.
- Negativbeiträge zur relativen Gesamtrendite:
  - Untergewichtung in Staatsanleihen aus Industrieländern.
  - Positionierung in Japan und in Zinssätzen europäischer Kernländer.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Im Verlauf des Berichtszeitraums bauten wir das Engagement in europäischen Unternehmensanleihen mit Investment Grade, quasistaatlichen MBS und gedeckten Anleihen aus.
- Das Engagement in Staatsanleihen aus Industrieländern, in US-Unternehmensanleihen mit Investment Grade sowie in globalen inflationsindexierten Anleihen führen wir zurück.
- Mit Blick auf die Zukunft legen wir Wert auf höhere Qualität, um uns gegen Konjunkturschwäche zu wappnen.

Im Abschwung bietet hohe Qualität in unseren Augen mehr Wert als Emissionen von schlechterer Bonität, deren Spreads sich angesichts der in letzter Zeit robusten Konjunktur verengt haben. Im Gegensatz zu den Trends, die seit der globalen Finanzkrise bestanden, glauben wir, dass die Geldpolitik künftig weniger entgegenkommend sein dürfte, was Kreditanalysen und einem schärferen Blick auf die Bedingungen bestimmter Emissionen mehr Bedeutung verleiht. Ein solches Umfeld kann unseres Erachtens den Wert steigern, den aktive Manager im gesamten festverzinslichen Universum bieten können.

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

Für den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD 1 2,57 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Rentenmärkte und Wirtschaft entwickelten sich weltweit auseinander, da sich der Anlegerfokus von Sorgen um den Bankensektor auf die restriktive Haltung von Zentralbanken in Industrieländern verlagerte – und darauf, wie Unternehmen und Verbraucher für das zweite Halbjahr aufgestellt sind.
- In den Industrieländern erhöhten sich die Zinsen im Berichtszeitraum, angeführt vom vorderen Ende.
- Die Spreads von Anleihen mit („IG“) und ohne Investment Grade aus Industrieländern mit kurzer Duration verengten sich im Berichtszeitraum, während sich die Spreads von Unternehmensanleihen aus Schwellenländern („EM“) mit kurzer Duration geringfügig weiteten.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf seine Wertentwicklung auswirkten.

- Positivbeiträge zur absoluten Gesamrendite:
  - Das Engagement in Hochzinsanleihen aus Industrieländern.
  - Das Engagement in IG-Unternehmensanleihen aus Industrieländern.
  - Das Engagement in EM-Unternehmensanleihen.
- Negativbeiträge zur absoluten Gesamrendite:
  - Aus Sektorperspektive gab es keine wesentlichen Negativbeiträge.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Im Einklang mit dem Buy-and-hold-Charakter des Portfolios wurden im Berichtszeitraum keine größeren Positionsveränderungen vorgenommen.

Im Abschwung bietet hohe Qualität in unseren Augen mehr Wert als Emissionen von schlechterer Bonität, deren Spreads sich angesichts der in letzter Zeit robusten Konjunktur verengt haben. Im Gegensatz zu den Trends, die seit der globalen Finanzkrise bestanden, glauben wir, dass die Geldpolitik künftig weniger entgegenkommend sein dürfte, was Kreditanalysen und einem schärferen Blick auf die Bedingungen bestimmter Emissionen mehr Bedeutung verleiht. Ein solches Umfeld steigert unseres Erachtens den Wert, den aktive Manager im gesamten festverzinslichen Universum bieten können.

## Global Equity Megatrends – Berichts des Investment-Managers

Für den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 15,68 %. Der als Benchmark dienende MSCI World Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der „Index“) verzeichnete im selben Zeitraum 15,09 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Im ersten Halbjahr 2023 gaben starke Arbeitsmärkte weltweit dem Konsum weiter Auftrieb. Der Inflationsdruck in den USA verringerte sich merklich.
- Die Verhandlungen um die Schuldenobergrenze in den USA, die hartnäckige Inflation in Europa sowie eine langsame Konjunkturerholung in China jagten den Anlegern aber laufend Angst ein.
- Parallel dazu zeigten sich Unternehmen aus vielen verschiedenen Branchen nach wie vor erstaunlich widerstandsfähig. In den letzten Wochen ist die Tonlage der geopolitischen Äußerungen zwischen den USA und China offenbar produktiver geworden.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf seine Wertentwicklung auswirkten.

- Positivbeiträge zur absoluten Gesamrendite:
  - Spitzenbeiträge zur Wertentwicklung von Anlagen leisteten im ersten Halbjahr unter anderem Pets At Home (Humanisierung von Haustieren), Delta Airlines (Globaler Verbraucher) sowie Alphabet (Smart Systems).
- Negativbeiträge zur absoluten Gesamrendite:
  - Die größten Negativbeiträge stammten unter anderem von ModivCare (Gesundheit und Wohlbefinden), Gen Digital (Smart Systems) sowie Stericycle (Gesundheit und Wohlbefinden).

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- 2023 initiierten wir bislang zwei neue Positionen, nämlich in Uber Technologies (Globaler Verbraucher) und in Element Solutions (Energieeffizienz).
- Außerdem stockten wir bestehende Anlagen auf, unter anderem in Stericycle (Gesundheit und Wohlbefinden), ModivCare (Gesundheit und Wohlbefinden) und Alibaba (Globaler Verbraucher).
- Finanziert wurden diese Anlagen in erster Linie durch die Verringerung des Engagements in Quanta Services (Energieinfrastruktur) und ATI Inc (Energieeffizienz) und durch die Veräußerung von Paya Holdings (Globaler Verbraucher), die im Zuge einer strategischen Übernahme Anfang 2023 von der Börse genommen wurde.

Mit Blick auf die Zukunft fallen die Aktienbewertungen weiter gemischt aus. Aktienindizes notieren auf historisch hohem Niveau, angeführt von nur wenigen Mega-Caps aus dem Technologiesektor, die als Wegbereiter der beginnenden Revolution der künstlichen Intelligenz (KI) wahrgenommen werden. Viele andere börsennotierte Unternehmen werden allerdings offenbar für tot gehalten, auch viele unserer Portfoliounternehmen. Das spricht für ein Wirtschaftsumfeld, das sich stark von der aktuellen Realität unterscheidet. Wir sind uns der laufenden Diskussionen unter den Anlegern zwar bewusst, glauben aber, dass die aktuellen Voraussetzungen für geduldige Anleger wie uns vielversprechende Chancen bieten.

## Global Flexible Credit Income – Berichts des Investment-Managers

Für den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 3,89 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Rentenmärkte und Wirtschaft entwickelten sich weltweit auseinander, da sich der Anlegerfokus von Sorgen um den Bankensektor auf die restriktive Haltung von Zentralbanken in Industrieländern verlagerte – und darauf, wie Unternehmen und Verbraucher für das zweite Halbjahr aufgestellt sind.
- Die Kreditspreads von Titeln mit und ohne Investment Grade („IG“) aus Industrieländern verengten sich im Berichtszeitraum, woraus solide Nachfrage für diese Anlagen sprach.
- Die Spreads von Unternehmensanleihen aus Schwellenländern („EM“) verengten sich insgesamt, während sie sich für lateinamerikanische Unternehmensanleihen leicht weiteten.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf seine Wertentwicklung auswirkten.

- Positivbeiträge zur absoluten Gesamrendite:
  - Den größten Wertbeitrag leistete das Engagement in Hochzinsanleihen aus den USA und Europa.
  - Die größten Positivbeiträge stammten vom Engagement in US-Unternehmensanleihen mit Investment Grade und EM-Unternehmensanleihen.
  - Das Engagement in CLOs und Kreditrisikotransfer leistete einen moderaten Positivbeitrag.
- Negativbeiträge zur absoluten Gesamrendite:
  - Die Zinspositionierung.
  - Das Engagement in europäischen Unternehmensanleihen mit Investment Grade.
  - Das Engagement in CMBS.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Im Berichtszeitraum engagierten wir uns verstärkt in europäischen Hochzinstiteln, EM-Anleihen und IG-Unternehmensanleihen aus den USA und Europa.
- Unser Engagement in US-Hochzinstiteln verringerten wir.
- Mit Blick auf die Zukunft legen wir Wert auf höhere Qualität, um uns gegen Konjunkturschwäche zu wappnen.

Im Abschwung bietet hohe Qualität in unseren Augen mehr Wert als Emissionen von schlechterer Bonität, deren Spreads sich angesichts der in letzter Zeit robusten Konjunktur verengt haben. Im Gegensatz zu den Trends, die seit der globalen Finanzkrise bestanden, glauben wir, dass die Geldpolitik künftig weniger entgegenkommend sein dürfte, was Kreditanalysen und einem schärferen Blick auf die Bedingungen bestimmter Emissionen mehr Bedeutung verleiht. Ein solches Umfeld steigert unseres Erachtens den Wert, den aktive Manager im gesamten festverzinslichen Universum bieten können.



## Global High Yield SDG Engagement – Berichts des Investment-Managers

Für den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 3,46 %. Der als Benchmark dienende ICE BofA Global High Yield Constrained Index (Total Return, Hedged, USD) (der „Index“) verbuchte im selben Zeitraum 4,94 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Der globale Markt für Hochzinsanleihen beschloss den Berichtszeitraum mit soliden Renditen, die vor allem darauf beruhten, dass die Wirtschaftsdaten robuster ausfielen als erwartet, aber auch auf die Erträge der meisten Emittenten. Das galt ungeachtet der Volatilitätsschübe, die von Sorgen um höhere Inflation ausgelöst wurden, der restriktiveren Zentralbankpolitik, der Minibankenkrise und des zunehmenden Rezessionsrisikos im ersten Halbjahr.
- Im laufenden Jahr schnitten Titel aus der Bonitätskategorie „CCC und darunter“ des Index mit Renditen von 4,94 % bzw. 8,30 % deutlich besser ab als die Indexsegmente mit BB- und B-Rating, die lediglich 3,91 % bzw. 5,65 % abwarfen.
- Die Ausfallquoten in den USA, in Europa und anderen Industrieländern dürften durchschnittlich bleiben, nachdem sie sich von den im Vorjahr erreichten historischen Tiefstständen nach oben bewegt haben. Die Ausfälle in Schwellenländern („EM“) nehmen zwar zu, aber wir konzentrieren uns auf ausgewählte Gelegenheiten außerhalb der Regionen und Sektoren mit höherem Risiko. Bei EM-Hochzins-Unternehmensanleihen betrug die Ausfallquote insgesamt in diesem Jahr anfangs um die 15 Prozent. Grund dafür sind ausbleibende Zahlungen russischer und ukrainischer Emittenten und die erhöhte Zahl an Ausfällen im chinesischen Immobiliensektor. Abgesehen von diesen spezifischen Bereichen rechnen wir mit einer eher gemäßigten Ausfallquote für hochverzinsliche EM-Unternehmensanleihen, da die EM-Unternehmen mit einer im Durchschnitt angemessenen Liquidität in diesen Berichtszeitraum eintraten.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf seine Wertentwicklung auswirkten.

- Positivbeiträge zur relativen Gesamtrendite:
  - Eine Untergewichtung in BB-Titeln im Vergleich zum Index, Übergewichtungen in Anleihen ohne Rating und mit B-Rating sowie die Einzeltitelauswahl bei Emittenten mit einem Rating von BBB oder besser.
  - Die Einzeltitelauswahl im Sektor Support-Dienstleistungen sowie dessen Übergewichtung gegenüber dem Index, die Einzeltitelauswahl im Sektor Medien, Rundfunk und Fernsehen sowie dessen Untergewichtung und die Einzeltitelauswahl im Sektor Autos und Autoteile sowie dessen Übergewichtung.
- Negativbeiträge zur relativen Gesamtrendite:
  - Die Einzeltitelauswahl bei Titeln mit einem Rating von CCC und darunter sowie deren Untergewichtung gegenüber dem Index und die Einzeltitelauswahl bei Titeln mit BB-Rating, ohne Rating und B-Rating.
  - Die Einzeltitelauswahl im Sektor Telekommunikation sowie dessen Übergewichtung gegenüber dem Index, die Einzeltitelauswahl im Sektor Immobilien und Bauunternehmen sowie dessen Übergewichtung und die Einzeltitelauswahl im Sektor Technologie und Elektronik.
  - Das Portfolio war im Beta von Unternehmensanleihen moderat untergewichtet, was den Ertrag im Verhältnis zum Index minderte, da sich die Spreads verengten und riskantere Papiere im Berichtszeitraum ungleich besser abschneiden. Ferner minderten auch Handels- und andere Effekte die Wertentwicklung, was auf die hohen Zuflüsse am letzten Handelstag 2022 (und das anschließende Swing Pricing Anfang 2023) zurückzuführen war, aber auch auf höhere Transaktionskosten Anfang Januar, bedingt durch die Investition eines Teils der Kapitalflüsse in europäische und EM-Hochzinstitel, deren Transaktionskosten nach wie vor erhöht waren.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Portfolio blieb bei der Gewichtung der Emissionen USD- und EUR-lastig. Auf diese Währungen entfielen am Ende des Berichtszeitraums rund 72 % bzw. 21 % des Portfolios.
- Die Anleihenallokation betrug am Ende des Berichtszeitraums 96,3 %.
- Veränderungen des Kreditrating-Engagements ergaben sich in erster Linie aus Entscheidungen für Einzeltitel, aber auch im Kontext der weiteren Entwicklung des Kreditzyklus und des gesamtwirtschaftlichen Ausblicks. Im Berichtszeitraum wurde das Engagement des Portfolios in Wertpapiere mit BB-, B- und BBB-Rating ausgebaut, das Engagement in Wertpapieren mit CCC-Rating und darunter zurückgefahren.

Unsere Analysten konzentrieren sich weiterhin auf die spezifischen Fundamentaldaten der Anleihen einzelner Emittenten und bewerten die Basis- und Abwärtsszenarien im Falle einer weichen Landung oder einer Rezession. Die relativ soliden Verbraucher- und Unternehmensbilanzen sowie ein wachsendes nominales BIP dürften die Fundamentaldaten der Emittenten unserer Ansicht nach weiterhin unterstützen. Zwar können die eingehenden makroökonomischen Daten und die Dynamik des gesamten Kreditzyklus im Tagesgeschäft Auswirkungen auf den Kreditmarkt zeigen, doch wir bleiben stark auf branchenspezifische Trends und idiosynkratische Risiken für Einzelemittenten fokussiert. Trotz potenzieller kurzfristiger Volatilität, die sich aus der erhöhten Unsicherheit in Bezug auf das Wirtschaftswachstum ergibt, sind wir der Meinung, dass wir mit unserem fundamentalen Bottom-up-Kreditresearch – mit Konzentration auf die Auswahl von Wertpapieren, die Vermeidung von Bonitätsherabstufungen und die ausschließliche Aufnahme der „besten Ideen“ in die Portfolios – gut aufgestellt sind, um von eventueller Volatilität zu profitieren.

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

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

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

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

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf seine Wertentwicklung auswirkten.

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

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Portfolio wurde am 16. Juni 2023 geschlossen.

\* Das Portfolio wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst.

## Global Investment Grade Credit – Bericht des Investment-Managers

Für den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 3,08 %. Der Bloomberg Global Aggregate Corporate Index (Total Return, Hedged, USD) (der „Index“) verbuchte im selben Zeitraum 3,13 %. (Die Angaben zur Wertentwicklung beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Der Wertentwicklung des Portfolios lagen überwiegend Zinserträge und etwas engere Spreads zugrunde, unterstützt durch rückläufige Daten zur Verbraucherpreis-inflation in den USA und allgemein stabile Wirtschaftsdaten.
- Belastungen im US-Bankensektor machten sich Anfang März bei bestimmten kleineren US-amerikanischen Regionalbanken und bei der Credit Suisse bemerkbar. Die Politik reagierte prompt. Die US-Notenbank kündigte am 12. März ein neues Bank Term Funding Program (BTFP) an, um Banken bei Bedarf auf Nachweis akzeptabler Sicherheiten Kredite bis zu einem Jahr Laufzeit zu gewähren. Als die Credit Suisse in Schieflage geriet, handelten die Schweizer Behörden umgehend die Übernahme des Instituts durch die UBS aus, die am 19. März bekannt gegeben wurde und am 12. Juni über die Bühne ging.
- Insgesamt reagierten die politischen Entscheidungsträger rasch auf die Anfang März aufgetretenen Belastungen der Finanzmärkte, während die Anleger aus der Belastung des Bankensektors resultierende restriktivere Finanzbedingungen als Hinweis darauf werteten, dass die Zentralbanken die Zinsen künftig langsamer anheben dürften.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf seine Wertentwicklung auswirkten.

- Positivbeiträge zur relativen Gesamrendite:
  - Die Einzeltitelauswahl in den Sektoren Grundstoffe, Technologie/Kommunikation und Nicht-Basiskonsumgüter steigerte die positive Wertentwicklung des Portfolios. Die Sektorallokation in Form einer Übergewichtung in Technologie/Kommunikation und einer Untergewichtung im Basiskonsumgütersektor trug ebenfalls positiv zur Wertentwicklung bei.
- Negativbeiträge zur relativen Gesamrendite:
  - Unsere Sektorallokation in Versorgungswerten (Übergewichtung) und Banken (Übergewichtung) minderte die Wertentwicklung.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Wir beteiligten uns im ersten Halbjahr 2023 an einer Reihe attraktiv bepreister Neuemissionen auf dem Primärmarkt, die dem Portfolio ein Renditeplus bescherten. Wir erwarben nachrangige Tier-2-Bankanleihen großer national führender britischer und europäischer Institute und stockten in volatilen Marktphasen Anfang März 2023 auch Positionen in US-Großbanken auf, die für uns einen hohen Überzeugungsgrad aufweisen. Unsere Position in den erstrangigen unbesicherten Holdco-Anleihen der Credit Suisse behielten wir bei. Diese verzeichnete eine rasche Verengung der Spreads nach der ausgehandelten Übernahme durch die UBS mit erheblicher Spread-Outperformance.
- Die Durationsposition des Portfolios blieb im Berichtszeitraum weitgehend auf Indexniveau. Allerdings geht unsere Durationspräferenz neuerdings von auf US-Dollar lautenden Anleihen weg, da sich die Spreads besser entwickelt haben als bei auf Euro und Pfund Sterling lautenden Anleihen. Ein besonderer Schwerpunkt liegt dabei angesichts des ungleich größeren Rückstands auf auf Pfund Sterling lautenden Unternehmensanleihen.

Zum Start ins zweite Halbjahr 2023 bleiben wir übergewichtet in manchen der defensiveren Sektoren wie Versorger und Banken sowie in einigen zyklischen Sektoren mit höherem Beta wie Finanzen. Wir bleiben übergewichtet in Sektoren mit starken Fundamentaldaten, die sich derzeit im Verschuldungsabbau befinden, wie Kommunikationsdienste, die unseres Erachtens weiterhin von einem von steigenden Zinsen geprägten Umfeld profitieren sollten. Wir sind untergewichtet in Sektoren wie nicht-zyklische Konsumgüter, die wir für stärker gefährdet einschätzen, Fremdkapital zur Finanzierung von Aktionärsrenditen über Aktienrückkäufe und M&A-Aktivitäten einzusetzen und zu relativ angespannten Bewertungen gehandelt werden.

## Global Opportunistic Bond – Bericht des Investment-Managers

Für den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 2,02 %. Der als Benchmark dienende Bloomberg Global Aggregate Index (Total Return, Hedged, USD) verbuchte im selben Zeitraum 2,96 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Rentenmärkte und Wirtschaft entwickelten sich weltweit auseinander, da sich der Anlegerfokus von Sorgen um den Bankensektor auf die restriktive Haltung von Zentralbanken in Industrieländern verlagerte – und darauf, wie Unternehmen und Verbraucher für das zweite Halbjahr aufgestellt sind.
- In den Industrieländern erhöhten sich die Zinsen im Berichtszeitraum, angeführt vom vorderen Ende.
- Die Kreditspreads von Titeln mit und ohne Investment Grade verengten sich im Berichtszeitraum, woraus solide Nachfrage nach diesen Anlagen sprach.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf seine Wertentwicklung auswirkten.

- Positivbeiträge zur Gesamrendite im Vergleich zur Benchmark:
  - Das Engagement in europäischen Hochzinstiteln, Schwellenländeranleihen und Kreditrisikotransfer.
  - Die Einzeltitelauswahl bei quasistaatlichen hypothekeunterlegten Wertpapieren („MBS“) und globalen Unternehmensanleihen mit Investment Grade.
  - Das aktive Devisen-Overlay des Portfolios.
- Negativbeiträge zur Gesamrendite im Vergleich zur Benchmark:
  - Die Zinspositionierung.
  - Die Untergewichtung in globalen Unternehmensanleihen mit Investment Grade.
  - Die Übergewichtung in quasistaatlichen MBS.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Im Verlauf des Berichtszeitraums bauten wir unser Engagement in quasistaatlichen MBS und Staatsanleihen aus Industrieländern aus.
- Das Engagement in europäischen Hochzinstiteln, Schwellenländeranleihen und Kreditrisikotransfer verringerten wir.

Mit Blick auf die Zukunft legen wir Wert auf höhere Qualität, um uns gegen Konjunkturschwäche zu wappnen. Im Abschwung bietet hohe Qualität in unseren Augen mehr Wert als Emissionen von schlechterer Bonität, deren Spreads sich angesichts der in letzter Zeit robusten Konjunktur verengt haben. Im Gegensatz zu den Trends, die seit der globalen Finanzkrise bestanden, glauben wir, dass die Geldpolitik künftig weniger entgegenkommend sein dürfte, was Kreditanalysen und einem schärferen Blick auf die Bedingungen bestimmter Emissionen mehr Bedeutung verleiht. Ein solches Umfeld steigert unseres Erachtens den Wert, den aktive Manager im gesamten festverzinslichen Universum bieten können.

## Global Real Estate Securities – Bericht des Investment-Managers

Für den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 0,16 %. Die Benchmark, der FTSE EPRA/Nareit Developed Real Estate Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der „Index“) verbuchte im gleichen Zeitraum 1,06 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Der globale Aktienmarkt legte im sechsmonatigen Berichtszeitraum kräftig zu.
- Der Markt überwand mehrere Widerstände, darunter anhaltend hohe Inflation und fortgesetzte Zinserhöhungen seitens der Zentralbanken, Sorgen, die Weltwirtschaft könnte in eine Rezession abgleiten, kontroverse Verhandlungen um die Schuldenobergrenze, Turbulenzen in der Bankenbranche und verschiedene geopolitische Entwicklungen.
- Die Anleger waren generell positiv gestimmt, da sich die Weltwirtschaft robust zeigte und mehrere der Unsicherheitsfaktoren, die auf dem Markt lasteten, ausgeräumt werden konnten.
- Alles in allem brachte der MSCI All Country World Index im sechsmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 13,93 %. Der FTSE EPRA/Nareit Developed Real Estate Index verbuchte dagegen 1,06 %. Immobilienwertpapiere wurden durch steigende Zinsen beeinträchtigt.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf seine Wertentwicklung auswirkten.

- Positivbeiträge zur relativen Gesamrendite:
  - Die Einzeltitelauswahl im Sektor Immobilien-Holdings und Bauträger.
  - Die Einzeltitelauswahl im Sektor Büroraum.
  - Untergewichtungen in Schweden und Japan.
- Negativbeiträge zur relativen Gesamrendite:
  - Die Einzeltitelauswahl im Sektor Industrie.
  - Die Einzeltitelauswahl im Sektor Einzelhandel.
  - Die Untergewichtung in den USA und eine Übergewichtung im Vereinigten Königreich.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Der Sektorpositionierung des Portfolios liegt überwiegend die Bottom-up-Einzeltitel zugrunde. Am Ende des Berichtszeitraums bestand die größte Übergewichtung im Verhältnis zur Benchmark in Infrastruktur-REITS. Die im Portfolio gegenüber dem Index am stärksten untergewichteten Sektoren waren Büroraum und diversifizierte Immobilien.
- Nach Ländern bestanden die größten Übergewichtungen im Vereinigten Königreich und in Spanien, die größten Untergewichtungen in den USA und in Schweden.

Die Pleiten von Regionalbanken schürten die Sorge, dass in den USA die Fähigkeit der Regionalbanken leiden dürfte, Kredite an den Immobiliensektor zu vergeben. Außerdem sorgten jüngste Ausfälle bei Kreditnehmern aus dem Büroraumsektor für eine insgesamt eher schlechte Stimmung in Bezug auf den US-Gewerbeimmobiliensektor. Erhöhte Kapitalkosten gepaart mit fundamentaler Abschwächung dürften sich für REITs negativ auf die Gesamtnachfrage und das Gewinnwachstum auswirken. Der Effekt auf den Markt für börsennotierte REITs dürfte nicht besonders ausgeprägt sein, da REITs überwiegend in hochwertige Vermögenswerte investiert sind, solide Bilanzen aufweisen und in aller Regel mit größeren Banken zusammenarbeiten. Während sich die Marktmieten im Vereinigten Königreich und in Kontinentaleuropa generell gut entwickelten, sollte der Mangel an Immobilientransaktionen die unvermeidliche Wertanpassung europäischer Immobilien nach unten lediglich verzögern. In Asien litt die Wertentwicklung in diesem Quartal unter Hongkong und Singapur. Diese beiden Märkte gaben unter anderem deshalb nach, weil die US-Zinsen noch längere Zeit höher bleiben würden und die Konjunktur in China nachließ. Der makroökonomische Hintergrund könnte die Aktien unseres Erachtens zwar weiterhin belasten, doch wir fokussieren uns nach wie vor auf ausgewählte Unternehmen mit besseren Fundamentaldaten, vielfältigen Nachfragetreibern und soliden Bilanzen, die unserer Ansicht nach stärkere Marktvolatilität verkraften können.

## Global Sustainable Equity – Bericht des Investment-Managers

Für den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 15,29 %. Der als Benchmark dienende MSCI World Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der „Index“) verzeichnete im selben Zeitraum 15,09 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse.

- Insgesamt lagen der risikoscheuen Marktstimmung durchwachsene Konjunkturdaten, hohe Zinsen, erhöhte Inflation sowie eine nach wie vor restriktive Zentralbankpolitik zugrunde.
- Die Renditen fielen weltweit in allen größeren Volkswirtschaften höher aus. Die Verzinsung 10-jähriger US-Staatsanleihen kletterte auf 3,85%.
- Die Europäische Zentralbank („EZB“) hob die Zinsen um 0,25 % an, sodass der Satz für Hauptrefinanzierungsgeschäfte auf 4 % stieg: das höchste Niveau seit der Finanzkrise von 2008.
- In China fiel die Inflation im Jahresvergleich moderat aus. Die wiederöffnungsbedingte Konjunkturdynamik scheint aber nachzulassen.
- Im Berichtszeitraum lieferten Large-Caps aus den USA die stärkste Wertentwicklung, gefolgt von Aktien aus anderen Industrieländern und aus Schwellenländern.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf seine Wertentwicklung auswirkten.

- Positivbeiträge zur relativen Gesamrendite:
  - Die Einzeltitelauswahl in den Sektoren Finanzen und Kommunikationsdienste steigerte die Wertentwicklung spürbar, da sich Positionen in diesen Sektoren dank ihrer robusten Geschäftsmodelle im Kontext einer Konjunkturabschwächung besser entwickelten als ihre Vergleichsgruppe. Der Verzicht auf klassische Banken und Versicherungen im Finanzsektor kam der Wertentwicklung besonders zugute, da diese Segmente zunehmend unter Druck standen, weil die Zentralbanken die geldpolitischen Zügel anzogen.
- Negativbeiträge zur relativen Gesamrendite:
  - Die Einzeltitelauswahl bei Nicht-Basiskonsumwerten und Basiskonsumwerten belastete die Wertentwicklung, da die Konsumausgaben zurückgingen, als nachgebende makroökonomische Indikatoren für einen eingetrübten Ausblick sprachen.
  - Positionen in Life-Science-Tools im Sektor Gesundheitswesen spürten Gegenwind durch Überbestände nach COVID.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Im Berichtszeitraum begründeten wir eine neue Position in der Wertschöpfungskette „Digitale Unternehmen“. Das Unternehmen ist einer der beiden Marktführer in der Electronic Design Automation an der Schnittstelle zweier von uns bevorzugter Segmente in der Wertschöpfungskette „Digitale Unternehmen“: Halbleiter und Software.
- Das Portfolio musste entsprechend einer Neugewichtung seines Index neu ausgerichtet werden. Dabei mussten wir uns auf die Umstufung von Zahlungsdienstleistern aus dem Informationstechnologiesektor in den Finanzsektor einstellen.

Unsere Analysten rechnen mit stärkerem konjunkturellem Gegenwind, da sich die restriktiveren geldpolitischen Rahmenbedingungen allmählich bemerkbar machen. Nachgebende Immobilienpreise stellen ein potenzielles Risiko dar. Wir halten an unserer Einschätzung fest, dass sich stabile, hochwertige Aktien weiter besser entwickeln dürften als riskantere Papiere. Angesichts des schwierigen Markthintergrunds hängt der Erfolg der meisten Qualitätsunternehmen in unseren Augen mehr und mehr von der Entwicklung immateriellen Kapitals ab – innovative Technologie, Forschung & Entwicklung, Humankapital und Marken- oder Plattformreputation –, um eine dauerhafte Wettbewerbsposition zu schaffen. Diese dauerhafte Wettbewerbsposition kann durch eine gute Corporate Citizenship gestärkt werden, indem ESG-Praktiken (Umwelt, Soziales und Governance) sorgfältig gemanagt werden. Wir denken, dass eine vorausschauende Analyse dieser Kombination aus Qualitätsmerkmalen, ESG-Faktoren und idiosynkratischen Merkmalen der Schlüssel zur Identifizierung der „Transition Winners“ der neuen Wirtschaft ist.

## High Yield Bond – Bericht des Investment-Managers

Für den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 betrug die Gesamttrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 4,00 %. Der als Benchmark dienende ICE BofA US High Yield Constrained Index (Total Return, USD) (der „Index“) verbuchte im selben Zeitraum 5,42 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamttrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Der Markt für Hochzinsanleihen beschloss den Berichtszeitraum mit soliden Renditen, die vor allem darauf beruhten, dass die Wirtschaftsdaten robuster ausfielen als erwartet, aber auch auf den Erträgen der meisten Emittenten. Das galt ungeachtet der Volatilitätsschübe, die von Sorgen um höhere Inflation ausgelöst wurden, der restriktiveren Zentralbankpolitik, der Minibankenkrise und des zunehmenden Rezessionsrisikos im ersten Halbjahr.
- Im laufenden Jahr schnitten Titel aus der Bonitätskategorie „CCC und darunter“ des ICE BofA US High Yield Constrained Index (mit plus 5,42 %) mit 9,80 % deutlich besser ab als der Gesamtindex, während die Segmente mit BB- und B-Rating lediglich 4,17 % bzw. 5,72 % abwarfen. Die notleidenden Emittenten im Index rentierten 10,98 %, was mehr als dem Doppelten des Indexertrags für das nicht notleidende Segment von 4,86 % entsprach.
- Die Ausfallquoten sind zwar von den im letzten Jahr erreichten Tiefs angestiegen, doch wir rechnen für 2023 und 2024 weiterhin mit einer Spanne, die unter oder bei dem langfristigen Durchschnitt liegt. Dieser Ausblick stützt sich auf unsere Bottom-up-Beurteilung von Emittenten und wird getragen von dem qualitativ höherwertigen Ratingsmix im Hochzinssegment (49 % der Emittenten mit Kreditratings von BB), von weniger aggressiven Neuemissionen, weniger kurzfristigen Fälligkeiten sowie einem Energiesektor, der deutlich solider ist als in den letzten Zyklen.
- Im Hochzinsbereich halten sich die Emittenten aus fundamentaler Sicht bei freiem Cashflow, Zinsdeckung und Verschuldung bisher in einer einigermaßen günstigen Bandbreite.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf seine Wertentwicklung auswirkten.

- Positivbeiträge zur relativen Gesamttrendite:
  - Die Einzeltitelauswahl unter Titeln mit B-Rating, eine Übergewichtung von Titeln ohne Rating gegenüber dem Index, eine Untergewichtung in Titeln mit BB-Rating und die Einzeltitelauswahl bei Emittenten mit einem Rating von BBB und besser.
  - Eine Untergewichtung und die Einzeltitelauswahl im Sektor Medien, Rundfunk und Fernsehen, die Einzeltitelauswahl im Sektor diversifizierte Finanzdienstleistungen sowie dessen Übergewichtung und die Einzeltitelauswahl im Sektor Autos und Autoteile.
- Negativbeiträge zur relativen Gesamttrendite:
  - Die Einzeltitelauswahl unter Titeln mit einem Rating von CCC und darunter, ohne Rating und mit einem Rating von BB sowie eine Übergewichtung von Wertpapieren mit einem Rating von BBB und darüber gegenüber dem Index.
  - Die Einzeltitelauswahl in den Sektoren Telekommunikation sowie Technologie und Elektronik und die Einzeltitelauswahl im Sektor Großmärkte sowie dessen Untergewichtung gegenüber dem Index.
  - Das Portfolio war im Beta von Unternehmensanleihen moderat untergewichtet, was den Ertrag im Verhältnis zum Index minderte, da sich die Spreads verengten und riskantere Papiere im Berichtszeitraum ungleich besser abschnitten.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Die Allokation des Portfolios in Anleihen betrug am Ende des Berichtszeitraums 88,1 %, des Nettovermögens, die Allokation in variabel verzinsliche Anleihen 5,0 % des Nettovermögens.
- Veränderungen des Kreditrating-Engagements ergaben sich in erster Linie aus Entscheidungen für Einzeltitel, aber auch im Kontext der weiteren Entwicklung des Kreditzyklus und des gesamtwirtschaftlichen Ausblicks. Im Berichtszeitraum wurde das Engagement des Portfolios in Wertpapiere mit BB-, B- und BBB-Rating ausgebaut, das Engagement in Wertpapieren mit CCC-Rating und darunter zurückgefahren.

Unsere Analysten konzentrieren sich weiterhin auf die spezifischen Fundamentaldaten der Anleihen einzelner Emittenten und bewerten die Basis- und Abwärtsszenarien im Falle einer weichen Landung oder einer Rezession. Die relativ soliden Verbraucher- und Unternehmensbilanzen sowie ein wachsendes nominales BIP dürften die Fundamentaldaten der Emittenten unserer Ansicht nach weiterhin unterstützen. Zwar können die eingehenden makroökonomischen Daten und die Dynamik des gesamten Kreditzyklus im Tagesgeschäft Auswirkungen auf den Kreditmarkt zeigen, doch wir bleiben stark auf branchenspezifische Trends und idiosynkratische Risiken für Einzelemittenten fokussiert.

Trotz potenzieller kurzfristiger Volatilität, die sich aus der erhöhten Unsicherheit in Bezug auf das Wirtschaftswachstum ergibt, sind wir der Meinung, dass wir mit unserem fundamentalen Bottom-up-Kreditresearch – mit Konzentration auf die Auswahl von Wertpapieren, die Vermeidung von Bonitätsherabstufungen und die ausschließliche Aufnahme der „besten Ideen“ in die Portfolios – gut aufgestellt sind, um von eventueller Volatilität zu profitieren.

## InnovAsia 5G – Bericht des Investment-Managers

Für den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 20,93 %. Der als Benchmark dienende MSCI All-Country World Index (ACWI) (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der „Index“) verbuchte im selben Zeitraum ein Plus von 13,93 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Angesichts der Sorgen um das Wirtschaftswachstum, des Aufschwungs in China, der langsamer vorstatten ging als erwartet, einer Regionalbankenkrise in den USA und anhaltender geopolitischer Spannungen waren die Märkte volatil.
- Das langsamere Zinserhöhungstempo der US-Notenbank Federal Reserve Board führte zu einer allgemeinen Outperformance von Tech- und Growth-Werten.
- Die überschwängliche Stimmung in Bezug auf künstliche Intelligenz („KI“) löste eine Rally damit verbundener Engagements aus, was KI-Wegbereitern innerhalb der asiatischen Tech-Lieferkette zugutekam.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf seine Wertentwicklung auswirkten.

- Positivbeiträge zur relativen Gesamrendite:
  - Die Einzeltitelauswahl und eine Übergewichtung in Japan und Taiwan im Vergleich zum Index.
  - Die Einzeltitelauswahl und eine Übergewichtung in den Sektoren Halbleiter und elektronische Geräte im Vergleich zum Index.
  - KI-Gewinner unter besonders leistungsstarken Halbleiter-Wegbereitern, Spezialisten für Hochgeschwindigkeitsnetze und Software.
- Negativbeiträge zur relativen Gesamrendite:
  - Die im Vergleich zum Index übergewichtete Position in China, die dadurch belastet wurde, dass die makroökonomische Erholung langsamer vorstatten ging als erwartet und die Anreize begrenzt blieben.
  - Die Einzeltitelauswahl und eine im Vergleich zum Index übergewichtete Position in Südostasien, da manche Unternehmen auf kürzere Sicht zyklischen Gegenwind spüren.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Weiterer Fokus auf führenden Halbleiter- und Geräteanbietern angesichts strategischer Investitionen von Staaten und Unternehmen, des Onshoring von Lieferketten und der strukturellen Trends in der KI.
- Der solide Ausblick in Teilbereichen der Industrie veranlasste uns zu verstärktem Engagement in Wegbereitern der Industrieautomation und Unternehmen, die hochentwickelte Halbleiterproduktionsausrüstung sowie Lösungen für das Energiemanagement anbieten.
- Verstärktes Engagement in innovativen Software-/Internetunternehmen, die den digitalen Wandel vorantreiben.
- Skepsis in Bezug auf die Auswirkungen geopolitischer Spannungen und verringertes Engagement in sensibleren Bereichen.
- Vermindertes Engagement in China und in Unternehmen mit schwächerem Wachstumsausblick.

Das Tempo der Zinserhöhungen verlangsamte sich zwar, doch die Zinsen dürften noch länger hoch gehalten werden und die makroökonomische Unsicherheit könnte anhalten. Wir setzen daher weiterhin auf Qualität, sind aber durchaus bereit, taktische Gelegenheiten zu nutzen und uns für zyklisches Wachstum zu positionieren. Wir sind in Bezug auf die Wachstumschancen in Asien optimistisch, vor allem bei modernsten Halbleitern, durch strukturelles Wachstum in KI, robuste Investitionsausgaben bei 5G und Datenzentren sowie die starke Zunahme Lifestyle-bezogener digitaler Inhalte. Asien ist eine dynamische Region mit zunehmend digitalisierten Volkswirtschaften und führend im Frühstadium innovativer 5G-Anwendungen. Wir fokussieren uns weiter auf führende Anbieter und sind bereit, aus Marktverzerrungen Kapital zu schlagen, um ein hochwertiges Engagement aufzubauen, wo wir immer positivere Aussichten erkennen und unsere Investmentthese bestätigt finden.



## Japan Equity Engagement – Bericht des Investment-Managers

Für den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse JPY I 15,17 %. Der MSCI Japan Small Cap Index (Net) (Total Return, JPY) (der „Index“) verzeichnete im selben Zeitraum ein Plus von 15,36 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividenderträgen und sonstigen Ausschüttungen.

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Japanische Small-Caps entwickelten sich positiv. Das war einer Kombination aus robuster Binnenwirtschaft, lockerer Geldpolitik und steigenden Erwartungen der Anleger an japanische Unternehmen zu verdanken, ihre Kapitaleffizienz auf der Grundlage neuer aufsichtsrechtlicher Reformen zu steigern.
- Die Risikobereitschaft kam japanischen Aktien im Berichtszeitraum zugute, da die US-Notenbank Federal Reserve Board („Fed“) signalisierte, dass sie sich dem Ende ihres Straffungszyklus nähere.
- Der Markt verzeichnete im März nach dem Zusammenbruch mehrerer Finanzinstitute in den USA und Europa zeitweilig eine Korrektur, der Fallout für Japan hielt sich jedoch in relativ engen Grenzen.
- Die japanische Wirtschaft wartete weiter mit positiven Überraschungen auf, da das BIP für das zweite Quartal auf der Grundlage robuster inländischer Ausgaben durch steigende Nachfrage von Touristen und erste Anzeichen für Lohnsteigerungen nach oben korrigiert wurde. Vor diesem Hintergrund signalisierte die Bank of Japan („BOJ“) unter ihrem neu ernannten Chef Kazuo Ueda, dass sie an ihrer lockeren Geldpolitik festhalten werde, bis sie darauf vertrauen könne, dass die Verbraucherpreise ein Trendwachstum von über 2 % aufrechterhalten können.
- Der japanische Yen wertete gegenüber maßgeblichen Währungen ab, weil erwartet wurde, dass das Zinsgefälle zwischen Japan und anderen Volkswirtschaften auf absehbare Zeit erhöht bleiben würde.
- Japanische Unternehmen kündigten für den Monat Mai rekordhohe Aktienrückkäufe an, nachdem die Vorgaben der Tokyo Stock Exchange („TSE“) an über 3.000 Unternehmen den Druck auf die Managementteams verstärkten, Pläne zur nachhaltigen Erhöhung der Kapitalrendite über die Kapitalkosten vorzulegen. Die Aussichten auf höhere Erträge für die Aktionäre steigerten im Zeitraum von April bis Juni das Kaufinteresse ausländischer Investoren an japanischen Aktien. Infolgedessen entwickelten sich kleinere japanische Unternehmen im Berichtszeitraum positiv und größere Unternehmen verzeichneten höhere Renditen, denen Anlegerströme in passive Indizes sowie Erwartungen zugrunde lagen, dass die schwache Währung den Erträgen exportabhängiger Large-Caps Auftrieb geben würde.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf seine Wertentwicklung auswirkten.

- Positivbeiträge zur relativen Gesamtrendite:
  - Das Portfolio blieb nach Abzug von Gebühren und Kosten hinter der Benchmark zurück. Kernpositionen in Immobilien- und Basiskonsumgüterwerten verbuchten positive Erträge, während die traditionelle Untergewichtung unseres Fonds in diesen Sektoren die Wertentwicklung ebenfalls steigerte.
- Negativbeiträge zur relativen Gesamtrendite:
  - Investments in den Sektoren Nicht-Basiskonsumgüter und Industrie schädeten der Wertentwicklung, und unser übergewichtetes Engagement in Finanzwerten belastete den Ertrag ebenfalls.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Der Fonds investierte weiter in kleine bis mittelgroße japanische Unternehmen mit starken Fundamentaldaten, soliden Wachstumsaussichten zu angemessenen Bewertungen und dem Potenzial, durch Mitwirkung Wert zu erschließen.
- Am stärksten übergewichtet war der Fonds in den Sektoren Finanzen und Kommunikationsdiensten, am stärksten untergewichtet in den Sektoren Werkstoffe und Basiskonsumgüter. Das Sektorengagement ergibt sich aus dem fundamental orientierten Bottom-up-Anlageverfahren des Teams.
- Im Finanzsektor halten wir traditionell diversifizierte Finanzwerte mit Beteiligung an Sparten wie Garantien für Hypothekendarlehen und personalisierte Versicherungen. In den letzten Monaten beurteilten wir bestimmte Regionalbanken aber konstruktiver, weil sich die Geldpolitik verändert und Aussichten auf mehr Kapitaleffizienz bestehen. Unser Engagement in Kommunikationsdiensten bestand in technologisch starken Telekommunikations- und Content-Publishing-Unternehmen mit hohem Marktanteil.
- Im Werkstoffsektor beobachteten wir größere Konkurrenz zu jungen asiatischen Unternehmen, die bei den Kosten wettbewerbsfähig sind, was für viele Unternehmen in diesem Sektor problematisch ist. Daher investierten wir gezielt in Unternehmen mit hohem globalem Marktanteil an der Wertschöpfungskette des Halbleitersegments, die durch einen größeren technologischen Vorsprung geschützt sind. Wir beobachteten zwar aufkeimende Preisinflation, sehen Basiskonsumwerte aber weiter skeptisch, weil wir den Standpunkt vertreten, dass viele Unternehmen aus diesem Sektor aus mangelnder Preismacht mit Herausforderungen konfrontiert sind, wenn sie Inputkosten durchreichen wollen.
- Im Rahmen der Mitwirkung nahm unser Team an über 300 Meetings teil, die zur Hälfte unter Beteiligung von Vertretern der Geschäftsführungsebene einschließlich Topmanagern und externer Mitglieder des Verwaltungsrats stattfanden. Im Berichtszeitraum stand das Kapitalmanagement ganz oben auf der Agenda. Zentrale Gesprächsthemen waren Bilanzeffizienz und Unternehmensportfolio.

## Japan Equity Engagement – Bericht des Investment-Managers (Fortsetzung)

Mittelfristig halten wir kleine bis mittelgroße japanische Unternehmen („KMU“) für gut aufgestellt, um die nächste Etappe der Aktienmarkt-Rally in Japan anzutreiben. Erstens sehen wir in diesem Marktsegment viele unterbewertete und vom Research vernachlässigte hochwertige Unternehmen mit attraktivem Wachstumspotenzial. Außerdem dürften die Aussichten auf eine Neubewertung aufgrund verbesserter Kapitaleffizienz für KMU nach unserem Dafürhalten besser sein als für Large-Caps, da bei KMU das Verhältnis von Nettoliquidität zu Eigenkapital höher und das Kurs-Buchwert-Verhältnis<sup>1</sup> niedriger ist. Das lässt vermuten, dass KMU möglicherweise die nächste Aktienrückkaufswelle anführen werden. Zweitens erkennen wir starke Parallelen zwischen der Marktlage heute und in den 2010er-Jahren, als der einem Attentat erlegene Premierminister Shinzo Abe seine Reformen in Angriff nahm, was bei Large-Caps Käufer aus dem Ausland auf den Plan rief. Im Anschluss beobachteten wir allerdings, wie Small- und Mid-Caps bis 2018<sup>2</sup> über vier Jahre in Folge besser abschnitten als größere Akteure, weil globale Investoren allmählich in den tiefen KMU-Markt umschichteten. Unserer Ansicht nach könnte der KMU-Markt auf ein ähnliches Szenario zusteuern und von der letzten Runde aufsichtsrechtlicher Reformen weiteren Rückenwind erhalten. Diese Reformen sind darauf ausgelegt, die Kapitalrenditen in Japan nachhaltig über die Kapitalkosten zu treiben.

<sup>1</sup> Daten von Bloomberg zum Stand von Juni 2023. Nettoverschuldung / Eigenkapital (letztes Geschäftsjahr) und Kurs-Buchwert-Verhältnis (aktuell). KMU = MSCI Japan Small Cap Net Total Return Index (JPY). Large-Caps = Topix 500 (JPY).

<sup>2</sup> Daten von Bloomberg zum Stand von Mai 2023. Relative Rendite des MSCI Japan Small Cap Net Total Return (JPY) im Vergleich zum Topix 500, zum Nikkei 225 und zu Topix-Indizes (JPY).

## Macro Opportunities FX – Berichts des Investment-Managers

Für den sechsmontigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse EUR I 0,87 %. Der als Benchmark dienende ICE BofA 0-1 Year AAA Euro Government Index (Total Return, EUR) (der „Index“) verzeichnete im selben Zeitraum 0,79 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Die ertragsstärksten unter den maßgeblichen Währungen waren im ersten Halbjahr das britische Pfund und der Schweizer Franken, die schwächsten der japanische Yen und die norwegische Krone.
- Die Wirtschaftsdaten tendierten im Berichtszeitraum absolut betrachtet aufwärts, schnitten aber schlechter ab als erwartet. Die Renditen legten weltweit weiter zu. Die Renditen für 2-jährige US-Anleihen beschlossen den Berichtszeitraum bei beinahe 5 %, nachdem zwischenzeitlich Volatilität herrschte.
- Die Währungsmärkte korrelieren seit Anfang des Jahres stark mit dem Gefälle bei kurzfristigen Zinssätzen.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf seine Wertentwicklung auswirkten.

- Positivbeiträge zur relativen Gesamrendite:
  - Das Portfolio erzielte im Berichtszeitraum positive Erträge.
  - Eine Untergewichtung in der schwedischen Krone und eine Übergewichtung im australischen Dollar leisteten die größten Positivbeiträge zur Wertentwicklung.
- Negativbeiträge zur relativen Gesamrendite:
  - Eine Untergewichtung im Schweizer Franken und im britischen Pfund minderte die Wertentwicklung.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Die Strategie verfolge im Berichtszeitraum einen eher taktischen Handelsstil, da die innerwöchentliche und innermonatliche Volatilität Handelschancen eröffnete, während die meisten maßgeblichen Währungen auf längere Sicht wenig Bewegung in eine bestimmte Richtung zeigten.
- Die Währungen richteten sich nach kürzerfristigen Faktoren. Zu längerfristigen Faktoren bestanden dagegen schwächere Zusammenhänge.

Mit Blick auf die Sommermonate, in denen die Marktliquidität häufig geringer ist und die Zentralbanken ihre Bilanzen weiter verkürzen könnten, falls sich die Finanzbedingungen noch verschärfen, könnten wir Phasen erleben, in denen Risikoaversion einsetzt, weil die Konjunktursorgen zunehmen. Die Konjunkturdaten für Europa zeigen weiter Anzeichen für Schwäche. Solange die geldpolitische Haltung der Europäischen Zentralbank („EZB“) aber eher restriktiv bleibt, sollte der Euro Rückhalt finden. Mit Blick auf die zweite Jahreshälfte wird das Augenmerk weltweit stark auf den Arbeitsmärkten liegen – und auf Signalen dafür, dass die deutliche Straffung der Geldpolitik allmählich auf die Konjunktur durchschlägt. Bislang gibt es wenig Hinweise darauf, dass sich die straffere Politik in Schwäche auf dem Arbeitsmarkt übersetzt, was die EZB in ihrer restriktiven Haltung bestärkte.

## Multi-Asset Income – Bericht des Investment-Managers

Für den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 betrug die Gesamttrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 2,67 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamttrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

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

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf seine Wertentwicklung auswirkten.

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

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Portfolio blieb breit gestreut über auf hohe laufende Erträge ausgerichtete Strategien, festverzinsliche Wertpapiere, hohe laufende Erträge abwerbende und alternative Aktien, Optionserträge und unkorrelierte Strategien.
- Im Berichtszeitraum wurde das Portfolio durch die Rückführung des Engagements in Staatsanleihen und REITs und den Ausbau der EM-Aktienstrategie neu gewichtet.
- Gemäß der am 6. Juni 2023 herausgegebenen Mitteilung an die Anteilhaber begann das Portfoliomanagementteam am 20. Juni 2023 damit, im Vorfeld der Schließung des Portfolios am 7. Juli Positionen zu veräußern.

Angesichts durchwachsender Wirtschaftsdaten, hartnäckiger Kerninflation und restriktiverer Kreditbedingungen bleiben unsere Einschätzungen zu den weltwirtschaftlichen Gegebenheiten im Fluss. Wir sehen nach wie vor Potenzial für eine mögliche Konjunkturabschwächung über einen Zeitraum von 12 bis 24 Monaten. Die Risiken einer globalen Rezession sind auf kürzere Sicht allerdings zurückgegangen. Wir gehen davon aus, dass sich die Leitzinsen der Zentralbanken weltweit ihren Höchstständen nähern, doch sie könnten durchaus auf höherem Niveau bleiben, bis eindeutige Belege dafür vorliegen, dass sich der Preisdruck in Richtung der Zielwerte abschwächen kann. Infolgedessen favorisieren wir auf den Rentenmärkten weiter Engagements in hohe Qualität und kürzere Duration sowie eine Barposition. Angesichts eines robusteren kurzfristigen Wirtschaftswachstums und einer potenziell weiterhin positiven Dynamik nehmen wir zu Aktien auf kurze Sicht eine neutralere Haltung ein.

## Next Generation Mobility – Bericht des Investment-Managers

Für den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 23,17 %. Der MSCI All-Country World Index (ACWI) (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der „Index“) rentierte im selben Zeitraum 13,93 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Die Aktienmarktrenditen fielen im ersten Halbjahr 2023 nach einem schwierigen Vorjahr auf breiter Front positiv aus. Dieser Entwicklung lagen nachlassende Inflation und allgemein rückläufige Rezessionsängste zugrunde, was vor allem gegen Ende des Berichtszeitraums festzustellen war. Dieser Hintergrund stützte die Bewertungskennzahlen – und zwar insbesondere für Growth-Aktien.
- Daher schnitten wachstumsorientierte Aktien im Berichtszeitraum deutlich besser ab als Value-Titel. Mega-Caps aus den Sektoren Kommunikationsdienste und Informationstechnologie entwickelten sich generell besser. Deren Wertentwicklung wurde durch den wachsenden Hype um KI nach der Gewinnmeldung von NVIDIA beflügelt.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf seine Wertentwicklung auswirkten.

- Im Berichtszeitraum schnitt das Portfolio um 924 Bp besser ab als der Index.
- Positivbeiträge zur Gesamtrendite:
  - Den größten Beitrag zur relativen Wertentwicklung leistete das Engagement im Informationstechnologiesektor, unterstützt durch die Überrenditen wachstumsorientierter Aktien im ersten Halbjahr.
  - Aus Einzeltitelperspektive trugen NVIDIA, Rambus und Tesla im Berichtszeitraum am meisten zur absoluten Wertentwicklung bei.
- Negativbeiträge zur Gesamtrendite:
  - Die größten relativen Wertabzüge entfielen auf das Engagement im Sektor Kommunikationsdienste, was unter anderem einer untergewichteten Position in thematisch weniger relevanten Mega-Caps geschuldet war.
  - Aus Einzeltitelperspektive waren im ersten Halbjahr JD.com, StarPower Semiconductor und Deere für die größten absoluten Wertabzüge von der Performance verantwortlich.
- Der Index entspricht zwar dem globalen Charakter des Portfolios, deckt aber ein breiteres Spektrum ab als das Anlageuniversum des Portfolios und eignet sich daher nur bedingt als Vergleichsgröße für die Wertentwicklung. Sektoren mit wenig oder keiner thematischen Relevanz wie Basiskonsumgüter, Energie, Gesundheitswesen und Versorger entwickelten sich im ersten Halbjahr 2023 unterdurchschnittlich und beeinflussten die relative Performance im Berichtszeitraum positiv.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Portfolio wurde im Berichtszeitraum um drei neue Positionen aufgestockt, nämlich Albemarle, LG Energy Solution und BYD.
  - Albemarle ist ein führender globaler Lithiumproduzent mit kostengünstigen Betriebsstätten in wichtigen Regionen wie Chile und Australien. Die Batterien von Elektrofahrzeugen (Electric Vehicles, „EVs“) sind stark auf Lithium angewiesen, das unserer Erwartung nach für absehbare Zeit das Rückgrat der EV-Batteriechemie bilden dürfte. Die Lithium-Preise korrigierten dieses Jahr, als die EV-Nachfrage in China zurückging. Wir rechnen für die kommenden Jahre aber letztlich damit, dass Elektrofahrzeuge weltweit viel stärker nachgefragt werden.
  - LG Energy Solution gehört zu den größten Batterieherstellern der Welt und ist maßgeblicher Nutznießer und Wegbereiter der Verbreitung von EVs. Batterien sind ein beschränkender Faktor für Wachstum bei EVs. Autohersteller arbeiten aggressiv am Ausbau ihrer EV-Produktportfolios und der damit verbundenen Kapazitäten zur Fahrzeugmontage, was für LG hohe Zuwächse bei Batterien sowie steigende Gewinnmargen bedeutet.
  - BYD ist der führende Hersteller von Fahrzeugen mit alternativer Antriebstechnik (New Energy Vehicles, „NEVs“) in China. Als einer der wenigen Massenproduzenten auf dem chinesischen Markt verfügt BYD im NEV-Segment als Marktführer über einen Marktanteil von rund 30 %. Das Unternehmen zählt außerdem zu den großen Produzenten von Batterien für NEVs und von stationären Speichersystemen.
- Eine Position, die aus dem Portfolio herausgenommen wurde, war Coherent (COHR). COHR wurde nach jüngster Stärke im Zusammenhang mit einer potenziellen Umstrukturierung der Siliziumkarbidsparte des Unternehmens abgestoßen. COHR bleibt durch ein hohes Verschuldungsniveau belastet. Wir sehen anderswo interessantere Anlagechancen.

Wir gehen davon aus, dass der gesamtwirtschaftliche Hintergrund im Fluss bleiben dürfte, da die Zentralbanken in ihrem Kampf gegen die Inflation auf eingehende Daten reagieren. Unseres Erachtens dürfte der verzögerte Effekt einer restriktiveren Geldpolitik in nachlassendem Wirtschaftswachstum resultieren. Langsamer steigende Inflationswerte in maßgeblichen Regionen wie den Vereinigten Staaten deuten darauf hin, dass die Zentralbanken generell näher auf das Ende ihrer jeweiligen Zinserhöhungszyklen zusteuern, was zuversichtlich stimmt. Außerdem gehen wir davon aus, dass die Aktienmärkte künftig mit der jüngsten Wertentwicklung von Mega-Caps zurande kommen müssen, die in diesem Jahr erheblich zum Marktertrag beigetragen haben. Trotz wirtschaftlicher Gegenströmungen sind die tragenden Säulen des Themas „Next Generation Mobility“ (Mobilität für die nächste Generation) absolut intakt. Wir rechnen für das zweite Halbjahr 2023 mit weiteren Zuwächsen bei der Markterschließung und solidem Wachstum sowohl bei autonomen als auch bei strombetriebenen Fahrzeugen. Dem liegt neben anderen Faktoren auch die politische Förderung auf regionaler Ebene zugrunde. Wir behalten unseren Fokus auf Anlagen in hochwertige, fundamental attraktive Unternehmen bei, die wichtige Wegbereiter und Nutznießer dieses langfristigen Themas sind.

## Next Generation Space Economy – Berichts des Investment-Managers

Für den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 17,69 %. Der als Benchmark dienende MSCI All-Country World Index (ACWI) (Total Return, abzüglich Steuern, USD) verbuchte im selben Zeitraum ein Plus von 13,93 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Insgesamt zeigten sich die globalen Aktienmärkte weiter ausgesprochen robust, obwohl im Berichtszeitraum Unsicherheit herrschte durch den fortgesetzten Konflikt zwischen Russland und der Ukraine, die Pleiten mehrerer US-Regionalbanken, die hartnäckig hohe Inflation im Zusammenspiel mit den Auswirkungen rasch anziehender Zinsen und schwächerer makroökonomischer Daten, etc.
- Die Markt-Performance wurde überwiegend von der Gewichtung und Wertentwicklung weniger Mega-Cap-Tech-Unternehmen wie AAPL, GOOG, MSFT, AMZN, META, TSLA und NVDA beeinträchtigt. Für die Wertentwicklung in den USA hätte sich beispielsweise unter Ausschluss dieser Wertpapiere eine S&P-Rendite von 6 % ergeben gegenüber einer im Berichtszeitraum ausgewiesenen Rendite von 16,6 %.
- Wir beobachten daher, wie sich die mangelnde Marktbreite in erhöhte Volatilität übersetzt, was im laufenden Jahr bisher zu sechs Bewegungen um +/- 5 % im MSCI All Country World Index geführt hat.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf seine Wertentwicklung auswirkten.

- Positivbeiträge zur relativen Gesamtrendite:
  - Eine strukturelle Untergewichtung thematisch weniger relevanter Sektoren (z. B. Gesundheitswesen, Finanzen), die im Berichtszeitraum einen Rückstand verzeichneten.
  - Die starke Einzeltitelauswahl im Industriesektor.
- Negativbeiträge zur relativen Gesamtrendite:
  - Die Einzeltitelauswahl und die Untergewichtung im Sektor Kommunikationsdienste.
  - Der leichte „Cash-Drag“ durch die opportunistische Verwendung von Kapital nach Zuflüssen aufgrund von Markt-Rallys.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Da wir mit Marktvolatilität rechnen, verfolgte das Portfolio weiterhin einen Handel-Ansatz zwischen wachstumsorientierten und defensiven Positionen. Im Jahresverlauf nutzten wir Verzerrungen als Chance, fundamental und thematisch relevante Positionen einzugehen und hochzuskalieren.
- Eine größere Zahl von Wertpapieren im Portfolio war auf die zunehmenden Multi-Sektor-Anlagegelegenheiten ausgerichtet und trug zur Risikostreuung bei.
- Unser Engagement in Japan bauten wir im Berichtszeitraum aus, beurteilen das thematische Universum regionenübergreifend aber insgesamt zuversichtlich, da das Portfolio aktuell regional ausgewogen aufgestellt ist.

Im Berichtszeitraum verfolgten wir mehrere aufregende Entwicklungen im Zusammenhang mit dem Weltraum-Ökosystem, von mehreren Ankündigungen zu Mobilfunkdiensten über Satellit Anfang des Jahres bis hin zum ersten kommerziellen Suborbitalflug von Virgin Galactic im Juni. Außerdem startete John Deere eine Ausschreibung für Satellitendienste und Deloitte richtete im Beratungsgeschäft eine Weltraumsparte ein. Diese Beispiele unterstreichen eine unserer zentralen Einschätzungen: dass weltraumgestützte Kapazitäten über bisherige weltraumgestützte Branchen hinaus expandieren werden. Trotz des ungewissen makroökonomischen Umfelds weisen Umsatzströme im Zusammenhang mit der Weltraumthematik weiter Wachstum auf, was auf zugrunde liegende Nachfrage, mehr Kapazität und eine Expansion des Endmarkts zurückzuführen ist. Wir fokussieren uns auch weiterhin auf unsere besten fundamentalen Ideen im Zusammenhang mit dem Weltraumthema und halten das Portfolio für gut aufgestellt, um von dem erwarteten Wachstum zu profitieren.

## Short Duration Emerging Market Debt – Bericht des Investment-Managers

Für den sechsmontatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 2,46 %. Der als Benchmark dienende ICE BofA 3-Month US Treasury Bill Index (Total Return, USD) verbuchte im selben Zeitraum 2,25 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Die Marktstimmung wurde generell von Entwicklungen im Zusammenhang mit Inflation und Geldpolitik geprägt. Ein Thema, das unterstützend wirkte, war die Wiederöffnung Chinas. Parallel dazu gingen die Ausfallquoten in Schwellenländern („EM“) zurück.
- Die Renditen auf 2-jährige US-Staatsanleihen weiteten sich um 47 Bp und beschlossen den Berichtszeitraum bei 4,90 %, da die Märkte die Möglichkeit auspreisten, dass die US-Notenbank Federal Reserve Board noch in diesem Jahr die Zinsen senken könnte.
- Die Spreads für EM-Staatsanleihen verengten sich im Schnitt von 452 auf 432 Bp mit einem Höchststand von 510 Bp im März etwa zu der Zeit, als in den USA und Europa die Bankenkrise einsetzte. Auch die Spreads von EM-Unternehmensanleihen verengten sich von 308 auf 300 Bp.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf seine Wertentwicklung auswirkten.

- Positivbeiträge zur relativen Gesamrendite:
  - Positionen in Sri Lanka leisteten den größten Beitrag zum positiven Spread-Ergebnis, da die Anleihen durch Fortschritte im Umschuldungsverfahren gestützt wurden.
  - Aber auch El Salvador, Argentinien, die Ukraine und Côte d'Ivoire zählten zu weiteren maßgeblichen Positionen in Hochzinsstaatsanleihen, die im Quartal einen Wertbeitrag lieferten.
  - Unter den Unternehmensanleihen stammten die größten Positivbeiträge unter anderem von Positionen im indischen Bergbausektor sowie von Finanzwerten aus den VAE und aus Kolumbien.
- Negativbeiträge zur relativen Gesamrendite:
  - Das Engagement in brasilianischen Unternehmensanleihen brachte die größten Wertabzüge, da Anleihen des Düngemittelanbieters Unigel abverkauft wurden, nachdem das Ergebnis die Erwartungen verfehlt hatte.
  - Auch ägyptische Staatsanleihen minderten den Ertrag, da die finanziellen Probleme anhielten.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Portfolio blieb bei einer ausgewogenen Allokation in EM-Unternehmensanleihen und staatlichen/quasistaatlichen Emissionen und einer Duration von knapp 2 Jahren.
- Wir bauten unser Engagement in hochwertigen Emittenten aus Südkorea in allen Sektoren über den Primärmarkt aus. Außerdem stockten wir Positionen in anderen Ländern mit Investment Grade auf, unter anderem in Ungarn, Rumänien und Hongkong.
- Im Hochzinsbereich engagierten wir uns vor allem verstärkt in Unternehmensanleihen mit BB-Rating. In diesem Segment nehmen wir Widerstandskraft gegen weltweit restriktivere Finanzierungsbedingungen wahr, beispielsweise in Serbien, Côte d'Ivoire, Kolumbien und der Dominikanischen Republik.
- Gleichzeitig fuhren wir unser Engagement in brasilianischen Unternehmensanleihen zurück, die wir unter restriktiveren Bedingungen für anfälliger halten, und trennten uns von polnischen Staatsanleihen angesichts engerer Spreads und weil die jüngsten legislativen Veränderungen die Beziehungen zur EU und die Finanzierungsaussichten belasten könnten. Das Engagement in Katar, Aserbaidschan und Malaysia wurde bei Fälligkeit von Anleihen verringert.

Wir rechnen bis Ende des Jahres mit günstigen Rahmenbedingungen für Schwellenländeranleihen aufgrund besserer technischer Voraussetzungen, stabiler Fundamentaldaten und einigermaßen attraktiver Bewertungen, verbunden mit dem Auslaufen der aggressiven Geldpolitik in den USA. Chinas ins Stocken geratener Aufschwung wirft weitere Fragen auf, doch wir halten das Wachstumsziel des Landes von 5 % für erreichbar, selbst wenn nur gezielt und in Maßen stimuliert wird, wie es die jüngste geldpolitische Lockerung signalisiert. Das Wachstum in China sollte sich mäßig und ungleichmäßig, aber per saldo letztlich positiv auf das Schwellenländeruniversum auswirken.

Wir gehen davon aus, dass die Ausfallraten für Staatsanleihen bis 2023 auf einen niedrigen einstelligen Prozentsatz sinken werden, während das zunehmende Engagement des IWF in verschiedenen Schwellenländern den Finanzierungsbedarf und die Reformagenden unterstützen dürfte. Auch bei EM-Hochzins-Unternehmensanleihen erwarten wir für 2023 einen Rückgang der Ausfallquoten von 14,0 % im Vorjahr auf 5,2 %, wobei die meisten Ausfälle chinesische Bauträger und ukrainische Emittenten betreffen dürften. Abgesehen von diesen spezifischen Bereichen erwarten wir, dass die Ausfallquote bei hochverzinslichen EM-Unternehmensanleihen mit 3,3 % weitgehend dem historischen Durchschnitt entsprechen wird, da EM-Unternehmen im Durchschnitt über robuste Bilanzen verfügen.

Wir rechnen mit günstigen technischen Voraussetzungen dank Spread-Momentum, Anlegerpositionierung und geringer Nettoemission. Vor diesem Hintergrund bleiben die Bewertungen von EM-Schuldtiteln mit kurzer Duration in unseren Augen attraktiv und wir erkennen mehr Spielraum für eine weitere Verengung der Spreads, vor allem bei auf harte Währungen lautenden EM-Anleihen ohne Investment Grade.

Die Hauptrisiken für unsere positive Einschätzung sehen wir entweder in einer möglichen globalen Rezession, die die Spreads der Schwellenländer erheblich in die Höhe treiben würde, oder in einer unerwarteten Beschleunigung der Inflationsdynamik weltweit, die deutlich mehr Zinserhöhungen erforderlich machen würde.

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

Für den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 4,07 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Der Markt für Hochzinsanleihen beschloss den Berichtszeitraum mit soliden Renditen, die vor allem darauf beruhten, dass die Wirtschaftsdaten robuster ausfielen als erwartet, aber auch auf den Erträgen der meisten Emittenten. Das galt ungeachtet der Volatilitätsschübe, die von Sorgen um höhere Inflation ausgelöst wurden, der restriktiveren Zentralbankpolitik, der Minibankenkrise und des zunehmenden Rezessionsrisikos im ersten Halbjahr.
- Im bisherigen Jahresverlauf brachte der ICE BofA US High Yield Constrained Index (der „Index“) 5,42 %. Die Indexkategorie mit einem Rating von CCC und darunter lieferte 9,80 % und schnitt damit besser ab als der Index insgesamt. Die Segmente mit BB- und B-Rating warfen 4,17 % bzw. 5,72 % ab. Die notleidenden Emittenten im Index rentierten 10,98 %, was mehr als dem Doppelten des Indexertrags für das nicht notleidende Segment von 4,86 % entsprach. Der ICE BofA 0-5 Year BB-B US High Yield Constrained Index verbuchte im Berichtszeitraum 4,62 %.
- Die Ausfallquoten sind zwar von den im letzten Jahr erreichten Tiefs angestiegen, doch wir rechnen für 2023 und 2024 weiterhin mit einer Spanne, die unter oder bei dem langfristigen Durchschnitt liegt. Dieser Ausblick stützt sich auf unsere Bottom-up-Beurteilung von Emittenten und wird getragen von dem qualitativ höherwertigen Ratingsmix im Hochzinssegment (49 % der Emittenten mit Kreditratings von BB), von weniger aggressiven Neuemissionen, weniger kurzfristigen Fälligkeiten sowie einem Energiesektor, der deutlich solider ist als in den letzten Zyklen.
- Im Hochzinsbereich halten sich die Emittenten aus fundamentaler Sicht bei freiem Cashflow, Zinsdeckung und Verschuldung bisher in einer einigermaßen günstigen Bandbreite.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf seine Wertentwicklung auswirkten.

- Positivbeiträge zur absoluten Gesamtrendite:
  - Die Positionierung in Emittenten mit B-, BB-, CCC- und schlechteren Ratings sowie mit BBB- und besseren Ratings.
  - Die Positionierung in den Sektoren Gasversorgung, Support-Dienstleistungen und diversifizierte Finanzdienstleistungen.
- Neutrale Beiträge zur absoluten Gesamtrendite:
  - Die Positionierung in Emittenten ohne Rating.
  - Die Positionierung in Gaming, Umwelt und Banken.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Die Allokation des Portfolios in Anleihen betrug am Ende des Berichtszeitraums 91,2 %, die Allokation in variabel verzinsliche Anleihen 5,6 %.
- Veränderungen des Kreditrating-Engagements ergaben sich in erster Linie aus Entscheidungen für Einzeltitel, aber auch im Kontext der weiteren Entwicklung des Kreditzyklus und des gesamtwirtschaftlichen Ausblicks. Im Berichtszeitraum wurde das Engagement des Portfolios in Wertpapiere mit BB- und BBB-Rating ausgebaut, das Engagement in Wertpapieren mit B- und CCC-Rating und darunter zurückgefahren.

Unsere Analysten konzentrieren sich weiterhin auf die spezifischen Fundamentaldaten der Anleihen einzelner Emittenten und bewerten die Basis- und Abwärtsszenarien im Falle einer weichen Landung oder einer Rezession. Die relativ soliden Verbraucher- und Unternehmensbilanzen sowie ein wachsendes nominales BIP dürften die Fundamentaldaten der Emittenten unserer Ansicht nach weiterhin unterstützen. Zwar können die eingehenden makroökonomischen Daten und die Dynamik des gesamten Kreditzyklus im Tagesgeschäft Auswirkungen auf den Kreditmarkt zeigen, doch wir bleiben stark auf branchenspezifische Trends und idiosynkratische Risiken für Einzelemittenten fokussiert. Trotz potenzieller kurzfristiger Volatilität, die sich aus der erhöhten Unsicherheit in Bezug auf das Wirtschaftswachstum ergibt, sind wir der Meinung, dass wir mit unserem fundamentalen Bottom-up-Kreditresearch – mit Konzentration auf die Auswahl von Wertpapieren, die Vermeidung von Bonitätsherabstufungen und die ausschließliche Aufnahme der „besten Ideen“ in die Portfolios – gut gestellt sind, um von eventueller Volatilität zu profitieren.



## Strategic Income – Bericht des Investment-Managers

Für den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 3,67 %. Der als Benchmark dienende Bloomberg US Aggregate Bond Index (Total Return, USD) verbuchte im selben Zeitraum 2,09 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Rentenmärkte und Wirtschaft entwickelten sich weltweit auseinander, da sich der Anlegerfokus von Sorgen um den Bankensektor und die Schuldenobergrenze in den USA auf die restriktive Haltung von Zentralbanken in Industrieländern verlagerte – und darauf, wie Unternehmen und Verbraucher für das zweite Halbjahr aufgestellt sind.
- Am vorderen Ende kletterten die Zinsen in den USA im Berichtszeitraum, während sie im mittleren und längerfristigen Bereich unverändert blieben oder leicht nachgaben. Die US-Renditekurve blieb invers – mit Sätzen, die am vorderen Ende höher waren als für längere Laufzeiten.
- Die Kreditspreads von Titeln mit und ohne Investment Grade („IG“) verengten sich im Berichtszeitraum, woraus solide Nachfrage für diese Anlagen sprach.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf seine Wertentwicklung auswirkten.

- Positivbeiträge zur relativen Gesamrendite:
  - Das Engagement in Hochzinsanleihen und Kreditrisikotransfer in den USA und Europa.
  - Die Einzeltitelauswahl bei quasistaatlichen MBS und IG-Unternehmensanleihen.
  - Das Engagement in US-TIPS, Schwellenländeranleihen und Kommunalobligationen.
- Negativbeiträge zur relativen Gesamrendite:
  - Die Zinspositionierung.
  - Das Engagement in hybride Finanztitel.
  - Die Untergewichtung in IG-Unternehmensanleihen.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Im Berichtszeitraum bauten wir unser Engagement in quasistaatlichen MBS, US-TIPS und CMBS aus.
- Unser Engagement in Hochzinsanleihen, IG-Unternehmensanleihen und Kommunalobligationen fuhrten wir zurück.
- Mit Blick auf die Zukunft legen wir Wert auf höhere Qualität, um uns gegen Konjunkturschwäche zu wappnen.

Im Abschwung bietet hohe Qualität in unseren Augen mehr Wert als Emissionen von schlechterer Bonität, deren Spreads sich angesichts der in letzter Zeit robusten Konjunktur verengt haben. Im Gegensatz zu den Trends, die seit der globalen Finanzkrise bestanden, glauben wir, dass die Geldpolitik künftig weniger entgegenkommend sein dürfte, was Kreditanalysen und einem schärferen Blick auf die Bedingungen bestimmter Emissionen mehr Bedeutung verleiht. Ein solches Umfeld steigert unseres Erachtens den Wert, den aktive Manager im gesamten festverzinslichen Universum bieten können.

## Sustainable Asia High Yield – Bericht des Investment-Managers

Für den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 0,60 %. Der als Benchmark dienende JP Morgan ESG Asia Credit (JSEC JACI) – High Yield Index (Total Return, USD) (der „Index“) verbuchte im selben Zeitraum 1,47 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Insgesamt wurde die Stimmung auf den asiatischen Hochzinsmärkten („HY“) vor allem von den Entwicklungen im chinesischen Hochzins-Immobilienmarkt beeinflusst. Die positive Dynamik vom Jahresbeginn nahm gegen Ende des Berichtszeitraums ab.
- Der Immobilienmarkt wartet nach dem im letzten Jahr von den Behörden angekündigten 16-Punkte-Plan nach wie vor auf konkretere Unterstützung.
- Im Segment der Staatsanleihen aus Frontier-Märkten stellten die Behörden Sri Lankas Umschuldungspläne vor. Aus diesen Plänen geht auch eine Umstrukturierung von Auslandsschulden hervor, die günstiger ausfällt als erwartet, was zu positiven Kursentwicklungen bei auf US-Dollar lautenden Anleihen Sri Lankas führte.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf seine Wertentwicklung auswirkten.

- Positivbeiträge zur relativen Gesamtrendite:
  - Die Einzeltitelauswahl leistete im Berichtszeitraum einen positiven Beitrag.
  - Insbesondere die Einzeltitelauswahl innerhalb der Portfolioallokation in Indien wirkte ertragssteigernd, ebenso wie in Sri Lanka, Macau und Südkorea.
  - Ungeachtet des Vorstehenden zählen zu den besonderen Highlights unter dem Positionen die Übergewichtung des Portfolios im indischen Sektor für erneuerbare Energie, die Übergewichtung in Macau sowie die Übergewichtung des Portfolios in Sri Lanka in der Erwartung eines Restwertes (Recovery Value), der höher ausfällt als die aktuellen Marktkurse.
  - Auch die Renditekurvenpositionierung steuerte insgesamt ein kleines Plus zur relativen Rendite bei.
- Negativbeiträge zur relativen Gesamtrendite:
  - Das Engagement in Spread-Duration schadete der relativen Wertentwicklung insgesamt.
  - Die untergewichtete Portfolioposition in Finanzwerten und Local Government Funding Vehicles („LGFVs“) in China minderte den relativen Ertrag.
  - Ansonsten wirkte die Untergewichtung des Portfolios in der Spread-Duration in Hongkong abträglich.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Portfolio verstärkte im Berichtszeitraum seine Allokation auf den Philippinen, unter anderem durch Engagement in Staatsanleihen (mit Investment Grade), aber auch in ausgewählten Unternehmensanleihen, darunter attraktive Titel aus den Sektoren Öl und Gas/Energie und Telekommunikation.
- Das Portfolio erhöhte außerdem seine Allokation in Macau, weil die Erholung des Tourismus zuversichtlich beurteilt wurde und ein klarer Trend zum Schuldenabbau bestand.
- Im Segment der Staatsanleihen aus Frontier-Märkten baute das Portfolio seine Allokation in Sri Lanka aus, was den im Vergleich zu den Marktpreisen höheren Restwerten geschuldet war.

Nachdem 2023 zur Hälfte vorüber ist, gehen wir davon aus, dass die Aussichten für die Anlageklasse besser geworden sind. Da wir bereits eine erhebliche Straffung der Geldpolitik hinter uns haben und die Inflation sowohl in den USA als auch in großen asiatischen Volkswirtschaften ihren Höhepunkt überschritten haben dürfte, sollte der durch steigende Zinssätze bedingte Druck früher oder später nachlassen und könnte in Zukunft zu einem eher zweischneidigen Risiko werden. Nach den kräftigen Wiederöffnungsimpulsen im ersten Quartal 2023 war die Wachstumsdynamik in China im Folgequartal eher verhalten. Bei chinesischen HY-Unternehmensanleihen bestehen weiterhin Ausfallrisiken, was auf neuerliche Schwäche auf dem Immobilienmarkt zurückzuführen ist. Wir rechnen für das Gesamtjahr 2023 dennoch mit niedrigeren Ausfallquoten für asiatischen Hochzinspapiere als 2022. Die Wiederöffnungsdynamik in China lässt zwar nach, doch wir gehen davon aus, dass das amtliche Wachstumsziel von 5 % für 2023 erreicht wird und dass der breitere China-abhängige Komplex einschließlich Macaus künftig profitiert.

Wir halten das Engagement in Sri Lanka nach dem jüngsten Aufwärtspotenzial bei den Kursen aufrecht und gehen davon aus, dass die Restwerte über den aktuellen Marktpreisen liegen werden. Andersorts bleiben wir angesichts der attraktiven Fundamentaldaten und der Bewertungen gegenüber Kreditgelegenheiten positiv, insbesondere in Süd- und Südostasien einschließlich Indien.

Die Hauptrisiken für unsere insgesamt positive Einschätzung sehen wir entweder in einer möglichen globalen Rezession, die die Spreads der Schwellenländer erheblich weiten würde, oder in einer unerwarteten Beschleunigung der Inflationsdynamik weltweit, die deutlich mehr Zinserhöhungen erforderlich machen könnte. Der potenziell holprige Weg zum Inflationsziel dürfte vor allem in den USA Zeit in Anspruch nehmen und könnte weitere Zinsvolatilität auslösen. Dennoch halten wir die Bewertungen von auf harte Währungen lautenden asiatischen Anleihen auf absoluter wie relativer Basis im Vergleich zu Unternehmensanleihen aus Industrieländern für attraktiv.

## Sustainable Emerging Market Corporate Debt – Berichts des Investment-Managers

Für den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 2,73 %. Der als Benchmark dienende JPMorgan JESG CEMBI Broad Diversified Index (Total Return, USD) verbuchte im selben Zeitraum 3,61 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Die Marktstimmung wurde generell von Entwicklungen im Zusammenhang mit Inflation und Geldpolitik geprägt. Ein Thema, das unterstützend wirkte, war die Wiederöffnung Chinas bei begrenzten Ausfällen.
- Die Renditen zehnjähriger US-Staatsanleihen beschlossen den Zeitraum mit 3,85 % seit Jahresbeginn mehr oder minder unverändert, verzeichneten aber so kräftige Volatilität, wie sie zuletzt während der Finanzkrise 2008 zu beobachten war.
- Die Spreads für Referenzanleihen verengten sich von 334 auf 326 Bp mit einem Höchststand von 376 Bp im März. Die Ukraine schnitt mit einer Rendite von 46,50 % am besten ab, da manche Unternehmen in dem Land weiterhin geschäftstätig waren. Die schwächsten Erträge verbuchte Polen mit -2,15 %.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf seine Wertentwicklung auswirkten.

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Das übergewichtete Engagement in Rumänien.
  - Das übergewichtete Engagement im argentinischen Energiesektor.
  - Die Übergewichtung in auf erneuerbare Energieträger und Rohstoffe spezialisierten indischen Unternehmen.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Übergewichtung in China, vor allem im Immobiliensektor, der angesichts der begrenzten politischen Unterstützung weiter hinterherhinkt.
  - Die Übergewichtung in Brasilien sowie das Engagement in einem Chemieunternehmen, das herabgestuft wurde, da ein schwaches Erstquartalsergebnis zu einem spürbaren Kursrückgang führte, der in einem Liquiditätsengpass mündete.
  - Die Untergewichtung in der Ukraine, wo ein wichtiges Unternehmen seine Geschäftstätigkeit auch im Krieg weiterführte.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Portfolio stockte sein Engagement in Hongkong und Korea, aber auch in den VAE auf. Im Gegenzug verringerte es sein Engagement in Südafrika, wo das operative Umfeld schwieriger wurde. Auch das China-Engagement führen wir über die Sektoren Informationstechnologie und Industrie zurück.
- Nach Sektoren baute das Portfolio sein Engagement in Finanzwerten aus, da diese weiter attraktiv bewertet sind, aber auch in Öl- und Gasgesellschaften, obwohl die Ölpreise von ihren jüngsten Höchstständen zurückfielen. Wir verringerten das Engagement in den Sektoren Konsum und Transport gegenüber dem Jahresbeginn, da das Wiedererstarken des Tourismus nach dem Wegfall der COVID-Einschränkungen in allen Schwellenländern („EM“) nachließ.

Wir rechnen bis Ende des Jahres mit günstigen Rahmenbedingungen für Schwellenländeranleihen aufgrund besserer technischer Voraussetzungen, stabiler Fundamentaldaten und einigermaßen attraktiver Bewertungen, verbunden mit dem Auslaufen der aggressiven Geldpolitik in den USA. Chinas ins Stocken geratener Aufschwung wirft weitere Fragen auf, doch wir halten das Wachstumsziel des Landes von 5 % für erreichbar, selbst wenn nur gezielt und in Maßen stimuliert wird, wie es die jüngste geldpolitische Lockerung signalisiert. Das Wachstum in China sollte sich mäßig und ungleichmäßig, aber per saldo letztlich positiv auf das Schwellenländeruniversum auswirken.

Die Hauptrisiken für unsere positive Einschätzung sehen wir entweder in einer möglichen globalen Rezession, die die Spreads der Schwellenländer erheblich in die Höhe treiben würde, oder in einer unerwarteten Beschleunigung der Inflationsdynamik weltweit, die deutlich mehr Zinserhöhungen erforderlich machen würde. In Anbetracht der aktuellen Renditeniveaus für EM-Unternehmensanleihen vertreten wir die Ansicht, dass Anleger für diese Risiken ausreichend entschädigt werden. Wir halten die Bewertungen für EM-Unternehmensanleihen für attraktiv.

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

Für den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 betrug die Gesamttrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 5,27 %. Der als Benchmark dienende JPM ESG EMBI Global Diversified Index (Total Return, USD) (der „Index“) verbuchte im selben Zeitraum 3,91 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamttrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Die Marktstimmung wurde generell von Entwicklungen im Zusammenhang mit Inflation und Geldpolitik geprägt. Die Wiederöffnung Chinas war ein Thema, das Unterstützung bot. Gleichzeitig machten ausgefallene Titel Fortschritte bei Umschuldungsvereinbarungen mit öffentlichen und privaten Gläubigern.
- Die Renditen 10-jähriger US-Staatsanleihen beschlossen den Zeitraum mit 3,85 % seit Jahresbeginn mehr oder minder unverändert, verzeichneten aber so kräftige Volatilität, wie sie zuletzt während der Finanzkrise 2008 zu beobachten war.
- Die Spreads für ESG-Referenzanleihen aus Schwellenländern („EM“) verengten sich von 377 auf 353 Basispunkte (Bp) mit einem Höchststand von 426 Bp im März. El Salvador schnitt mit einer Rendite von 57,84 % im breiten Marktindex am besten ab, da sich seine fiskalpolitischen Aussichten besserten. Schwächstes Land war Ecuador mit -21,74 %, weil es mit erhöhter politischer Volatilität konfrontiert war.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf seine Wertentwicklung auswirkten.

- Positivbeiträge zur Gesamttrendite:
  - Die gesamte Länderallokation mit Übergewichtungen in Hochzins-Unternehmensanleihen, etwa aus El Salvador, Sri Lanka und Argentinien, und dem Verzicht auf Ägypten aufgrund von ESG-Kriterien.
  - Die Einzeltitelauswahl leistete per saldo einen Positivbeitrag.
- Negativbeiträge zur Gesamttrendite:
  - Übergewichtungen in Ecuador und Marokko mit seinem niedrigeren Beta sowie die Einzeltitelauswahl in Ghana.
  - Die Top-down-Positionierung wirkte per saldo ertragsmindernd.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Portfolio hielt an einer Tendenz zu Hochzinstiteln (gegenüber Unternehmensanleihen mit Investment Grade) fest. Wir stockten unsere übergewichteten Allokationen in Armenien, Kolumbien, El Salvador und Serbien auf. Diese entsprachen den ökologischen und sozialen Zielen des Portfolios und wir erkennen dort Widerstandskraft gegen restriktivere globale Finanzierungsbedingungen.
- Unsere übergewichtete Allokation in Ecuador haben wir infolge politischer Risiken verringert und sind aufgrund revidierter Nachhaltigkeitsbewertungen aus Staatsanleihen der VAE ausgestiegen.
- Die Allokation in auf Euro lautende Anleihen betrug am Ende des Berichtszeitraums ca. 31,9 %.

Wir beurteilen die Aussichten dieser Anlageklasse für das verbleibende Jahr positiv. Da wir bereits eine erhebliche Straffung der Geldpolitik hinter uns haben und die Inflation sowohl in den USA als auch in vielen Schwellenländern ihren Höhepunkt erreicht haben dürfte, glauben wir, dass der durch steigende Zinssätze bedingte Druck nachlassen und EM-Volkswirtschaften und -Märkten Erleichterung verschaffen könnte. Wir erwarten, dass die Ausfallraten für Staatsanleihen bis 2023 auf einen niedrigen einstelligen Prozentsatz sinken werden, während das zunehmende Engagement des IWF in verschiedenen Schwellenländern den Finanzierungsbedarf und die Reformagenden unterstützen dürfte. Die Hauptrisiken für unsere positive Einschätzung sehen wir entweder in einer möglichen globalen Rezession, die die Risikoprämie für Schwellenländer erheblich in die Höhe treiben würde, oder in einer unerwarteten Beschleunigung der Inflationsdynamik weltweit, die deutlich mehr Zinserhöhungen erforderlich machen würde.

## Systematic Global Sustainable Value – Bericht des Investment-Managers

Für den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 8,08 %. Im selben Zeitraum erzielten der MSCI ACWI (All-Country World Index) Value (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der „übergeordnete Index“) und der MSCI All-Country World Index (ACWI) (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der „Sekundärindex“) eine Rendite von 4,25 % bzw. 13,93 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Die globalen Aktienmärkte legten im ersten Halbjahr 2023 kräftig zu, angeführt von Growth-Werten.
- Am besten entwickelte sich der Sektor Informationstechnologie, befeuert durch den Hype um künstliche Intelligenz im zweiten Quartal.
- Die US-Notenbank Federal Reserve Board („Fed“) setzte die für Juni 2023 geplante Zinserhöhung aus. Damit hat sie zum ersten Mal seit März 2022 auf einer Sitzung die Zinsen nicht erhöht. Die US-Inflation beschloss den Berichtszeitraum auf ihrem niedrigsten Stand seit zwei Jahren, gemessen am Preisindex für die persönlichen Konsumausgaben.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf seine Wertentwicklung auswirkten.

- Positivbeiträge zur relativen Gesamrendite:
  - Die Übergewichtung im Sektor Informationstechnologie.
  - Die Einzeltitelauswahl im Sektor Informationstechnologie.
  - Die Einzeltitelauswahl im Sektor Kommunikationsdienste.
  - Die Einzeltitelauswahl in den Regionen USA und Europa ohne Vereinigtes Königreich.
  - Die Faktoren Volatilität, Momentum und Qualität.
- Negativbeiträge zur relativen Gesamrendite:
  - Die Einzeltitelauswahl im Gesundheitswesen.
  - Die Einzeltitelauswahl in Schwellenländern.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Portfolio behielt eine moderate Übergewichtung im Sektor Informationstechnologie bei. Dabei konzentrierte sich das Engagement größtenteils auf Branchen, in denen wir die meisten Value-Aktien aus dem Sektor entdecken, nämlich Halbleiter und Hardware.
- Das Portfolio war mit seiner Positionierung auf profitable Aktien und kürzere Duration ausgerichtet, während die Inflation weiter erhöht blieb und die Zinsen erneut anstiegen.

Mit Blick auf das zweite Halbjahr 2023 rechnen wir mit abnehmendem Wachstum in den USA und den meisten globalen Industrieländern trotz Anreizprogrammen wie dem Inflation Reduction Act von US-Präsident Biden, die darauf abzielen, einer Konjunkturabschwächung entgegenzuwirken. Das aktuelle Inflationsumfeld zeigt sich hartnäckiger als erwartet. Angesichts schärferer Kreditbedingungen ist das Portfolio gut aufgestellt, um sich auf profitable Aktien und kurze Duration zu fokussieren.

## Tactical Macro – Berichts des Investment-Managers

Der Neuberger Berman Tactical Macro Fund wurde am 30. Juni 2023 aufgelegt. Ziel des Portfolios ist es, ungeachtet des Marktumfelds positive Erträge zu erzielen durch die Ermittlung von Missverhältnissen bei den Marktpreisen für ein breites Spektrum von Anlageklassen, Märkten und Regionen im Rahmen ausgeprägter Risikosteuerung. Das Portfolio setzt einen diskretionären fundamentalen Ansatz für globale Makro-Investments ein, der versucht, auf der Grundlage aktueller und prognostizierter gesamtwirtschaftlicher Trends und Maßnahmen aus den thematischen Treibern bestimmter Vermögenswerte ebenso Kapital zu schlagen wie aus Fehlbewertungen, die vom Verhalten und von den Neigungen der Anleger ausgelöst werden. Um diese Einschätzungen umzusetzen und ein Engagement in den ermittelten Anlagethemen herzustellen, investiert die Strategie in hochliquide Instrumente, in erster Linie in Finanzderivate (wie Futures, Forwards, Swaps und Optionen) auf Aktien-, Renten-, Rohstoff- und Devisenmärkten.

Das Portfolio hat keine ausgewiesene Benchmark und soll flexibel Chancen mit dem besten Ertrags-/Risikoverhältnis aus dem gesamten globalen Chancenspektrum nutzen. Ausführung, Dimensionierung und laufende Überwachung sind für das Risikomanagement auf Positions- und Portfolioebene entscheidend.

## Ultra Short Term Euro Bond – Bericht des Investment-Managers

Für den sechsmontigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 betrug die Gesamttrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse EUR I 1,92 %. Der ICE BofA 0-1 Year AAA Euro Government Index (Total Return, EUR) (der „Index“) verzeichnete im selben Zeitraum 0,79 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamttrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Die erste Jahreshälfte zeichnete sich durch hohe Volatilität der Anleiherenditen aus, gefolgt von einem rasanten, maßgeblichen Anstieg der Leitzinssätze der Europäischen Zentralbank („EZB“). Die EZB-Politik schlug weiter restriktive Töne an, weil keine eindeutigen Belege dafür vorlagen, dass die zugrunde liegende Inflation ihren Höchststand bereits überschritten hat. Überdies konnte sich die Wirtschaft gut behaupten, als Turbulenzen im Bankensystem einsetzten, die von den Liquiditätsproblemen verschiedener US-amerikanischer Regionalbanken ausgelöst worden waren.
- Eine derart restriktive EZB-Politik führte zur Inversion der Renditekurve. Die Rendite des 3-monatigen deutschen Bubill stieg mit 177 Bp spürbar an, von 1,56 % im Dezember 2022 auf 3,33 % im Juni 2023, den höchsten Stand seit 2008. Die 2-jährige deutsche Bundesanleihe legte mit 45 Bp deutlich zu, von 2,74 % auf 3,19 %, während die 10-jährige Bundesanleihe leicht nachgab: um 17 Bp von 2,56 % auf 2,39 %.
- Die Inflationszahlen für die Eurozone lagen der EZB-Politik und den Marktbewegungen zugrunde. Die Gesamtinflationsrate ging deutlich zurück – von 9,2 % im Dezember 2022 auf 5,5 % im Juni 2023, ein nach dem Rückgang der Energiepreise verzeichnetes 16-Monatsstief. Die Kerinflation ohne Energie und Nahrungsmittel erhöhte sich in dem Halbjahr dagegen leicht: von 5,2 % im Dezember 2022 auf 5,4 % im Juni 2023. Sie hatte im März mit 5,7 % einen Gipfel verzeichnet, dem die Dienstleistungskomponente zugrunde lag.
- Das Wachstum des deutschen BIP betrug im ersten Quartal 2023 im Quartalsvergleich -0,3 %. Vorausgegangen war eine Kontraktion um 0,5 % im vierten Quartal 2022.
- Dass das Wirtschaftswachstum in Südeuropa besser ausgefallen war als erwartet, führte 2023 zu der überdurchschnittlichen Entwicklung von Staatsanleihen aus Peripherieländern in den ersten sechs Monaten. Außerdem verengten sich die Kreditspreads im Berichtszeitraum, weil die Unternehmensergebnisse die Erwartungen übertrafen und die technischen Rahmenbedingungen für Unternehmensanleihen günstig waren. Das ausgesprochen hohe Renditeniveau, wie es zuletzt 2009 vorgelegen hatte, gepaart mit dem Umstand, dass der Zinserhöhungszyklus auf sein Ende zusteuert, hat das Anlegerinteresse am Rentenmarkt im ersten Halbjahr 2023 sogar noch verstärkt.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf seine Wertentwicklung auswirkten.

- Positivbeiträge zur relativen Gesamttrendite:
  - Tendenz zu Long-Positionen in Unternehmensanleihen
  - Die volle Ausnutzung des taktischen Portfoliosegments, das bis Mai um seine Obergrenze pendelte: das taktische Segment ermöglicht es der Strategie, in Unternehmensanleihen mit hohem Beta wie Hochzins- und Hybridpapiere zu investieren.
  - Long-Tendenz zu forderungsbesicherten Wertpapieren („ABS“)
- Negativbeiträge zur relativen Gesamttrendite:
  - Übergewichtung in Finanzwerten und Engagement in REIT-Anleihen
  - Zinskurven-Steepener (2 bis 10 Jahre).
  - Short-Position in iTraxx Crossover.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Im Berichtszeitraum behielten wir eine Long-Tendenz zu Unternehmensanleihen bei und konnten unser Engagement im März aufstocken, als die Krise im Bankensektor eine allgemeine Spread-Weitung bei Unternehmensanleihen auslöste.
- Wir verringerten unser Engagement in ABS angesichts der starken Performance variabel verzinslicher Schuldverschreibungen in einem von steigenden Zinsen geprägten Umfeld und schichteten in gedeckte Anleihen oder Finanztitel um, damit die Konvexität der Strategie gesteigert wird.
- Das Engagement in den Ende Mai im taktischen Portfoliosegment gehaltenen Anleihen mit hohem Beta verringerten wir.
- Das durchschnittliche Rating des Portfolios erhöhten wir progressiv, um die Strategie gegen Spread-Volatilität im zweiten Halbjahr zu wappnen.
- Die Duration steuerten wir aktiv durch Zins-Futures, indem wir Volatilität nutzten und Alpha generierten.
- Wir ergänzten die Strategie (2 bis 10 Jahre) nach und nach um einen Steepener, da die Zinskurve stark invertiert ist und sich in der zweiten Jahreshälfte normalisieren könnte.
- Wir managten aktiv eine Short-Position im iTraxx Crossover, um die Strategie gegen eine Weitung der Spreads abzusichern.

Mit Blick auf die Zukunft wollen wir nach der kräftigen Spread-Rally bei europäischen Unternehmensanleihen im ersten Halbjahr 2023 den prozentualen Marktanteil des taktischen Portfoliosegments weiter zurückfahren mit dem Ziel, das Beta des Portfolios zu verringern. Dahinter steht der Gedanke, die Spread-Duration zu verringern, falls sich die Spreads in den nächsten paar Monaten weiten. Wir sind der festen Überzeugung, dass sich die Straffung der Zentralbankpolitik auf die Wirtschaft auswirkt und das früher oder später auch Effekte auf die Kreditspreads haben könnte. Falls es dazu kommt, würde sich das auf Hochzinsanleihen und nachrangige Schuldtitel möglicherweise ungleich stärker auswirken.

## Uncorrelated Strategies – Bericht des Investment-Managers

Für den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 betrug die Gesamttrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I -7,69 %. Die Benchmark des Portfolios, der ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return, USD) (der „Index“), rentierte im selben Zeitraum 2,32 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamttrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Die ersten vier Monate des Jahres waren fraglos eine schwierige Phase für das Portfolio. Daran schloss sich eine ruhigere Periode mit neutraler Ertragsentwicklung an, wobei angesichts einer kräftigen Risiko-Rally auf Schutz in Abwärtsrichtung geachtet wurde. Zuletzt fielen die Erträge für uns zwar enttäuschend aus, doch wir wissen auch, dass das Portfolio noch im letzten Jahr kräftig von dem von höheren Zinsen geprägten Umfeld profitieren konnte und sind grundsätzlich der Ansicht, dass uns die verschärften Bedingungen mittelfristig zugutekommen sollten.
- Dass aktienmarktneutrale Investments wieder ein positives P&L aufwiesen, war erfreulich und trotzte einem langfristigen Trend zur unterdurchschnittlichen Wertentwicklung. Wir sehen da noch Luft nach oben, wenn die Dominanz makroökonomischer Schlagzeilen gegenüber Entwicklungen bei einzelnen Aktien etwas gedämpfter ausfällt, wie es im Mai der Fall war.
- Die globale Aktien-Rally im zweiten Quartal 2023 setzte ein, obwohl die Anleiherenditen weiter anzogen und die Zentralbanken restriktiv agierten. Im Vereinigten Königreich und in Norwegen wurden die Zinsen überraschend um 50 Basispunkte heraufgesetzt, die US-Notenbank Federal Reserve Board setzte ihre restriktive Politik aus, Kanada und Australien hoben die Zinsen erneut an und die Schweiz, Schweden und die Europäische Zentralbanken setzten ihren Straffungskurs fort. Diese restriktive Politik war nicht ganz einfach mit der niedrigen Volatilität und den höheren Bewertungen in Einklang zu bringen, die wir bei Aktien beobachtet hatten. Mit Blick auf den Cboe Volatility Index („VIX“) als Volatilitätsindikator stellen wir beispielsweise fest, dass er den Juni auf dem tiefsten Stand seit der Pandemie beschloss.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf seine Wertentwicklung auswirkten.

- Positivbeiträge zur relativen Gesamttrendite:
  - Positive Erträge stammten im Berichtszeitraum von Insurance-Linked Securities.
  - Devisengeschäfte trugen im zweiten Quartal am meisten zur Rendite bei.
- Negativbeiträge zur relativen Gesamttrendite:
  - Allokationen in Trend Following, Volatility Relative Value, Short Term Trading, Global Macro, Equity Market Neutral und Statistical Arbitrage schaden der Wertentwicklung.
  - Das Portfolio verbuchte im ersten Quartal 2023 ein Minus von 6,52 %. Für das negative Quartalsergebnis war in erster Linie die Wertentwicklung im März verantwortlich, als alle sechs Kernallokationen ertragsmindernd wirkten, allen voran Short-Term Trading und Trend Following
  - Im zweiten Quartal brachten Aktien die größten Wertabzüge, gefolgt von Unternehmensanleihen und dem Zins-/Anleihengeschäft.
  - Global Macro leistete im zweiten Quartal den größten Negativbeitrag, gefolgt von Statistical Arbitrage. Short Term Trading, Equity Market Neutral und Volatility Relative Value brachten kleinere Verluste.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Die Allokationen in Unterberater blieben im ersten Halbjahr unverändert.
- Volatility Relative Value profitierte weiter von manchen unserer schwerer zugänglichen Streuungstransaktionen. Die negativ zu Buche schlagenden Wandelanleihen betrachten wir dagegen als potenzielle künftige P&L-Faktoren und warten derzeit ab, bis sich allgemein bessere Chancen ergeben, falls die Aktienvolatilität anzieht.
- Im Segment Trend Following ist es gelungen, in bestimmten Bereichen wie japanischen Aktien von etwas nachhaltigerer Dynamik zu profitieren, allerdings im Rahmen unserer maßgeschneiderten Risikolimits.

Bei dieser Strategie beobachten wir historische Höchstrenditen in manchen der turbulentesten Phasen für risikoreichere Anlagen und 60/40-Portfolios. Das Engagement ist aktuell recht breit diversifiziert. Stresstests weisen allgemein auf positive Endergebnisse hin.

In unseren Augen passt nicht, dass die Bewertungen von Aktien nach einer Erhöhung der Zinsen in der größten Volkswirtschaft der Welt um 500 Basispunkte nicht heftiger reagieren und das Volatilitätsniveau für gelassenes Vertrauen in die Fähigkeit der Zentralbanken spricht, uns durch einen „kurzfristigen“ Inflationsschub zu einer sanften Landung mit minimalen wirtschaftlichen Problemen zu führen. Angesichts zweistelliger Gewinne von Aktien im ersten Halbjahr und neuen VIX-Tiefständen ist die Zeit unserer Ansicht nach reifer denn je, sich nach Alternativen umzusehen, die echte Diversifizierung bieten. Abschließend finden wir die Pipeline neuer Ideen für die zweite Jahreshälfte spannend – sowohl mit Blick auf Analysen zu neuen Managern als auch auf die für den Bestand gebotenen Chancen.



## Uncorrelated Trading\* – Berichts des Investment-Managers

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

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

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

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf seine Wertentwicklung auswirkten.

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

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Die Allokationen in Unterberater blieben im Berichtszeitraum unverändert.

\* Das Portfolio wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst.

## US Equity – Bericht des Investment-Managers

Für den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 23,55 %. Der als Benchmark dienende S&P 500 Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der „Index“) verzeichnete im selben Zeitraum ein Plus von 16,60 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Das Konjunkturklima war im ersten Halbjahr von einer bunten Mischung von Faktoren geprägt. Dabei hoben Vertreter der US-Notenbank Federal Reserve (die „Fed“) die Zinsen in beiden Quartalen an.
- Trotz des verhaltenen Konjunkturausblicks legten die Märkte weiter kräftig zu, obwohl die Gewinne im S&P 500 insgesamt leicht nachgaben, was darauf zurückzuführen war, dass erhöhte Kosten auf die Margen drückten.
- Währenddessen sorgten durchwachsene Wirtschaftsdaten weiter für Volatilität auf dem Markt. Die stärksten Schwankungen betrafen die Renditekurven kurz laufender Staatsanleihen. Das rasante Zinserhöhungstempo löste auch Aktiv-Passiv-Inkongruenzen bei mehreren US-amerikanischen Regionalbanken aus, was die Sorgen um die gesamtwirtschaftliche Stabilität noch verstärkte.
- Trotz dieser Herausforderungen sorgten Zuversicht im Zusammenhang mit Fortschritten in der KI sowie ermutigende Gewinnmeldungen von Unternehmen, vor allem von Technologieriesen aus dem Mega-Cap-Segment, zumindest vorübergehend für eine gewisse Erleichterung.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf seine Wertentwicklung auswirkten.

- Positivbeiträge zur relativen Gesamrendite:
  - Im Berichtszeitraum fiel die Einzeltitelauswahl in den Sektoren Kommunikationsdienste und Finanzen am vorteilhaftesten aus.
  - Die Übergewichtung des Portfolios im Sektor Informationstechnologie und seine Untergewichtung in Energiewerten steigerte den Ertrag aus Allokationsperspektive am meisten.
- Negativbeiträge zur relativen Gesamrendite:
  - Die Einzeltitelauswahl in den Sektoren Nicht-Basiskonsumgüter und Informationstechnologie schadete der relativen Wertentwicklung.
  - Aus Allokationsicht wirkte eine Übergewichtung der Barposition im Berichtszeitraum ertragsmindernd.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

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

Im Verlauf von 2023 nehmen wir eine Konjunkturabschwächung wahr. Gleichzeitig macht die Fed offenbar gewisse Fortschritte im Kampf gegen die Inflation und die Unternehmensgewinne liegen im Durchschnitt über den Erwartungen. Doch Äußerungen über nachlassende Konsumtrends und erhöhte Unsicherheit liefern einen eindeutigen Hinweis darauf, dass sich der Straffungszyklus der Fed effektiv auf die breitere Wirtschaft auswirkt. Dennoch bekennt sich die Fed nach wie vor unbeirrt zur Inflationsbekämpfung und macht bisher keine Anstalten, in diesem Jahr noch umzuschwenken und die Zinsen zu senken. Das begreift der Markt allmählich, da anhaltende Kerninflation in bestimmten Kategorien wie Nahrungsmitteln sowie bestimmte starke Wirtschaftsdaten dieser Vorstellung Vorschub leisten. Solange wir aber nicht mehr Klarheit über das Verhältnis zwischen höheren Zinsen, Fortschritten bei der Inflationsbekämpfung und einer Konjunkturabschwächung haben, rechnen wir weiter mit Marktvolatilität. Im aktuellen Umfeld dürfte sich unseres Erachtens daher im weiteren Verlauf immer klarer abzeichnen, dass sich die operative Leistung der zugrunde liegenden Unternehmen auseinanderentwickelt. Wie immer setzen wir unsere Anstrengungen zum bestmöglichen Verständnis unternehmens- und portfoliospezifischer Faktoren fort, da dieses Umfeld unseres Erachtens vom Zusammenwirken einer Vielzahl von Faktoren wie fiskalpolitische Überlegungen, geldpolitische Anreize, Sorgen um die öffentliche Gesundheit, geopolitische Unsicherheit, Rohstoffpreisvolatilität, Inflationsdynamik und den gesteuerten Neustart geprägt ist. Bei Veränderungen der Marktdynamik kann dies zu einer Verzerrung des Marktwerts von Unternehmen gegenüber ihrem langfristigen potenziellen Wert führen, was für ein volatiles Umfeld sorgt, das potenzielle Gelegenheiten eröffnet.

## US Equity Index PutWrite – Bericht des Investment-Managers

Für den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 10,58 %. In demselben Zeitraum verzeichnete die sich zu je 50 % aus dem Cboe S&P 500 One-Week PutWrite Index und dem Cboe S&P 500 PutWrite Index (zusammen der „Index“) zusammengesetzte Benchmark 10,92 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Beflügelt durch die Atempause der US-Notenbank Federal Reserve Board („Fed“) bei den Zinserhöhungen, die Vermeidung einer Zahlungsunfähigkeit der USA sowie die optimistischen Erwartungen eines technologischen Durchbruchs in der künstlichen Intelligenz („KI“), verbuchte der S&P 500 Index im ersten Halbjahr 2023 16,60 %. Der NASDAQ 100 Index ließ sich von seinem wachstumsschwächeren Cousin nicht ausstechen und legte ganze 39,35 % zu.
- Die implizite Volatilität ging weiter zurück, da Anleger auf kürzere Sicht weniger zu prüfende Risiken wahrnahmen. Der Cboe Volatility Index („VIX“) ging im Quartal zwar zurück, entsprach aber mit einem Durchschnittsniveau von 18,56 für 2023 weiter seinem langfristigen Durchschnitt. Ein Rückgang des VIX unter 15 wird sicherlich wilde Spekulationen auslösen, doch ganz ähnlich wie bei Goldilocks auf der Suche nach dem besten Porridge ist der VIX den Anlegern stets zu hoch oder zu niedrig. Möglicherweise übersehen sie dabei manchmal, dass der VIX im Schnitt gewöhnlich genau richtig liegt. Mit festem Blick auf den aktuellen VIX-Stand entgeht ihnen insbesondere, dass die meisten Optionsstrategien generell nicht aus einem einzigen VIX-Ausschlag nach oben oder unten Kapital schlagen, sondern aus dem Durchschnittsniveau der impliziten Volatilität, da Optionsprämien im Zeitverlauf verfallen.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf seine Wertentwicklung auswirkten.

- Positivbeiträge zur relativen Gesamtrendite:
  - Das Optionssegment des S&P 500 PutWrite Strategy lieferte mit 11,18 % (brutto) eine attraktive Rendite. Der Cboe S&P 500 PutWrite Index (PUT) erzielte demgegenüber ein Plus von 12,54 %. Im selben Zeitraum brachte es der Cboe S&P 500 One-Week PutWrite Index (WPUT) auf 9,30 %. Das Sicherheitenportfolio gewann parallel dazu 1,51 % gegenüber einem Ertrag des ICE BofA 0-3M U.S. T-Bill Index von 2,32 %.
- Negativbeiträge zur relativen Gesamtrendite:
  - Im Berichtszeitraum gab es keine Negativbeiträge zur Wertentwicklung des Portfolios.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

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

Wir gehen davon aus, dass das Renditeniveau der Sicherheiten trotz der Zinspause der Fed attraktiv bleibt, da die Inflationsgefahr aufgrund vergleichsweise robuster Konjunkturprognosen für die USA fortbesteht. Wir nehmen bei den Anlegern geteilte Meinungen dazu wahr, ob/wann die Fed die Zinsen nach ihrer jüngsten Atempause erhöhen wird. Wir sind nach wie vor der Ansicht, dass der „Geist aus der Flasche“ ist und die Zinsen noch längere Zeit höher bleiben müssen, weil die US-Wirtschaft bisher Stärke zeigt. Höhere Zinsen bescheren Anlegern aus ihren Anlageportfolios die höchsten Erträge seit Jahren. Diese Erträge könnten den Konsum ankurbeln, was den Aufwärtsdruck auf die Preise verstärkt und damit die Wahrscheinlichkeit anhaltender Inflation erhöht. Ein weiterer Inflationstreiber könnte der Fachkräftemangel sein, da das Durchschnittsalter von US-Facharbeitern weiter ansteigt, weil sich Arbeitnehmer über Jahre für andere berufliche Werdegänge entschieden haben. Daher stellt sich die Frage, wie KI Arbeitnehmer dazu bringen könnte, wieder in den eher gewerblichen Arbeitsmarkt zurückzukehren. So oder so dürften sich diese Trends kaum in wenigen Quartalen maßgeblich verändern.

## US Large Cap Value – Bericht des Investment-Managers

Für den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I -1,95 %. Der als Benchmark dienende Russell 1000 Value Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der „Index“) verzeichnete im selben Zeitraum ein Plus von 4,76 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Der Aktienmarkt legte im Berichtszeitraum kräftig zu.
- Der Markt überwand mehrere Widerstände, darunter anhaltend hohe Inflation und eine weitere Zinserhöhung seitens der US-Notenbank Federal Reserve Board (die „Fed“), Sorgen, die Weltwirtschaft könnte in eine Rezession abgleiten, kontroverse Verhandlungen um die Schuldenobergrenze, Turbulenzen in der Regionalbankenbranche und verschiedene geopolitische Entwicklungen.
- Die Anleger waren generell positiv gestimmt, da sich die Wirtschaft robust zeigte, die Inflation nachgab und mehrere der Unsicherheitsfaktoren, die auf dem Markt lasteten, ausgeräumt werden konnten.
- Alles in allem brachte der S&P 500 Index im Berichtszeitraum mit 16,60 % eine höhere Rendite als der Index, der 4,76 % verbuchte.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf seine Wertentwicklung auswirkten.

- Positivbeiträge zur relativen Gesamtrendite:
  - Die Einzeltitelauswahl im Gesundheitswesen (allen voran bei medizinischen Geräten und Versorgungsgütern).
  - Die Einzeltitelauswahl im Sektor Basiskonsumgüter (angeführt von Nahrungsmittelprodukten).
  - Die Untergewichtung im Finanzsektor.
- Negativbeiträge zur relativen Gesamtrendite:
  - Die Einzeltitelauswahl im Industriesektor (getrieben vom Maschinenbau).
  - Die Einzeltitelauswahl im Werkstoffsektor (getrieben von Metallen und Bergbau).
  - Die Untergewichtungen in den Sektoren Kommunikationsdienste und Informationstechnologie.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Wir nahmen im Berichtszeitraum etliche geringfügige Anpassungen vor.
- Der Sektorpositionierung des Portfolios liegt die Bottom-up-Einzeltitel zugrunde. Am Ende des Berichtszeitraums bestanden die größte Übergewichtungen im Verhältnis zum Index in den Sektoren Basiskonsumgüter und Versorgung. Die im Portfolio gegenüber dem Index am stärksten untergewichteten Sektoren waren Finanzen und Nicht-Basiskonsumgüter.

In der letzten Zeit schätzen wir die Auswirkungen einer Konjunkturabschwächung ab und sind skeptischer in unserem Ausblick, insbesondere bezüglich der Entwicklungen, die nachlassende Nachfrage in Aussicht stellt. Daher bewerten wir, welche Risiken für unsere Portfoliositionen angemessen sind und welche Aktien vor diesem Hintergrund am attraktivsten wirken. Bis vor Kurzem nahmen die Marktteilnehmer Signale für eine Konjunkturabschwächung noch positiv auf in der Hoffnung, die Fed würde dann bei ihren aggressiven Zinserhöhungen zur Inflationseindämmung auf die Bremse treten. Doch nach den jüngsten Turbulenzen im Bankensektor weisen eingehende schwächere Wirtschaftsdaten auf das Risiko hin, dass die Wirtschaft in eine Rezession rutschen könnte. Setzt die Fed ihre Zinserhöhungen weiter aus, um die Wirtschaft zu stützen, könnten die Anleger das in gewisser Hinsicht als Bestätigung auffassen, dass sich die Wirtschaft in einer noch viel prekäreren Lage befindet, als sie angenommen hatten. Das würde die Zentralbank im Streben nach ihren geldpolitischen Zielen vor ein echtes Dilemma stellen. Wir sind nach wie vor aktive wertorientierte Large-Cap-Manager, die an ihrer Disziplin festhalten und das Portfolio nach Möglichkeit so aufstellen, dass es die interessantesten Chancen nutzen kann, die wir im aktuellen Umfeld erkennen.

## US Long Short Equity – Bericht des Investment-Managers

Für den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 6,97 %. Die als Benchmark dienenden beiden Indizes, der S&P 500 Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) und der HFRX Equity Hedge Index (Total Return, USD), verbuchten im selben Zeitraum ein Plus von 16,60 % bzw. 2,96 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividenden erträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Das Konjunkturklima war im ersten Halbjahr von einer bunten Mischung von Faktoren geprägt. Dabei hoben Vertreter der US-Notenbank („Fed“) die Zinsen in beiden Quartalen an.
- Trotz des verhaltenen Konjunkturausblicks legten die Märkte weiter kräftig zu, obwohl die Gewinne im S&P 500 insgesamt leicht nachgaben, was darauf zurückzuführen war, dass erhöhte Kosten auf die Margen drückten.
- Währenddessen sorgten durchwachsene Wirtschaftsdaten weiter für Volatilität auf dem Markt. Die stärksten Schwankungen betrafen die Renditekurven kurz laufender Staatsanleihen. Das rasante Zinserhöhungstempo löste auch Aktiv-Passiv-Inkongruenzen bei mehreren US-amerikanischen Regionalbanken aus, was die Sorgen um die gesamtwirtschaftliche Stabilität noch verstärkte.
- Trotz dieser Herausforderungen sorgten Zuversicht im Zusammenhang mit Fortschritten in der KI sowie ermutigende Gewinnmeldungen von Unternehmen, vor allem von Technologieriesen aus dem Mega-Cap-Segment, zumindest vorübergehend für eine gewisse Erleichterung.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf seine Wertentwicklung auswirkten.

- Positivbeiträge zur relativen Gesamtrendite:
  - Im Berichtszeitraum schnitten Long-Positionen in Aktien beim Gesamtertrag besser ab als der breitere Markt und leisteten einen positiven Beitrag zur Portfoliorendite.
  - Am vorteilhaftesten fiel die Einzeltitelauswahl unter Long-Positionen in Aktien aus den Sektoren Kommunikationsdienste und Finanzen aus.
- Negativbeiträge zur relativen Gesamtrendite:
  - Das Short-Engagement auf dem Markt – darunter breite marktkapitalisierungs-, sektor- und anlagestilspezifische Absicherungen – minderte die Portfoliorendite im Berichtszeitraum insgesamt.
  - Am nachteiligsten fiel die Einzeltitelauswahl unter Long-Positionen in Aktien aus den Sektoren Nicht-Basiskonsumgüter und Informationstechnologie aus.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Nettoengagement des Portfolios erhöhte sich im Berichtszeitraum schrittweise auf eine Netto-Long-Position von etwa 40 bis 45 %, während sich das rechnerische Bruttoengagement in den Bereich von rund 125 bis 130 % steigerte.
- Das fundamentale Short-Engagement verringerte sich im Berichtszeitraum insgesamt, allen voran durch einen Rückgang von Short-Positionen in den Sektoren Nicht-Basiskonsumgüter, Finanzen, Werkstoffe und Kommunikationsdienste.
- Das Short-Engagement auf dem Markt im Zusammenhang mit Absicherungsgeschäften nahm im Berichtszeitraum ab.

Im Verlauf von 2023 nehmen wir eine Konjunkturabschwächung wahr. Gleichzeitig macht die Fed offenbar gewisse Fortschritte im Kampf gegen die Inflation und die Unternehmensgewinne liegen im Durchschnitt über den Erwartungen. Doch Äußerungen über nachlassende Konsumtrends und erhöhte Unsicherheit liefern einen eindeutigen Hinweis darauf, dass sich der Straffungszyklus der Fed effektiv auf die breitere Wirtschaft auswirkt. Dennoch bekennt sich die Fed nach wie vor unbeirrt zur Inflationsbekämpfung und macht bisher keine Anstalten, in diesem Jahr noch umzuschwenken und die Zinsen zu senken. Das begreift der Markt allmählich, da anhaltende Kerninflation in bestimmten Kategorien wie Nahrungsmitteln sowie bestimmte starke Wirtschaftsdaten dieser Vorstellung Vorschub leisten. Solange wir aber nicht mehr Klarheit über das Verhältnis zwischen höheren Zinsen, Fortschritten bei der Inflationsbekämpfung und einer Konjunkturabschwächung haben, rechnen wir weiter mit Marktvolatilität. Im aktuellen Umfeld dürfte sich unseres Erachtens daher im weiteren Verlauf immer klarer abzeichnen, dass sich die operative Leistung der zugrunde liegenden Unternehmen auseinanderentwickelt. Wie immer setzen wir unsere Anstrengungen zum bestmöglichen Verständnis unternehmens- und portfoliospezifischer Faktoren fort, da dieses Umfeld unseres Erachtens vom Zusammenwirken einer Vielzahl von Faktoren wie fiskalpolitische Überlegungen, geldpolitische Anreize, Sorgen um die öffentliche Gesundheit, geopolitische Unsicherheit, Rohstoffpreisvolatilität, Inflationsdynamik und den gesteuerten Neustart geprägt ist. Bei Veränderungen der Marktdynamik kann dies zu einer Verzerrung des Markts von Unternehmen gegenüber ihrem langfristigen potenziellen Wert führen, was für ein volatiles Umfeld sorgt, das auf Long- und Short-Seite potenzielle Gelegenheiten eröffnet.

## US Multi Cap Opportunities – Bericht des Investment-Managers

Für den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 12,32 %. Der S&P 500 Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der „Index“) rentierte im selben Zeitraum 16,60 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- US-Aktien warfen im Berichtszeitraum hohe Renditen ab.
- Die US-Wirtschaft zeigt sich weiter robust, unterstrichen durch positives BIP-Wachstum und einen soliden Arbeitsmarkt.
- Die Inflationsrate geht zurück.
- Insgesamt lag den Aktienmärkten Momentum zugrunde. Unverhältnismäßig hohe Überrenditen erzielten dabei Large-Caps aus dem Growth-Segment sowie technologieorientierte Unternehmen. Das Renditegefälle zwischen dem Index und dem Equal-Weight S&P 500 Index von 986 Basispunkten verdeutlicht, wie konzentriert sich der Ertrag im bisherigen Jahresverlauf zusammensetzt. Der Informationstechnologiesektor brachte über 45 %, das Large-Cap-Growth-Segment rund 29 %. Dem stehen Erträge von rund 5 % für das Value-Segment und 8 % für Small-Cap-Indizes gegenüber.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf seine Wertentwicklung auswirkten.

- Positivbeiträge zur relativen Gesamtrendite:
  - Im Berichtszeitraum erzielte das Portfolio eine starke absolute Wertentwicklung.
  - Im laufenden Jahr lag den Aktienmarktrenditen für den Index überwiegend die unverhältnismäßig starke Wertentwicklung von Large-Cap-Growth-Titeln und technologieorientierten Unternehmen zugrunde – Marktsegmente, in denen das Portfolio untergewichtet ist.
  - Das Bottom-up-Verfahren und der flexible Anlagestil des Portfolios bieten Kunden Möglichkeiten zur Wertschöpfung in einem Umfeld, in dem die Bewegungen der Aktienkurse auf die Fundamentaldaten der Unternehmen zurückgehen. Im April und Juni dieses Jahres entwickelte sich das Portfolio überdurchschnittlich – zwei Monate, in denen die Aktienmarktrenditen breit aufgestellt waren.
  - Die relative Wertentwicklung profitierte von der Einzeltitelauswahl in den Sektoren Basiskonsumgüter, Finanzen, Gesundheitswesen, Industrie, Werkstoffe und Versorgung.
  - Dem Portfolio kamen übergewichtete Positionen in den Sektoren Kommunikationsdienste und Nicht-Basiskonsumgüter zugute, aber auch untergewichtete Positionen in den Sektoren Energie und Gesundheitswesen.
- Negativbeiträge zur relativen Gesamtrendite:
  - Die Übergewichtung des Portfolios im Finanzsektor schadete der Wertentwicklung ebenso wie die Einzeltitelauswahl in den Sektoren Kommunikationsdienste und Nicht-Basiskonsumgüter.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Am Ende des Berichtszeitraums war das Portfolio voll investiert – mit einer transaktionsbedingten Barposition von rund 1,0 %.
- Das Portfolio beschloss den Berichtszeitraum mit einer Übergewichtung in den Sektoren Nicht-Basiskonsumgüter, Finanzen und Werkstoffe. Das Portfolio beendete den Berichtszeitraum mit einer Untergewichtung in den Sektoren Gesundheitswesen und Informationstechnologie. Im Immobiliensektor war es nicht engagiert.

Der Kern unseres Anlageprozesses ist ein konsequenter Fokus auf der Generierung eines freien Cashflows bei einem Unternehmen und seine Verwendung durch die Unternehmensleitung. Wir sind der Meinung, dass der freie Cashflow der bessere Maßstab für die Wertschöpfung als die Gewinn- und Verlustrechnung ist, die durch diverse Buchhaltungsmethoden beeinflusst werden kann. Unsere Analyse berücksichtigt die Stabilität und die Treiber des freien Cashflows sowie die Verwendungsmöglichkeiten für dieses Kapital. Dieser Anlageschwerpunkt gibt uns die Möglichkeit, Chancen in allen Sektoren, Marktkapitalisierungs- und Risikoprofillkategorien auszumachen.

Wir wenden weiterhin ein diszipliniertes fundamentales Research zur Ermittlung qualitativ hochwertiger Geschäftsmodelle mit attraktiven freien Cashflow-Merkmalen, die zu überzeugenden Bewertungen gehandelt werden, an. Während sich die Aktienmärkte auf gemäßigte Wirtschaftswachstumserwartungen einstellen, trauen wir unserer Anlagestrategie zu, das dynamische Marktumfeld effektiv zu bewältigen und langfristig Wert für unsere Kunden zu erwirtschaften. Lieferketten mit Schwierigkeiten, Inflationsdruck, höhere Zinsen und laufende Veränderungen im Verbraucherverhalten ermöglichen es Unternehmen, sich mit unternehmensspezifischen Lösungen von Wettbewerbern abzuheben. Die Tiefe unseres Wissensarchivs und Erfahrungsschatzes bleibt robust.

Wir identifizieren weiterhin attraktive Anlagemöglichkeiten, während sich die Bedingungen am Aktienmarkt weiterentwickeln. Da sich die Anleger in letzter Zeit auf Large-Caps aus dem Growth-Segment und technologieorientierte Unternehmen fokussieren, geraten unseres Erachtens viele Marktbereiche und bestimmte Unternehmen aus dem Blickfeld. Das eröffnet unserer Ansicht nach die Chance, differenzierte, idiosynkratische Anlagemöglichkeiten ausfindig zu machen. Überdies sehen wir in der robusten US-Wirtschaft und der nachlassenden Inflation vorteilhafte Rahmenbedingungen für Aktien. Wir halten weiter an unserer Disziplin fest und fokussieren uns auch künftig auf unternehmensspezifische Chancen. Wir sind überzeugt, dass das Portfolio gut positioniert ist, um von einem zunehmenden Fokus auf den zugrunde liegenden Fundamentaldaten zu profitieren.

Da wir sowohl potenzielle neue Portfoliositionen als auch aktuelle Bestände bewerten, werden wir dies auch in Zukunft unter Berücksichtigung einer langfristigen Anlageperspektive tun. Unser Schwerpunkt liegt stets auf darauf, das Vermögen unserer Kunden durch die disziplinierte Anwendung unserer Anlagephilosophie und unseres Anlageverfahrens zu steigern.

## US Real Estate Securities – Bericht des Investment-Managers

Für den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 2,42 %. Der als Benchmark dienende FTSE Nareit All Equity REITs Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der „Index“) verbuchte im selben Zeitraum 2,32 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Der Aktienmarkt legte im sechsmonatigen Berichtszeitraum kräftig zu.
- Der Markt überwand mehrere Widerstände, darunter anhaltend hohe Inflation und eine weitere Zinserhöhung seitens der US-Notenbank Federal Reserve (die „Fed“), Sorgen, die Weltwirtschaft könnte in eine Rezession abgleiten, kontroverse Verhandlungen um die Schuldenobergrenze, Turbulenzen in der Regionalbankenbranche und verschiedene geopolitische Entwicklungen.
- Die Anleger waren generell positiv gestimmt, da sich die Wirtschaft robust zeigte, die Inflation nachgab und mehrere der Unsicherheitsfaktoren, die auf dem Markt lasteten, ausgeräumt werden konnten.
- Insgesamt rentierte der S&P 500 Index für Large-Cap-Aktien im Berichtszeitraum 16,60 %. Der Index kam demgegenüber auf 2,32 %. Immobilienwertpapiere wurden durch steigende Zinsen beeinträchtigt.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf seine Wertentwicklung auswirkten.

- Positivbeiträge zur relativen Gesamtrendite:
  - Die Einzeltitelauswahl im Sektor Spezialobjekte.
  - Die Einzeltitelauswahl im Wohnungssektor.
  - Die Untergewichtungen in den Sektoren Büroraum und diversifizierte Immobilien.
- Negativbeiträge zur relativen Gesamtrendite:
  - Die Einzeltitelauswahl bei Datenzentren.
  - Die Einzeltitelauswahl bei Einkaufszentren.
  - Die Untergewichtung in Datenzentren und die Übergewichtung in Infrastruktur-REITS.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Der Sektorpositionierung des Portfolios lag überwiegend eine Bottom-up-Einzeltitelauswahl zugrunde. Am Ende des Berichtszeitraums bestanden die größte Übergewichtungen im Verhältnis zum Index in den Sektoren Selbsteinlagerung und Fertighäuser. Die im Portfolio gegenüber dem Index am stärksten untergewichteten Sektoren waren Büroraum und Datenzentren.

Die Pleiten von Regionalbanken schürten die Sorge, dass in den USA die Fähigkeit der Regionalbanken leiden dürfte, Kredite an den Immobiliensektor zu vergeben. Außerdem sorgten jüngste Ausfälle bei Kreditnehmern aus dem Büroraumsektor für eine insgesamt eher schlechte Stimmung in Bezug auf den US-Gewerbeimmobiliensektor. Der Effekt auf den Markt für börsennotierte REITs dürfte nicht besonders ausgeprägt sein, da REITs überwiegend in hochwertige Vermögenswerte investiert sind, solide Bilanzen aufweisen und in aller Regel mit größeren Banken zusammenarbeiten. REITs werden allerdings weiterhin durch negative Schlagzeilen belastet, die einen anderen Eindruck erwecken. Erhöhte Kapitalkosten, gepaart mit fundamentaler Abschwächung, dürften sich unserer Ansicht nach für REITs auf die Gesamtnachfrage und das Gewinnwachstum auswirken. Die meisten REITs sind auf eine erhebliche Störung der Nachfrage vorbereitet, mit starken Bilanzen, einer relativ geringen Neubautätigkeit und verschiedenen Nachfragefaktoren, die eher defensiven Charakters sind. Der makroökonomische Hintergrund könnte die Aktien unseres Erachtens zwar weiterhin belasten, doch wir fokussieren uns nach wie vor auf ausgewählte Unternehmen mit besseren Fundamentaldaten, vielfältigen Nachfragetreibern und soliden Bilanzen, die unserer Ansicht nach stärkere Marktvolatilität verkraften können.

## US Small Cap – Bericht des Investment-Managers

Für den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 12,03 %. Der als Benchmark dienende Russell 2000 Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der „Index“) verzeichnete im selben Zeitraum ein Plus von 7,85 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Der Aktienmarkt legte im Berichtszeitraum kräftig zu.
- Der Markt überwand im Berichtszeitraum mehrere Widerstände, darunter anhaltend hohe Inflation, eine weitere Zinserhöhung seitens der US-Notenbank Federal Reserve Board (die „Fed“), Sorgen, restriktivere Geldpolitik könnte die Wirtschaft in eine Rezession stürzen, kontroverse Verhandlungen um die Schuldenobergrenze und Turbulenzen in der Regionalbankenbranche. Trotz allem blieb die Konjunktur robust und die Anleger waren allgemein positiv gestimmt, was dem Markt – und besonders Mega-Caps aus dem Technologiesektor – Auftrieb verlieh.
- Insgesamt rentierte der Index 7,85 %, während der S&P 500 Index im Berichtszeitraum auf 16,60 % kam.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf seine Wertentwicklung auswirkten.

- Positivbeiträge zur relativen Gesamrendite:
  - Die Einzeltitelauswahl im Gesundheitswesen (angeführt von Life Science Tools und Dienstleistungen).
  - Die Einzeltitelauswahl im Sektor Fachhandel (angeführt vom Fachhandel).
  - Die Einzeltitelauswahl im Sektor Informationstechnologie (angeführt von Software) sowie eine Übergewichtung in diesem Sektor.
- Negativbeiträge zur relativen Gesamrendite:
  - Die Einzeltitelauswahl im Finanzsektor (getrieben von Banken).
  - Die Einzeltitelauswahl im Industriesektor (getrieben vom Maschinenbau).
  - Die Einzeltitelauswahl im Sektor Kommunikationsdienste (getrieben vom Mediensegment).

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Wir nahmen im Berichtszeitraum etliche geringfügige Anpassungen vor. Der Sektorpositionierung des Portfolios liegt die Bottom-up-Einzeltitel zugrunde. Am Ende des Berichtszeitraums bestanden die größte Übergewichtungen im Verhältnis zum Index in den Sektoren Informationstechnologie und Industrie. Die im Portfolio gegenüber dem Index am stärksten untergewichteten Sektoren waren Immobilien und Finanzen. Die Fed bleibt voll und ganz auf die Wiederherstellung der Preisstabilität fokussiert mit dem Ziel, die Nachfrage zu drosseln, um die Inflation unter Kontrolle zu bringen. In den letzten Monaten fiel der Inflationsausblick durchwachsen aus. Manche zukunftsweisenden Indikatoren sprachen für eine Abkühlung der Konjunktur, verschiedene allgemeine makroökonomische Daten dagegen für weitere wirtschaftliche Widerstandskraft. Angesichts dessen lautet die Botschaft der Fed nach wie vor, dass die zinspolitischen Zügel möglicherweise noch angezogen werden müssen. Es gibt Anzeichen für mindestens noch eine weitere Zinserhöhung in diesem Jahr. Mit Blick auf diesen Hintergrund reagieren die Aktienmärkte weiterhin höchst empfindlich auf eingehende Daten zur Inflation. Etwas distanzierter betrachtet wird offensichtlich, dass die Märkte inzwischen ganz anderen Regeln unterliegen als in den letzten zehn Jahren. Es herrscht wieder Risikoaversion, der Zugang zu Finanzmitteln ist schwieriger geworden, und die Kapitalkosten haben spürbar zugenommen. Darüber hinaus könnten die jüngsten Entwicklungen im Bankensektor eine weitere Verschärfung der Finanzierungsbedingungen bewirken, wenn die Kreditvergabestandards strenger werden. Die Gefahr einer Rezession ist in den USA und weltweit gestiegen, doch dass sie eintritt, steht keinesfalls fest.

Da die makroökonomische Entwicklung unsicher ist, versuchen wir, das Portfolio weiterhin ausgewogen aufzustellen. Wir sind nach wie vor zuversichtlich, dass unser qualitativ hochwertiges Portfolio aus Unternehmen mit attraktiven Finanzmerkmalen, differenzierten und beständigen Geschäftsmodellen und nachhaltigen Ertragssteigerungen gut aufgestellt ist, um diese unsicheren Zeiten zu überstehen und überdurchschnittliche risikobereinigte Ergebnisse zu liefern.



## US Small Cap Intrinsic Value – Bericht des Investment-Managers

Für den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD 18,93 %. Der als Benchmark dienende Russell 2000 Value Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) verzeichnete im selben Zeitraum ein Plus von 2,17 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Die Wertentwicklung im bisherigen Jahresverlauf begünstigte Aktien mit höherer Marktkapitalisierung und Wachstumswerte. Finanztitel, Value-Aktien und kleinere Unternehmen hinken weiter hinterher.
- Zweifelsohne haben die Regionalbankenkrise und Rezessionsängste das Vertrauen in den Bankensektor unterhöhlt, während die Aufwärtsbewegung der Zinsen Dividenden ausschüttenden REITs in die Parade gefahren ist. Andererseits liegt der Begeisterung für Technologie- und Wachstumswerte die Zuversicht der Anleger mit Blick auf Anwendungen künstlicher Intelligenz („KI“) wie Chat GPT zugrunde, die nach Ansicht vieler eine neue Welle der Innovation und des Wachstums einläuten werden.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf seine Wertentwicklung auswirkten.

- Positivbeiträge zur relativen Gesamtrendite:
  - Unsere Übergewichtung in Technologie und die Unterinvestition in Banken und REITs leistet uns gute Dienste.
  - Mit Blick auf ertragsstärkere Positionen stechen mehrere Portfoliounternehmen heraus, die gut aufgestellt sind, um von populären Themen zu profitieren. Rambus etwa von dem Eindruck, dass KI-Anwendungen schnellere Verarbeitung erfordern. Saubere Energie wird die Nachfrage nach Wasserstoff und den Bedarf an effizienteren Stromnetzen (KBR und Itron) antreiben und die wachsende Popularität des Gaming-Sektors, ob bei Onlinespielen oder im Kasino, wird International Game Technology zugutekommen.
- Negativbeiträge zur relativen Gesamtrendite:
  - Trotz der KI-Manie haben sich aber nicht alle unsere Technologieunternehmen gut entwickelt. Im Quartal wuchs die Besorgnis um Überbestellungen bei Technologie-Hardware und -Systemen, um eine Abschwächung der Investitionen in Datenzentren und um den Abbau von Auftragsbeständen. Diese Ängste belasteten die Aktien von Ciena, MACOM Technology Solutions, Infinera und Ribbon Communications.
  - Im Berichtszeitraum kam uns unser bescheidenes Engagement in Regionalbanken teuer zu stehen.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Im Berichtszeitraum waren insgesamt fünf Neuzugänge und vier Abgänge zu verzeichnen.
- In den zurückliegenden Quartalen waren wir mehr mit der Neugewichtung bestehender Positionen beschäftigt als mit der Aufnahme neuer Titel oder der Neuausrichtung unseres Sektorengagements. Wäre der Konjunkturausblick klarer, würden wir entschlossener vorgehen, doch offen gestanden lagen die meisten Ökonomen und Investmentstrategen, auf die wir im letzten Jahr gehört haben, falsch. Das Wirtschaftswachstum überrascht weiter positiv, die Gewinne fielen robuster aus als erwartet und die Arbeitsmarktlage ist nach wie vor solide. Die große Unbekannte ist der Inflationsausblick. Das Schlimmste ist zwischenzeitlich zwar überstanden, doch eine Verbesserung vom aktuellen Niveau, das derzeit knapp unter 5 % liegt, auf das von der US-Notenbank vorgegebene Ziel von 2 % könnte schwer erreichbar sein.
- Wir bleiben weiter im Dialog mit den Verwaltungsratsgremien und Managementteams mehrerer Portfoliounternehmen, die noch keine positiven Erträge erzielen, aber mit erheblichem Abschlag auf unsere Schätzungen ihres intrinsischen Werts gehandelt werden. Tendenziell versuchen wir, konstruktive Empfehlungen zu den Botschaften des Unternehmens zu erteilen. Ein besonderer Schwerpunkt liegt dabei auf der Festlegung langfristiger Finanzziele und der Unterstützung der Unternehmen bei der Formulierung besserer Erklärungen für Situationen, die Anlegern komplex oder verwirrend vorkommen können. Außerdem decken wir gegebenenfalls kurzfristigen Finanzierungsbedarf, um Unternehmen beim Turnaround zu helfen. Wir sind nach wie vor vorsichtig optimistisch, dass sich daraus Alpha realisieren lässt. Offen gesagt ist aber noch Geduld gefragt. Turnarounds haben in der Regel in früheren Phasen eines Konjunkturzyklus größere Erfolgchancen als in späteren, und die laufende Expansion ist bereits recht fortgeschritten.

Im Rückblick ist die Verunsicherung, die viele von uns empfinden, nichts Neues. Trotz aller Verbitterung und Spannungen Ende der 1960er- und in den 1970er-Jahren haben es die Welt und unser Land irgendwie geschafft, voranzukommen, und die Aktienmärkte verzeichneten einen drastischen Wertzuwachs. Hätten Sie damals der negativen Stimmung nachgegeben und den Schwerpunkt in Ihren Portfolios von Aktien auf festverzinsliche Wertpapiere verschoben, hätte das verheerende Folgen gehabt. Eine Anlage von 10.000 US-Dollar in Aktien ist im Zeitraum vom 1. Januar 1976 bis zum 30. Juni 2023 fast neunmal stärker gewachsen, als wenn derselbe Betrag in festverzinsliche Wertpapiere investiert worden wäre. Wir wollen die aktuellen Probleme keinesfalls kleinreden, und wir können auch nicht sicher sagen, ob die Markt-Rally des ersten Halbjahrs 2023 eine Bärenfalle ist oder der Beginn eines neuen Bullenmarktes. Doch auf unserem Schlingerkurs zwischen Krieg, Bankenkrise und Inflation wird es Gewinner und Verlierer geben, und in den meisten Fällen zahlen sich die eingegangenen Risiken und die Volatilität für geduldige, disziplinierte Anleger aus.

Erfreut stellen wir fest, dass sich das Portfolio vom letzten Jahr erholt, und sind weiterhin vorsichtig optimistisch, dass viele Portfoliounternehmen nach wie vor klar unterbewertet sind. Wir freuen uns auf unsere nächste Mitteilung und verschreiben uns wie immer engagiert der Aufgabe, Ihr bei uns angelegtes Kapital mit einer attraktiven langfristigen Rate zu mehren.

## 5G Connectivity - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der<br>Anteile                              | Wertpapierbezeichnung                        | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------------------|------------------------------|
| <b>Aktien 97,55 % (31. Dezember 2022: 95,96 %)</b> |  |                    |                              |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi</b>                  |  |                    |                              |
| 6.178.500  | Foxconn Industrial Internet Co Ltd Class A   | 21.399.935         | 2,03                         |
| 1.158.915  | Shenzhen Inovance Technology Co Ltd Class A  | 10.257.023         | 0,98                         |
| 977.600  | Sungrow Power Supply Co Ltd Class A          | 15.724.122         | 1,50                         |
|  | <b>Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt</b>  | <b>47.381.080</b>  | <b>4,51</b>                  |
| <b>Euro</b>  |  |                    |                              |
| 62.806   | ASM International NV                         | 26.610.264         | 2,53                         |
| 27.832   | ASML Holding NV                              | 20.131.804         | 1,91                         |
| 101.129  | BE Semiconductor Industries NV               | 10.955.942         | 1,04                         |
| 794.644  | Deutsche Telekom AG                          | 17.318.325         | 1,65                         |
| 560.416  | Infineon Technologies AG                     | 23.102.272         | 2,20                         |
|  | <b>Euro insgesamt</b>                        | <b>98.118.607</b>  | <b>9,33</b>                  |
| <b>Japanischer Yen</b>                             |  |                    |                              |
| 257.600  | Advantest Corp                               | 34.636.989         | 3,29                         |
| 172.600  | Disco Corp                                   | 27.319.600         | 2,60                         |
| 31.700   | Keyence Corp                                 | 15.037.456         | 1,43                         |
| 195.800  | Sony Group Corp                              | 17.645.558         | 1,68                         |
| 266.800  | TDK Corp                                     | 10.389.214         | 0,99                         |
|  | <b>Japanischer Yen insgesamt</b>             | <b>105.028.817</b> | <b>9,99</b>                  |
| <b>Neuer taiwanesischer Dollar</b>                 |  |                    |                              |
| 3.947.000  | Quanta Computer Inc                          | 19.276.614         | 1,83                         |
| 1.852.000  | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd    | 34.212.613         | 3,26                         |
| 8.469.000  | Wistron Corp                                 | 24.710.559         | 2,35                         |
|  | <b>Neuer taiwanesischer Dollar insgesamt</b> | <b>78.199.786</b>  | <b>7,44</b>                  |
| <b>Südkoreanischer Won</b>                         |  |                    |                              |
| 181.478  | SK Hynix Inc                                 | 15.945.457         | 1,51                         |
|  | <b>Südkoreanischer Won insgesamt</b>         | <b>15.945.457</b>  | <b>1,51</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>                                   |  |                    |                              |
| 331.715  | Advanced Micro Devices Inc                   | 37.785.656         | 3,59                         |
| 166.228  | Amazon.com Inc                               | 21.669.482         | 2,06                         |
| 109.349  | Analog Devices Inc                           | 21.302.279         | 2,03                         |
| 56.556   | Apple Inc                                    | 10.970.167         | 1,04                         |
| 171.063  | Arista Networks Inc                          | 27.722.470         | 2,64                         |
| 4.034  | Booking Holdings Inc                         | 10.893.131         | 1,04                         |
| 37.855   | Broadcom Inc                                 | 32.836.563         | 3,12                         |
| 69.252   | Cadence Design Systems Inc                   | 16.240.979         | 1,54                         |

## 5G Connectivity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile  | Wertpapierbezeichnung        | Zeitwert US\$        | % des Nettovermögens |
|---|------------------------------|----------------------|----------------------|
| <b>Aktien 97,55% (31. Dezember 2022: 95,96 %) (Fortsetzung)</b> |                              |                      |                      |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>                                  |                              |                      |                      |
| 202.770   | Dexcom Inc                   | 26.057.973           | 2,48                 |
| 14.872  | Enphase Energy Inc           | 2.490.763            | 0,24                 |
| 226.556   | Fortinet Inc                 | 17.125.368           | 1,63                 |
| 43.978  | Globant SA                   | 7.903.726            | 0,75                 |
| 63.906  | HubSpot Inc                  | 34.003.743           | 3,23                 |
| 32.038  | Keysight Technologies Inc    | 5.364.763            | 0,51                 |
| 32.623  | Lam Research Corp            | 20.972.022           | 2,00                 |
| 7.363   | MercadoLibre Inc             | 8.722.210            | 0,83                 |
| 96.590  | Meta Platforms Inc Class A   | 27.719.398           | 2,64                 |
| 115.763   | Microsoft Corp               | 39.421.932           | 3,75                 |
| 19.973  | Monolithic Power Systems Inc | 10.790.014           | 1,03                 |
| 25.447  | Netflix Inc                  | 11.209.149           | 1,07                 |
| 107.090   | NVIDIA Corp                  | 45.301.212           | 4,31                 |
| 235.004   | ON Semiconductor Corp        | 22.226.678           | 2,11                 |
| 277.193   | Oracle Corp                  | 33.010.914           | 3,14                 |
| 146.444   | Palo Alto Networks Inc       | 37.417.906           | 3,56                 |
| 120.460   | Salesforce Inc               | 25.448.380           | 2,42                 |
| 71.128  | ServiceNow Inc               | 39.971.802           | 3,80                 |
| 319.757   | Shopify Inc Class A          | 20.656.302           | 1,97                 |
| 318.112   | STMicroelectronics NV        | 15.902.419           | 1,51                 |
| 277.708   | T-Mobile US Inc              | 38.573.641           | 3,67                 |
| 49.391  | Workday Inc Class A          | 11.156.933           | 1,06                 |
|   | <b>US-Dollar insgesamt</b>   | <b>680.867.975</b>   | <b>64,77</b>         |
|   | <b>Aktien insgesamt *</b>    | <b>1.025.541.722</b> | <b>97,55</b>         |
|   | <b>Anlagen insgesamt</b>     | <b>1.025.541.722</b> | <b>97,55</b>         |

### Devisenterminkontrakte 0,08 % (31. Dezember 2022: 1,22 %)

| Geforderter Betrag              | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 1.071.598 AUD                   | 703.149 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 3         | 10.493                         | 0,00                 |
| 1.032.291 AUD                   | 676.483 US\$        | 20.07.2023       | UBS AG                         | 2         | 10.981                         | 0,00                 |
| 1.404.988 AUD                   | 928.094 US\$        | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 6         | 7.573                          | 0,00                 |
| 453.687 US\$                    | 675.254 AUD         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 4         | 3.996                          | 0,00                 |
| 315.882 US\$                    | 467.326 AUD         | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 2         | 4.662                          | 0,00                 |
| 2.164.108 US\$                  | 3.211.691 AUD       | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 22        | 25.256                         | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen CNY</i> |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 33.232 US\$                     | 231.584 CNY         | 20.07.2023       | UBS AG                         | 9         | 1.359                          | 0,00                 |
| 50.637 US\$                     | 354.430 CNY         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 10        | 1.858                          | 0,00                 |

## 5G Connectivity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 0,08 % (31. Dezember 2022: 1,22 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>  |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 5.899.142 €  | 6.363.155 US\$      | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 4         | 77.813                         | 0,01                 |
| 489.428 €  | 527.091 US\$        | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | 7.289                          | 0,00                 |
| 2.430.256 €  | 2.633.139 US\$      | 20.07.2023       | UBS AG                         | 2         | 20.332                         | 0,00                 |
| 6.147.604 €  | 6.622.750 US\$      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 19        | 89.502                         | 0,01                 |
| 5.519.437 US\$   | 5.009.231 €         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 6         | 50.116                         | 0,01                 |
| 940.991 US\$   | 854.108 €           | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 8.435                          | 0,00                 |
| 3.268.119 US\$   | 2.972.340 €         | 20.07.2023       | UBS AG                         | 4         | 22.774                         | 0,00                 |
| 7.742.010 US\$   | 7.012.548 €         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 39        | 85.367                         | 0,01                 |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>  |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 557.620 £  | 697.885 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 5         | 11.123                         | 0,00                 |
| 132.604 £  | 165.863 US\$        | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 2         | 2.741                          | 0,00                 |
| 541.532 £  | 679.908 US\$        | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 3         | 8.644                          | 0,00                 |
| 140.635 £  | 177.854 US\$        | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | 962                            | 0,00                 |
| 11.979.959 £   | 14.966.862 US\$     | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 13        | 265.514                        | 0,03                 |
| 261.963 US\$   | 205.552 £           | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 2         | 605                            | 0,00                 |
| 116.641 US\$   | 91.211 £            | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 668                            | 0,00                 |
| 315.671 US\$   | 247.881 £           | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 4         | 493                            | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen HKD</i>  |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 287.037 HKD  | 36.636 US\$         | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | 2                              | 0,00                 |
| 1.003 HKD  | 128 US\$            | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 2         | 0                              | 0,00                 |
| 38.461 US\$  | 300.554 HKD         | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | 98                             | 0,00                 |
| 525.610 US\$   | 4.112.844 HKD       | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 6         | 646                            | 0,00                 |
| 106.673 US\$   | 833.899 HKD         | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 2         | 233                            | 0,00                 |
| 578.124 US\$   | 4.521.240 HKD       | 20.07.2023       | UBS AG                         | 9         | 1.032                          | 0,00                 |
| 1.795.132 US\$   | 14.050.539 HKD      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 16        | 1.718                          | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>  |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 2.029 SGD  | 1.500 US\$          | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 2         | 0                              | 0,00                 |
| 1.822.361 US\$   | 2.426.832 SGD       | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 5         | 28.122                         | 0,00                 |
| 888.709 US\$   | 1.183.423 SGD       | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | 13.765                         | 0,00                 |
| 623.250 US\$   | 825.701 SGD         | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 12.782                         | 0,00                 |
| 2.449.243 US\$   | 3.292.437 SGD       | 20.07.2023       | UBS AG                         | 8         | 15.035                         | 0,00                 |
| 2.517.077 US\$   | 3.364.873 SGD       | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 49        | 29.312                         | 0,01                 |
| <i>Abgesicherte Klassen ZAR</i>  |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 1.064 US\$   | 20.000 ZAR          | 05.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 1         | 5                              | 0,00                 |
| 10.215 ZAR   | 516 US\$            | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 24                             | 0,00                 |
| 158.734 ZAR  | 8.236 US\$          | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 6         | 152                            | 0,00                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>20</sup></b> |                     |                  |                                |           | <b>821.482</b>                 | <b>0,08</b>          |

## 5G Connectivity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

|  | Zeitwert<br>US\$     | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|----------------------|------------------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> | <b>1.026.363.204</b> | <b>97,63</b>                 |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,19 %) (31. Dezember 2022: (0,33 %))

| Geforderter Betrag              | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 1.434.643 AUD                   | 970.323 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 6         | (14.909)                        | (0,00)               |
| 327.007 AUD                     | 223.528 US\$        | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 2         | (5.754)                         | (0,00)               |
| 19.501.905 AUD                  | 13.141.567 US\$     | 20.07.2023       | UBS AG                         | 2         | (154.089)                       | (0,02)               |
| 1.165.479 AUD                   | 781.409 US\$        | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 14        | (5.248)                         | (0,00)               |
| 229.942 US\$                    | 351.643 AUD         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 2         | (4.239)                         | (0,00)               |
| 365.355 US\$                    | 551.382 AUD         | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (1.843)                         | (0,00)               |
| 347.566 US\$                    | 527.913 AUD         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 7         | (4.001)                         | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen CNY</i> |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 3.083.008 CNY                   | 450.123 US\$        | 20.07.2023       | UBS AG                         | 12        | (25.808)                        | (0,00)               |
| 302.074 CNY                     | 42.824 US\$         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 7         | (1.250)                         | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 582.770 €                       | 636.595 US\$        | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 1         | (298)                           | (0,00)               |
| 5.109.849 €                     | 5.618.210 US\$      | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 6         | (39.030)                        | (0,01)               |
| 1.083.432 €                     | 1.183.384 US\$      | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | (440)                           | (0,00)               |
| 84.734.402 €                    | 93.314.891 US\$     | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 26        | (797.763)                       | (0,08)               |
| 2.168.533 US\$                  | 2.007.351 €         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | (23.190)                        | (0,00)               |
| 2.063.828 US\$                  | 1.901.653 €         | 20.07.2023       | UBS AG                         | 2         | (12.489)                        | (0,00)               |
| 3.119.290 US\$                  | 2.890.061 €         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 40        | (36.220)                        | (0,01)               |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 101.495 £                       | 130.073 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | (1.023)                         | (0,00)               |
| 112.628 £                       | 143.926 US\$        | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (721)                           | (0,00)               |
| 40.276 £                        | 51.313 US\$         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 2         | (103)                           | (0,00)               |
| 325.683 US\$                    | 259.182 £           | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | (3.864)                         | (0,00)               |
| 235.616 US\$                    | 187.172 £           | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 2         | (2.371)                         | (0,00)               |
| 621.072 US\$                    | 497.613 £           | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 2         | (11.637)                        | (0,00)               |
| 95.340 US\$                     | 75.945 £            | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | (1.224)                         | (0,00)               |
| 1.422.050 US\$                  | 1.141.113 £         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 21        | (28.861)                        | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen HKD</i> |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 4.744.233 HKD                   | 606.467 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 6         | (912)                           | (0,00)               |
| 934.863 HKD                     | 119.452 US\$        | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (126)                           | (0,00)               |
| 6.317.874 HKD                   | 807.684 US\$        | 20.07.2023       | UBS AG                         | 10        | (1.268)                         | (0,00)               |
| 52.690.263 HKD                  | 6.744.357 US\$      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 22        | (18.954)                        | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i> |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 675.434 SGD                     | 504.909 US\$        | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 2         | (5.537)                         | (0,00)               |

## 5G Connectivity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (0,19 %) (31. Dezember 2022: (0,33 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen SGD (Fortsetzung)</i>                                    |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 273.142 SGD  | 204.351 US\$        | 20.07.2023       | Citibank NA                 | 1         | (2.408)                         | (0,00)               |
| 2.633.012 SGD  | 1.957.514 US\$      | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 4         | (10.839)                        | (0,00)               |
| 44.759.184 SGD   | 33.839.332 US\$     | 20.07.2023       | UBS AG                      | 6         | (747.354)                       | (0,07)               |
| 4.331.603 SGD  | 3.231.661 US\$      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 43        | (29.162)                        | (0,00)               |
| 288.822 US\$   | 390.731 SGD         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 5         | (59)                            | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen ZAR</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 73 US\$  | 1.403 ZAR           | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 1         | (1)                             | (0,00)               |
| 25.000 ZAR   | 1.382 US\$          | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank     | 1         | (61)                            | (0,00)               |
| 1.219.093 ZAR  | 65.667 US\$         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 8         | (1.235)                         | (0,00)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                             |           | <b>(1.994.291)</b>              | <b>(0,19)</b>        |

|   | Zeitwert US\$        | % des Nettovermögens |
|---|----------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(1.994.291)</b>   | <b>(0,19)</b>        |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>1.024.368.913</b> | <b>97,44</b>         |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>26.860.188</b>    | <b>2,56</b>          |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>1.051.229.101</b> | <b>100,00</b>        |

| Portfolioanalyse  | US\$                 | % des Gesamtvermögens |
|---|----------------------|-----------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 1.025.541.722        | 96,59                 |
| <sup>∞</sup> OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente  | (1.172.809)          | (0,11)                |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>1.024.368.913</b> | <b>96,48</b>          |

## Absolute Return Multi Strategy - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der Anteile                               | Wertpapierbezeichnung          | Zeitwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------------|------------------|---------------------------|
| <b>Aktien 0,00 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)</b> |                                |                  |                           |
| <b>US-Dollar</b>                                 |                                |                  |                           |
| 12.622   | Achillion Pharmaceuticals Inc* | 6.311            | 0,00                      |
| 1.356  | Clementia Pharmaceuticals Inc† | 0                | 0,00                      |
| 17.768   | Fresh Market Escrow Inc†       | 0                | 0,00                      |
| 1.250  | Tobira Therapeutics Inc†       | 0                | 0,00                      |
| <b>Aktien insgesamt</b>                          |                                | <b>6.311</b>     | <b>0,00</b>               |
| <b>Anlagen insgesamt</b>                         |                                | <b>6.311</b>     | <b>0,00</b>               |

|  | Zeitwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens |
|--|------------------|---------------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> | <b>6.311</b>     | <b>0,00</b>               |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>           | <b>6.311</b>     | <b>0,00</b>               |
| <b>Sonstige Nettoverbindlichkeiten</b>   | <b>(6.311)</b>   | <b>(0,00)</b>             |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                | <b>0</b>         | <b>00,00</b>              |

| Portfolioanalyse  | US\$         | % des Gesamtver-<br>mögens |
|---|--------------|----------------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 6.311        | 6,10                       |
| † Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente  | 0            | 0,00                       |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>6.311</b> | <b>6,10</b>                |

## Asian Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 72,24 % (31. Dezember 2022: 83,65 %)</b> |   |        |                       |                  |                              |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi</b>                                |   |        |                       |                  |                              |
| 320.000  | Bank of Chengdu Co Ltd*   | 0,40 % | 03.03.2028            | 51.424           | 0,08                         |
| 975.000  | China Southern Airlines Co Ltd*   | 0,60 % | 15.10.2026            | 167.957          | 0,27                         |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt</b>                      |   |        |                       | <b>219.381</b>   | <b>0,35</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 200.000  | Adani Green Energy Ltd*   | 4,38 % | 08.09.2024            | 184.984          | 0,30                         |
| 200.000  | Adani Green Energy UP Ltd/Prayatna Developers Pvt Ltd/Parampujya Solar Energ* | 6,25 % | 10.12.2024            | 191.959          | 0,31                         |
| 200.000  | Adani Ports & Special Economic Zone Ltd*                                      | 4,20 % | 04.08.2027            | 170.929          | 0,28                         |
| 400.000  | Agile Group Holdings Ltd**  | 5,75 % | 02.01.2025            | 122.952          | 0,20                         |
| 200.000  | Agile Group Holdings Ltd*   | 8,38 % | 29.12.2049            | 25.331           | 0,04                         |
| 200.000  | AIA Group Ltd*  | 2,70 % | 29.12.2049            | 178.008          | 0,29                         |
| 200.000  | AIA Group Ltd*  | 3,20 % | 16.09.2040            | 153.555          | 0,25                         |
| 400.000  | AIA Group Ltd**   | 4,95 % | 04.04.2033            | 400.411          | 0,65                         |
| 200.000  | AIA Group Ltd*  | 5,63 % | 25.10.2027            | 205.120          | 0,33                         |
| 200.000  | Alibaba Group Holding Ltd*  | 2,13 % | 09.02.2031            | 162.965          | 0,26                         |
| 300.000  | Alibaba Group Holding Ltd*  | 2,70 % | 09.02.2041            | 200.632          | 0,32                         |
| 200.000  | Alibaba Group Holding Ltd*  | 3,40 % | 06.12.2027            | 186.084          | 0,30                         |
| 200.000  | Alibaba Group Holding Ltd*  | 4,00 % | 06.12.2037            | 167.804          | 0,27                         |
| 400.000  | Axis Bank Ltd*  | 4,10 % | 29.12.2049            | 350.029          | 0,56                         |
| 400.000  | Bangkok Bank PCL**  | 3,73 % | 25.09.2034            | 339.560          | 0,55                         |
| 200.000  | Bangkok Bank PCL*   | 4,30 % | 15.06.2027            | 194.525          | 0,31                         |
| 200.000  | Bangkok Bank PCL**  | 5,00 % | 29.12.2049            | 189.724          | 0,31                         |
| 400.000  | Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT**  | 3,75 % | 30.03.2026            | 370.515          | 0,60                         |
| 200.000  | Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT*   | 4,30 % | 29.12.2049            | 165.751          | 0,27                         |
| 250.000  | Bank of East Asia Ltd*  | 4,00 % | 29.05.2030            | 231.738          | 0,37                         |
| 200.000  | BOC Aviation Ltd*   | 1,75 % | 21.01.2026            | 180.624          | 0,29                         |
| 200.000  | BOC Aviation Ltd*   | 2,63 % | 17.09.2030            | 170.631          | 0,28                         |
| 200.000  | BOC Aviation Ltd*   | 3,00 % | 11.09.2029            | 175.957          | 0,28                         |
| 200.000  | BOC Aviation Ltd**  | 3,50 % | 10.10.2024            | 193.503          | 0,31                         |
| 200.000  | BOC Aviation Ltd*   | 4,50 % | 23.05.2028            | 193.432          | 0,31                         |
| 200.000  | BOC Aviation USA Corp*  | 1,63 % | 29.04.2024            | 192.996          | 0,31                         |
| 200.000  | CAS Capital No 1 Ltd*   | 4,00 % | 29.12.2049            | 166.100          | 0,27                         |
| 400.000  | CCBL Cayman 1 Corp Ltd*   | 1,99 % | 21.07.2025            | 368.962          | 0,60                         |
| 200.000  | CDBL Funding 2*   | 2,00 % | 04.03.2026            | 182.036          | 0,29                         |
| 200.000  | Celestial Miles Ltd*  | 5,75 % | 29.12.2049            | 197.510          | 0,32                         |
| 200.000  | China Cinda Finance 2017 I Ltd*   | 4,75 % | 08.02.2028            | 191.953          | 0,31                         |
| 400.000  | China Cinda Finance 2017 I Ltd**  | 4,75 % | 21.02.2029            | 377.598          | 0,61                         |
| 400.000  | China Construction Bank Corp*   | 2,45 % | 24.06.2030            | 374.112          | 0,60                         |
| 400.000  | China Construction Bank Corp*   | 4,50 % | 31.05.2026            | 394.870          | 0,64                         |
| 400.000  | China SCE Group Holdings Ltd*   | 7,00 % | 02.05.2025            | 58.000           | 0,09                         |



## Asian Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                          | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 72,24 % (31. Dezember 2022: 83,65 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |        |                       |                  |                              |
| 500.000  | Chinalco Capital Holdings Ltd*                 | 2,13 % | 03.06.2026            | 451.691          | 0,73                         |
| 200.000  | CICC Hong Kong Finance 2016 MTN Ltd*           | 5,49 % | 01.03.2026            | 199.517          | 0,32                         |
| 200.000  | CIFI Holdings Group Co Ltd*                    | 5,95 % | 20.10.2025            | 23.188           | 0,04                         |
| 200.000  | CK Hutchison International 21 Ltd*             | 2,50 % | 15.04.2031            | 169.488          | 0,27                         |
| 200.000  | CK Hutchison International 23 Ltd**            | 4,75 % | 21.04.2028            | 197.876          | 0,32                         |
| 390.000  | CK Hutchison International 23 Ltd**            | 4,88 % | 21.04.2033            | 386.132          | 0,62                         |
| 400.000  | CLP Power HK Finance Ltd*                      | 3,55 % | 29.12.2049            | 382.993          | 0,62                         |
| 300.000  | CMB International Leasing Management Ltd*      | 1,88 % | 12.08.2025            | 276.813          | 0,45                         |
| 200.000  | CMHI Finance BVI Co Ltd*                       | 5,00 % | 06.08.2028            | 199.946          | 0,32                         |
| 200.000  | Contemporary Ruiding Development Ltd*          | 2,63 % | 17.09.2030            | 168.989          | 0,27                         |
| 186.000  | Continuum Energy Levanter Pte Ltd**            | 4,50 % | 09.02.2027            | 173.445          | 0,28                         |
| 400.000  | Country Garden Holdings Co Ltd*                | 3,13 % | 22.10.2025            | 126.060          | 0,20                         |
| 600.000  | Country Garden Holdings Co Ltd*                | 4,80 % | 06.08.2030            | 173.768          | 0,28                         |
| 200.000  | DBS Group Holdings Ltd**                       | 1,82 % | 10.03.2031            | 179.002          | 0,29                         |
| 200.000  | DBS Group Holdings Ltd*                        | 3,30 % | 29.12.2049            | 189.442          | 0,31                         |
| 400.000  | Dua Capital Ltd*                               | 2,78 % | 11.05.2031            | 343.840          | 0,55                         |
| 400.000  | Elect Global Investments Ltd*                  | 4,10 % | 29.12.2049            | 360.320          | 0,58                         |
| 600.000  | ENN Clean Energy International Investment Ltd* | 3,38 % | 12.05.2026            | 555.910          | 0,90                         |
| 200.000  | ENN Energy Holdings Ltd*                       | 2,63 % | 17.09.2030            | 167.343          | 0,27                         |
| 200.000  | Fortune Star BVI Ltd*                          | 5,95 % | 19.10.2025            | 160.320          | 0,26                         |
| 400.000  | Franshion Brilliant Ltd*                       | 4,25 % | 23.07.2029            | 318.013          | 0,51                         |
| 200.000  | GC Treasury Center Co Ltd*                     | 4,40 % | 30.03.2032            | 180.842          | 0,29                         |
| 400.000  | GENM Capital Labuan Ltd*                       | 3,88 % | 19.04.2031            | 323.947          | 0,52                         |
| 200.000  | Globe Telecom Inc*                             | 4,20 % | 29.12.2049            | 186.250          | 0,30                         |
| 188.000  | Greenko Dutch BV**                             | 3,85 % | 29.03.2026            | 169.227          | 0,27                         |
| 371.000  | Greenko Power II Ltd*                          | 4,30 % | 13.12.2028            | 323.388          | 0,52                         |
| 200.000  | Greenko Solar Mauritius Ltd*                   | 5,95 % | 29.07.2026            | 188.000          | 0,30                         |
| 200.000  | Hana Bank*                                     | 3,25 % | 30.03.2027            | 187.367          | 0,30                         |
| 400.000  | HDFC Bank Ltd**                                | 3,70 % | 29.12.2049            | 347.467          | 0,56                         |
| 200.000  | HKT Capital No 6 Ltd*                          | 3,00 % | 18.01.2032            | 169.051          | 0,27                         |
| 200.000  | Horse Gallop Finance Ltd*                      | 1,10 % | 26.07.2024            | 190.287          | 0,31                         |
| 200.000  | Huarong Finance 2019 Co Ltd*                   | 3,38 % | 24.02.2030            | 151.680          | 0,24                         |
| 300.000  | Huarong Finance 2019 Co Ltd*                   | 4,50 % | 29.05.2029            | 240.753          | 0,39                         |
| 450.000  | Huarong Finance II Co Ltd*                     | 5,50 % | 16.01.2025            | 428.154          | 0,69                         |
| 200.000  | Hyundai Capital America**                      | 5,50 % | 30.03.2026            | 198.291          | 0,32                         |
| 400.000  | Hyundai Capital America**                      | 5,60 % | 30.03.2028            | 398.213          | 0,64                         |
| 200.000  | Hyundai Capital America**                      | 5,68 % | 26.06.2028            | 198.506          | 0,32                         |
| 200.000  | Indian Railway Finance Corp Ltd*               | 2,80 % | 10.02.2031            | 165.350          | 0,27                         |
| 200.000  | Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT*             | 3,40 % | 09.06.2031            | 169.254          | 0,27                         |
| 200.000  | Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT*             | 3,54 % | 27.04.2032            | 168.500          | 0,27                         |

## Asian Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung  | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 72,24 % (31. Dezember 2022: 83,65 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |        |                       |                  |                              |
| 600.000  | Industrial & Commercial Bank of China Ltd <sup>*</sup>                 | 4,88 % | 21.09.2025            | 587.584          | 0,95                         |
| 200.000  | Inventive Global Investments Ltd <sup>*</sup>                          | 1,10 % | 01.09.2024            | 189.150          | 0,30                         |
| 200.000  | Inventive Global Investments Ltd <sup>*</sup>                          | 1,50 % | 15.07.2023            | 199.752          | 0,32                         |
| 200.000  | JD.com Inc <sup>*</sup>  | 3,38 % | 14.01.2030            | 179.613          | 0,29                         |
| 200.000  | JMH Co Ltd <sup>*</sup>  | 2,50 % | 09.04.2031            | 167.716          | 0,27                         |
| 168.000  | JSW Hydro Energy Ltd <sup>*</sup>                                      | 4,13 % | 18.05.2031            | 141.893          | 0,23                         |
| 400.000  | Kasikornbank PCL <sup>*</sup>  | 5,46 % | 07.03.2028            | 400.430          | 0,65                         |
| 200.000  | Khazanah Capital Ltd <sup>**</sup>                                     | 4,88 % | 01.06.2033            | 198.137          | 0,32                         |
| 400.000  | Kookmin Bank <sup>**</sup>   | 2,50 % | 04.11.2030            | 324.950          | 0,52                         |
| 200.000  | Krung Thai Bank PCL <sup>**</sup>                                      | 4,40 % | 29.12.2049            | 184.870          | 0,30                         |
| 200.000  | KT Corp <sup>*</sup>   | 4,00 % | 08.08.2025            | 193.975          | 0,31                         |
| 200.000  | Kyobo Life Insurance Co Ltd <sup>*</sup>                               | 5,90 % | 15.06.2052            | 196.500          | 0,32                         |
| 200.000  | Lenovo Group Ltd <sup>*</sup>  | 3,42 % | 02.11.2030            | 168.672          | 0,27                         |
| 473.000  | Lenovo Group Ltd <sup>*</sup>  | 5,83 % | 27.01.2028            | 472.131          | 0,76                         |
| 200.000  | Lenovo Group Ltd <sup>*</sup>  | 6,54 % | 27.07.2032            | 201.837          | 0,33                         |
| 400.000  | LG Chem Ltd <sup>*</sup>   | 2,38 % | 07.07.2031            | 329.278          | 0,54                         |
| 200.000  | Link Finance Cayman 2009 Ltd <sup>*</sup>                              | 2,75 % | 19.01.2032            | 169.211          | 0,27                         |
| 600.000  | Longfor Group Holdings Ltd <sup>*</sup>                                | 3,95 % | 16.09.2029            | 449.257          | 0,72                         |
| 400.000  | Medco Bell Pte Ltd <sup>*</sup>  | 6,38 % | 30.01.2027            | 374.814          | 0,60                         |
| 200.000  | Medco Oak Tree Pte Ltd <sup>*</sup>                                    | 7,38 % | 14.05.2026            | 196.930          | 0,32                         |
| 300.000  | Meituan <sup>*</sup>   | 3,05 % | 28.10.2030            | 237.846          | 0,38                         |
| 200.000  | Melco Resorts Finance Ltd <sup>**</sup>                                | 5,63 % | 17.07.2027            | 181.385          | 0,29                         |
| 400.000  | Melco Resorts Finance Ltd <sup>*</sup>                                 | 5,75 % | 21.07.2028            | 354.000          | 0,57                         |
| 200.000  | Metropolitan Bank & Trust Co <sup>*</sup>                              | 2,13 % | 15.01.2026            | 183.803          | 0,30                         |
| 300.000  | Minmetals Bounteous Finance BVI Ltd <sup>*</sup>                       | 3,38 % | 29.12.2049            | 290.871          | 0,47                         |
| 200.000  | MTR Corp Ltd <sup>*</sup>  | 1,63 % | 19.08.2030            | 164.374          | 0,27                         |
| 400.000  | Network i2i Ltd <sup>*</sup>   | 5,65 % | 29.12.2049            | 389.500          | 0,63                         |
| 200.000  | New Metro Global Ltd <sup>*</sup>                                      | 4,80 % | 15.12.2024            | 136.930          | 0,22                         |
| 400.000  | NWD Finance BVI Ltd <sup>*</sup>                                       | 5,25 % | 29.12.2049            | 352.600          | 0,57                         |
| 200.000  | NWD MTN Ltd <sup>*</sup>   | 4,13 % | 18.07.2029            | 164.033          | 0,26                         |
| 200.000  | NWD MTN Ltd <sup>*</sup>   | 4,50 % | 19.05.2030            | 165.170          | 0,27                         |
| 200.000  | Oversea-Chinese Banking Corp Ltd <sup>**</sup>                         | 1,83 % | 10.09.2030            | 182.438          | 0,29                         |
| 200.000  | Oversea-Chinese Banking Corp Ltd <sup>*</sup>                          | 4,60 % | 15.06.2032            | 193.910          | 0,31                         |
| 200.000  | PCPD Capital Ltd <sup>*</sup>  | 5,13 % | 18.06.2026            | 160.000          | 0,26                         |
| 200.000  | Periama Holdings LLC <sup>*</sup>                                      | 5,95 % | 19.04.2026            | 192.936          | 0,31                         |
| 1.000.000  | Pertamina Persero PT <sup>*</sup>                                      | 6,50 % | 27.05.2041            | 1.037.710        | 1,67                         |
| 200.000  | Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara <sup>*</sup> | 5,25 % | 24.10.2042            | 178.678          | 0,29                         |
| 700.000  | Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara <sup>*</sup> | 6,15 % | 21.05.2048            | 677.457          | 1,09                         |
| 300.000  | Petronas Capital Ltd <sup>*</sup>                                      | 3,40 % | 28.04.2061            | 214.251          | 0,35                         |
| 200.000  | Philippine National Bank <sup>*</sup>                                  | 3,28 % | 27.09.2024            | 193.790          | 0,31                         |

## Asian Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung  | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 72,24 % (31. Dezember 2022: 83,65 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |        |                       |                  |                              |
| 300.000  | Power Finance Corp Ltd*  | 3,35 % | 16.05.2031            | 251.755          | 0,41                         |
| 300.000  | Power Finance Corp Ltd*  | 3,95 % | 23.04.2030            | 267.072          | 0,43                         |
| 400.000  | Prudential Funding Asia Plc*                                     | 2,95 % | 03.11.2033            | 338.238          | 0,55                         |
| 200.000  | PSA Treasury Pte Ltd*  | 2,25 % | 30.04.2030            | 172.424          | 0,28                         |
| 200.000  | REC Ltd*   | 2,25 % | 01.09.2026            | 178.680          | 0,29                         |
| 200.000  | REC Ltd**  | 5,63 % | 11.04.2028            | 197.887          | 0,32                         |
| 250.000  | Reliance Industries Ltd*   | 2,88 % | 12.01.2032            | 208.645          | 0,34                         |
| 500.000  | Reliance Industries Ltd*   | 3,63 % | 12.01.2052            | 357.343          | 0,58                         |
| 600.000  | ReNew Wind Energy AP2/ReNew Power Pvt Ltd other 9 Subsidiaries** | 4,50 % | 14.07.2028            | 511.912          | 0,83                         |
| 400.000  | RKPF Overseas 2020 A Ltd*  | 5,20 % | 12.01.2026            | 214.605          | 0,35                         |
| 200.000  | Sands China Ltd*   | 4,88 % | 18.06.2030            | 178.230          | 0,29                         |
| 400.000  | Sands China Ltd*   | 5,90 % | 08.08.2028            | 381.660          | 0,62                         |
| 422.000  | SF Holding Investment 2021 Ltd*                                  | 3,13 % | 17.11.2031            | 360.080          | 0,58                         |
| 200.000  | Shanghai Port Group BVI Development 2 Co Ltd*                    | 2,38 % | 13.07.2030            | 172.051          | 0,28                         |
| 400.000  | Shinhan Bank Co Ltd*   | 4,38 % | 13.04.2032            | 364.798          | 0,59                         |
| 525.000  | Shinhan Bank Co Ltd**  | 4,50 % | 12.04.2028            | 512.143          | 0,83                         |
| 200.000  | Shinhan Financial Group Co Ltd*                                  | 3,34 % | 05.02.2030            | 191.549          | 0,31                         |
| 500.000  | Shriram Finance Ltd*   | 4,40 % | 13.03.2024            | 489.287          | 0,79                         |
| 200.000  | Singapore Telecommunications Ltd**                               | 7,38 % | 01.12.2031            | 235.014          | 0,38                         |
| 200.000  | Sinochem Offshore Capital Co Ltd*                                | 2,25 % | 24.11.2026            | 177.525          | 0,29                         |
| 200.000  | Sinochem Offshore Capital Co Ltd*                                | 2,38 % | 23.09.2031            | 158.112          | 0,25                         |
| 200.000  | Sino-Ocean Land Treasure IV Ltd*                                 | 4,75 % | 05.08.2029            | 40.822           | 0,07                         |
| 400.000  | Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd*                     | 2,30 % | 08.01.2031            | 344.700          | 0,56                         |
| 1.100.000  | Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd*                     | 3,10 % | 08.01.2051            | 771.359          | 1,24                         |
| 400.000  | SK Battery America Inc*  | 2,13 % | 26.01.2026            | 351.785          | 0,57                         |
| 400.000  | SK Hynix Inc*  | 2,38 % | 19.01.2031            | 308.769          | 0,50                         |
| 200.000  | SK Hynix Inc*  | 6,38 % | 17.01.2028            | 200.860          | 0,32                         |
| 200.000  | SK Hynix Inc*  | 6,50 % | 17.01.2033            | 202.054          | 0,33                         |
| 200.000  | SK On Co Ltd**   | 5,38 % | 11.05.2026            | 198.410          | 0,32                         |
| 400.000  | Standard Chartered Plc*  | 4,30 % | 29.12.2049            | 290.760          | 0,47                         |
| 200.000  | Standard Chartered Plc*  | 4,75 % | 29.12.2049            | 146.155          | 0,24                         |
| 200.000  | Standard Chartered Plc*  | 6,19 % | 06.07.2027            | 200.130          | 0,32                         |
| 600.000  | Standard Chartered Plc*  | 6,30 % | 09.01.2029            | 603.639          | 0,97                         |
| 784.000  | Standard Chartered Plc*  | 6,30 % | 06.07.2034            | 785.313          | 1,27                         |
| 200.000  | Star Energy Geothermal Darajat II/Star Energy Geothermal Salak*  | 4,85 % | 14.10.2038            | 181.153          | 0,29                         |
| 162.160  | Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd*                         | 6,75 % | 24.04.2033            | 159.362          | 0,26                         |
| 400.000  | State Bank of India*   | 4,88 % | 05.05.2028            | 392.284          | 0,63                         |
| 200.000  | Studio City Finance Ltd*   | 6,00 % | 15.07.2025            | 185.897          | 0,30                         |
| 400.000  | Studio City Finance Ltd*   | 6,50 % | 15.01.2028            | 334.432          | 0,54                         |
| 200.000  | Sun Hung Kai Properties Capital Market Ltd*                      | 2,75 % | 13.05.2030            | 174.278          | 0,28                         |

## Asian Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                       | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|---------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 72,24 % (31. Dezember 2022: 83,65 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                   |                              |
| 200.000  | Sun Hung Kai Properties Capital Market Ltd* | 3,75 %  | 25.02.2029            | 186.532           | 0,30                         |
| 200.000  | Tencent Holdings Ltd*                       | 3,24 %  | 03.06.2050            | 131.392           | 0,21                         |
| 200.000  | Tencent Holdings Ltd*                       | 3,60 %  | 19.01.2028            | 186.228           | 0,30                         |
| 200.000  | Tencent Holdings Ltd**                      | 3,68 %  | 22.04.2041            | 154.997           | 0,25                         |
| 200.000  | Tencent Holdings Ltd*                       | 3,98 %  | 11.04.2029            | 186.037           | 0,30                         |
| 400.000  | Thaioil Treasury Center Co Ltd*             | 3,75 %  | 18.06.2050            | 267.765           | 0,43                         |
| 200.000  | TSMC Arizona Corp*                          | 1,75 %  | 25.10.2026            | 179.481           | 0,29                         |
| 400.000  | TSMC Arizona Corp*                          | 2,50 %  | 25.10.2031            | 335.594           | 0,54                         |
| 500.000  | TSMC Global Ltd*                            | 2,25 %  | 23.04.2031            | 413.529           | 0,67                         |
| 200.000  | United Overseas Bank Ltd*                   | 1,75 %  | 16.03.2031            | 178.045           | 0,29                         |
| 200.000  | United Overseas Bank Ltd*                   | 2,00 %  | 14.10.2031            | 175.809           | 0,28                         |
| 300.000  | United Overseas Bank Ltd*                   | 3,86 %  | 07.10.2032            | 281.211           | 0,45                         |
| 400.000  | Vanke Real Estate Hong Kong Co Ltd*         | 3,98 %  | 09.11.2027            | 361.377           | 0,58                         |
| 400.000  | Vedanta Resources Finance II Plc*           | 8,95 %  | 11.03.2025            | 302.412           | 0,49                         |
| 200.000  | Vedanta Resources Finance II Plc*           | 13,88 % | 21.01.2024            | 182.663           | 0,29                         |
| 200.000  | Woori Bank*                                 | 4,75 %  | 30.04.2024            | 197.110           | 0,32                         |
| 200.000  | Wynn Macau Ltd*                             | 5,50 %  | 01.10.2027            | 178.245           | 0,29                         |
| 400.000  | Wynn Macau Ltd*                             | 5,63 %  | 26.08.2028            | 349.468           | 0,56                         |
| 200.000  | Yanlord Land HK Co Ltd*                     | 5,13 %  | 20.05.2026            | 164.690           | 0,27                         |
| 200.000  | Zhejiang Seaport International Co Ltd*      | 1,98 %  | 17.03.2026            | 181.252           | 0,29                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |   |         |                       | <b>44.562.874</b> | <b>71,89</b>                 |
| <b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>  |   |         |                       | <b>44.782.255</b> | <b>72,24</b>                 |
| <b>Staatsanleihen 18,48 % (31. Dezember 2022: 9,67 %)</b>                      |   |         |                       |                   |                              |
| <b>Euro</b>  |   |         |                       |                   |                              |
| 900.000  | Indonesia Government International Bond     | 1,10 %  | 12.03.2033            | 730.455           | 1,18                         |
| 758.000  | Indonesia Government International Bond     | 1,40 %  | 30.10.2031            | 656.912           | 1,06                         |
| 400.000  | Philippine Government International Bond    | 1,20 %  | 28.04.2033            | 334.531           | 0,54                         |
| <b>Euro insgesamt</b>  |   |         |                       | <b>1.721.898</b>  | <b>2,78</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>   |   |         |                       |                   |                              |
| 200.000  | Airport Authority                           | 2,10 %  | 29.12.2049            | 183.323           | 0,30                         |
| 200.000  | Airport Authority                           | 2,40 %  | 29.12.2049            | 177.109           | 0,29                         |
| 400.000  | Airport Authority                           | 3,25 %  | 12.01.2052            | 310.996           | 0,50                         |
| 300.000  | Airport Authority                           | 4,88 %  | 12.01.2033            | 305.888           | 0,49                         |
| 200.000  | Export-Import Bank of India                 | 2,25 %  | 13.01.2031            | 161.232           | 0,26                         |
| 200.000  | Export-Import Bank of Korea                 | 4,50 %  | 15.09.2032            | 197.076           | 0,32                         |
| 600.000  | Export-Import Bank of Korea                 | 5,00 %  | 11.01.2028            | 602.076           | 0,97                         |
| 300.000  | Indonesia Government International Bond     | 4,85 %  | 11.01.2033            | 299.288           | 0,48                         |
| 500.000  | Indonesia Government International Bond     | 5,25 %  | 17.01.2042            | 500.112           | 0,81                         |

## Asian Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag  | Wertpapierbezeichnung                              | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 18,48 % (31. Dezember 2022: 9,67 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>  |  |        |                       |                   |                              |
| 95.000  | Indonesia Government International Bond            | 7,75 % | 17.01.2038            | 118.966           | 0,19                         |
| 1.100.000   | Indonesia Government International Bond            | 8,50 % | 12.10.2035            | 1.434.433         | 2,31                         |
| 200.000   | Korea Development Bank                             | 4,38 % | 15.02.2028            | 196.127           | 0,32                         |
| 200.000   | Korea Development Bank                             | 4,38 % | 15.02.2033            | 194.569           | 0,31                         |
| 200.000   | Korea Gas Corp                                     | 2,88 % | 16.07.2029            | 178.690           | 0,29                         |
| 200.000   | Korea Gas Corp                                     | 3,88 % | 13.07.2027            | 192.330           | 0,31                         |
| 300.000   | Korea Gas Corp                                     | 4,88 % | 05.07.2028            | 298.746           | 0,48                         |
| 200.000   | Korea Housing Finance Corp                         | 4,63 % | 24.02.2028            | 197.148           | 0,32                         |
| 200.000   | Korea Mine Rehabilitation & Mineral Resources Corp | 1,75 % | 15.04.2026            | 178.392           | 0,29                         |
| 400.000   | Korea Mine Rehabilitation & Mineral Resources Corp | 5,38 % | 11.05.2028            | 394.196           | 0,64                         |
| 1.000.000   | Mongolia Government International Bond             | 5,13 % | 07.04.2026            | 932.478           | 1,50                         |
| 200.000   | Mongolia Government International Bond             | 8,65 % | 19.01.2028            | 201.750           | 0,32                         |
| 500.000   | Philippine Government International Bond           | 6,38 % | 23.10.2034            | 559.288           | 0,90                         |
| 200.000   | Sri Lanka Government International Bond            | 5,75 % | 18.04.2023            | 91.231            | 0,15                         |
| 200.000   | Sri Lanka Government International Bond            | 5,88 % | 25.07.2024            | 93.028            | 0,15                         |
| 400.000   | Sri Lanka Government International Bond            | 6,20 % | 11.05.2027            | 184.163           | 0,30                         |
| 400.000   | Sri Lanka Government International Bond            | 6,35 % | 28.06.2024            | 184.230           | 0,30                         |
| 1.000.000   | Sri Lanka Government International Bond            | 6,83 % | 18.07.2026            | 473.736           | 0,76                         |
| 1.200.000   | Sri Lanka Government International Bond            | 6,85 % | 14.03.2024            | 552.670           | 0,89                         |
| 720.000   | Sri Lanka Government International Bond            | 6,85 % | 03.11.2025            | 343.098           | 0,55                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>9.736.369</b>  | <b>15,70</b>                 |
| <b>Staatsanleihen insgesamt *</b>                                       |  |        |                       | <b>11.458.267</b> | <b>18,48</b>                 |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>56.240.522</b> | <b>90,72</b>                 |

### Devisenterminkontrakte 0,06 % (31. Dezember 2022: 0,16 %)

| Geforderter<br>Betrag   | Zu zahlender<br>Betrag | Fälligkeits-<br>datum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|------------------------|-----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------------|------------------------------|
| 25.787.050 INR  | 313.551 US\$           | 20.07.2023            | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 535                                  | 0,00                         |
| 111.146 US\$  | 3.335.884 TWD          | 06.07.2023            | BNP Paribas                 | 1         | 4.046                                | 0,01                         |
| 312.286 US\$  | 9.586.816 TWD          | 13.07.2023            | Citibank NA                 | 1         | 4.669                                | 0,01                         |
| 312.816 US\$  | 9.583.123 TWD          | 17.07.2023            | Citibank NA                 | 1         | 5.310                                | 0,01                         |
| 724.394 US\$  | 5.155.740 CNY          | 20.09.2023            | Goldman Sachs International | 1         | 10.999                               | 0,02                         |
| 1.763.868 US\$  | 1.606.854 €            | 20.09.2023            | Morgan Stanley              | 1         | 3.885                                | 0,00                         |
| 602.592 US\$  | 4.318.722 CNY          | 20.07.2023            | Morgan Stanley              | 1         | 8.205                                | 0,01                         |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                        |                       |                             |           | <b>37.649</b>                        | <b>0,06</b>                  |

## Asian Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Futures-Kontrakte 0,14 % (31. Dezember 2022: 0,22 %)

| Anzahl Kontrakte  | Beschreibung   | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|--|--------------------------------|----------------------|
| (12)  | Euro-Bund Future September 2023                      | 23.173                         | 0,04                 |
| (38)  | US Treasury 10-Year Note (CBT) Future September 2023 | 60.148                         | 0,10                 |
| 1   | US Treasury Ultra Bond (CBT) Future September 2023   | 469                            | 0,00                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten *</b> |  | <b>83.790</b>                  | <b>0,14</b>          |

### Zinsswap-Kontrakte 0,00 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)

|  | Nominalwert | Fälligkeit | Gegenpartei                   | Erhalt/(Zahlung)# | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|-------------|------------|-------------------------------|-------------------|-----------------|--------------------|--------------------------------|----------------------|
| THB  | 20.000.000  | 04.04.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | Erhalt            | 1,97 %          | 1D THOR            | 98                             | 0,00                 |
| THB  | 8.000.000   | 04.04.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | Erhalt            | 2,17 %          | 1D THOR            | 85                             | 0,00                 |
| THB  | 9.000.000   | 12.01.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | Erhalt            | 1,89 %          | 1D THOR            | 47                             | 0,00                 |
| THB  | 4.000.000   | 12.01.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | Erhalt            | 2,18 %          | 1D THOR            | 38                             | 0,00                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Zinsswapkontrakten <sup>∞</sup></b> |             |            |                               |                   |                 |                    | <b>268</b>                     | <b>0,00</b>          |

#Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

|  | Zeitwert US\$     | % des Nettovermögens |
|--|-------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> | <b>56.362.229</b> | <b>90,92</b>         |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (0,06 %) (31. Dezember 2022: (0,39 %))

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 150.583 CNH  | 21.191 US\$         | 20.09.2023       | Morgan Stanley              | 1         | (355)                           | (0,00)               |
| 4.497.272 CNH  | 627.374 US\$        | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank     | 1         | (8.412)                         | (0,01)               |
| 4.687.010.443 IDR  | 313.554 US\$        | 20.07.2023       | Citibank NA                 | 1         | (1.907)                         | (0,00)               |
| 4.628.026.535 IDR  | 310.867 US\$        | 07.07.2023       | Citibank NA                 | 1         | (2.437)                         | (0,01)               |
| 17.568.901 THB   | 511.914 US\$        | 20.09.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (12.561)                        | (0,02)               |
| 3.745.677 THB  | 112.446 US\$        | 06.07.2023       | Standard Chartered Bank     | 1         | (6.790)                         | (0,01)               |
| 330.558 TWD  | 11.182 US\$         | 06.07.2023       | Citibank NA                 | 1         | (569)                           | (0,00)               |
| 2.968.084 TWD  | 102.469 US\$        | 06.07.2023       | Morgan Stanley              | 1         | (7.178)                         | (0,01)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                             |           | <b>(40.209)</b>                 | <b>(0,06)</b>        |

## Asian Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

**Futures-Kontrakte (0,03 %) (31. Dezember 2022: (0,02 %))**

| Anzahl Kontrakte   | Beschreibung                                      | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---|---------------------------------|----------------------|
| 55   | South Korea 3-Year Bond Future September 2023     | (10.907)                        | (0,02)               |
| 15   | US Treasury Long Bond (CBT) Future September 2023 | (7.602)                         | (0,01)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten *</b> |   | <b>(18.509)</b>                 | <b>(0,03)</b>        |

|   | Zeitwert US\$     | % des Nettovermögens |
|---|-------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(58.718)</b>   | <b>(0,09)</b>        |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>56.303.511</b> | <b>90,83</b>         |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>5.688.850</b>  | <b>9,17</b>          |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>61.992.361</b> | <b>100,00</b>        |

| Portfolioanalyse  | US\$              | % des Gesamtvermögens |
|---|-------------------|-----------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 49.115.957        | 77,47                 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden            | 7.124.565         | 11,24                 |
| ± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden                          | 65.281            | 0,10                  |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap                            | (2.292)           | (0,00)                |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>56.303.511</b> | <b>88,81</b>          |

## China A-Share Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der<br>Anteile                              | Wertpapierbezeichnung  | Zeitwert<br>CNY | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|-----------------|------------------------------|
| <b>Aktien 95,20 % (31. Dezember 2022: 94,31 %)</b> |  |                 |                              |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi</b>                  |  |                 |                              |
| 1.307  | Advanced Micro-Fabrication Equipment Inc China Class A       | 204.480         | 1,31                         |
| 896  | Amlogic Shanghai Co Ltd Class A                              | 75.551          | 0,48                         |
| 23.420   | Bank of Ningbo Co Ltd Class A                                | 592.526         | 3,80                         |
| 4.850  | Beijing Oriental Yuhong Waterproof Technology Co Ltd Class A | 132.211         | 0,85                         |
| 5.200  | Chaozhou Three-Circle Group Co Ltd Class A                   | 152.620         | 0,98                         |
| 40.500   | China Construction Bank Corp Class A                         | 253.530         | 1,63                         |
| 10.954   | China Jushi Co Ltd Class A                                   | 155.109         | 0,99                         |
| 9.100  | China Merchants Bank Co Ltd Class A                          | 298.116         | 1,91                         |
| 20.700   | China Railway Group Ltd Class A                              | 156.906         | 1,01                         |
| 10.300   | China Yangtze Power Co Ltd Class A                           | 227.218         | 1,46                         |
| 11.400   | CITIC Securities Co Ltd Class A                              | 225.492         | 1,45                         |
| 1.360  | Contemporary Ampere Technology Co Ltd Class A                | 311.154         | 1,99                         |
| 10.500   | Fuyao Glass Industry Group Co Ltd Class A                    | 376.425         | 2,41                         |
| 2.933  | Guangdong Haid Group Co Ltd Class A                          | 137.382         | 0,88                         |
| 3.800  | Guangzhou Kingmed Diagnostics Group Co Ltd Class A           | 286.900         | 1,84                         |
| 4.668  | Hundsun Technologies Inc Class A                             | 206.746         | 1,33                         |
| 13.800   | Inner Mongolia Yili Industrial Group Co Ltd Class A          | 390.816         | 2,51                         |
| 5.600  | JCET Group Co Ltd Class A                                    | 174.552         | 1,12                         |
| 23.400   | Jiangsu Changshu Rural Commercial Bank Co Ltd Class A        | 159.588         | 1,02                         |
| 6.720  | Jiangsu Hengrui Pharmaceuticals Co Ltd Class A               | 321.888         | 2,06                         |
| 3.400  | Jiangsu Yoke Technology Co Ltd Class A                       | 247.792         | 1,59                         |
| 700  | Kweichow Moutai Co Ltd Class A                               | 1.183.700       | 7,59                         |
| 13.896   | LONGi Green Energy Technology Co Ltd Class A                 | 398.398         | 2,55                         |
| 18.900   | Luxshare Precision Industry Co Ltd Class A                   | 613.305         | 3,93                         |
| 11.300   | Midea Group Co Ltd Class A                                   | 665.796         | 4,27                         |
| 1.300  | Milkyway Chemical Supply Chain Service Co Ltd Class A        | 115.817         | 0,74                         |
| 16.204   | NARI Technology Co Ltd Class A                               | 374.312         | 2,40                         |
| 15.600   | Ping An Insurance Group Co of China Ltd Class A              | 723.840         | 4,64                         |
| 24.100   | Poly Developments & Holdings Group Co Ltd Class A            | 314.023         | 2,01                         |
| 26.100   | Sany Heavy Industry Co Ltd Class A                           | 434.043         | 2,78                         |
| 6.100  | Shenzhen Inovance Technology Co Ltd Class A                  | 391.681         | 2,51                         |
| 2.000  | Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co Ltd Class A      | 599.600         | 3,84                         |
| 10.600   | Shenzhen Topband Co Ltd Class A                              | 138.330         | 0,89                         |
| 4.600  | Sinoma Science & Technology Co Ltd Class A                   | 94.392          | 0,61                         |
| 2.800  | Sungrow Power Supply Co Ltd Class A                          | 326.564         | 2,09                         |
| 720  | Suzhou Maxwell Technologies Co Ltd Class A                   | 121.954         | 0,78                         |
| 27.910   | TCL Technology Group Corp Class A                            | 109.965         | 0,71                         |
| 9.100  | Tongwei Co Ltd Class A                                       | 312.221         | 2,00                         |
| 3.108  | Tsingtao Brewery Co Ltd Class A                              | 322.082         | 2,06                         |
| 2.700  | Wanhua Chemical Group Co Ltd Class A                         | 237.168         | 1,52                         |



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

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der<br>Anteile   | Wertpapierbezeichnung                                  | Zeitwert<br>CNY         | % des<br>Netto-<br>vermögens           |
|---|--|-------------------------|--|
| <b>Aktien 95,20% (31. Dezember 2022: 94,31 %) (Fortsetzung)</b>   |  |                         |  |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi (Fortsetzung)</b>   |  |                         |  |
| 2.020   | Will Semiconductor Co Ltd Shanghai Class A             | 198.041                 | 1,27                                   |
| 4.575   | Wuliangye Yibin Co Ltd Class A                         | 748.333                 | 4,80                                   |
| 2.100   | WuXi AppTec Co Ltd Class A                             | 130.851                 | 0,84                                   |
| 4.130   | Yifeng Pharmacy Chain Co Ltd Class A                   | 152.810                 | 0,98                                   |
| 7.500   | Zhejiang Weixing New Building Materials Co Ltd Class A | 154.050                 | 0,99                                   |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt</b>   |  | <b>13.948.278</b>       | <b>89,42</b>                           |
| <b>Hongkong-Dollar</b>  |  |                         |  |
| 3.400   | Alibaba Group Holding Ltd                              | 256.288                 | 1,64                                   |
| 1.620   | Meituan Class B  | 183.922                 | 1,18                                   |
| 1.500   | Tencent Holdings Ltd                                   | 461.742                 | 2,96                                   |
| <b>Hongkong-Dollar insgesamt</b>  |  | <b>901.952</b>          | <b>5,78</b>                            |
| <b>Aktien insgesamt *</b>   |  | <b>14.850.230</b>       | <b>95,20</b>                           |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  |  | <b>14.850.230</b>       | <b>95,20</b>                           |
|   |  | <b>Zeitwert<br/>CNY</b> | <b>% des<br/>Netto-<br/>vermögens</b>  |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>  |  | <b>14.850.230</b>       | <b>95,20</b>                           |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>            |  | <b>14.850.230</b>       | <b>95,20</b>                           |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  |  | <b>748.528</b>          | <b>4,80</b>                            |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                 |  | <b>15.598.758</b>       | <b>100,00</b>                          |
|   |  | <b>CNY</b>              | <b>% des<br/>Gesamtver-<br/>mögens</b> |
| <b>Portfolioanalyse</b>   |  |                         |  |
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind |  | 14.850.230              | 92,99                                  |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  |  | <b>14.850.230</b>       | <b>92,99</b>                           |

## China Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                             | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>CNY   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Einlagenzertifikate 1,34 % (31. Dezember 2022: 20,52 %)</b>   |   |        |                       |                   |                              |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi</b>                                |   |        |                       |                   |                              |
| 20.000.000   | Agricultural Bank of China Ltd**                  | 2,63 % | 23.04.2024            | 19.530.800        | 4,17                         |
| 20.000.000   | China Citic Bank Corp*                            | 2,49 % | 22.05.2024            | 19.537.610        | 4,18                         |
| 20.000.000   | Industrial & Commercial Bank of China Ltd*        | 2,60 % | 06.11.2023            | 19.642.100        | 4,20                         |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt</b>                      |   |        |                       | <b>58.710.510</b> | <b>12,55</b>                 |
| <b>US-Dollar</b>   |   |        |                       |                   |                              |
| 700.000  | Industrial & Commercial Bank of China Ltd*        | 5,00 % | 16.11.2023            | 5.078.025         | 1,09                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>                                       |   |        |                       | <b>5.078.025</b>  | <b>1,09</b>                  |
| <b>Einlagenzertifikat insgesamt</b>                              |   |        |                       | <b>63.788.535</b> | <b>13,64</b>                 |
| <b>Unternehmensanleihen 71,50 % (31. Dezember 2022: 60,07 %)</b> |   |        |                       |                   |                              |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi</b>                                |   |        |                       |                   |                              |
| 10.000.000   | Agricultural Bank of China Ltd**                  | 4,30 % | 11.04.2029            | 10.150.500        | 2,17                         |
| 1.300.000  | Bank of Chengdu Co Ltd*                           | 0,40 % | 03.03.2028            | 1.517.542         | 0,32                         |
| 20.000.000   | Bank of China Ltd**                               | 4,01 % | 22.11.2029            | 20.387.700        | 4,36                         |
| 20.000.000   | Bright Food Group Co Ltd*                         | 3,25 % | 12.07.2024            | 20.169.030        | 4,31                         |
| 10.000.000   | Central Huijin Investment Ltd**                   | 1,00 % | 23.09.2024            | 9.974.470         | 2,13                         |
| 20.000.000   | Central Huijin Investment Ltd**                   | 3,52 % | 26.09.2024            | 20.274.290        | 4,33                         |
| 10.000.000   | China Post Group Co Ltd*                          | 2,84 % | 20.01.2025            | 10.051.395        | 2,15                         |
| 10.000.000   | China Resources Inc*                              | 3,00 % | 21.04.2025            | 10.068.030        | 2,15                         |
| 2.895.000  | China Southern Airlines Co Ltd*                   | 0,60 % | 15.10.2026            | 3.622.600         | 0,77                         |
| 20.000.000   | China Southern Power Grid Co Ltd**                | 2,90 % | 22.04.2025            | 20.129.500        | 4,30                         |
| 840.000  | Ecovacs Robotics Co Ltd*                          | 0,50 % | 30.11.2027            | 930.989           | 0,20                         |
| 400.000  | Great Wall Motor Co Ltd*                          | 0,60 % | 10.06.2027            | 455.336           | 0,10                         |
| 950.000  | Guangxi LiuYao Group Co Ltd*                      | 1,50 % | 16.01.2026            | 1.236.948         | 0,27                         |
| 20.000.000   | Guangzhou Yuexiu Financial Holdings Group Co Ltd* | 2,84 % | 24.11.2025            | 20.135.800        | 4,30                         |
| 10.000.000   | Guotai Junan Securities Co Ltd*                   | 2,44 % | 11.11.2025            | 10.122.925        | 2,16                         |
| 1.450.000  | Hangzhou First Applied Material Co Ltd*           | 0,20 % | 22.11.2028            | 1.755.167         | 0,37                         |
| 800.000  | Hunan Changyuan Lico Co Ltd*                      | 0,30 % | 11.10.2028            | 890.384           | 0,19                         |
| 10.000.000   | Industrial & Commercial Bank of China Ltd**       | 4,15 % | 21.01.2031            | 10.321.900        | 2,20                         |
| 700.000  | iRay Technology Co Ltd*                           | 0,20 % | 24.10.2028            | 861.210           | 0,19                         |
| 750.000  | Lepu Medical Technology Beijing Co Ltd*           | 1,00 % | 30.03.2026            | 913.733           | 0,20                         |
| 3.150.000  | LONGi Green Energy Technology Co Ltd*             | 0,40 % | 05.01.2028            | 3.375.351         | 0,72                         |
| 1.700.000  | Luxshare Precision Industry Co Ltd*               | 0,30 % | 03.11.2026            | 1.912.721         | 0,41                         |
| 400.000  | Ningbo Tuopu Group Co Ltd*                        | 0,20 % | 14.07.2028            | 540.108           | 0,12                         |
| 1.000.000  | Sailun Group Co Ltd*                              | 0,30 % | 02.11.2028            | 1.371.640         | 0,29                         |
| 800.000  | Shanying International Holding Co Ltd*            | 2,00 % | 21.11.2024            | 904.376           | 0,19                         |
| 20.000.000   | Shenzhen Metro Group Co Ltd**                     | 3,25 % | 12.07.2024            | 20.158.920        | 4,31                         |
| 650.000  | Sichuan Kelun Pharmaceutical Co Ltd*              | 0,40 % | 18.03.2028            | 1.228.292         | 0,26                         |
| 770.000  | Sinocare Inc*                                     | 1,00 % | 21.12.2026            | 941.710           | 0,20                         |

## China Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                          | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>CNY    | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 71,50 % (31. Dezember 2022: 60,07 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                    |                              |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi (Fortsetzung)</b>                                |  |        |                       |                    |                              |
| 1.080.000  | Tongwei Co Ltd*                                | 0,40 % | 24.02.2028            | 1.329.739          | 0,29                         |
| 420.000  | Wingtech Technology Co Ltd*                    | 0,20 % | 28.07.2027            | 469.245            | 0,10                         |
| 800.000  | Zhejiang Huahai Pharmaceutical Co Ltd*         | 1,00 % | 02.11.2026            | 881.784            | 0,19                         |
| 700.000  | Zhejiang Sanhua Intelligent Controls Co Ltd*   | 0,60 % | 01.06.2027            | 1.002.400          | 0,21                         |
| 1.100.000  | Zheshang Securities Co Ltd*                    | 0,40 % | 14.06.2028            | 1.330.483          | 0,29                         |
| 400.000  | Zhuzhou Kibing Group Co Ltd*                   | 0,60 % | 09.04.2027            | 487.088            | 0,10                         |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt</b>                                    |  |        |                       | <b>209.903.306</b> | <b>44,85</b>                 |
| <b>US-Dollar</b>   |  |        |                       |                    |                              |
| 1.000.000  | Blossom Joy Ltd*                               | 3,10 % | 29.12.2049            | 6.893.377          | 1,47                         |
| 2.000.000  | BOC Aviation USA Corp*                         | 1,63 % | 29.04.2024            | 14.040.087         | 3,00                         |
| 1.000.000  | China Hongqiao Group Ltd*                      | 6,25 % | 08.06.2024            | 7.155.493          | 1,53                         |
| 1.000.000  | China Mengniu Dairy Co Ltd*                    | 3,00 % | 18.07.2024            | 7.067.094          | 1,51                         |
| 1.500.000  | ENN Clean Energy International Investment Ltd* | 3,38 % | 12.05.2026            | 10.110.332         | 2,16                         |
| 500.000  | Gemdale Ever Prosperity Investment Ltd*        | 4,95 % | 12.08.2024            | 3.078.513          | 0,66                         |
| 2.000.000  | Guangzhou Metro Investment Finance BVI Ltd*    | 1,51 % | 17.09.2025            | 13.246.883         | 2,83                         |
| 1.000.000  | Haitong International Securities Group Ltd*    | 3,38 % | 19.07.2024            | 7.019.761          | 1,50                         |
| 500.000  | Huarong Finance 2019 Co Ltd*                   | 3,75 % | 29.05.2024            | 3.497.177          | 0,75                         |
| 1.000.000  | Huarong Finance II Co Ltd*                     | 5,50 % | 16.01.2025            | 6.921.630          | 1,48                         |
| 1.000.000  | Prosperous Ray Ltd*                            | 4,63 % | 12.11.2023            | 7.241.008          | 1,55                         |
| 1.000.000  | Shanghai Port Group BVI Development 2 Co Ltd*  | 1,50 % | 13.07.2025            | 6.694.992          | 1,43                         |
| 583.000  | Shui On Development Holding Ltd*               | 5,75 % | 12.11.2023            | 4.164.867          | 0,89                         |
| 1.000.000  | Sinochem Offshore Capital Co Ltd*              | 3,16 % | 15.02.2026            | 6.841.508          | 1,46                         |
| 1.000.000  | Studio City Finance Ltd*                       | 6,00 % | 15.07.2025            | 6.761.801          | 1,45                         |
| 1.000.000  | Tencent Holdings Ltd*                          | 3,98 % | 11.04.2029            | 6.766.918          | 1,45                         |
| 1.000.000  | TFI Overseas Investment Ltd*                   | 6,50 % | 05.06.2024            | 7.165.439          | 1,53                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |  |        |                       | <b>124.666.880</b> | <b>26,65</b>                 |
| <b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>334.570.186</b> | <b>71,50</b>                 |
| <b>Staatsanleihen 10,76 % (31. Dezember 2022: 13,26 %)</b>                     |  |        |                       |                    |                              |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi</b>  |  |        |                       |                    |                              |
| 20.000.000   | China Government Bond                          | 2,18 % | 25.08.2025            | 19.990.620         | 4,27                         |
| 30.000.000   | China Government Bond                          | 2,69 % | 12.08.2026            | 30.359.385         | 6,49                         |
| <b>Staatsanleihen insgesamt **</b>   |  |        |                       | <b>50.350.005</b>  | <b>10,76</b>                 |
| <b>Anlagen insgesamt</b>   |  |        |                       | <b>448.708.726</b> | <b>95,90</b>                 |

Devisenterminkontrakte 1,83 % (31. Dezember 2022: 0,87 %)

| Geforderter<br>Betrag | Zu zahlender<br>Betrag | Fälligkeits-<br>datum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn CNY | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|-----------------------|------------------------|-----------------------|-----------------------------|-----------|-------------------------------------|------------------------------|
| 1.534.026 US\$        | 10.710.025 CNY         | 20.07.2023            | Goldman Sachs International | 1         | 435.989                             | 0,09                         |

## China Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 1,83 % (31. Dezember 2022: 0,87 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei             | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn CNY | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-------------------------|-----------|-------------------------------|----------------------|
| 2.251.452 US\$   | 15.891.800 CNY      | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank | 3         | 466.930                       | 0,10                 |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>  |                     |                  |                         |           |                               |                      |
| 10.420 £   | 92.652 CNY          | 14.09.2023       | UBS AG                  | 2         | 3.163                         | 0,00                 |
| 10.202 £   | 90.691 CNY          | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp    | 1         | 3.119                         | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen USD</i>  |                     |                  |                         |           |                               |                      |
| 25.262.226 US\$  | 178.841.514 CNY     | 14.09.2023       | UBS AG                  | 2         | 3.835.530                     | 0,82                 |
| 24.619.156 US\$  | 174.206.697 CNY     | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp    | 1         | 3.820.158                     | 0,82                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>                        |                     |                  |                         |           | <b>8.564.889</b>              | <b>1,83</b>          |
|  |                     |                  |                         |           | <b>Zeitwert</b>               | <b>% des</b>         |
|  |                     |                  |                         |           | <b>CNY</b>                    | <b>Netto-</b>        |
|  |                     |                  |                         |           | <b>457.273.615</b>            | <b>vermögens</b>     |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> |                     |                  |                         |           |                               | <b>97,73</b>         |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Futures-Kontrakte (0,31 %) (31. Dezember 2022: (0,01 %))

| Anzahl Kontrakte  | Beschreibung   | Nicht realisierter Verlust CNY | % des Nettovermögens |
|---|--|--------------------------------|----------------------|
| 75  | US Treasury 10-Year Note (CBT) Future September 2023 | (815.573)                      | (0,17)               |
| 40  | US Treasury 5-Year Note (CBT) Future September 2023  | (636.545)                      | (0,14)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten <sup>*</sup></b> |  | <b>(1.452.118)</b>             | <b>(0,31)</b>        |

### Devisenterminkontrakte (2,07 %) (31. Dezember 2022: (0,60 %))

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei             | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust CNY | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 3.656.060 CNY  | 528.868 US\$        | 20.07.2023       | Citibank NA             | 1         | (186.619)                      | (0,04)               |
| 65.996.184 CNY   | 9.725.000 US\$      | 12.10.2023       | Citibank NA             | 1         | (4.143.952)                    | (0,88)               |
| 58.864.884 CNY   | 8.788.612 US\$      | 20.07.2023       | JPMorgan Chase Bank     | 1         | (4.991.921)                    | (1,07)               |
| 3.914.507 CNY  | 550.000 US\$        | 12.10.2023       | JPMorgan Chase Bank     | 1         | (52.287)                       | (0,01)               |
| 4.901.114 CNY  | 716.947 US\$        | 12.10.2023       | Standard Chartered Bank | 1         | (269.761)                      | (0,06)               |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>  |                     |                  |                         |           |                                |                      |
| 2.740 CNY  | 365 €               | 20.07.2023       | JPMorgan Chase Bank     | 1         | (157)                          | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen USD</i>  |                     |                  |                         |           |                                |                      |
| 2.910.440 CNY  | 407.674 US\$        | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp    | 2         | (37.548)                       | (0,01)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                         |           | <b>(9.682.245)</b>             | <b>(2,07)</b>        |

## China Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

|   | Zeitwert<br>CNY     | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---------------------|------------------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(11.134.363)</b> | <b>(2,38)</b>                |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>446.139.252</b>  | <b>95,35</b>                 |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>21.772.057</b>   | <b>4,65</b>                  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>467.911.309</b>  | <b>100,00</b>                |

| Portfolioanalyse  | CNY                | % des<br>Gesamtver-<br>mögens |
|---|--------------------|-------------------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 267.430.641        | 55,78                         |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden            | 181.278.085        | 37,81                         |
| ± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden                          | (1.452.118)        | (0,30)                        |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente   | (1.117.356)        | (0,23)                        |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>446.139.252</b> | <b>93,06</b>                  |

## China Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der<br>Anteile                              | Wertpapierbezeichnung                                       | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------------------|------------------------------|
| <b>Aktien 96,65 % (31. Dezember 2022: 96,67 %)</b> |   |                    |                              |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi</b>                  |   |                    |                              |
| 660.000  | Eve Energy Co Ltd Class A                                   | 5.506.826          | 2,00                         |
| 2.650.072  | Inner Mongolia Yili Industrial Group Co Ltd Class A         | 10.325.452         | 3,75                         |
| 354.300  | Jiangsu Hengli Hydraulic Co Ltd Class A                     | 3.137.340          | 1,14                         |
| 3.400.002  | Luxshare Precision Industry Co Ltd Class A                  | 15.238.015         | 5,54                         |
| 1.656.031  | Midea Group Co Ltd Class A                                  | 13.441.493         | 4,89                         |
| 221.014  | Milkyway Chemical Supply Chain Service Co Ltd Class A       | 2.708.670          | 0,99                         |
| 6.999.916  | Satellite Chemical Co Ltd Class A                           | 14.416.549         | 5,24                         |
| 900.058  | Shandong Hualu Hengsheng Chemical Co Ltd Class A            | 3.794.544          | 1,38                         |
| 255.873  | Shenzhen Dynanonic Co Ltd Class A                           | 3.894.630          | 1,42                         |
| 675.027  | Shenzhen Inovance Technology Co Ltd Class A                 | 5.974.353          | 2,17                         |
| 739.035  | Shenzhen Sunlord Electronics Co Ltd Class A                 | 2.432.135          | 0,88                         |
| 127.567  | Suzhou Maxwell Technologies Co Ltd Class A                  | 2.973.988          | 1,08                         |
| 2.208.648  | TCL Zhonghuan Renewable Energy Technology Co Ltd Class A    | 10.093.893         | 3,67                         |
| 1.200.059  | Wanhua Chemical Group Co Ltd Class A                        | 14.499.806         | 5,27                         |
| 860.094  | Yunnan Energy New Material Co Ltd Class A                   | 11.435.266         | 4,16                         |
| 665.000  | Zhejiang Jingsheng Mechanical & Electrical Co Ltd Class A   | 6.504.438          | 2,37                         |
| 6.000.103  | Zoomlion Heavy Industry Science & Technology Co Ltd Class A | 5.573.766          | 2,03                         |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt</b>        |   | <b>131.951.164</b> | <b>47,98</b>                 |
| <b>Hongkong-Dollar</b>                             |   |                    |                              |
| 2.319.000  | Akeso Inc   | 10.518.100         | 3,82                         |
| 1.000.000  | Alibaba Group Holding Ltd                                   | 10.409.034         | 3,79                         |
| 2.490.500  | China Merchants Bank Co Ltd - H Shares                      | 11.358.529         | 4,13                         |
| 2.800.000  | China National Building Material Co Ltd - H Shares          | 1.730.104          | 0,63                         |
| 5.525.000  | China Pacific Insurance Group Co Ltd - H Shares             | 14.342.701         | 5,22                         |
| 1.850.000  | China Resources Beer Holdings Co Ltd                        | 12.224.276         | 4,45                         |
| 2.650.000  | China Resources Land Ltd                                    | 11.276.647         | 4,10                         |
| 8.750.000  | CSPC Pharmaceutical Group Ltd                               | 7.614.357          | 2,77                         |
| 5.299.000  | Haier Smart Home Co Ltd - H Shares                          | 16.709.412         | 6,08                         |
| 710.500  | Li Ning Co Ltd  | 3.836.536          | 1,39                         |
| 396.000  | Meituan Class B   | 6.209.168          | 2,26                         |
| 1.250.000  | SITC International Holdings Co Ltd                          | 2.288.788          | 0,83                         |
| 275.000  | Tencent Holdings Ltd  | 11.659.431         | 4,24                         |
| 340.000  | Zhongsheng Group Holdings Ltd                               | 1.305.125          | 0,47                         |
| <b>Hongkong-Dollar insgesamt</b>                   |   | <b>121.482.208</b> | <b>44,18</b>                 |
| <b>US-Dollar</b>                                   |   |                    |                              |
| 89.982   | H World Group Ltd ADR                                       | 3.489.502          | 1,27                         |
| 353.439  | ZTO Express Cayman Inc ADR                                  | 8.864.250          | 3,22                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>                         |   | <b>12.353.752</b>  | <b>4,49</b>                  |
| <b>Aktien insgesamt *</b>                          |   | <b>265.787.124</b> | <b>96,65</b>                 |
| <b>Anlagen insgesamt</b>                           |   | <b>265.787.124</b> | <b>96,65</b>                 |

## China Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 0,06 % (31. Dezember 2022: 0,35 %)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens        |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|-----------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 19.042 CHF   | 21.220 US\$         | 20.07.2023       | UBS AG                      | 5         | 99                             | 0,00                        |
| 370.460 CHF  | 413.981 US\$        | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 3         | 772                            | 0,00                        |
| 5.138 US\$   | 4.565 CHF           | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | 28                             | 0,00                        |
| 22.145 US\$  | 19.525 CHF          | 20.07.2023       | UBS AG                      | 5         | 285                            | 0,00                        |
| 29.593 US\$  | 26.221 CHF          | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 5         | 235                            | 0,00                        |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 77.181 €   | 82.894 US\$         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | 1.376                          | 0,00                        |
| 53.051 €   | 57.868 US\$         | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | 55                             | 0,00                        |
| 75.313 €   | 81.083 US\$         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 4         | 1.146                          | 0,00                        |
| 23.476 US\$  | 21.130 €            | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | 406                            | 0,00                        |
| 261.416 US\$   | 236.727 €           | 20.07.2023       | UBS AG                      | 6         | 2.947                          | 0,00                        |
| 6.869.584 US\$   | 6.253.867 €         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 16        | 41.307                         | 0,02                        |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 428 £  | 536 US\$            | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 3         | 9                              | 0,00                        |
| 674 £  | 844 US\$            | 20.07.2023       | UBS AG                      | 2         | 13                             | 0,00                        |
| 14.497 £   | 18.096 US\$         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 9         | 337                            | 0,00                        |
| 238 US\$   | 187 £               | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | 0                              | 0,00                        |
| 263 US\$   | 207 £               | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 1         | 0                              | 0,00                        |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 2.505.785 US\$   | 3.312.877 SGD       | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 7         | 56.462                         | 0,02                        |
| 2.557.099 US\$   | 3.386.536 SGD       | 20.07.2023       | UBS AG                      | 8         | 53.318                         | 0,02                        |
| 219.065 US\$   | 292.938 SGD         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 19        | 2.487                          | 0,00                        |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>                        |                     |                  |                             |           | <b>161.282</b>                 | <b>0,06</b>                 |
|  |                     |                  |                             |           | <b>Zeitwert US\$</b>           | <b>% des Nettovermögens</b> |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> |                     |                  |                             |           | <b>265.948.406</b>             | <b>96,71</b>                |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,08 %) (31. Dezember 2022: (0,26 %))

| Geforderter Betrag              | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i> |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 6.168 CHF                       | 6.954 US\$          | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 2         | (48)                            | (0,00)               |
| 20.347 CHF                      | 22.844 US\$         | 20.07.2023       | UBS AG                      | 3         | (65)                            | (0,00)               |
| 4.387 CHF                       | 4.959 US\$          | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 2         | (47)                            | (0,00)               |
| 22.725 US\$                     | 20.563 CHF          | 20.07.2023       | UBS AG                      | 4         | (296)                           | (0,00)               |
| 32.026 US\$                     | 28.729 CHF          | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 8         | (138)                           | (0,00)               |

## China Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Devisenterminkontrakte (0,08 %) (31. Dezember 2022: (0,26 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens         |
|---|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|------------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>   |                     |                  |                             |           |                                 |                              |
| 177.100 €   | 194.482 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 5         | (1.116)                         | (0,00)                       |
| 4.531.983 €   | 4.969.319 US\$      | 20.07.2023       | UBS AG                      | 4         | (21.080)                        | (0,01)                       |
| 4.449.803 €   | 4.893.347 US\$      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 6         | (34.837)                        | (0,01)                       |
| 68.745 US\$   | 63.560 €            | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 3         | (654)                           | (0,00)                       |
| 131.246 US\$  | 120.653 €           | 20.07.2023       | UBS AG                      | 4         | (489)                           | (0,00)                       |
| 246.405 US\$  | 229.446 €           | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 9         | (4.116)                         | (0,00)                       |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>   |                     |                  |                             |           |                                 |                              |
| 427 £   | 547 US\$            | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (4)                             | (0,00)                       |
| 65 £  | 83 US\$             | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | (0)                             | (0,00)                       |
| 408 US\$  | 328 £               | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 3         | (9)                             | (0,00)                       |
| 676 US\$  | 538 £               | 20.07.2023       | UBS AG                      | 5         | (8)                             | (0,00)                       |
| 3.044 US\$  | 2.444 £             | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 12        | (64)                            | (0,00)                       |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>   |                     |                  |                             |           |                                 |                              |
| 4.368.705 SGD   | 3.304.677 US\$      | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 5         | (74.745)                        | (0,03)                       |
| 4.485.335 SGD   | 3.386.777 US\$      | 20.07.2023       | UBS AG                      | 7         | (70.616)                        | (0,03)                       |
| 61.986 SGD  | 46.556 US\$         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 7         | (729)                           | (0,00)                       |
| 44.806 US\$   | 60.659 SGD          | 20.07.2023       | UBS AG                      | 2         | (41)                            | (0,00)                       |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>                          |                     |                  |                             |           | <b>(209.102)</b>                | <b>(0,08)</b>                |
|   |                     |                  |                             |           | <b>Zeitwert US\$</b>            | <b>% des Nettovermögens</b>  |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> |                     |                  |                             |           | <b>(209.102)</b>                | <b>(0,08)</b>                |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              |                     |                  |                             |           | <b>265.739.304</b>              | <b>96,63</b>                 |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  |                     |                  |                             |           | <b>9.256.478</b>                | <b>3,37</b>                  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   |                     |                  |                             |           | <b>274.995.782</b>              | <b>100,00</b>                |
| <b>Portfolioanalyse</b>   |                     |                  |                             |           | <b>US\$</b>                     | <b>% des Gesamtvermögens</b> |
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind   |                     |                  |                             |           | 265.787.124                     | 96,45                        |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente   |                     |                  |                             |           | (47.820)                        | (0,02)                       |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  |                     |                  |                             |           | <b>265.739.304</b>              | <b>96,43</b>                 |



## CLO Income - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital-<br>betrag  | Wertpapierbezeichnung  | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--|---------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Schatzwechsel 3,80 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)</b>                                     |  |         |                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar</b>  |  |         |                       |                   |                              |
| 5.500.000   | United States Treasury Bill                                  | 0,00 %  | 11.07.2023            | 5.493.929         | 3,80                         |
| <b>Schatzwechsel insgesamt **</b>   |  |         |                       | <b>5.493.929</b>  | <b>3,80</b>                  |
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 82,06 % (31. Dezember 2022: 81,77 %)</b> |  |         |                       |                   |                              |
| <b>Euro</b>   |  |         |                       |                   |                              |
| 1.400.000   | Aqueduct European CLO 7-2022 DAC Series 2022-7X Class E      | 10,39 % | 15.03.2036            | 1.469.977         | 1,02                         |
| 1.000.000   | Arbour CLO VI DAC Series 6X Class E                          | 9,10 %  | 15.11.2031            | 974.418           | 0,67                         |
| 1.000.000   | Ares European CLO X DAC Series 10X Class F                   | 10,25 % | 15.10.2031            | 931.608           | 0,64                         |
| 1.400.000   | Avoca CLO XXVI Designated Activity Co Series 26X Class F     | 12,30 % | 15.04.2035            | 1.368.651         | 0,95                         |
| 1.000.000   | BlackRock European CLO X DAC Series 10X Class FR             | 12,02 % | 15.10.2034            | 923.651           | 0,64                         |
| 1.000.000   | BlackRock European CLO XIV DAC Series 14X Class F            | 13,99 % | 15.07.2036            | 1.009.965         | 0,70                         |
| 1.050.000   | Cifc European Funding CLO III DAC Series 3X Class E          | 8,79 %  | 15.01.2034            | 1.041.704         | 0,72                         |
| 700.000   | CVC Cordatus Loan Fund XXIII DAC Series 23X Class E          | 10,52 % | 25.04.2036            | 707.743           | 0,49                         |
| 1.500.000   | CVC Cordatus Loan Fund XXIII DAC Series 23X Class F          | 12,62 % | 25.04.2036            | 1.499.527         | 1,04                         |
| 1.400.000   | CVC Cordatus Loan Fund XXVII DAC Series 27X Class F          | 14,16 % | 15.04.2035            | 1.437.023         | 0,99                         |
| 3.000.000   | Euro-Galaxy VII CLO DAC Series 2019-7X Class ER              | 9,46 %  | 25.07.2035            | 2.955.619         | 2,04                         |
| 1.500.000   | Goldentree Loan Management EUR CLO 3 DAC Series 3X Class E   | 9,11 %  | 20.01.2032            | 1.458.175         | 1,01                         |
| 1.500.000   | Goldentree Loan Management EUR CLO 5 DAC Series 5X Class E   | 8,45 %  | 20.04.2034            | 1.421.944         | 0,98                         |
| 1.000.000   | Harvest CLO XXVII DAC Series 27X Class F                     | 12,03 % | 15.07.2034            | 939.350           | 0,65                         |
| 1.000.000   | Margay CLO I DAC Series 1X Class E                           | 12,20 % | 15.07.2036            | 1.025.922         | 0,71                         |
| 1.251.000   | OCP Euro CLO 2029-3 Ltd Series 2019-3X Class ER              | 9,22 %  | 20.04.2033            | 1.243.787         | 0,86                         |
| 1.485.000   | Otranto Park CLO DAC Series 1X Class E                       | 10,37 % | 15.05.2035            | 1.511.581         | 1,04                         |
| 1.150.000   | Otranto Park CLO DAC Series 1X Class F                       | 12,37 % | 15.05.2035            | 1.134.777         | 0,78                         |
| 1.000.000   | Palmer Square European CLO 2022-1 DAC Series 2022-1X Class F | 12,06 % | 21.01.2035            | 975.641           | 0,67                         |
| 2.289.000   | Providus CLO IV DAC Series 4X Class ER                       | 9,19 %  | 20.04.2034            | 2.274.238         | 1,57                         |
| 1.650.000   | Vesey Park CLO DAC Series 1X Class E                         | 13,23 % | 16.11.2032            | 1.718.962         | 1,19                         |
| 1.300.000   | Voya Euro CLO IV DAC Series 4X Class FR                      | 11,93 % | 15.10.2034            | 1.273.567         | 0,88                         |
| <b>Euro insgesamt</b>   |  |         |                       | <b>29.297.830</b> | <b>20,24</b>                 |
| <b>US-Dollar</b>  |  |         |                       |                   |                              |
| 2.000.000   | AB BSL CLO 1 Ltd Series 2020-1X Class ER                     | 12,17 % | 15.01.2035            | 1.803.674         | 1,25                         |
| 1.000.000   | AB BSL CLO 3 Ltd Series 2021-3A Class E                      | 12,20 % | 20.10.2034            | 913.033           | 0,63                         |
| 1.000.000   | AB BSL CLO 3 Ltd Series 2021-3X Class E                      | 12,20 % | 20.10.2034            | 913.034           | 0,63                         |
| 4.800.000   | AGL CLO 22 Ltd Series 2022-22X Class E                       | 13,68 % | 20.10.2035            | 4.825.440         | 3,33                         |
| 1.000.000   | AGL CLO 25 Ltd Series 2023-25X Class E                       | 13,91 % | 21.07.2036            | 1.005.305         | 0,70                         |
| 1.500.000   | Aimco CLO Series 2017-A Series 2017-AX Class FR              | 13,79 % | 20.04.2034            | 1.265.049         | 0,88                         |
| 2.000.000   | Apidos CLO XX Series 2015-20X Class DR                       | 11,27 % | 16.07.2031            | 1.721.152         | 1,19                         |
| 2.100.000   | Apidos CLO XXIV Series 2016-24X Class DR                     | 11,05 % | 20.10.2030            | 1.828.004         | 1,26                         |
| 3.000.000   | Apidos CLO XXXIV Series 2020-34X Class ER                    | 11,75 % | 20.01.2035            | 2.898.247         | 2,00                         |
| 1.000.000   | Ares XLIX CLO Ltd Series 2018-49X Class E                    | 10,97 % | 22.07.2030            | 857.610           | 0,59                         |

## CLO Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag  | Wertpapierbezeichnung  | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--|---------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 82,06 % (31. Dezember 2022: 81,77 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                    |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>  |  |         |                       |                    |                              |
| 2.000.000   | Ares XXXVII CLO Ltd Series 2015-4X Class DR                      | 11,72 % | 15.10.2030            | 1.618.835          | 1,12                         |
| 4.000.000   | Assurant CLO I Ltd Series 2018-2X Class E                        | 11,40 % | 20.10.2031            | 3.288.074          | 2,27                         |
| 1.000.000   | Bain Capital Credit CLO 2023-2 Ltd Series 2023-2X Class E        | 13,71 % | 18.07.2036            | 989.685            | 0,68                         |
| 2.825.000   | Ballyrock CLO 2018-1 Ltd Series 2018-1X Class D                  | 11,05 % | 20.04.2031            | 2.445.250          | 1,69                         |
| 2.000.000   | Burnham Park CLO Ltd Series 2016-1X Class ER                     | 10,65 % | 20.10.2029            | 1.697.156          | 1,17                         |
| 5.000.000   | Carlyle Global Market Strategies Series 2014-2RX Class D         | 10,67 % | 15.05.2031            | 4.062.558          | 2,81                         |
| 6.000.000   | Cific Funding 2018-I Ltd Series 2018-1X Class E                  | 10,26 % | 18.04.2031            | 5.050.112          | 3,49                         |
| 5.000.000   | Dryden 60 CLO Ltd Series 2018-60X Class E                        | 11,17 % | 15.07.2031            | 4.494.844          | 3,11                         |
| 2.135.000   | Dryden XXVIII Senior Loan Fund Series 2013-28X Class B2LR        | 11,77 % | 15.08.2030            | 1.921.537          | 1,33                         |
| 1.250.000   | Eaton Vance CLO 2015-1 Ltd Series 2015-1X Class ER               | 10,85 % | 20.01.2030            | 1.016.836          | 0,70                         |
| 2.000.000   | Eaton Vance CLO 2018-1 Ltd Series 2018-1X Class E                | 11,57 % | 15.10.2030            | 1.723.915          | 1,19                         |
| 1.050.000   | Galaxy XIX CLO Ltd Series 2015-19X Class D1R                     | 11,80 % | 24.07.2030            | 885.104            | 0,61                         |
| 4.000.000   | Galaxy XXV CLO Ltd Series 2018-25X Class E                       | 11,21 % | 25.10.2031            | 3.506.705          | 2,42                         |
| 4.400.000   | Goldentree Loan Management US CLO 14 Ltd Series 2022-14X Class E | 12,78 % | 20.07.2035            | 4.392.114          | 3,04                         |
| 1.588.000   | Goldentree Loan Management US CLO 4 Ltd Series 2019-4X Class F   | 11,67 % | 24.04.2031            | 1.214.151          | 0,84                         |
| 1.400.000   | Goldentree Loan Management US CLO 5 Ltd Series 2019-5X Class F   | 11,82 % | 20.10.2032            | 1.088.381          | 0,75                         |
| 3.000.000   | Invesco CLO 2022-1 Ltd Series 2022-1X Class D                    | 8,10 %  | 20.04.2035            | 2.787.841          | 1,93                         |
| 1.000.000   | Invesco US CLO 2023-1 Ltd Series 2023-1X Class E                 | 13,23 % | 22.04.2035            | 1.004.374          | 0,69                         |
| 750.000   | KKR CLO 17 Ltd Series 17X Class E                                | 12,96 % | 15.04.2034            | 656.443            | 0,45                         |
| 1.702.500   | Madison Park Funding XXX Ltd Series 2018-30X Class E             | 10,52 % | 15.04.2029            | 1.547.527          | 1,07                         |
| 3.300.000   | Magnetite CLO Ltd Series 2015-14RX Class E                       | 10,86 % | 18.10.2031            | 3.019.860          | 2,09                         |
| 1.650.000   | Magnetite VII Ltd Series 2012-7X Class ER2                       | 12,07 % | 15.01.2028            | 1.436.943          | 0,99                         |
| 2.650.000   | Magnetite VIII Ltd Series 2014-8X Class FR2                      | 13,01 % | 15.04.2031            | 2.164.298          | 1,50                         |
| 2.490.000   | Magnetite XVII Ltd Series 2016-18X Class FR                      | 12,92 % | 15.11.2028            | 2.266.065          | 1,57                         |
| 2.000.000   | Mariner CLO 5 Ltd Series 2018-5X Class E                         | 10,91 % | 25.04.2031            | 1.739.376          | 1,20                         |
| 1.500.000   | OCP CLO 2023-26 Ltd Series 2023-26X Class E                      | 12,98 % | 17.04.2036            | 1.478.128          | 1,02                         |
| 2.500.000   | Palmer Square CLO Ltd Series 2020-3X Class ER                    | 13,23 % | 15.11.2031            | 2.118.758          | 1,46                         |
| 2.000.000   | Post CLO 2018-1 Ltd Series 2018-1X Class E                       | 11,44 % | 16.04.2031            | 1.771.525          | 1,22                         |
| 2.000.000   | PPM CLO 3 Ltd Series 2019-3X Class E                             | 12,18 % | 17.04.2034            | 1.642.401          | 1,14                         |
| 4.000.000   | Trestles CLO II Ltd Series 2018-2X Class D                       | 11,01 % | 25.07.2031            | 3.562.543          | 2,46                         |
| 1.000.000   | Trestles CLO Ltd Series 2021-18X Class E                         | 12,30 % | 20.01.2035            | 916.816            | 0,63                         |
| 2.000.000   | Trinitas CLO VII Ltd Series 2017-7X Class ER                     | 12,36 % | 25.01.2035            | 1.655.005          | 1,14                         |
| 1.675.000   | Trinitas CLO X Ltd Series 2019-10X Class ER                      | 12,28 % | 15.01.2035            | 1.372.323          | 0,95                         |
| 1.000.000   | Trinitas CLO XVII Ltd Series 2021-17X Class E                    | 12,28 % | 20.10.2034            | 911.058            | 0,63                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>  |  |         |                       | <b>89.477.089</b>  | <b>61,82</b>                 |
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) insgesamt **</b>                                       |  |         |                       | <b>118.774.919</b> | <b>82,06</b>                 |

## CLO Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile  | Wertpapierbezeichnung                      | Zeitwert US\$      | % des Nettovermögens |
|---|--|--------------------|----------------------|
| <b>Investmentfonds 8,05 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)</b> |  |                    |                      |
| <b>US-Dollar</b>  |  |                    |                      |
| 70.089  | iShares USD High Yield Corp Bond UCITS ETF | 6.303.104          | 4,35                 |
| 1.055.441   | iShares USD Treasury Bond 0-1yr UCITS ETF  | 5.354.252          | 3,70                 |
| <b>Investmentfonds insgesamt <sup>#</sup></b>             |  | <b>11.657.356</b>  | <b>8,05</b>          |
| <b>Anlagen insgesamt</b>                                  |  | <b>135.926.204</b> | <b>93,91</b>         |

### Devisenterminkontrakte 0,43 % (31. Dezember 2022: 2,37 %)

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 16.105.184 US\$   | 14.622.579 €        | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 139.544                        | 0,10                 |
| 4.306.843 US\$  | 3.915.000 €         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 3         | 32.255                         | 0,02                 |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>   |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 151.181 €   | 164.502 US\$        | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | 565                            | 0,00                 |
| 4.794.790 €   | 5.159.678 US\$      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 1         | 75.506                         | 0,05                 |
| 304.991 US\$  | 276.815 €           | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 3         | 2.751                          | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>   |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 466.757 £   | 582.511 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 3         | 10.965                         | 0,01                 |
| 7.612.418 £   | 9.492.632 US\$      | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 2         | 186.467                        | 0,13                 |
| 80.302 £  | 101.367 US\$        | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | 736                            | 0,00                 |
| 7.717.827 £   | 9.639.896 US\$      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 3         | 173.228                        | 0,12                 |
| <i>Abgesicherte Klassen SEK</i>   |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 165.467 SEK   | 15.252 US\$         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 1         | 78                             | 0,00                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                                |           | <b>622.095</b>                 | <b>0,43</b>          |

### Total Return Swap-Kontrakte 0,01 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)

| Nominalwert  | Datum der Schließung | Variabler Zinssatz | Referenzunternehmen                            | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|----------------------|--------------------|--|--------------------------------|----------------------|
| USD 5.000.000  | 20.09.2023           | 5,09 <sup>1</sup>  | iBoxx USD Liquid High Yield Index <sup>2</sup> | 12.305                         | 0,01                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Total Return Swap-Kontrakten <sup>∞</sup></b> |                      |                    |  | <b>12.305</b>                  | <b>0,01</b>          |

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

<sup>2</sup> Die Gegenpartei für die Total Return Swap-Kontrakte ist Goldman Sachs International.

|  | Zeitwert US\$      | % des Nettovermögens |
|--|--------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> | <b>136.560.604</b> | <b>94,35</b>         |

## CLO Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (0,28 %) (31. Dezember 2022: (0,72 %))

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 654.522 US\$   | 600.000 €           | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 1         | (586)                           | (0,00)               |
| 2.965.724 US\$   | 2.750.000 €         | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 2         | (36.859)                        | (0,03)               |
| 3.901.740 US\$   | 3.620.000 €         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 2         | (50.752)                        | (0,03)               |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>  |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 678.881 €  | 748.616 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 3         | (7.382)                         | (0,01)               |
| 12.180.385 €   | 13.394.934 US\$     | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 2         | (95.799)                        | (0,07)               |
| 569.236 €  | 628.105 US\$        | 20.07.2023       | UBS AG                         | 3         | (6.585)                         | (0,00)               |
| 12.330.350 €   | 13.519.834 US\$     | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 3         | (56.961)                        | (0,04)               |
| 1.226.377 US\$   | 1.136.826 €         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 3         | (14.865)                        | (0,01)               |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>  |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 79.032 £   | 100.499 US\$        | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 1         | (11)                            | (0,00)               |
| 588.154 US\$   | 471.928 £           | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (11.897)                        | (0,01)               |
| <i>Abgesicherte Klassen SEK</i>  |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 327.860 SEK  | 32.048 US\$         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | (1.672)                         | (0,00)               |
| 833.922 SEK  | 80.387 US\$         | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 4         | (3.126)                         | (0,00)               |
| 28.524.617 SEK   | 2.760.851 US\$      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 5         | (118.125)                       | (0,08)               |
| 15.555 US\$  | 168.005 SEK         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | (10)                            | (0,00)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                                |           | <b>(404.630)</b>                | <b>(0,28)</b>        |

|   | Zeitwert US\$      | % des Nettovermögens |
|---|--------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(404.630)</b>   | <b>(0,28)</b>        |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>136.155.974</b> | <b>94,07</b>         |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>8.586.059</b>   | <b>5,93</b>          |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>144.742.033</b> | <b>100,00</b>        |

| Portfolioanalyse   | US\$               | % des Gesamtvermögens |
|--|--------------------|-----------------------|
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | 124.268.848        | 84,35                 |
| μ Investmentfonds  | 11.657.356         | 7,91                  |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente  | 229.770            | 0,16                  |
| <b>Anlagen insgesamt</b>   | <b>136.155.974</b> | <b>92,42</b>          |

## Commodities - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                 | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---------------------------------------|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Schatzwechsel 26,81 % (31. Dezember 2022: 45,88 %)</b>        |                                       |        |                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |                                       |        |                       |                   |                              |
| 1.000.000  | United States Treasury Bill           | 0,00 % | 11.07.2023            | 998.896           | 0,93                         |
| 10.000.000   | United States Treasury Bill           | 0,00 % | 20.07.2023            | 9.976.377         | 9,25                         |
| 250.000  | United States Treasury Bill           | 0,00 % | 17.08.2023            | 248.389           | 0,23                         |
| 4.355.000  | United States Treasury Bill           | 0,00 % | 31.08.2023            | 4.318.194         | 4,00                         |
| 13.550.000   | United States Treasury Bill           | 0,00 % | 28.09.2023            | 13.381.195        | 12,40                        |
| <b>Schatzwechsel insgesamt **</b>                                |                                       |        |                       | <b>28.923.051</b> | <b>26,81</b>                 |
| <b>Agency Bonds 11,17 % (31. Dezember 2022: 12,25 %)</b>         |                                       |        |                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |                                       |        |                       |                   |                              |
| 4.125.000  | Federal Home Loan Banks               | 0,13 % | 28.08.2023            | 4.091.087         | 3,79                         |
| 1.285.000  | Federal Home Loan Banks               | 5,55 % | 05.04.2024            | 1.281.142         | 1,19                         |
| 6.725.000  | Federal Home Loan Mortgage Corp       | 0,25 % | 24.08.2023            | 6.678.031         | 6,19                         |
| <b>Agency Bonds insgesamt **</b>                                 |                                       |        |                       | <b>12.050.260</b> | <b>11,17</b>                 |
| <b>Unternehmensanleihen 39,82 % (31. Dezember 2022: 30,49 %)</b> |                                       |        |                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |                                       |        |                       |                   |                              |
| 1.545.000  | AbbVie Inc**                          | 3,85 % | 15.06.2024            | 1.519.491         | 1,41                         |
| 1.175.000  | Amazon.com Inc**                      | 0,45 % | 12.05.2024            | 1.126.826         | 1,04                         |
| 540.000  | American Express Co**                 | 5,31 % | 03.11.2023            | 539.587           | 0,50                         |
| 1.000.000  | American Express Co**                 | 6,02 % | 04.03.2025            | 1.006.676         | 0,93                         |
| 1.299.000  | Amgen Inc**                           | 3,63 % | 22.05.2024            | 1.276.643         | 1,18                         |
| 1.400.000  | Analog Devices Inc**                  | 5,34 % | 01.10.2024            | 1.399.170         | 1,30                         |
| 1.011.000  | AT&T Inc*                             | 0,90 % | 25.03.2024            | 976.755           | 0,91                         |
| 2.250.000  | Bank of America Corp**                | 6,15 % | 25.04.2025            | 2.257.514         | 2,08                         |
| 20.000   | Bank of New York Mellon Corp**        | 5,25 % | 25.10.2024            | 19.858            | 0,02                         |
| 1.265.000  | Capital One Financial Corp**          | 5,78 % | 06.12.2024            | 1.244.810         | 1,15                         |
| 330.000  | Capital One Financial Corp**          | 6,44 % | 09.05.2025            | 326.236           | 0,30                         |
| 545.000  | Caterpillar Financial Services Corp** | 5,33 % | 17.05.2024            | 544.671           | 0,50                         |
| 605.000  | Caterpillar Financial Services Corp** | 5,36 % | 13.09.2024            | 604.347           | 0,56                         |
| 345.000  | Citibank NA**                         | 3,65 % | 23.01.2024            | 341.078           | 0,32                         |
| 145.000  | Citigroup Inc**                       | 6,46 % | 24.05.2025            | 145.651           | 0,14                         |
| 1.915.000  | Citigroup Inc**                       | 6,62 % | 17.03.2026            | 1.933.378         | 1,79                         |
| 1.155.000  | Enbridge Inc*                         | 4,00 % | 01.10.2023            | 1.150.494         | 1,07                         |
| 40.000   | Enbridge Inc**                        | 5,72 % | 16.02.2024            | 39.974            | 0,04                         |
| 2.240.000  | Enterprise Products Operating LLC*    | 3,90 % | 15.02.2024            | 2.215.853         | 2,05                         |
| 400.000  | Florida Power & Light Co**            | 5,40 % | 12.01.2024            | 400.008           | 0,37                         |
| 2.670.000  | Goldman Sachs Group Inc**             | 7,06 % | 29.11.2023            | 2.682.816         | 2,49                         |
| 1.175.000  | John Deere Capital Corp**             | 0,25 % | 11.10.2024            | 1.173.475         | 1,09                         |
| 1.195.000  | John Deere Capital Corp**             | 5,12 % | 10.07.2023            | 1.194.971         | 1,11                         |
| 10.000   | John Deere Capital Corp**             | 5,65 % | 07.03.2025            | 10.015            | 0,01                         |

## Commodities - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung           | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---------------------------------|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 39,82 % (31. Dezember 2022: 30,49 %) (Fortsetzung)</b> |                                 |        |                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |                                 |        |                       |                   |                              |
| 2.673.000  | JPMorgan Chase & Co**           | 5,67 % | 23.06.2025            | 2.663.520         | 2,47                         |
| 2.385.000  | Morgan Stanley**                | 5,69 % | 24.01.2025            | 2.380.938         | 2,21                         |
| 1.540.000  | PepsiCo Inc**                   | 5,49 % | 13.02.2026            | 1.547.872         | 1,44                         |
| 1.729.000  | Royal Bank of Canada**          | 5,49 % | 21.01.2025            | 1.721.332         | 1,60                         |
| 1.490.000  | Shell International Finance BV* | 5,72 % | 13.11.2023            | 1.491.707         | 1,38                         |
| 1.425.000  | Simon Property Group LP*        | 3,75 % | 01.02.2024            | 1.407.351         | 1,30                         |
| 55.000   | Starbucks Corp**                | 5,51 % | 14.02.2024            | 55.000            | 0,05                         |
| 1.200.000  | Thermo Fisher Scientific Inc**  | 5,42 % | 18.10.2023            | 1.200.041         | 1,11                         |
| 1.185.000  | Toyota Motor Credit Corp**      | 5,71 % | 22.03.2024            | 1.186.807         | 1,10                         |
| 1.240.000  | Truist Bank**                   | 5,23 % | 17.01.2024            | 1.229.136         | 1,14                         |
| 240.000  | Truist Financial Corp**         | 5,49 % | 09.06.2025            | 232.370           | 0,22                         |
| 1.395.000  | Verizon Communications Inc**    | 5,59 % | 22.03.2024            | 1.395.251         | 1,28                         |
| 2.365.000  | Wells Fargo & Co*               | 3,75 % | 24.01.2024            | 2.338.152         | 2,16                         |
| <b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>  |                                 |        |                       | <b>42.979.774</b> | <b>39,82</b>                 |
| <b>Anlagen insgesamt</b>   |                                 |        |                       | <b>83.953.085</b> | <b>77,80</b>                 |

Devisenterminkontrakte 0,66 % (31. Dezember 2022: 1,77 %)

| Geforderter<br>Betrag   | Zu zahlender<br>Betrag | Fälligkeits-<br>datum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|------------------------|-----------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------------|------------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>   |                        |                       |                                |           |                                      |                              |
| 1.006.738 £   | 1.255.948 US\$         | 20.07.2023            | Standard Chartered Bank        | 3         | 24.107                               | 0,02                         |
| 1.545.839 £   | 1.940.895 US\$         | 20.07.2023            | State Street Bank and Trust Co | 6         | 24.622                               | 0,03                         |
| 27.689.022 £  | 34.547.435 US\$        | 20.07.2023            | Westpac Banking Corp           | 69        | 658.831                              | 0,61                         |
| 467.563 US\$  | 366.747 £              | 20.07.2023            | Standard Chartered Bank        | 1         | 1.248                                | 0,00                         |
| 1.013.573 US\$  | 796.936 £              | 20.07.2023            | Westpac Banking Corp           | 7         | 278                                  | 0,00                         |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                        |                       |                                |           | <b>709.086</b>                       | <b>0,66</b>                  |

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

| Nominalwert   | Datum der<br>Schließung | Variabler Zinssatz | Referenzunternehmen                                     | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------------------|--------------------|---|--------------------------------------|------------------------------|
| USD 106.900.342   | 29.09.2023              | 0,00 <sup>1</sup>  | Goldman Sachs i-Select Strategy 1168 Index <sup>2</sup> | 0                                    | 0,00                         |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Total Return Swap-Kontrakten <sup>∞</sup></b> |                         |                    |   | <b>0</b>                             | <b>0,00</b>                  |

<sup>1</sup> Fester Zinssatz.<sup>2</sup> Die Gegenpartei für den Total Return Swap-Kontrakt ist Goldman Sachs International.

|  |  |  |  | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--|--|-------------------|------------------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> |  |  |  | <b>84.662.171</b> | <b>78,46</b>                 |

## Commodities - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

## Devisenterminkontrakte (0,10 %) (31. Dezember 2022: (0,39 %))

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>  |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 557.837 £  | 714.870 US\$        | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | (5.587)                         | (0,01)               |
| 846.455 £  | 1.080.516 US\$      | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 2         | (4.259)                         | (0,00)               |
| 924.088 £  | 1.177.532 US\$      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 7         | (2.566)                         | (0,00)               |
| 2.152.569 US\$   | 1.718.783 £         | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 6         | (32.844)                        | (0,03)               |
| 1.904.263 US\$   | 1.515.028 £         | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 6         | (22.077)                        | (0,02)               |
| 2.001.712 US\$   | 1.609.278 £         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 33        | (44.467)                        | (0,04)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                                |           | <b>(111.800)</b>                | <b>(0,10)</b>        |

|   | Zeitwert US\$      | % des Nettovermögens |
|---|--------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(111.800)</b>   | <b>(0,10)</b>        |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>84.550.371</b>  | <b>78,36</b>         |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>23.345.259</b>  | <b>21,64</b>         |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>107.895.630</b> | <b>100,00</b>        |

| Portfolioanalyse  | US\$              | % des Gesamtvermögens |
|---|-------------------|-----------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 9.580.312         | 7,99                  |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden            | 74.372.773        | 61,99                 |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente   | 597.286           | 0,49                  |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>84.550.371</b> | <b>70,47</b>          |

## Corporate Hybrid Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                  | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|-----------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 92,33 % (31. Dezember 2022: 91,91 %)</b> |  |        |                       |                 |                              |
| <b>Euro</b>  |  |        |                       |                 |                              |
| 700.000  | Arkema SA*                             | 1,50 % | 29.12.2049            | 620.486         | 0,04                         |
| 17.500.000   | Aroundtown SA*                         | 2,88 % | 29.12.2049            | 6.212.342       | 0,36                         |
| 48.104.000   | AusNet Services Holdings Pty Ltd*      | 1,63 % | 11.03.2081            | 41.068.790      | 2,39                         |
| 67.500.000   | Bayer AG*                              | 2,38 % | 12.11.2079            | 62.843.512      | 3,65                         |
| 51.500.000   | Bayer AG*                              | 3,13 % | 12.11.2079            | 44.781.052      | 2,60                         |
| 7.600.000  | Bayer AG*                              | 5,38 % | 25.03.2082            | 7.058.500       | 0,41                         |
| 100.000  | Bertelsmann SE & Co KGaA*              | 3,50 % | 23.04.2075            | 91.620          | 0,00                         |
| 4.090.000  | BP Capital Markets Plc*                | 3,25 % | 29.12.2049            | 3.778.815       | 0,22                         |
| 44.080.000   | BP Capital Markets Plc*                | 3,63 % | 29.12.2049            | 38.471.746      | 2,24                         |
| 4.400.000  | EDP - Energias de Portugal SA*         | 1,88 % | 14.03.2082            | 3.404.526       | 0,20                         |
| 29.500.000   | Elia Group SA*                         | 5,85 % | 29.12.2049            | 29.665.170      | 1,72                         |
| 41.500.000   | ELM BV for Firmenich International SA* | 3,75 % | 29.12.2049            | 39.772.853      | 2,31                         |
| 75.600.000   | EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG*    | 1,38 % | 31.08.2081            | 60.433.383      | 3,51                         |
| 2.900.000  | EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG*    | 1,63 % | 05.08.2079            | 2.475.797       | 0,14                         |
| 42.700.000   | EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG*    | 1,88 % | 29.06.2080            | 38.245.013      | 2,22                         |
| 6.600.000  | Enel SpA*                              | 6,38 % | 29.12.2049            | 6.660.062       | 0,39                         |
| 3.100.000  | Engie SA*                              | 1,63 % | 29.12.2049            | 2.876.123       | 0,17                         |
| 4.209.000  | Eni SpA*                               | 3,38 % | 29.12.2049            | 3.550.805       | 0,21                         |
| 10.094.000   | ENI SpA*                               | 2,00 % | 29.12.2049            | 8.591.377       | 0,50                         |
| 42.700.000   | Evonik Industries AG*                  | 1,38 % | 02.09.2081            | 35.565.855      | 2,07                         |
| 36.371.000   | Heimstaden Bostad AB*                  | 2,63 % | 29.12.2049            | 17.172.786      | 1,00                         |
| 16.860.000   | Heimstaden Bostad AB*                  | 3,25 % | 29.12.2049            | 10.181.467      | 0,59                         |
| 6.714.000  | Heimstaden Bostad AB*                  | 3,38 % | 29.12.2049            | 3.407.355       | 0,20                         |
| 20.000.000   | Iberdrola International BV*            | 1,45 % | 29.12.2049            | 17.302.920      | 1,01                         |
| 3.900.000  | Iberdrola International BV*            | 1,87 % | 29.12.2049            | 3.516.178       | 0,20                         |
| 9.800.000  | Infineon Technologies AG*              | 3,63 % | 29.12.2049            | 8.970.989       | 0,52                         |
| 32.166.000   | Koninklijke FrieslandCampina NV*       | 2,85 % | 29.12.2049            | 29.061.981      | 1,69                         |
| 3.600.000  | Orange SA*                             | 2,38 % | 29.12.2049            | 3.423.890       | 0,20                         |
| 3.000.000  | Orange SA*                             | 5,25 % | 29.12.2049            | 3.007.671       | 0,17                         |
| 100.000  | Redeia Corp. SA*                       | 4,63 % | 29.12.2049            | 98.569          | 0,01                         |
| 100.000  | Solvay SA*                             | 2,50 % | 29.12.2049            | 92.182          | 0,01                         |
| 104.673.000  | Southern Co*                           | 1,88 % | 15.09.2081            | 82.160.768      | 4,78                         |
| 19.358.000   | SSE Plc*                               | 3,13 % | 29.12.2049            | 17.606.856      | 1,02                         |
| 33.405.000   | SSE Plc*                               | 4,00 % | 29.12.2049            | 30.782.808      | 1,79                         |
| 17.275.000   | Stedin Holding NV*                     | 1,50 % | 29.12.2049            | 14.822.860      | 0,86                         |
| 100.000  | Terna - Rete Elettrica Nazionale*      | 2,38 % | 29.12.2049            | 85.562          | 0,00                         |
| 25.944.000   | TotalEnergies SE*                      | 1,63 % | 29.12.2049            | 21.629.980      | 1,26                         |
| 12.045.000   | TotalEnergies SE*                      | 2,63 % | 29.12.2049            | 11.451.519      | 0,67                         |
| 31.500.000   | Veolia Environnement SA*               | 2,00 % | 29.12.2049            | 26.281.773      | 1,53                         |
| 48.800.000   | Veolia Environnement SA*               | 2,25 % | 29.12.2049            | 44.224.366      | 2,57                         |



## Corporate Hybrid Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR         | % des<br>Netto-<br>vermögens          |
|--|--|--------|-----------------------|-------------------------|---------------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 92,33 % (31. Dezember 2022: 91,91 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                         |                                       |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |  |        |                       |                         |                                       |
| 15.300.000   | Veolia Environnement SA*                             | 2,50 % | 29.12.2049            | 12.677.611              | 0,74                                  |
| 38.000.000   | Vodafone Group Plc*                                  | 6,50 % | 30.08.2084            | 38.258.438              | 2,22                                  |
| 23.900.000   | Volkswagen International Finance NV*                 | 3,88 % | 29.12.2049            | 20.070.909              | 1,17                                  |
| 40.700.000   | Volkswagen International Finance NV*                 | 3,88 % | 29.12.2049            | 36.451.937              | 2,12                                  |
| 25.600.000   | Volkswagen International Finance NV*                 | 4,63 % | 29.12.2049            | 23.136.205              | 1,34                                  |
| <b>Euro insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>912.045.407</b>      | <b>53,02</b>                          |
| <b>Britisches Pfund</b>  |  |        |                       |                         |                                       |
| 33.993.000   | BP Capital Markets Plc*                              | 4,25 % | 29.12.2049            | 34.937.041              | 2,03                                  |
| 18.600.000   | British Telecommunications Plc*                      | 8,38 % | 20.12.2083            | 21.340.594              | 1,24                                  |
| 62.536.000   | Centrica Plc*  | 5,25 % | 10.04.2075            | 69.123.561              | 4,02                                  |
| 8.800.000  | Electricite de France SA*                            | 5,88 % | 29.12.2049            | 8.509.444               | 0,49                                  |
| 76.600.000   | Electricite de France SA*                            | 6,00 % | 29.12.2049            | 81.457.401              | 4,73                                  |
| 108.587.000  | NGG Finance Plc*                                     | 5,63 % | 18.06.2073            | 120.463.405             | 7,00                                  |
| 3.500.000  | Orsted AS*   | 2,50 % | 18.02.3021            | 2.717.758               | 0,16                                  |
| 23.597.000   | SSE Plc*   | 3,74 % | 29.12.2049            | 24.925.280              | 1,45                                  |
| 20.600.000   | Vattenfall AB*                                       | 2,50 % | 29.06.2083            | 19.241.731              | 1,12                                  |
| 32.500.000   | Vattenfall AB*                                       | 6,88 % | 17.08.2083            | 37.258.261              | 2,17                                  |
| <b>Britisches Pfund insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>419.974.476</b>      | <b>24,41</b>                          |
| <b>US-Dollar</b>   |  |        |                       |                         |                                       |
| 75.750.000   | AT Securities BV*                                    | 5,25 % | 29.12.2049            | 28.258.708              | 1,64                                  |
| 48.750.000   | British Telecommunications Plc*                      | 4,25 % | 23.11.2081            | 39.533.133              | 2,30                                  |
| 71.590.000   | Enbridge Inc**                                       | 5,50 % | 15.07.2077            | 58.521.741              | 3,40                                  |
| 31.500.000   | Paramount Global**                                   | 6,38 % | 30.03.2062            | 24.117.864              | 1,40                                  |
| 30.955.000   | Rogers Communications Inc**                          | 5,25 % | 15.03.2082            | 26.290.186              | 1,53                                  |
| 4.919.000  | Transcanada Trust**                                  | 5,30 % | 15.03.2077            | 4.021.497               | 0,23                                  |
| 2.000.000  | Vodafone Group Plc**                                 | 3,25 % | 04.06.2081            | 1.617.023               | 0,10                                  |
| 81.487.000   | Vodafone Group Plc*                                  | 6,25 % | 03.10.2078            | 74.009.018              | 4,30                                  |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |  |        |                       | <b>256.369.170</b>      | <b>14,90</b>                          |
| <b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>1.588.389.053</b>    | <b>92,33</b>                          |
| <b>Anzahl der<br/>Anteile</b>  | <b>Wertpapierbezeichnung</b>                         |        |                       | <b>Zeitwert<br/>EUR</b> | <b>% des<br/>Netto-<br/>vermögens</b> |
| <b>Investmentfonds 0,60 % (31. Dezember 2022: 0,58 %)</b>                      |  |        |                       |                         |                                       |
| <b>US-Dollar</b>   |  |        |                       |                         |                                       |
| 1.300.000  | Neuberger Berman Global Investment Grade Credit Fund |        |                       | 10.426.215              | 0,60                                  |
| <b>Investmentfonds insgesamt <sup>1)</sup></b>                                 |  |        |                       | <b>10.426.215</b>       | <b>0,60</b>                           |
| <b>Anlagen insgesamt</b>   |  |        |                       | <b>1.598.815.268</b>    | <b>92,93</b>                          |

## Corporate Hybrid Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 0,19 % (31. Dezember 2022: 2,05 %)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn EUR | % des Nettovermögens        |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|-------------------------------|-----------------------------|
| 1.774.861 €  | 1.520.930 £         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | 3.696                         | 0,00                        |
| 28.045.483 €   | 30.201.620 US\$     | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | 384.497                       | 0,02                        |
| 19.642.547 €   | 21.283.940 US\$     | 20.07.2023       | UBS AG                      | 3         | 149.064                       | 0,01                        |
| 22.477.139 £   | 25.525.380 €        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | 649.878                       | 0,04                        |
| 1.983.479 £  | 2.304.484 €         | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | 5.332                         | 0,00                        |
| 2.099.495 US\$   | 1.908.538 €         | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | 14.342                        | 0,00                        |
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i>  |                     |                  |                             |           |                               |                             |
| 23.216 €   | 37.710 AUD          | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | 215                           | 0,00                        |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i>  |                     |                  |                             |           |                               |                             |
| 170.311 CHF  | 172.666 €           | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | 1.968                         | 0,00                        |
| 27.074.138 CHF   | 27.548.491 €        | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 8         | 212.908                       | 0,01                        |
| 346.733 €  | 337.219 CHF         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 12        | 953                           | 0,00                        |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>  |                     |                  |                             |           |                               |                             |
| 613.253 €  | 525.327 £           | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 13        | 1.494                         | 0,00                        |
| 231.774 £  | 263.478 €           | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | 6.429                         | 0,00                        |
| 21.853.753 £   | 24.835.051 €        | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 14        | 614.256                       | 0,04                        |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>  |                     |                  |                             |           |                               |                             |
| 19.094 €   | 27.917 SGD          | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 3         | 190                           | 0,00                        |
| <i>Abgesicherte Klassen USD</i>  |                     |                  |                             |           |                               |                             |
| 2.697.917 €  | 2.916.632 US\$      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 30        | 26.638                        | 0,00                        |
| 2.850.984 US\$   | 2.589.259 €         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | 21.893                        | 0,00                        |
| 204.383.440 US\$   | 186.062.676 €       | 20.07.2023       | UBS AG                      | 2         | 1.127.531                     | 0,07                        |
| 1.042.395 US\$   | 948.202 €           | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 18        | 6.506                         | 0,00                        |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>~</sup></b>                        |                     |                  |                             |           | <b>3.227.790</b>              | <b>0,19</b>                 |
|  |                     |                  |                             |           | <b>Zeitwert EUR</b>           | <b>% des Nettovermögens</b> |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> |                     |                  |                             |           | <b>1.602.043.058</b>          | <b>93,12</b>                |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (0,85 %) (31. Dezember 2022: (1,14 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust EUR | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 434.011.886 €      | 382.135.823 £       | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 3         | (10.995.984)                   | (0,64)               |
| 11.806.288 €       | 12.965.386 US\$     | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 4         | (68.418)                       | (0,00)               |
| 4.979.026 €        | 5.444.500 US\$      | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | (7.469)                        | (0,00)               |
| 32.766.695 €       | 28.638.091 £        | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 1         | (583.165)                      | (0,03)               |
| 265.398.241 €      | 292.242.755 US\$    | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 3         | (2.260.341)                    | (0,13)               |
| 1.488.352 £        | 1.733.944 €         | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | (717)                          | (0,00)               |
| 28.320.477 US\$    | 26.206.964 €        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (268.874)                      | (0,02)               |

## Corporate Hybrid Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Devisenterminkontrakte (0,85 %) (31. Dezember 2022: (1,14 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust EUR | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 2.552.478 US\$   | 2.346.839 €         | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | (9.081)                        | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 44.632 AUD   | 27.411 €            | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (188)                          | (0,00)               |
| 2.395.658 AUD  | 1.471.691 €         | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | (10.490)                       | (0,00)               |
| 2.425.554 AUD  | 1.485.448 €         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 2         | (6.012)                        | (0,00)               |
| 17.993 €   | 29.690 AUD          | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (116)                          | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 94.802 CHF   | 97.514 €            | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | (306)                          | (0,00)               |
| 4.196 CHF  | 4.326 €             | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 1         | (24)                           | (0,00)               |
| 99.822 €   | 97.506 CHF          | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 2         | (159)                          | (0,00)               |
| 21.043.759 €   | 20.602.122 CHF      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 24        | (81.337)                       | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 7.420.200 €  | 6.520.187 £         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 76        | (172.744)                      | (0,01)               |
| 1.329 £  | 1.548 €             | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 3         | (1)                            | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 8.169 SGD  | 5.638 €             | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (106)                          | (0,00)               |
| 1.623.897 SGD  | 1.118.280 €         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 9         | (18.676)                       | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen USD</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 15.626.523 €   | 17.165.198 US\$     | 20.07.2023       | UBS AG                      | 2         | (94.696)                       | (0,01)               |
| 8.607.800 €  | 9.499.730 US\$      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 29        | (92.789)                       | (0,01)               |
| 1.524.290 US\$   | 1.412.467 €         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 6         | (16.404)                       | (0,00)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                             |           | <b>(14.688.097)</b>            | <b>(0,85)</b>        |

|   | Zeitwert EUR         | % des Nettovermögens |
|---|----------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(14.688.097)</b>  | <b>(0,85)</b>        |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>1.587.354.961</b> | <b>92,27</b>         |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>133.034.777</b>   | <b>7,73</b>          |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>1.720.389.738</b> | <b>100,00</b>        |

| Portfolioanalyse  | EUR                  | % des Gesamtvermögens |
|---|----------------------|-----------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 1.473.820.742        | 84,59                 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden            | 114.568.311          | 6,58                  |
| µ Investmentfonds   | 10.426.215           | 0,60                  |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente   | (11.460.307)         | (0,66)                |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>1.587.354.961</b> | <b>91,11</b>          |

## Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 29,54 % (31. Dezember 2022: 31,50 %)</b> |   |        |                       |                   |                              |
| <b>Euro</b>  |   |        |                       |                   |                              |
| 700.000  | Banque Ouest Africaine de Developpement*                                      | 2,75 % | 22.01.2033            | 558.456           | 0,02                         |
| 6.921.000  | NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance Plc*                                  | 7,13 % | 19.07.2026            | 2.812.451         | 0,11                         |
| 16.529.000   | Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara*                    | 1,88 % | 05.11.2031            | 13.700.034        | 0,55                         |
| <b>Euro insgesamt</b>  |   |        |                       | <b>17.070.941</b> | <b>0,68</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>   |   |        |                       |                   |                              |
| 2.072.000  | Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC*   | 3,65 % | 02.11.2029            | 1.961.017         | 0,08                         |
| 23.127.000   | Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC*   | 4,60 % | 02.11.2047            | 21.510.538        | 0,87                         |
| 3.684.000  | Abu Dhabi National Energy Co PJSC*  | 4,70 % | 24.04.2033            | 3.667.761         | 0,15                         |
| 4.527.000  | Abu Dhabi Ports Co PJSC*  | 2,50 % | 06.05.2031            | 3.843.749         | 0,15                         |
| 7.530.000  | Adani Electricity Mumbai Ltd*   | 3,95 % | 12.02.2030            | 5.605.752         | 0,22                         |
| 5.990.000  | Adani Green Energy UP Ltd/Prayatna Developers Pvt Ltd/Parampujya Solar Energ* | 6,25 % | 10.12.2024            | 5.749.181         | 0,23                         |
| 5.620.000  | Aeropuerto Internacional de Tocumen SA**                                      | 5,13 % | 11.08.2061            | 4.338.415         | 0,17                         |
| 3.195.000  | African Export-Import Bank*   | 3,80 % | 17.05.2031            | 2.573.109         | 0,10                         |
| 3.978.290  | Alfa Desarrollo SpA**   | 4,55 % | 27.09.2051            | 2.922.870         | 0,12                         |
| 2.556.000  | Alibaba Group Holding Ltd*  | 3,25 % | 09.02.2061            | 1.583.098         | 0,06                         |
| 1.528.000  | AngloGold Ashanti Holdings Plc*   | 3,75 % | 01.10.2030            | 1.312.793         | 0,05                         |
| 3.283.000  | Banco Nacional de Panama*   | 2,50 % | 11.08.2030            | 2.586.164         | 0,10                         |
| 3.143.000  | Bank Leumi Le-Israel BM*  | 3,28 % | 29.01.2031            | 2.816.568         | 0,11                         |
| 17.663.000   | Banque Ouest Africaine de Developpement*                                      | 4,70 % | 22.10.2031            | 14.351.982        | 0,58                         |
| 12.145.000   | Banque Ouest Africaine de Developpement*                                      | 5,00 % | 27.07.2027            | 11.117.922        | 0,45                         |
| 5.905.000  | Bidvest Group UK Plc*   | 3,63 % | 23.09.2026            | 5.278.332         | 0,21                         |
| 10.127.266   | Bioceanico Sovereign Certificate Ltd**  | 0,00 % | 05.06.2034            | 7.086.852         | 0,28                         |
| 2.363.000  | Blossom Joy Ltd*  | 3,10 % | 29.12.2049            | 2.240.525         | 0,09                         |
| 4.310.000  | Braskem Netherlands Finance BV*   | 7,25 % | 13.02.2033            | 4.238.007         | 0,17                         |
| 1.074.486  | Brazil Loan Trust 1*  | 5,48 % | 24.07.2023            | 1.070.188         | 0,04                         |
| 6.983.500  | Brazil Minas SPE via State of Minas Gerais†                                   | 5,33 % | 15.02.2028            | 6.859.473         | 0,27                         |
| 3.254.000  | Cemex SAB de CV**   | 5,13 % | 29.12.2049            | 2.898.742         | 0,12                         |
| 6.750.000  | Cemex SAB de CV**   | 9,13 % | 29.12.2049            | 6.844.480         | 0,27                         |
| 4.626.000  | Cencosud SA*  | 4,38 % | 17.07.2027            | 4.395.140         | 0,18                         |
| 227.000  | China Huadian Overseas Development Management Co Ltd*                         | 4,00 % | 29.12.2049            | 222.797           | 0,01                         |
| 639.000  | Chinalco Capital Holdings Ltd*  | 2,13 % | 03.06.2026            | 577.915           | 0,02                         |
| 7.043.000  | Chinalco Capital Holdings Ltd*  | 4,10 % | 29.12.2049            | 6.884.339         | 0,28                         |
| 8.482.000  | Comision Federal de Electricidad*   | 3,35 % | 09.02.2031            | 6.683.771         | 0,27                         |
| 8.419.000  | Comision Federal de Electricidad*   | 4,69 % | 15.05.2029            | 7.586.609         | 0,30                         |
| 4.988.000  | Comision Federal de Electricidad*   | 6,26 % | 15.02.2052            | 4.206.427         | 0,17                         |
| 2.193.000  | Corp Nacional del Cobre de Chile*   | 3,00 % | 30.09.2029            | 1.929.081         | 0,08                         |
| 6.749.000  | Corp Nacional del Cobre de Chile*   | 3,15 % | 14.01.2030            | 5.986.859         | 0,24                         |
| 6.844.000  | Corp Nacional del Cobre de Chile*   | 3,70 % | 30.01.2050            | 5.192.587         | 0,21                         |
| 1.373.000  | Corp Nacional del Cobre de Chile*   | 4,38 % | 05.02.2049            | 1.158.971         | 0,05                         |

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

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 29,54 % (31. Dezember 2022: 31,50 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |        |                       |                  |                              |
| 3.594.000  | Corp Nacional del Cobre de Chile*                    | 5,13 % | 02.02.2033            | 3.548.316        | 0,14                         |
| 150.000  | Corp Nacional del Cobre de Chile*                    | 6,15 % | 24.10.2036            | 163.185          | 0,01                         |
| 5.870.000  | CSN Inova Ventures**                                 | 6,75 % | 28.01.2028            | 5.451.359        | 0,22                         |
| 9.306.000  | CSN Resources SA**                                   | 4,63 % | 10.06.2031            | 7.113.012        | 0,29                         |
| 2.934.000  | CT Trust**   | 5,13 % | 03.02.2032            | 2.357.441        | 0,09                         |
| 3.314.000  | DP World Crescent Ltd*                               | 3,88 % | 18.07.2029            | 3.140.429        | 0,13                         |
| 3.400.000  | DP World Ltd*  | 6,85 % | 02.07.2037            | 3.683.359        | 0,15                         |
| 5.914.000  | Eastern & Southern African Trade & Development Bank† | 4,13 % | 30.06.2028            | 4.667.920        | 0,19                         |
| 6.949.000  | Eastern & Southern African Trade & Development Bank† | 4,88 % | 23.05.2024            | 6.693.207        | 0,27                         |
| 5.626.000  | Ecopetrol SA*  | 5,88 % | 02.11.2051            | 3.728.476        | 0,15                         |
| 5.120.000  | Ecopetrol SA*  | 6,88 % | 29.04.2030            | 4.674.620        | 0,19                         |
| 4.395.000  | Ecopetrol SA*  | 8,88 % | 13.01.2033            | 4.355.861        | 0,17                         |
| 5.783.000  | Empresa de Transmision Electrica SA†                 | 5,13 % | 02.05.2049            | 4.736.688        | 0,19                         |
| 5.719.000  | Empresa Nacional del Petroleo**                      | 3,45 % | 16.09.2031            | 4.793.181        | 0,19                         |
| 2.231.000  | Empresa Nacional del Petroleo**                      | 4,50 % | 14.09.2047            | 1.678.722        | 0,07                         |
| 1.340.000  | Empresa Nacional del Petroleo†                       | 4,50 % | 14.09.2047            | 1.009.327        | 0,04                         |
| 5.830.000  | Empresa Nacional del Petroleo†                       | 5,25 % | 06.11.2029            | 5.642.701        | 0,23                         |
| 1.814.000  | Empresa Nacional del Petroleo†                       | 6,15 % | 10.05.2033            | 1.813.302        | 0,07                         |
| 4.589.855  | Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd**                   | 2,16 % | 31.03.2034            | 3.907.393        | 0,16                         |
| 8.304.000  | Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd†                    | 2,63 % | 31.03.2036            | 6.717.219        | 0,27                         |
| 9.922.133  | Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd†                    | 2,94 % | 30.09.2040            | 7.984.179        | 0,32                         |
| 5.611.375  | Greenko Power II Ltd†                                | 4,30 % | 13.12.2028            | 4.891.230        | 0,20                         |
| 9.182.000  | Grupo Aval Ltd†                                      | 4,38 % | 04.02.2030            | 7.210.850        | 0,29                         |
| 1.685.000  | IHS Netherlands Holdco BV**                          | 8,00 % | 18.09.2027            | 1.540.090        | 0,06                         |
| 2.633.000  | Kallpa Generacion SA†                                | 4,13 % | 16.08.2027            | 2.461.468        | 0,10                         |
| 5.640.000  | KazMunayGas National Co JSC†                         | 3,50 % | 14.04.2033            | 4.385.551        | 0,18                         |
| 32.727.000   | KazMunayGas National Co JSC†                         | 5,38 % | 24.04.2030            | 30.456.676       | 1,22                         |
| 17.847.000   | KazMunayGas National Co JSC†                         | 5,75 % | 19.04.2047            | 14.590.547       | 0,59                         |
| 8.734.000  | KazMunayGas National Co JSC†                         | 6,38 % | 24.10.2048            | 7.505.331        | 0,30                         |
| 2.026.000  | Khazanah Capital Ltd†                                | 4,88 % | 01.06.2033            | 2.007.129        | 0,08                         |
| 6.221.887  | Leviathan Bond Ltd†                                  | 6,75 % | 30.06.2030            | 5.816.332        | 0,23                         |
| 16.031.080   | MC Brazil Downstream Trading Sarl**                  | 7,25 % | 30.06.2031            | 10.843.299       | 0,43                         |
| 2.850.000  | MDGH GMTN RSC Ltd†                                   | 4,38 % | 22.11.2033            | 2.749.897        | 0,11                         |
| 991.000  | MDGH GMTN RSC Ltd**                                  | 5,08 % | 22.05.2053            | 989.722          | 0,04                         |
| 2.196.000  | MDGH GMTN RSC Ltd†                                   | 5,50 % | 28.04.2033            | 2.311.356        | 0,09                         |
| 5.728.000  | Medco Bell Pte Ltd†                                  | 6,38 % | 30.01.2027            | 5.367.341        | 0,22                         |
| 2.334.000  | Meituan†   | 3,05 % | 28.10.2030            | 1.850.440        | 0,07                         |
| 3.734.000  | Mexico City Airport Trust†                           | 5,50 % | 31.07.2047            | 3.266.341        | 0,13                         |
| 9.763.000  | Minmetals Bounteous Finance BVI Ltd†                 | 3,38 % | 29.12.2049            | 9.465.912        | 0,38                         |
| 4.496.000  | NBK Tier 1 Financing 2 Ltd†                          | 4,50 % | 29.12.2049            | 4.137.939        | 0,17                         |

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

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                      | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 29,54 % (31. Dezember 2022: 31,50 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |         |                       |                  |                              |
| 11.154.000   | Nexa Resources SA**  | 5,38 %  | 04.05.2027            | 10.418.412       | 0,42                         |
| 6.754.000  | NWD MTN Ltd*   | 4,13 %  | 18.07.2029            | 5.539.766        | 0,22                         |
| 17.067.000   | Oil & Gas Holding Co BSCC**                                | 7,50 %  | 25.10.2027            | 17.352.650       | 0,70                         |
| 4.043.000  | Ooredoo International Finance Ltd*                         | 2,63 %  | 08.04.2031            | 3.491.122        | 0,14                         |
| 4.474.000  | Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III*                    | 4,70 %  | 06.06.2032            | 4.443.071        | 0,18                         |
| 2.675.000  | Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara* | 4,38 %  | 05.02.2050            | 2.015.953        | 0,08                         |
| 8.423.000  | Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara* | 5,25 %  | 15.05.2047            | 7.402.101        | 0,30                         |
| 13.882.000   | Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara* | 6,15 %  | 21.05.2048            | 13.434.930       | 0,54                         |
| 10.489.000   | Petrobras Global Finance BV**                              | 6,50 %  | 03.07.2033            | 10.279.220       | 0,41                         |
| 11.455.000   | Petroleos de Venezuela SA*                                 | 5,38 %  | 12.04.2027            | 404.473          | 0,02                         |
| 730.000  | Petroleos de Venezuela SA*                                 | 5,50 %  | 12.04.2037            | 28.287           | 0,00                         |
| 38.698.964   | Petroleos de Venezuela SA*                                 | 6,00 %  | 16.05.2024            | 1.499.585        | 0,06                         |
| 26.169.079   | Petroleos de Venezuela SA**                                | 6,00 %  | 15.11.2026            | 909.376          | 0,04                         |
| 5.618.000  | Petroleos del Peru SA*                                     | 4,75 %  | 19.06.2032            | 4.255.604        | 0,17                         |
| 25.851.000   | Petroleos del Peru SA*                                     | 5,63 %  | 19.06.2047            | 16.698.010       | 0,67                         |
| 7.161.000  | Petroleos Mexicanos*                                       | 6,75 %  | 21.09.2047            | 4.503.361        | 0,18                         |
| 14.105.000   | Petroleos Mexicanos*                                       | 6,95 %  | 28.01.2060            | 8.808.695        | 0,35                         |
| 61.060.000   | Petroleos Mexicanos*                                       | 7,69 %  | 23.01.2050            | 41.438.003       | 1,66                         |
| 5.879.000  | Petroleos Mexicanos**                                      | 10,00 % | 07.02.2033            | 5.390.288        | 0,22                         |
| 3.706.000  | Power Finance Corp Ltd*                                    | 3,95 %  | 23.04.2030            | 3.299.229        | 0,13                         |
| 2.898.000  | Powerchina Roadbridge Group British Virgin Islands Ltd**   | 3,08 %  | 29.12.2049            | 2.709.630        | 0,11                         |
| 4.596.000  | QatarEnergy*   | 3,30 %  | 12.07.2051            | 3.381.323        | 0,14                         |
| 3.147.000  | QNB Finance Ltd*   | 2,75 %  | 12.02.2027            | 2.910.588        | 0,12                         |
| 10.097.000   | Reliance Industries Ltd*                                   | 2,88 %  | 12.01.2032            | 8.426.746        | 0,34                         |
| 9.411.000  | Reliance Industries Ltd*                                   | 3,63 %  | 12.01.2052            | 6.725.914        | 0,27                         |
| 5.850.000  | Sasol Financing USA LLC*                                   | 5,88 %  | 27.03.2024            | 5.779.670        | 0,23                         |
| 10.610.000   | Sasol Financing USA LLC*                                   | 6,50 %  | 27.09.2028            | 9.497.160        | 0,38                         |
| 3.969.000  | Sasol Financing USA LLC*                                   | 8,75 %  | 03.05.2029            | 3.870.597        | 0,15                         |
| 13.694.000   | Saudi Arabian Oil Co*                                      | 4,25 %  | 16.04.2039            | 12.103.990       | 0,49                         |
| 1.782.000  | Saudi Electricity Sukuk Programme Co*                      | 5,68 %  | 11.04.2053            | 1.773.461        | 0,07                         |
| 2.000.000  | Sinopec Group Overseas Development 2015 Ltd*               | 4,10 %  | 28.04.2045            | 1.730.694        | 0,07                         |
| 2.645.000  | Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd*               | 3,35 %  | 13.05.2050            | 1.984.054        | 0,08                         |
| 2.904.000  | Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd*               | 3,68 %  | 08.08.2049            | 2.325.534        | 0,09                         |
| 53.792.000   | Southern Gas Corridor CJSC*                                | 6,88 %  | 24.03.2026            | 54.744.118       | 2,20                         |
| 28.891.000   | State Oil Co of the Azerbaijan Republic*                   | 6,95 %  | 18.03.2030            | 29.843.247       | 1,20                         |
| 4.696.000  | Suzano Austria GmbH**                                      | 7,00 %  | 16.03.2047            | 4.744.814        | 0,19                         |
| 1.876.000  | Telecomunicaciones Digitales SA**                          | 4,50 %  | 30.01.2030            | 1.597.071        | 0,06                         |
| 6.803.000  | Tencent Holdings Ltd*                                      | 3,24 %  | 03.06.2050            | 4.469.315        | 0,18                         |
| 778.000  | Tencent Holdings Ltd**                                     | 3,29 %  | 03.06.2060            | 483.075          | 0,02                         |
| 1.900.000  | Tengizchevroil Finance Co International Ltd**              | 2,63 %  | 15.08.2025            | 1.731.708        | 0,07                         |

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

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                             | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|---------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 29,54 % (31. Dezember 2022: 31,50 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                    |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                    |                              |
| 5.985.000  | Tengizchevroil Finance Co International Ltd**     | 3,25 %  | 15.08.2030            | 4.581.218          | 0,18                         |
| 1.880.000  | Transnet SOC Ltd*                                 | 8,25 %  | 06.02.2028            | 1.830.650          | 0,07                         |
| 4.752.000  | Turkiye Vakiflar Bankasi TAO*                     | 6,50 %  | 08.01.2026            | 4.428.270          | 0,18                         |
| 57.000   | Ukreximbank Via Biz Finance Plc**                 | 9,75 %  | 22.01.2025            | 49.031             | 0,00                         |
| 6.250.000  | Vedanta Resources Finance II Plc*                 | 8,95 %  | 11.03.2025            | 4.725.188          | 0,19                         |
| 4.472.000  | Vedanta Resources Finance II Plc*                 | 13,88 % | 21.01.2024            | 4.084.345          | 0,16                         |
| 450.000  | Vnesheconombank Via VEB Finance Plc*              | 6,80 %  | 22.11.2025            | 27.070             | 0,00                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |   |         |                       | <b>719.159.979</b> | <b>28,86</b>                 |
| <b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>  |   |         |                       | <b>736.230.920</b> | <b>29,54</b>                 |
| <b>Staatsanleihen 65,56 % (31. Dezember 2022: 60,52 %)</b>                     |   |         |                       |                    |                              |
| <b>Euro</b>  |   |         |                       |                    |                              |
| 10.028.000   | Bank Gospodarstwa Krajowego*                      | 5,13 %  | 22.02.2033            | 11.367.645         | 0,46                         |
| 1.825.000  | Benin Government International Bond*              | 4,88 %  | 19.01.2032            | 1.516.920          | 0,06                         |
| 9.589.000  | Benin Government International Bond*              | 4,95 %  | 22.01.2035            | 7.420.935          | 0,30                         |
| 1.367.000  | Benin Government International Bond*              | 6,88 %  | 19.01.2052            | 1.059.175          | 0,04                         |
| 2.600.000  | Chile Government International Bond*              | 0,83 %  | 02.07.2031            | 2.238.077          | 0,09                         |
| 2.800.000  | Chile Government International Bond*              | 1,88 %  | 27.05.2030            | 2.687.760          | 0,11                         |
| 1.757.000  | Egypt Government International Bond*              | 4,75 %  | 11.04.2025            | 1.529.607          | 0,06                         |
| 3.170.000  | Egypt Government International Bond*              | 4,75 %  | 16.04.2026            | 2.442.141          | 0,10                         |
| 10.344.000   | Egypt Government International Bond*              | 5,63 %  | 16.04.2030            | 6.290.880          | 0,25                         |
| 28.113.000   | Egypt Government International Bond*              | 6,38 %  | 11.04.2031            | 17.116.477         | 0,69                         |
| 1.600.000  | Indonesia Government International Bond*          | 1,00 %  | 28.07.2029            | 1.455.551          | 0,06                         |
| 13.889.000   | Indonesia Government International Bond*          | 1,10 %  | 12.03.2033            | 11.259.392         | 0,45                         |
| 32.691.000   | Indonesia Government International Bond*          | 1,40 %  | 30.10.2031            | 28.254.011         | 1,13                         |
| 4.379.000  | Indonesia Government International Bond*          | 3,75 %  | 14.06.2028            | 4.747.740          | 0,19                         |
| 4.420.000  | Ivory Coast Government International Bond*        | 4,88 %  | 30.01.2032            | 3.765.786          | 0,15                         |
| 20.169.000   | Ivory Coast Government International Bond*        | 5,25 %  | 22.03.2030            | 18.648.220         | 0,75                         |
| 29.660.000   | Ivory Coast Government International Bond*        | 6,63 %  | 22.03.2048            | 23.031.344         | 0,92                         |
| 34.005.000   | Ivory Coast Government International Bond*        | 6,88 %  | 17.10.2040            | 28.268.264         | 1,13                         |
| 2.750.000  | Kazakhstan Government International Bond*         | 1,50 %  | 30.09.2034            | 2.163.307          | 0,09                         |
| 1.018.000  | Kazakhstan Government International Bond*         | 2,38 %  | 09.11.2028            | 1.006.444          | 0,04                         |
| 800.000  | Mexico Government International Bond*             | 2,25 %  | 12.08.2036            | 647.878            | 0,03                         |
| 36.522.000   | Peruvian Government International Bond*           | 1,25 %  | 11.03.2033            | 30.099.730         | 1,21                         |
| 18.107.000   | Peruvian Government International Bond*           | 1,95 %  | 17.11.2036            | 14.340.398         | 0,58                         |
| 13.993.000   | Peruvian Government International Bond*           | 3,75 %  | 01.03.2030            | 14.826.310         | 0,59                         |
| 5.493.000  | Philippine Government International Bond*         | 1,75 %  | 28.04.2041            | 3.918.398          | 0,16                         |
| 2.675.372  | Provincia de Buenos Aires*                        | 4,00 %  | 01.09.2037            | 994.767            | 0,04                         |
| 9.677.000  | Republic of Cameroon International Bond*          | 5,95 %  | 07.07.2032            | 7.623.701          | 0,31                         |
| 4.430.000  | Republic of Poland Government International Bond* | 4,25 %  | 14.02.2043            | 4.761.696          | 0,19                         |

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

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                             | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 65,56 % (31. Dezember 2022: 60,52 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                    |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |   |        |                       |                    |                              |
| 3.470.000  | Romanian Government International Bond*           | 2,00 % | 28.01.2032            | 2.788.462          | 0,11                         |
| 9.942.000  | Romanian Government International Bond*           | 2,00 % | 14.04.2033            | 7.686.822          | 0,31                         |
| 856.000  | Romanian Government International Bond*           | 2,12 % | 16.07.2031            | 710.004            | 0,03                         |
| 6.016.000  | Romanian Government International Bond*           | 2,63 % | 02.12.2040            | 4.009.057          | 0,16                         |
| 3.683.000  | Romanian Government International Bond*           | 2,88 % | 13.04.2042            | 2.478.987          | 0,10                         |
| 30.775.000   | Romanian Government International Bond*           | 3,38 % | 28.01.2050            | 21.105.635         | 0,85                         |
| 1.000.000  | Romanian Government International Bond*           | 3,62 % | 26.05.2030            | 957.858            | 0,04                         |
| 28.196.000   | Romanian Government International Bond*           | 3,75 % | 07.02.2034            | 24.948.310         | 1,00                         |
| 23.600.000   | Romanian Government International Bond*           | 3,88 % | 29.10.2035            | 20.468.956         | 0,82                         |
| 3.272.000  | Romanian Government International Bond*           | 4,63 % | 03.04.2049            | 2.765.972          | 0,11                         |
| 6.507.000  | Senegal Government International Bond*            | 4,75 % | 13.03.2028            | 6.131.921          | 0,25                         |
| 35.479.000   | Serbia International Bond*                        | 1,50 % | 26.06.2029            | 30.014.406         | 1,20                         |
| 12.451.000   | Serbia International Bond*                        | 1,65 % | 03.03.2033            | 9.078.527          | 0,36                         |
| 17.115.000   | Serbia International Bond*                        | 2,05 % | 23.09.2036            | 11.500.035         | 0,46                         |
| 833.000  | Serbia International Bond*                        | 3,13 % | 15.05.2027            | 818.523            | 0,03                         |
| 6.760.000  | Tunisian Republic*                                | 5,63 % | 17.02.2024            | 6.130.897          | 0,25                         |
| 9.031.000  | Tunisian Republic*                                | 6,38 % | 15.07.2026            | 5.753.949          | 0,23                         |
| 8.615.000  | Ukraine Government International Bond**           | 6,75 % | 20.06.2028            | 2.031.821          | 0,08                         |
| <b>Euro insgesamt</b>  |   |        |                       | <b>412.862.696</b> | <b>16,57</b>                 |
| <b>US-Dollar</b>   |   |        |                       |                    |                              |
| 7.924.000  | Abu Dhabi Government International Bond*          | 2,70 % | 02.09.2070            | 4.849.092          | 0,19                         |
| 8.613.000  | Abu Dhabi Government International Bond*          | 3,00 % | 15.09.2051            | 6.128.184          | 0,25                         |
| 5.643.000  | Angolan Government International Bond*            | 8,25 % | 09.05.2028            | 5.019.731          | 0,20                         |
| 18.427.000   | Angolan Government International Bond*            | 8,75 % | 14.04.2032            | 15.535.343         | 0,62                         |
| 15.784.000   | Angolan Government International Bond*            | 9,13 % | 26.11.2049            | 12.212.870         | 0,49                         |
| 40.343.000   | Angolan Government International Bond*            | 9,38 % | 08.05.2048            | 32.028.711         | 1,28                         |
| 28.187.000   | Arab Republic of Egypt*                           | 8,88 % | 29.05.2050            | 15.268.052         | 0,61                         |
| 50.350.000   | Argentine Republic Government International Bond* | 0,50 % | 09.07.2030            | 16.845.410         | 0,68                         |
| 153.180.568  | Argentine Republic Government International Bond* | 1,50 % | 09.07.2035            | 46.077.783         | 1,85                         |
| 11.700.000   | Bahamas Government International Bond*            | 6,00 % | 21.11.2028            | 9.447.750          | 0,38                         |
| 4.928.000  | Bank Gospodarstwa Krajowego*                      | 5,38 % | 22.05.2033            | 4.904.863          | 0,20                         |
| 2.674.000  | Bermuda Government International Bond*            | 2,38 % | 20.08.2030            | 2.242.176          | 0,09                         |
| 1.809.000  | Bermuda Government International Bond*            | 3,72 % | 25.01.2027            | 1.727.595          | 0,07                         |
| 13.898.000   | Bermuda Government International Bond*            | 4,75 % | 15.02.2029            | 13.630.464         | 0,55                         |
| 8.658.000  | Bermuda Government International Bond*            | 5,00 % | 15.07.2032            | 8.463.195          | 0,34                         |
| 10.659.000   | Brazilian Government International Bond*          | 5,63 % | 07.01.2041            | 9.456.298          | 0,38                         |
| 17.610.000   | Brazilian Government International Bond*          | 5,63 % | 21.02.2047            | 14.870.230         | 0,60                         |
| 14.738.000   | Brazilian Government International Bond*          | 6,00 % | 20.10.2033            | 14.596.602         | 0,59                         |
| 6.492.000  | Chile Government International Bond*              | 3,25 % | 21.09.2071            | 4.227.964          | 0,17                         |



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

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                            | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 65,56 % (31. Dezember 2022: 60,52 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |         |                       |                  |                              |
| 5.772.000  | Chile Government International Bond**            | 4,95 %  | 05.01.2036            | 5.704.776        | 0,23                         |
| 27.695.000   | Colombia Government International Bond*          | 3,00 %  | 30.01.2030            | 21.596.090       | 0,87                         |
| 29.812.000   | Colombia Government International Bond*          | 5,00 %  | 15.06.2045            | 20.828.726       | 0,84                         |
| 24.357.000   | Colombia Government International Bond*          | 5,20 %  | 15.05.2049            | 16.794.151       | 0,67                         |
| 7.587.000  | Colombia Government International Bond*          | 6,13 %  | 18.01.2041            | 6.200.241        | 0,25                         |
| 1.471.000  | Costa Rica Government International Bond*        | 7,16 %  | 12.03.2045            | 1.460.486        | 0,06                         |
| 5.316.000  | Development Bank of Mongolia LLC*                | 7,25 %  | 23.10.2023            | 5.296.065        | 0,21                         |
| 39.195.000   | Dominican Republic International Bond*           | 5,88 %  | 30.01.2060            | 30.471.726       | 1,22                         |
| 6.800.000  | Dominican Republic International Bond*           | 6,00 %  | 19.07.2028            | 6.644.305        | 0,27                         |
| 22.017.000   | Dominican Republic International Bond*           | 6,00 %  | 22.02.2033            | 20.358.759       | 0,82                         |
| 553.000  | Dominican Republic International Bond*           | 6,40 %  | 05.06.2049            | 472.551          | 0,02                         |
| 26.430.000   | Dominican Republic International Bond*           | 6,85 %  | 27.01.2045            | 24.056.468       | 0,96                         |
| 4.533.000  | Dominican Republic International Bond*           | 7,05 %  | 03.02.2031            | 4.526.141        | 0,18                         |
| 5.774.110  | Ecuador Government International Bond*           | 0,00 %  | 31.07.2030            | 1.691.121        | 0,07                         |
| 17.538.001   | Ecuador Government International Bond*           | 1,50 %  | 31.07.2040            | 5.498.163        | 0,22                         |
| 80.502.248   | Ecuador Government International Bond*           | 2,50 %  | 31.07.2035            | 28.137.865       | 1,13                         |
| 11.013.929   | Ecuador Government International Bond*           | 5,50 %  | 31.07.2030            | 5.350.883        | 0,21                         |
| 13.331.000   | Egypt Government International Bond*             | 7,90 %  | 21.02.2048            | 6.879.729        | 0,28                         |
| 688.000  | Egypt Government International Bond*             | 8,15 %  | 20.11.2059            | 358.813          | 0,01                         |
| 33.950.000   | Egypt Government International Bond*             | 8,50 %  | 31.01.2047            | 18.124.615       | 0,73                         |
| 5.113.000  | Egypt Government International Bond*             | 8,70 %  | 01.03.2049            | 2.770.024        | 0,11                         |
| 6.658.000  | El Salvador Government International Bond*       | 7,12 %  | 20.01.2050            | 3.721.694        | 0,15                         |
| 1.040.000  | El Salvador Government International Bond*       | 7,63 %  | 01.02.2041            | 596.918          | 0,02                         |
| 15.037.000   | El Salvador Government International Bond*       | 7,65 %  | 15.06.2035            | 8.932.552        | 0,36                         |
| 50.689.000   | El Salvador Government International Bond*       | 9,50 %  | 15.07.2052            | 32.137.518       | 1,29                         |
| 4.130.000  | Emirate of Dubai Government International Bonds* | 3,90 %  | 09.09.2050            | 3.003.229        | 0,12                         |
| 2.000.000  | Ghana Government International Bond*             | 6,38 %  | 11.02.2027            | 867.960          | 0,03                         |
| 13.833.000   | Ghana Government International Bond*             | 7,63 %  | 16.05.2029            | 5.961.221        | 0,24                         |
| 15.125.000   | Ghana Government International Bond*             | 7,75 %  | 07.04.2029            | 6.520.645        | 0,26                         |
| 12.017.000   | Ghana Government International Bond*             | 7,88 %  | 11.02.2035            | 5.247.980        | 0,21                         |
| 11.138.000   | Ghana Government International Bond*             | 8,63 %  | 07.04.2034            | 4.797.693        | 0,19                         |
| 5.375.000  | Ghana Government International Bond*             | 8,75 %  | 11.03.2061            | 2.241.751        | 0,09                         |
| 4.857.000  | Ghana Government International Bond*             | 8,88 %  | 07.05.2042            | 2.010.341        | 0,08                         |
| 8.151.000  | Ghana Government International Bond*             | 8,95 %  | 26.03.2051            | 3.414.454        | 0,14                         |
| 31.534.000   | Ghana Government International Bond*             | 10,75 % | 14.10.2030            | 21.300.050       | 0,85                         |
| 5.237.000  | Guatemala Government Bond*                       | 3,70 %  | 07.10.2033            | 4.238.724        | 0,17                         |
| 735.000  | Guatemala Government Bond*                       | 5,25 %  | 10.08.2029            | 701.231          | 0,03                         |
| 6.190.000  | Guatemala Government Bond*                       | 5,38 %  | 24.04.2032            | 5.891.160        | 0,24                         |
| 17.898.000   | Guatemala Government Bond*                       | 6,60 %  | 13.06.2036            | 18.030.794       | 0,72                         |
| 3.260.000  | Honduras Government International Bond*          | 5,63 %  | 24.06.2030            | 2.645.303        | 0,11                         |

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

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                      | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 65,56 % (31. Dezember 2022: 60,52 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |        |                       |                  |                              |
| 1.247.000  | Honduras Government International Bond*    | 6,25 % | 19.01.2027            | 1.138.318        | 0,05                         |
| 1.300.000  | Hungary Government International Bond*     | 7,63 % | 29.03.2041            | 1.468.910        | 0,06                         |
| 3.500.000  | Indonesia Government International Bond*   | 4,85 % | 11.01.2033            | 3.491.691        | 0,14                         |
| 2.600.000  | Indonesia Government International Bond*   | 5,13 % | 15.01.2045            | 2.592.509        | 0,10                         |
| 2.765.000  | Indonesia Government International Bond*   | 5,25 % | 17.01.2042            | 2.765.618        | 0,11                         |
| 400.000  | Indonesia Government International Bond*   | 7,75 % | 17.01.2038            | 500.911          | 0,02                         |
| 10.437.000   | Indonesia Government International Bond*   | 8,50 % | 12.10.2035            | 13.591.040       | 0,54                         |
| 18.449.000   | Colombia Government International Bond*    | 7,50 % | 02.02.2034            | 18.087.836       | 0,73                         |
| 7.962.000  | Colombia Government International Bond*    | 8,00 % | 20.04.2033            | 8.098.183        | 0,32                         |
| 1.043.000  | Corp Financiera de Desarrollo SA*          | 2,40 % | 28.09.2027            | 909.809          | 0,04                         |
| 6.077.000  | Costa Rica Government International Bond*  | 6,55 % | 03.04.2034            | 6.110.424        | 0,24                         |
| 2.809.000  | Costa Rica Government International Bond*  | 7,00 % | 04.04.2044            | 2.745.133        | 0,11                         |
| 921.250  | Iraq International Bond*                   | 5,80 % | 15.01.2028            | 848.348          | 0,03                         |
| 6.634.390  | Ivory Coast Government International Bond* | 5,75 % | 31.12.2032            | 6.205.523        | 0,25                         |
| 3.799.000  | Jordan Government International Bond*      | 7,50 % | 13.01.2029            | 3.829.346        | 0,15                         |
| 45.992.000   | Lebanon Government International Bond*     | 6,38 % | 09.03.2020            | 3.150.820        | 0,13                         |
| 21.038.000   | Lebanon Government International Bond*     | 6,60 % | 27.11.2026            | 1.427.218        | 0,06                         |
| 58.532.000   | Lebanon Government International Bond*     | 6,65 % | 26.02.2030            | 3.950.910        | 0,16                         |
| 6.112.000  | Lebanon Government International Bond*     | 6,85 % | 25.05.2029            | 407.793          | 0,02                         |
| 83.325.000   | Lebanon Government International Bond*     | 8,25 % | 17.05.2034            | 5.612.772        | 0,22                         |
| 42.644.000   | Mexico Government International Bond*      | 5,75 % | 12.10.2110            | 38.162.907       | 1,53                         |
| 1.223.000  | Mexico Government International Bond*      | 6,35 % | 09.02.2035            | 1.288.787        | 0,05                         |
| 11.771.000   | Mongolia Government International Bond*    | 3,50 % | 07.07.2027            | 9.844.311        | 0,39                         |
| 8.042.000  | Mongolia Government International Bond*    | 5,13 % | 07.04.2026            | 7.498.986        | 0,30                         |
| 12.119.000   | Mongolia Government International Bond*    | 8,65 % | 19.01.2028            | 12.225.041       | 0,49                         |
| 7.022.000  | Mongolia Government International Bond*    | 8,75 % | 09.03.2024            | 7.078.176        | 0,28                         |
| 3.300.000  | Morocco Government International Bond*     | 5,50 % | 11.12.2042            | 2.849.071        | 0,11                         |
| 6.284.000  | Morocco Government International Bond*     | 6,50 % | 08.09.2033            | 6.488.230        | 0,26                         |
| 328.000  | Nigeria Government International Bond*     | 7,63 % | 21.11.2025            | 314.721          | 0,01                         |
| 2.059.000  | Nigeria Government International Bond*     | 7,70 % | 23.02.2038            | 1.548.043        | 0,06                         |
| 13.081.000   | Nigeria Government International Bond*     | 7,88 % | 16.02.2032            | 11.003.057       | 0,44                         |
| 9.342.000  | Nigeria Government International Bond*     | 8,25 % | 28.09.2051            | 6.999.307        | 0,28                         |
| 3.326.000  | Nigeria Government International Bond*     | 8,38 % | 24.03.2029            | 3.000.800        | 0,12                         |
| 10.975.000   | Nigeria Government International Bond*     | 8,75 % | 21.01.2031            | 9.856.977        | 0,40                         |
| 34.975.000   | Oman Government International Bond*        | 6,75 % | 17.01.2048            | 33.680.645       | 1,35                         |
| 2.960.000  | Oman Government International Bond*        | 7,00 % | 25.01.2051            | 2.936.903        | 0,12                         |
| 1.893.000  | Panama Government International Bond*      | 4,50 % | 19.01.2063            | 1.389.692        | 0,06                         |
| 19.550.000   | Panama Government International Bond*      | 6,40 % | 14.02.2035            | 20.436.188       | 0,82                         |
| 10.432.000   | Panama Government International Bond*      | 6,70 % | 26.01.2036            | 11.196.201       | 0,45                         |
| 8.742.000  | Panama Government International Bond*      | 6,85 % | 28.03.2054            | 9.115.683        | 0,37                         |

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

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                   | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 65,56 % (31. Dezember 2022: 60,52 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 7.524.000  | Papua New Guinea Government International Bond*         | 8,38 % | 04.10.2028            | 7.050.299        | 0,28                         |
| 1.032.000  | Paraguay Government International Bond*                 | 3,85 % | 28.06.2033            | 898.271          | 0,04                         |
| 8.803.000  | Paraguay Government International Bond*                 | 4,95 % | 28.04.2031            | 8.478.271        | 0,34                         |
| 3.375.000  | Paraguay Government International Bond*                 | 5,40 % | 30.03.2050            | 2.890.737        | 0,12                         |
| 14.082.000   | Paraguay Government International Bond*                 | 5,60 % | 13.03.2048            | 12.386.420       | 0,50                         |
| 4.991.000  | Paraguay Government International Bond*                 | 6,10 % | 11.08.2044            | 4.738.219        | 0,19                         |
| 2.371.000  | Philippine Government International Bond*               | 5,50 % | 17.01.2048            | 2.435.813        | 0,10                         |
| 1.612.000  | Philippine Government International Bond*               | 5,61 % | 13.04.2033            | 1.705.355        | 0,07                         |
| 540.002  | Provincia de Cordoba*                                   | 6,88 % | 10.12.2025            | 407.701          | 0,02                         |
| 3.636.000  | Provincia de Mendoza Argentina*                         | 5,75 % | 19.03.2029            | 2.817.900        | 0,11                         |
| 7.600.000  | Qatar Government International Bond*                    | 4,40 % | 16.04.2050            | 6.931.154        | 0,28                         |
| 31.757.000   | Qatar Government International Bond*                    | 4,82 % | 14.03.2049            | 30.580.943       | 1,23                         |
| 13.166.000   | Republic of Armenia International Bond*                 | 3,60 % | 02.02.2031            | 10.353.742       | 0,41                         |
| 1.800.000  | Republic of Azerbaijan International Bond*              | 5,13 % | 01.09.2029            | 1.727.976        | 0,07                         |
| 4.402.000  | Republic of Kenya Government International Bond*        | 6,30 % | 23.01.2034            | 3.335.382        | 0,13                         |
| 3.290.000  | Republic of Kenya Government International Bond*        | 8,25 % | 28.02.2048            | 2.529.158        | 0,10                         |
| 8.419.000  | Republic of Poland Government International Bond*       | 5,50 % | 04.04.2053            | 8.494.367        | 0,34                         |
| 5.322.000  | Republic of Poland Government International Bond*       | 5,75 % | 16.11.2032            | 5.591.942        | 0,22                         |
| 29.008.000   | Republic of South Africa Government International Bond* | 5,75 % | 30.09.2049            | 20.605.833       | 0,83                         |
| 20.450.000   | Republic of South Africa Government International Bond* | 7,30 % | 20.04.2052            | 17.243.031       | 0,69                         |
| 2.601.000  | Republic of Uzbekistan International Bond*              | 4,75 % | 20.02.2024            | 2.579.412        | 0,10                         |
| 7.990.000  | Republic of Uzbekistan International Bond*              | 5,38 % | 20.02.2029            | 7.329.571        | 0,30                         |
| 3.630.000  | Romanian Government International Bond*                 | 7,13 % | 17.01.2033            | 3.853.437        | 0,15                         |
| 1.528.000  | Romanian Government International Bond*                 | 7,63 % | 17.01.2053            | 1.683.424        | 0,07                         |
| 11.443.000   | Sri Lanka Government International Bond*                | 5,75 % | 18.04.2023            | 5.219.812        | 0,21                         |
| 2.503.000  | Sri Lanka Government International Bond*                | 5,88 % | 25.07.2024            | 1.164.246        | 0,05                         |
| 6.070.000  | Sri Lanka Government International Bond*                | 6,13 % | 03.06.2025            | 2.895.716        | 0,12                         |
| 19.443.000   | Sri Lanka Government International Bond*                | 6,20 % | 11.05.2027            | 8.951.694        | 0,36                         |
| 16.169.000   | Sri Lanka Government International Bond*                | 6,75 % | 18.04.2028            | 7.445.993        | 0,30                         |
| 15.086.000   | Sri Lanka Government International Bond*                | 6,85 % | 14.03.2024            | 6.947.990        | 0,28                         |
| 15.820.000   | Sri Lanka Government International Bond*                | 6,85 % | 03.11.2025            | 7.538.620        | 0,30                         |
| 18.879.000   | Sri Lanka Government International Bond*                | 7,55 % | 28.03.2030            | 8.691.862        | 0,35                         |
| 43.860.000   | Sri Lanka Government International Bond*                | 7,85 % | 14.03.2029            | 20.192.968       | 0,81                         |
| 6.462.000  | State Agency of Roads of Ukraine*                       | 6,25 % | 24.06.2030            | 1.415.178        | 0,06                         |
| 8.548.000  | Turkey Government International Bond*                   | 6,00 % | 14.01.2041            | 6.316.698        | 0,25                         |
| 14.987.000   | Turkey Government International Bond*                   | 9,13 % | 13.07.2030            | 14.893.032       | 0,60                         |
| 9.596.000  | Turkey Government International Bond*                   | 9,38 % | 14.03.2029            | 9.641.965        | 0,39                         |
| 4.715.000  | Turkiye Ihracat Kredi Bankasi AS*                       | 9,38 % | 31.01.2026            | 4.702.854        | 0,19                         |
| 2.517.000  | UAE International Government Bond*                      | 4,95 % | 07.07.2052            | 2.499.698        | 0,10                         |
| 5.161.000  | Ukraine Government International Bond*                  | 6,88 % | 21.05.2031            | 1.192.449        | 0,05                         |

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

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                    | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$     | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|----------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 65,56 % (31. Dezember 2022: 60,52 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                      |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |        |                       |                      |                              |
| 1.713.000  | Ukraine Government International Bond*   | 7,25 % | 15.03.2035            | 402.555              | 0,02                         |
| 14.203.000   | Ukraine Government International Bond*   | 7,38 % | 25.09.2034            | 3.318.602            | 0,13                         |
| 6.784.000  | Ukraine Government International Bond*   | 7,75 % | 01.09.2027            | 1.651.904            | 0,07                         |
| 14.549.000   | Ukraine Government International Bond*   | 7,75 % | 01.09.2029            | 3.524.044            | 0,14                         |
| 15.381.000   | Ukraine Government International Bond*   | 7,75 % | 01.08.2041            | 6.072.111            | 0,24                         |
| 14.305.000   | Ukraine Government International Bond*   | 9,75 % | 01.11.2030            | 3.577.123            | 0,14                         |
| 9.514.000  | Uzbekneftegaz JSC*                       | 4,75 % | 16.11.2028            | 7.862.103            | 0,32                         |
| 32.118.500   | Venezuela Government International Bond* | 8,25 % | 13.10.2024            | 2.970.961            | 0,12                         |
| 14.430.000   | Zambia Government International Bond*    | 5,38 % | 30.12.2023            | 7.604.610            | 0,30                         |
| 710.000  | Zambia Government International Bond*    | 8,50 % | 14.04.2024            | 414.952              | 0,02                         |
| 35.128.000   | Zambia Government International Bond*    | 8,97 % | 30.07.2027            | 20.290.284           | 0,81                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |  |        |                       | <b>1.220.910.449</b> | <b>48,99</b>                 |
| <b>Staatsanleihen insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>1.633.773.145</b> | <b>65,56</b>                 |

| Anzahl der<br>Anteile                                     | Wertpapierbezeichnung                            | Zeitwert<br>US\$     | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--|----------------------|------------------------------|
| <b>Investmentfonds 0,67 % (31. Dezember 2022: 0,65 %)</b> |  |                      |                              |
| <b>US-Dollar</b>  |  |                      |                              |
| 150.000   | Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund | 16.618.500           | 0,67                         |
| <b>Investmentfonds insgesamt <sup>#</sup></b>             |  | <b>16.618.500</b>    | <b>0,67</b>                  |
| <b>Anlagen insgesamt</b>                                  |  | <b>2.386.622.565</b> | <b>95,77</b>                 |

**Devisenterminkontrakte 0,45 % (31. Dezember 2022: 0,50 %)**

| Geforderter<br>Betrag           | Zu zahlender<br>Betrag | Fälligkeits-<br>datum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---------------------------------|------------------------|-----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------------|------------------------------|
| 9.099.964 US\$                  | 8.325.371 €            | 05.07.2023            | Brown Brothers Harriman     | 1         | 16.981                               | 0,00                         |
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> |                        |                       |                             |           |                                      |                              |
| 158.695 US\$                    | 234.213 AUD            | 14.09.2023            | Westpac Banking Corp        | 11        | 2.474                                | 0,00                         |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i> |                        |                       |                             |           |                                      |                              |
| 1.667.652 CHF                   | 1.873.393 US\$         | 14.09.2023            | Citibank NA                 | 2         | 4.890                                | 0,00                         |
| 91.460.429 CHF                  | 102.519.943 US\$       | 14.09.2023            | UBS AG                      | 3         | 492.275                              | 0,02                         |
| 90.544.243 CHF                  | 101.563.225 US\$       | 14.09.2023            | Westpac Banking Corp        | 7         | 417.091                              | 0,02                         |
| 116.793 US\$                    | 103.667 CHF            | 14.09.2023            | Westpac Banking Corp        | 2         | 32                                   | 0,00                         |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> |                        |                       |                             |           |                                      |                              |
| 6.951.316 €                     | 7.586.613 US\$         | 14.09.2023            | Citibank NA                 | 2         | 24.812                               | 0,00                         |
| 325.678.655 €                   | 352.298.000 US\$       | 14.09.2023            | Goldman Sachs International | 2         | 4.307.635                            | 0,17                         |
| 334.730.620 €                   | 362.160.803 US\$       | 14.09.2023            | Westpac Banking Corp        | 7         | 4.356.386                            | 0,18                         |
| 1.286.974 US\$                  | 1.174.893 €            | 14.09.2023            | Westpac Banking Corp        | 10        | 510                                  | 0,00                         |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> |                        |                       |                             |           |                                      |                              |
| 441.275 £                       | 557.189 US\$           | 14.09.2023            | Citibank NA                 | 1         | 3.949                                | 0,00                         |
| 34.983.762 £                    | 43.963.570 US\$        | 14.09.2023            | Goldman Sachs International | 2         | 522.791                              | 0,02                         |
| 1.316.195 £                     | 1.660.382 US\$         | 14.09.2023            | UBS AG                      | 2         | 13.329                               | 0,00                         |

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

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 0,45 % (31. Dezember 2022: 0,50 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen GBP (Fortsetzung)</i>                                   |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 40.902.348 £  | 51.420.716 US\$     | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 11        | 591.888                        | 0,02                 |
| 172.455 US\$  | 135.288 £           | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 8         | 418                            | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen HKD</i>   |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 199 HKD   | 26 US\$             | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 2         | 0                              | 0,00                 |
| 2.264 US\$  | 17.707 HKD          | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 4         | 1                              | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen JPY</i>   |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 8.344.716 ¥   | 58.268 US\$         | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 1         | 122                            | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen SEK</i>   |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 811.308.649 SEK   | 75.160.143 US\$     | 14.09.2023       | Goldman Sachs International | 2         | 210.351                        | 0,01                 |
| 822.594.394 SEK   | 76.214.220 US\$     | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 5         | 204.718                        | 0,01                 |
| 1.223.743 US\$  | 13.042.395 SEK      | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 9         | 12.106                         | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>   |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 91.208 SGD  | 67.471 US\$         | 14.09.2023       | Goldman Sachs International | 1         | 107                            | 0,00                 |
| 39.238 SGD  | 29.066 US\$         | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 2         | 6                              | 0,00                 |
| 40.831 US\$   | 54.639 SGD          | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 13        | 349                            | 0,00                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                             |           | <b>11.183.221</b>              | <b>0,45</b>          |

### Futures-Kontrakte 0,17 % (31. Dezember 2022: 0,93 %)

| Anzahl Kontrakte   | Beschreibung                                       | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|--|--------------------------------|----------------------|
| (486)  | Euro-BOBL Future September 2023                    | 949.105                        | 0,04                 |
| (1.449)  | Euro-Bund Future September 2023                    | 2.711.168                      | 0,11                 |
| (46)   | Euro-Schatz Future September 2023                  | 46.924                         | 0,00                 |
| 390  | US Treasury Ultra Bond (CBT) Future September 2023 | 487.394                        | 0,02                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten <sup>*</sup></b> |  | <b>4.194.591</b>               | <b>0,17</b>          |

### Credit-Default-Swap-Kontrakten 0,05 % (31. Dezember 2022: 0,08 %)

| Nominalwert   | Fälligkeit | Gegenpartei                 | Referenzverbindlichkeit                   | Zeitwert US\$    | % des Nettovermögens |
|---|------------|-----------------------------|---|------------------|----------------------|
| USD 25.810.000  | 20.06.2028 | ICE Clear U.S. <sup>1</sup> | Buying default protection on CDX.EM.39.V1 | 1.247.088        | 0,05                 |
| <b>Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten insgesamt <sup>*</sup></b> |            |                             |   | <b>1.247.088</b> | <b>0,05</b>          |

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | Zeitwert US\$        | % des Nettovermögens |
|---|----------------------|----------------------|
|   | <b>2.403.247.465</b> | <b>96,44</b>         |

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

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (0,46 %) (31. Dezember 2022: (0,43 %))

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 474.075.502 US\$   | 443.174.868 €       | 05.07.2023       | Deutsche Bank AG            | 1         | (9.428.429)                     | (0,38)               |
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 10.561.768 AUD   | 7.114.301 US\$      | 14.09.2023       | UBS AG                      | 1         | (69.558)                        | (0,00)               |
| 40.091.621 AUD   | 27.438.827 US\$     | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 12        | (697.548)                       | (0,03)               |
| 21.277 US\$  | 32.167 AUD          | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 3         | (179)                           | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 898.283 CHF  | 1.013.208 US\$      | 14.09.2023       | UBS AG                      | 1         | (1.469)                         | (0,00)               |
| 232.774 CHF  | 262.668 US\$        | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 4         | (495)                           | (0,00)               |
| 33.005.314 US\$  | 29.653.844 CHF      | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 15        | (393.920)                       | (0,02)               |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 3.663.046 €  | 4.019.494 US\$      | 14.09.2023       | Citibank NA                 | 1         | (8.600)                         | (0,00)               |
| 327.937 €  | 359.934 US\$        | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 4         | (856)                           | (0,00)               |
| 25.637.176 US\$  | 23.664.408 €        | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 12        | (274.444)                       | (0,01)               |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 410.244 £  | 526.052 US\$        | 14.09.2023       | Citibank NA                 | 1         | (4.374)                         | (0,00)               |
| 842.295 £  | 1.071.534 US\$      | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 5         | (448)                           | (0,00)               |
| 91.726 US\$  | 72.170 £            | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 7         | (47)                            | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen HKD</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 644.107 HKD  | 82.384 US\$         | 14.09.2023       | Goldman Sachs International | 3         | (55)                            | (0,00)               |
| 7.256 HKD  | 929 US\$            | 14.09.2023       | UBS AG                      | 1         | (2)                             | (0,00)               |
| 639.572 HKD  | 81.825 US\$         | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 14        | (74)                            | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen JPY</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 9.234.328 ¥  | 65.983 US\$         | 14.09.2023       | Citibank NA                 | 1         | (1.369)                         | (0,00)               |
| 828.380.869 ¥  | 6.020.154 US\$      | 14.09.2023       | Goldman Sachs International | 3         | (223.801)                       | (0,01)               |
| 818.292.194 ¥  | 5.947.604 US\$      | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 2         | (221.844)                       | (0,01)               |
| <i>Abgesicherte Klassen SEK</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 9.220.292 SEK  | 869.160 US\$        | 14.09.2023       | Citibank NA                 | 1         | (12.596)                        | (0,00)               |
| 25.337.522 SEK   | 2.369.046 US\$      | 14.09.2023       | Goldman Sachs International | 2         | (15.192)                        | (0,00)               |
| 8.013.911 SEK  | 744.945 US\$        | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 4         | (454)                           | (0,00)               |
| 600.948 US\$   | 6.500.113 SEK       | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 3         | (2.912)                         | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 99.358 SGD   | 74.496 US\$         | 14.09.2023       | Citibank NA                 | 1         | (879)                           | (0,00)               |
| 8.707.331 SGD  | 6.500.764 US\$      | 14.09.2023       | Goldman Sachs International | 3         | (49.312)                        | (0,00)               |
| 8.924.050 SGD  | 6.668.555 US\$      | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 6         | (56.531)                        | (0,00)               |
| 6.446 US\$   | 8.700 SGD           | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 2         | (0)                             | (0,00)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                             |           | <b>(11.465.388)</b>             | <b>(0,46)</b>        |

### Futures-Kontrakte (0,33 %) (31. Dezember 2022: (0,05 %))

| Anzahl Kontrakte | Beschreibung   | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|------------------|--|---------------------------------|----------------------|
| (319)            | Euro-Buxl 30-Year Bond Future September 2023         | (445.477)                       | (0,02)               |
| 495              | US Treasury 10-Year Note (CBT) Future September 2023 | (1.055.742)                     | (0,04)               |
| 647              | US Treasury 2-Year Note (CBT) Future September 2023  | (1.895.508)                     | (0,08)               |

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

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

**Futures-Kontrakte (0,33 %) (31. Dezember 2022: (0,05 %)) (Fortsetzung)**

| Anzahl Kontrakte   | Beschreibung  | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---|---------------------------------|----------------------|
| 2.299  | US Treasury 5-Year Note (CBT) Future September 2023 | (4.793.274)                     | (0,19)               |
| 378  | US Treasury Long Bond (CBT) Future September 2023   | (97.453)                        | (0,00)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten *</b> |   | <b>(8.287.454)</b>              | <b>(0,33)</b>        |

|   | Zeitwert US\$        | % des Nettovermögens |
|---|----------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(19.752.842)</b>  | <b>(0,79)</b>        |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>2.383.494.623</b> | <b>95,65</b>         |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>108.507.597</b>   | <b>4,35</b>          |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>2.492.002.220</b> | <b>100,00</b>        |

| Portfolioanalyse  | US\$                 | % des Gesamtvermögens |
|---|----------------------|-----------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 2.232.395.924        | 87,66                 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden            | 130.748.668          | 5,13                  |
| † Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente  | 6.859.473            | 0,27                  |
| µ Investmentfonds   | 16.618.500           | 0,65                  |
| ± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden                          | (4.092.863)          | (0,16)                |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap                            | 964.921              | 0,04                  |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>2.383.494.623</b> | <b>93,59</b>          |

## Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                           | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Schatzwechsel 1,04 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)</b>        |   |        |                       |                   |                              |
| <b>Thailändischer Baht</b>                                     |   |        |                       |                   |                              |
| 209.900.000  | Bank of Thailand Bill                           | 0,00 % | 17.08.2023            | 5.906.443         | 0,47                         |
| 259.670.000  | Bank of Thailand Bill                           | 0,00 % | 09.05.2024            | 7.199.381         | 0,57                         |
| <b>Schatzwechsel insgesamt **</b>                              |   |        |                       | <b>13.105.824</b> | <b>1,04</b>                  |
| <b>Unternehmensanleihen 2,54 % (31. Dezember 2022: 1,62 %)</b> |   |        |                       |                   |                              |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi</b>                              |   |        |                       |                   |                              |
| 10.000.000   | Central Huijin Investment Ltd**                 | 2,49 % | 19.05.2024            | 1.376.973         | 0,11                         |
| 50.000.000   | Central Huijin Investment Ltd**                 | 2,74 % | 24.05.2026            | 6.892.650         | 0,54                         |
| 10.000.000   | China Southern Power Grid Co Ltd**              | 2,98 % | 27.07.2024            | 1.384.008         | 0,11                         |
| 20.000.000   | China Southern Power Grid Co Ltd**              | 3,66 % | 25.02.2024            | 2.773.192         | 0,22                         |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt</b>                    |   |        |                       | <b>12.426.823</b> | <b>0,98</b>                  |
| <b>Kolumbianischer Peso</b>                                    |   |        |                       |                   |                              |
| 6.450.000.000  | Empresas Publicas de Medellin ESP*              | 7,63 % | 10.09.2024            | 1.440.547         | 0,11                         |
| 49.079.000.000   | Empresas Publicas de Medellin ESP*              | 8,38 % | 08.11.2027            | 9.452.139         | 0,75                         |
| <b>Kolumbianischer Peso insgesamt</b>                          |   |        |                       | <b>10.892.686</b> | <b>0,86</b>                  |
| <b>Mexikanischer Peso</b>                                      |   |        |                       |                   |                              |
| 102.700.000  | Asian Infrastructure Investment Bank*           | 0,00 % | 08.02.2038            | 1.556.492         | 0,12                         |
| 72.618.300   | Comision Federal de Electricidad*               | 7,35 % | 25.11.2025            | 3.900.638         | 0,31                         |
| 62.682.200   | Comision Federal de Electricidad*               | 8,18 % | 23.12.2027            | 3.348.334         | 0,27                         |
| <b>Mexikanischer Peso insgesamt</b>                            |   |        |                       | <b>8.805.464</b>  | <b>0,70</b>                  |
| <b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>                          |   |        |                       | <b>32.124.973</b> | <b>2,54</b>                  |
| <b>Staatsanleihen 90,17 % (31. Dezember 2022: 92,36 %)</b>     |   |        |                       |                   |                              |
| <b>Chilenischer Peso</b>                                       |   |        |                       |                   |                              |
| 6.315.869.000  | Bonos de la Tesoreria de la Republica*          | 1,90 % | 01.09.2030            | 7.841.000         | 0,62                         |
| 2.055.000.000  | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos* | 2,80 % | 01.10.2033            | 2.102.651         | 0,17                         |
| 5.865.000.000  | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos* | 4,50 % | 01.03.2026            | 7.224.226         | 0,57                         |
| 900.000.000  | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos* | 4,70 % | 01.09.2030            | 1.104.201         | 0,09                         |
| 2.335.000.000  | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos* | 5,00 % | 01.03.2035            | 2.938.780         | 0,23                         |
| 445.000.000  | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos* | 5,10 % | 15.07.2050            | 565.050           | 0,04                         |
| 4.885.000.000  | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos* | 6,00 % | 01.04.2033            | 6.546.585         | 0,52                         |
| 3.570.000.000  | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos* | 7,00 % | 01.05.2034            | 5.164.120         | 0,41                         |
| <b>Chilenischer Peso insgesamt</b>                             |   |        |                       | <b>33.486.613</b> | <b>2,65</b>                  |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi</b>                              |   |        |                       |                   |                              |
| 20.000.000   | China Development Bank**                        | 2,69 % | 16.06.2027            | 2.767.297         | 0,22                         |
| 30.000.000   | China Development Bank**                        | 2,73 % | 11.11.2024            | 4.153.522         | 0,33                         |
| 10.000.000   | China Development Bank**                        | 2,83 % | 10.09.2026            | 1.391.939         | 0,11                         |



## Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                             | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|---------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 90,17 % (31. Dezember 2022: 92,36 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                    |                              |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi (Fortsetzung)</b>                          |   |         |                       |                    |                              |
| 40.000.000   | China Development Bank**                          | 3,02 %  | 06.03.2033            | 5.594.001          | 0,44                         |
| 30.000.000   | China Development Bank**                          | 3,30 %  | 03.03.2026            | 4.225.232          | 0,34                         |
| 40.000.000   | China Development Bank**                          | 3,34 %  | 14.07.2025            | 5.612.215          | 0,44                         |
| 20.000.000   | China Development Bank**                          | 3,42 %  | 02.07.2024            | 2.785.257          | 0,22                         |
| 30.000.000   | China Development Bank**                          | 3,48 %  | 08.01.2029            | 4.294.209          | 0,34                         |
| 20.000.000   | China Development Bank**                          | 3,70 %  | 20.10.2030            | 2.916.285          | 0,23                         |
| 40.000.000   | China Development Bank**                          | 4,04 %  | 06.07.2028            | 5.865.261          | 0,46                         |
| 20.000.000   | China Development Bank**                          | 4,24 %  | 24.08.2027            | 2.930.349          | 0,23                         |
| 13.000.000   | China Government Bond**                           | 2,69 %  | 15.08.2032            | 1.783.779          | 0,14                         |
| 8.000.000  | China Government Bond**                           | 2,80 %  | 25.03.2030            | 1.111.834          | 0,09                         |
| 30.000.000   | China Government Bond**                           | 2,85 %  | 04.06.2027            | 4.199.373          | 0,33                         |
| 12.000.000   | China Government Bond**                           | 2,88 %  | 25.02.2033            | 1.678.684          | 0,13                         |
| 22.000.000   | China Government Bond**                           | 3,02 %  | 27.05.2031            | 3.105.068          | 0,25                         |
| 10.030.000   | China Government Bond**                           | 3,12 %  | 25.10.2052            | 1.404.144          | 0,11                         |
| 30.000.000   | China Government Bond**                           | 3,13 %  | 21.11.2029            | 4.269.377          | 0,34                         |
| 2.810.000  | China Government Bond**                           | 3,19 %  | 15.04.2053            | 401.547            | 0,03                         |
| 10.000.000   | China Government Bond**                           | 3,25 %  | 22.11.2028            | 1.435.889          | 0,11                         |
| 5.000.000  | China Government Bond**                           | 3,29 %  | 23.05.2029            | 719.030            | 0,06                         |
| 250.000  | China Government Bond**                           | 3,39 %  | 16.03.2050            | 36.349             | 0,00                         |
| 50.650.000   | China Government Bond**                           | 3,72 %  | 12.04.2051            | 7.810.991          | 0,62                         |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt</b>                              |   |         |                       | <b>70.491.632</b>  | <b>5,57</b>                  |
| <b>Kolumbianischer Peso</b>  |   |         |                       |                    |                              |
| 117.909.900.000  | Colombian TES*                                    | 5,75 %  | 03.11.2027            | 24.325.167         | 1,92                         |
| 87.177.400.000   | Colombian TES*                                    | 6,00 %  | 28.04.2028            | 17.909.491         | 1,42                         |
| 75.461.500.000   | Colombian TES*                                    | 7,00 %  | 26.03.2031            | 15.249.307         | 1,20                         |
| 25.028.700.000   | Colombian TES*                                    | 7,00 %  | 30.06.2032            | 4.918.784          | 0,39                         |
| 26.308.300.000   | Colombian TES*                                    | 7,25 %  | 18.10.2034            | 5.087.522          | 0,40                         |
| 30.706.900.000   | Colombian TES*                                    | 7,50 %  | 26.08.2026            | 6.907.466          | 0,55                         |
| 22.429.000.000   | Colombian TES*                                    | 9,25 %  | 28.05.2042            | 4.811.936          | 0,38                         |
| 72.020.900.000   | Colombian TES*                                    | 13,25 % | 09.02.2033            | 20.249.936         | 1,60                         |
| 10.400.100.000   | Colombian TES Series G*                           | 7,00 %  | 26.03.2031            | 2.101.659          | 0,17                         |
| 1.303.000.000  | Financiera de Desarrollo Territorial SA Findeter* | 7,88 %  | 12.08.2024            | 292.592            | 0,02                         |
| <b>Kolumbianischer Peso insgesamt</b>                                    |   |         |                       | <b>101.853.860</b> | <b>8,05</b>                  |
| <b>Tschechische Krone</b>  |   |         |                       |                    |                              |
| 53.760.000   | Czech Republic Government Bond*                   | 0,05 %  | 29.11.2029            | 1.874.098          | 0,15                         |
| 496.230.000  | Czech Republic Government Bond*                   | 0,95 %  | 15.05.2030            | 18.200.655         | 1,44                         |
| 368.120.000  | Czech Republic Government Bond*                   | 1,00 %  | 26.06.2026            | 15.031.724         | 1,19                         |
| 215.890.000  | Czech Republic Government Bond*                   | 1,20 %  | 13.03.2031            | 7.892.922          | 0,62                         |

## Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                  | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|---------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 90,17 % (31. Dezember 2022: 92,36 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                   |                              |
| <b>Tschechische Krone (Fortsetzung)</b>                                  |  |         |                       |                   |                              |
| 96.070.000   | Czech Republic Government Bond*        | 1,75 %  | 23.06.2032            | 3.595.426         | 0,28                         |
| 79.870.000   | Czech Republic Government Bond*        | 2,00 %  | 13.10.2033            | 2.973.112         | 0,23                         |
| 107.220.000  | Czech Republic Government Bond*        | 2,40 %  | 17.09.2025            | 4.636.465         | 0,37                         |
| 103.810.000  | Czech Republic Government Bond*        | 2,50 %  | 25.08.2028            | 4.323.977         | 0,34                         |
| 29.020.000   | Czech Republic Government Bond*        | 2,75 %  | 23.07.2029            | 1.211.880         | 0,10                         |
| 35.400.000   | Czech Republic Government Bond*        | 4,20 %  | 04.12.2036            | 1.601.077         | 0,13                         |
| <b>Tschechische Krone insgesamt</b>                                      |  |         |                       | <b>61.341.336</b> | <b>4,85</b>                  |
| <b>Peso Dominikanische Republik</b>                                      |  |         |                       |                   |                              |
| 152.700.000  | Dominican Republic International Bond* | 9,75 %  | 05.06.2026            | 2.830.036         | 0,22                         |
| <b>Peso Dominikanische Republik insgesamt</b>                            |  |         |                       | <b>2.830.036</b>  | <b>0,22</b>                  |
| <b>Ghanaischer Cedi</b>  |  |         |                       |                   |                              |
| 28.061.000   | Republic of Ghana Government Bonds*    | 19,25 % | 18.12.2023            | 2.264.625         | 0,18                         |
| <b>Ghanaischer Cedi insgesamt</b>  |  |         |                       | <b>2.264.625</b>  | <b>0,18</b>                  |
| <b>Ungarischer Forint</b>  |  |         |                       |                   |                              |
| 2.353.490.000  | Hungary Government Bond*               | 2,00 %  | 23.05.2029            | 5.228.934         | 0,41                         |
| 1.141.430.000  | Hungary Government Bond*               | 2,25 %  | 20.04.2033            | 2.293.956         | 0,18                         |
| 3.926.450.000  | Hungary Government Bond*               | 3,00 %  | 27.10.2027            | 9.567.822         | 0,76                         |
| 1.522.590.000  | Hungary Government Bond*               | 3,25 %  | 22.10.2031            | 3.470.280         | 0,27                         |
| 2.891.560.000  | Hungary Government Bond*               | 4,50 %  | 23.03.2028            | 7.427.261         | 0,59                         |
| 1.390.770.000  | Hungary Government Bond*               | 4,75 %  | 24.11.2032            | 3.471.134         | 0,28                         |
| 1.179.640.000  | Hungary Government Bond*               | 6,75 %  | 22.10.2028            | 3.325.500         | 0,26                         |
| <b>Ungarischer Forint insgesamt</b>                                      |  |         |                       | <b>34.784.887</b> | <b>2,75</b>                  |
| <b>Indonesische Rupiah</b>   |  |         |                       |                   |                              |
| 72.466.000.000   | Indonesia Treasury Bond*               | 6,13 %  | 15.05.2028            | 4.862.667         | 0,38                         |
| 237.648.000.000  | Indonesia Treasury Bond*               | 6,38 %  | 15.08.2028            | 16.188.622        | 1,28                         |
| 12.550.000.000   | Indonesia Treasury Bond*               | 6,38 %  | 15.04.2032            | 841.901           | 0,07                         |
| 11.000.000.000   | Indonesia Treasury Bond*               | 6,38 %  | 15.07.2037            | 728.351           | 0,06                         |
| 156.481.000.000  | Indonesia Treasury Bond*               | 6,63 %  | 15.05.2033            | 10.635.119        | 0,84                         |
| 64.288.000.000   | Indonesia Treasury Bond*               | 7,00 %  | 15.05.2027            | 4.445.158         | 0,35                         |
| 403.931.000.000  | Indonesia Treasury Bond*               | 7,00 %  | 15.02.2033            | 28.390.084        | 2,25                         |
| 44.000.000.000   | Indonesia Treasury Bond*               | 7,13 %  | 15.06.2038            | 3.116.078         | 0,25                         |
| 129.250.000.000  | Indonesia Treasury Bond*               | 7,13 %  | 15.06.2042            | 9.037.598         | 0,71                         |
| 68.800.000.000   | Indonesia Treasury Bond*               | 7,13 %  | 15.06.2043            | 4.867.753         | 0,38                         |
| 97.706.000.000   | Indonesia Treasury Bond*               | 7,50 %  | 15.08.2032            | 7.051.564         | 0,56                         |
| 79.493.000.000   | Indonesia Treasury Bond*               | 7,50 %  | 15.06.2035            | 5.749.502         | 0,45                         |
| 20.280.000.000   | Indonesia Treasury Bond*               | 7,50 %  | 15.05.2038            | 1.470.337         | 0,12                         |

## Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                              | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 90,17 % (31. Dezember 2022: 92,36 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                    |                              |
| <b>Indonesische Rupie (Fortsetzung)</b>                                  |  |        |                       |                    |                              |
| 60.000.000.000   | Indonesia Treasury Bond*                           | 7,50 % | 15.04.2040            | 4.339.194          | 0,34                         |
| 45.505.000.000   | Indonesia Treasury Bond*                           | 8,13 % | 15.05.2024            | 3.098.355          | 0,24                         |
| 39.425.000.000   | Indonesia Treasury Bond*                           | 8,25 % | 15.05.2029            | 2.902.223          | 0,23                         |
| 73.362.000.000   | Indonesia Treasury Bond*                           | 8,25 % | 15.05.2036            | 5.640.593          | 0,45                         |
| 58.565.000.000   | Indonesia Treasury Bond*                           | 8,38 % | 15.09.2026            | 4.189.011          | 0,33                         |
| 88.577.000.000   | Indonesia Treasury Bond*                           | 8,38 % | 15.03.2034            | 6.806.567          | 0,54                         |
| 98.837.000.000   | Indonesia Treasury Bond*                           | 8,75 % | 15.05.2031            | 7.583.887          | 0,60                         |
| 33.258.000.000   | Indonesia Treasury Bond*                           | 9,00 % | 15.03.2029            | 2.537.908          | 0,20                         |
| <b>Indonesische Rupiah insgesamt</b>                                     |  |        |                       | <b>134.482.472</b> | <b>10,63</b>                 |
| <b>Japanischer Yen</b>   |  |        |                       |                    |                              |
| 11.253.000   | Argentine Republic Government International Bond** | 0,67 % | 31.12.2038            | 15.350             | 0,00                         |
| 7.424.445  | Argentine Republic Government International Bond** | 4,33 % | 31.12.2033            | 10.562             | 0,00                         |
| <b>Japanischer Yen insgesamt</b>   |  |        |                       | <b>25.912</b>      | <b>0,00</b>                  |
| <b>Malaysischer Ringgit</b>  |  |        |                       |                    |                              |
| 26.922.000   | Malaysia Government Bond**                         | 2,63 % | 15.04.2031            | 5.293.191          | 0,42                         |
| 27.226.000   | Malaysia Government Bond**                         | 3,50 % | 31.05.2027            | 5.804.377          | 0,46                         |
| 16.210.000   | Malaysia Government Bond**                         | 3,58 % | 15.07.2032            | 3.403.806          | 0,27                         |
| 31.882.000   | Malaysia Government Bond**                         | 3,73 % | 15.06.2028            | 6.864.391          | 0,54                         |
| 24.319.000   | Malaysia Government Bond**                         | 3,76 % | 22.05.2040            | 4.960.271          | 0,39                         |
| 31.512.000   | Malaysia Government Bond**                         | 3,83 % | 05.07.2034            | 6.636.018          | 0,52                         |
| 5.637.000  | Malaysia Government Bond**                         | 3,84 % | 15.04.2033            | 1.200.650          | 0,10                         |
| 17.138.000   | Malaysia Government Bond**                         | 3,90 % | 30.11.2026            | 3.713.633          | 0,29                         |
| 80.535.000   | Malaysia Government Bond**                         | 3,90 % | 16.11.2027            | 17.437.857         | 1,38                         |
| 31.229.000   | Malaysia Government Bond**                         | 4,07 % | 15.06.2050            | 6.526.845          | 0,52                         |
| 9.113.000  | Malaysia Government Bond**                         | 4,23 % | 30.06.2031            | 2.001.962          | 0,16                         |
| 16.765.000   | Malaysia Government Bond**                         | 4,25 % | 31.05.2035            | 3.649.738          | 0,29                         |
| 22.000.000   | Malaysia Government Bond**                         | 4,50 % | 30.04.2029            | 4.898.164          | 0,39                         |
| 14.210.000   | Malaysia Government Bond**                         | 4,64 % | 07.11.2033            | 3.235.370          | 0,26                         |
| 45.108.000   | Malaysia Government Bond**                         | 4,70 % | 15.10.2042            | 10.412.843         | 0,82                         |
| 6.300.000  | Malaysia Government Bond**                         | 4,76 % | 07.04.2037            | 1.441.517          | 0,11                         |
| 44.010.000   | Malaysia Government Bond**                         | 4,89 % | 08.06.2038            | 10.346.195         | 0,82                         |
| 4.791.000  | Malaysia Government Bond**                         | 4,94 % | 30.09.2043            | 1.136.842          | 0,09                         |
| 26.306.000   | Malaysia Government Investment Issue**             | 4,07 % | 30.09.2026            | 5.731.546          | 0,45                         |
| 26.775.000   | Malaysia Government Investment Issue**             | 4,37 % | 31.10.2028            | 5.926.361          | 0,47                         |
| <b>Malaysischer Ringgit insgesamt</b>                                    |  |        |                       | <b>110.621.577</b> | <b>8,75</b>                  |
| <b>Mexikanischer Peso</b>  |  |        |                       |                    |                              |
| 261.449.400  | Mexican Bonos*                                     | 7,50 % | 03.06.2027            | 14.511.162         | 1,15                         |

## Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                    | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 90,17 % (31. Dezember 2022: 92,36 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                    |                              |
| <b>Mexikanischer Peso (Fortsetzung)</b>                                  |  |        |                       |                    |                              |
| 355.500.000  | Mexican Bonos*                           | 7,50 % | 26.05.2033            | 19.254.193         | 1,52                         |
| 630.443.600  | Mexican Bonos*                           | 7,75 % | 29.05.2031            | 34.788.812         | 2,75                         |
| 171.430.200  | Mexican Bonos*                           | 7,75 % | 13.11.2042            | 8.972.535          | 0,71                         |
| 90.673.600   | Mexican Bonos*                           | 8,00 % | 07.11.2047            | 4.834.375          | 0,38                         |
| 495.631.200  | Mexican Bonos*                           | 8,50 % | 31.05.2029            | 28.640.868         | 2,27                         |
| 349.723.000  | Mexican Bonos*                           | 8,50 % | 18.11.2038            | 19.881.224         | 1,57                         |
| <b>Mexikanischer Peso insgesamt</b>                                      |  |        |                       | <b>130.883.169</b> | <b>10,35</b>                 |
| <b>Peruanischer Sol</b>  |  |        |                       |                    |                              |
| 24.441.000   | Fondo MIVIVIENDA SA*                     | 7,00 % | 14.02.2024            | 6.642.250          | 0,52                         |
| 7.536.000  | Peru Government Bond*                    | 5,35 % | 12.08.2040            | 1.731.683          | 0,14                         |
| 22.336.000   | Peru Government Bond*                    | 5,40 % | 12.08.2034            | 5.443.857          | 0,43                         |
| 3.458.000  | Peru Government Bond*                    | 5,94 % | 12.02.2029            | 935.702            | 0,07                         |
| 39.064.000   | Peru Government Bond*                    | 6,15 % | 12.08.2032            | 10.299.128         | 0,81                         |
| 23.856.000   | Peru Government Bond*                    | 7,30 % | 12.08.2033            | 6.773.267          | 0,54                         |
| 7.312.000  | Peruvian Government International Bond** | 5,20 % | 12.09.2023            | 2.011.238          | 0,16                         |
| 8.187.000  | Peruvian Government International Bond*  | 5,40 % | 12.08.2034            | 1.995.382          | 0,16                         |
| 23.052.000   | Peruvian Government International Bond** | 6,90 % | 12.08.2037            | 6.271.711          | 0,50                         |
| 156.000  | Peruvian Government International Bond** | 8,20 % | 12.08.2026            | 45.692             | 0,00                         |
| <b>Peruanischer Sol insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>42.149.910</b>  | <b>3,33</b>                  |
| <b>Polnischer Zloty</b>  |  |        |                       |                    |                              |
| 19.507.000   | Republic of Poland Government Bond*      | 0,25 % | 25.10.2026            | 4.032.137          | 0,32                         |
| 43.303.000   | Republic of Poland Government Bond**     | 1,25 % | 25.10.2030            | 7.950.243          | 0,63                         |
| 36.484.000   | Republic of Poland Government Bond*      | 1,75 % | 25.04.2032            | 6.557.413          | 0,52                         |
| 86.365.000   | Republic of Poland Government Bond*      | 2,50 % | 25.07.2026            | 19.400.529         | 1,53                         |
| 69.845.000   | Republic of Poland Government Bond*      | 2,50 % | 25.07.2027            | 15.263.925         | 1,21                         |
| 62.747.000   | Republic of Poland Government Bond*      | 2,75 % | 25.10.2029            | 13.174.716         | 1,04                         |
| 29.868.000   | Republic of Poland Government Bond*      | 6,00 % | 25.10.2033            | 7.508.994          | 0,59                         |
| 63.974.000   | Republic of Poland Government Bond*      | 7,50 % | 25.07.2028            | 17.008.571         | 1,35                         |
| <b>Polnischer Zloty insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>90.896.528</b>  | <b>7,19</b>                  |
| <b>Rumänischer neuer Leu</b>   |  |        |                       |                    |                              |
| 66.350.000   | Romania Government Bond*                 | 2,50 % | 25.10.2027            | 12.403.011         | 0,98                         |
| 5.040.000  | Romania Government Bond*                 | 3,65 % | 24.09.2031            | 904.985            | 0,07                         |
| 14.600.000   | Romania Government Bond*                 | 4,15 % | 24.10.2030            | 2.744.331          | 0,22                         |
| 55.140.000   | Romania Government Bond*                 | 4,40 % | 25.09.2023            | 12.080.677         | 0,96                         |
| 22.535.000   | Romania Government Bond*                 | 4,75 % | 11.10.2034            | 4.183.991          | 0,33                         |
| 35.830.000   | Romania Government Bond**                | 4,85 % | 25.07.2029            | 7.170.966          | 0,57                         |
| 5.465.000  | Romania Government Bond*                 | 5,00 % | 12.02.2029            | 1.109.814          | 0,09                         |

## Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                     | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|---------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 90,17 % (31. Dezember 2022: 92,36 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                    |                              |
| <b>Rumänischer neuer Leu (Fortsetzung)</b>                               |   |         |                       |                    |                              |
| 11.580.000   | Romania Government Bond*                  | 6,70 %  | 25.02.2032            | 2.545.856          | 0,20                         |
| 6.440.000  | Romania Government Bond*                  | 7,90 %  | 24.02.2038            | 1.552.791          | 0,12                         |
| 10.080.000   | Romania Government Bond*                  | 8,25 %  | 29.09.2032            | 2.442.203          | 0,19                         |
| <b>Rumänischer neuer Leu insgesamt</b>                                   |   |         |                       | <b>47.138.625</b>  | <b>3,73</b>                  |
| <b>Serbischer Dinar</b>  |   |         |                       |                    |                              |
| 115.190.000  | Serbia Treasury Bonds*                    | 4,50 %  | 11.01.2026            | 1.060.822          | 0,09                         |
| 80.900.000   | Serbia Treasury Bonds*                    | 4,50 %  | 20.08.2032            | 670.729            | 0,05                         |
| 198.550.000  | Serbia Treasury Bonds*                    | 5,88 %  | 08.02.2028            | 1.907.022          | 0,15                         |
| <b>Serbischer Dinar insgesamt</b>  |   |         |                       | <b>3.638.573</b>   | <b>0,29</b>                  |
| <b>Südafrikanischer Rand</b>   |   |         |                       |                    |                              |
| 406.859.212  | Republic of South Africa Government Bond* | 7,00 %  | 28.02.2031            | 17.246.760         | 1,36                         |
| 870.648.762  | Republic of South Africa Government Bond* | 8,50 %  | 31.01.2037            | 35.254.563         | 2,79                         |
| 248.343.396  | Republic of South Africa Government Bond* | 8,75 %  | 31.01.2044            | 9.658.657          | 0,76                         |
| 1.138.656.018  | Republic of South Africa Government Bond* | 8,88 %  | 28.02.2035            | 49.412.834         | 3,91                         |
| 268.452.094  | Republic of South Africa Government Bond* | 9,00 %  | 31.01.2040            | 10.934.898         | 0,87                         |
| 318.866.689  | Republic of South Africa Government Bond* | 10,50 % | 21.12.2026            | 17.549.589         | 1,39                         |
| <b>Südafrikanischer Rand insgesamt</b>                                   |   |         |                       | <b>140.057.301</b> | <b>11,08</b>                 |
| <b>Thailändischer Baht</b>   |   |         |                       |                    |                              |
| 290.000.000  | Thailand Government Bond**                | 1,00 %  | 17.06.2027            | 7.792.086          | 0,62                         |
| 52.597.000   | Thailand Government Bond**                | 1,60 %  | 17.06.2035            | 1.318.489          | 0,11                         |
| 324.120.000  | Thailand Government Bond**                | 2,00 %  | 17.12.2031            | 8.844.482          | 0,70                         |
| 283.646.000  | Thailand Government Bond**                | 2,00 %  | 17.06.2042            | 6.877.247          | 0,54                         |
| 109.097.000  | Thailand Government Bond**                | 2,13 %  | 17.12.2026            | 3.068.738          | 0,24                         |
| 478.400.000  | Thailand Government Bond**                | 2,65 %  | 17.06.2028            | 13.707.163         | 1,08                         |
| 83.000   | Thailand Government Bond**                | 2,88 %  | 17.12.2028            | 2.402              | 0,00                         |
| 27.836.000   | Thailand Government Bond**                | 2,88 %  | 17.06.2046            | 743.921            | 0,06                         |
| 315.519.000  | Thailand Government Bond**                | 3,30 %  | 17.06.2038            | 9.374.893          | 0,74                         |
| 90.000.000   | Thailand Government Bond**                | 3,35 %  | 17.06.2033            | 2.712.559          | 0,22                         |
| 77.000.000   | Thailand Government Bond**                | 3,39 %  | 17.06.2037            | 2.309.357          | 0,18                         |
| 266.399.000  | Thailand Government Bond**                | 3,40 %  | 17.06.2036            | 8.001.500          | 0,63                         |
| 63.900.000   | Thailand Government Bond**                | 3,45 %  | 17.06.2043            | 1.904.537          | 0,15                         |
| 211.333.000  | Thailand Government Bond**                | 3,65 %  | 20.06.2031            | 6.478.346          | 0,51                         |
| 272.450.000  | Thailand Government Bond**                | 3,78 %  | 25.06.2032            | 8.486.139          | 0,67                         |
| 5.000  | Thailand Government Bond**                | 3,85 %  | 12.12.2025            | 147                | 0,00                         |
| 136.225.000  | Thailand Government Bond**                | 4,88 %  | 22.06.2029            | 4.367.619          | 0,35                         |
| <b>Thailändischer Baht insgesamt</b>                                     |   |         |                       | <b>85.989.625</b>  | <b>6,80</b>                  |

## Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                             | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$     | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|---------|-----------------------|----------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 90,17 % (31. Dezember 2022: 92,36 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                      |                              |
| <b>Türkische Lira</b>  |   |         |                       |                      |                              |
| 263.842.110  | Turkey Government Bond*                           | 1,50 %  | 18.06.2025            | 12.883.429           | 1,02                         |
| <b>Türkische Lira insgesamt</b>  |   |         |                       | <b>12.883.429</b>    | <b>1,02</b>                  |
| <b>Uganda-Schilling</b>  |   |         |                       |                      |                              |
| 22.942.900.000   | Republic of Uganda Government Bonds*              | 14,25 % | 22.06.2034            | 6.077.489            | 0,48                         |
| <b>Uganda-Schilling insgesamt</b>  |   |         |                       | <b>6.077.489</b>     | <b>0,48</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>   |   |         |                       |                      |                              |
| 27.119.632   | Argentine Republic Government International Bond* | 0,50 %  | 09.07.2030            | 9.073.313            | 0,72                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |   |         |                       | <b>9.073.313</b>     | <b>0,72</b>                  |
| <b>Uruguayischer Peso</b>  |   |         |                       |                      |                              |
| 245.638.457  | Uruguay Government International Bond*            | 8,25 %  | 21.05.2031            | 6.069.488            | 0,48                         |
| 399.834.000  | Uruguay Government International Bond*            | 8,50 %  | 15.03.2028            | 10.200.447           | 0,81                         |
| <b>Uruguayischer Peso insgesamt</b>                                      |   |         |                       | <b>16.269.935</b>    | <b>1,29</b>                  |
| <b>Sambischer Kwacha</b>   |   |         |                       |                      |                              |
| 92.909.000   | Zambia Government Bond*                           | 13,00 % | 25.01.2031            | 2.992.476            | 0,24                         |
| <b>Sambischer Kwacha insgesamt</b>                                       |   |         |                       | <b>2.992.476</b>     | <b>0,24</b>                  |
| <b>Staatsanleihen insgesamt</b>  |   |         |                       | <b>1.140.233.323</b> | <b>90,17</b>                 |
| Anzahl der<br>Anteile  | Wertpapierbezeichnung                             |         |                       | Zeitwert<br>US\$     | % des<br>Netto-<br>vermögens |
| <b>Investmentfonds 1,25 % (31. Dezember 2022: 1,09 %)</b>                |   |         |                       |                      |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |   |         |                       |                      |                              |
| 1.595.000  | Neuberger Berman China Bond Fund                  |         |                       | 15.886.200           | 1,25                         |
| <b>Investmentfonds insgesamt #</b>                                       |   |         |                       | <b>15.886.200</b>    | <b>1,25</b>                  |
| <b>Anlagen insgesamt</b>   |   |         |                       | <b>1.201.350.320</b> | <b>95,00</b>                 |

Devisenterminkontrakte 1,19 % (31. Dezember 2022: 1,08 %)

| Geforderter<br>Betrag | Zu zahlender<br>Betrag | Fälligkeits-<br>datum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|-----------------------|------------------------|-----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------------|------------------------------|
| 23.057.689 BRL        | 4.539.323 US\$         | 25.07.2023            | Goldman Sachs International | 2         | 222.349                              | 0,02                         |
| 147.670.132 BRL       | 28.792.953 US\$        | 05.07.2023            | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 1.818.600                            | 0,15                         |
| 625.577.195 BRL       | 124.105.222 US\$       | 25.07.2023            | Morgan Stanley              | 1         | 5.083.485                            | 0,40                         |
| 45.829.443 CNH        | 6.307.331 US\$         | 20.07.2023            | Morgan Stanley              | 1         | 192                                  | 0,00                         |
| 40.917.653.250 COP    | 9.794.583 US\$         | 06.07.2023            | Citibank NA                 | 1         | 1.189                                | 0,00                         |
| 208.280.414 CZK       | 8.655.978 €            | 20.09.2023            | Citibank NA                 | 1         | 50.959                               | 0,01                         |
| 5.505.498 €           | 2.068.706.848 HUF      | 11.08.2023            | BNP Paribas                 | 1         | 30.432                               | 0,00                         |
| 5.125.920 €           | 5.593.791 US\$         | 03.08.2023            | Citibank NA                 | 1         | 7.316                                | 0,00                         |

## Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 1,19 % (31. Dezember 2022: 1,08 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 16.332.612 €       | 17.482.873 US\$     | 05.07.2023       | Citibank NA                    | 2         | 336.012                        | 0,03                 |
| 3.951.494 €        | 4.290.484 US\$      | 05.07.2023       | Goldman Sachs International    | 2         | 20.598                         | 0,00                 |
| 19.382.481 €       | 20.919.787 US\$     | 05.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | 226.507                        | 0,02                 |
| 2.419.210 €        | 12.010.529 RON      | 25.07.2023       | UBS AG                         | 1         | 1.693                          | 0,00                 |
| 2.060.708.924 HUF  | 5.449.947 €         | 01.08.2023       | Citibank NA                    | 1         | 25.001                         | 0,00                 |
| 610.069.944 HUF    | 1.614.926 €         | 11.08.2023       | Citibank NA                    | 1         | 500                            | 0,00                 |
| 2.396.268.295 HUF  | 6.354.969 €         | 01.08.2023       | HSBC Bank Plc                  | 1         | 9.876                          | 0,00                 |
| 491.431.865 INR    | 5.975.764 US\$      | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | 9.864                          | 0,00                 |
| 39.599.909 MXN     | 2.281.508 US\$      | 06.07.2023       | Citibank NA                    | 1         | 27.013                         | 0,00                 |
| 140.562.353 MXN    | 8.034.306 US\$      | 20.09.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 39.267                         | 0,00                 |
| 39.365.170 PHP     | 701.028 US\$        | 20.09.2023       | HSBC Bank Plc                  | 1         | 9.313                          | 0,00                 |
| 45.833.727 PLN     | 10.235.126 €        | 20.09.2023       | Morgan Stanley                 | 2         | 26.946                         | 0,00                 |
| 130.285.873 RON    | 26.081.765 €        | 25.07.2023       | Goldman Sachs International    | 2         | 157.408                        | 0,01                 |
| 39.204.903 US\$    | 166.303.669.439 COP | 20.09.2023       | Barclays Bank Plc              | 1         | 216.666                        | 0,02                 |
| 10.391.621 US\$    | 362.303.876 THB     | 06.07.2023       | Barclays Bank Plc              | 1         | 171.978                        | 0,02                 |
| 8.657.647 US\$     | 7.005.854.824 CLP   | 20.09.2023       | Barclays Bank Plc              | 1         | 6.717                          | 0,00                 |
| 9.223.234 US\$     | 65.542.106 CNH      | 20.09.2023       | Barclays Bank Plc              | 1         | 154.226                        | 0,01                 |
| 10.012.502 US\$    | 71.758.102 CNH      | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | 136.409                        | 0,01                 |
| 6.524.869 US\$     | 195.765.637 TWD     | 06.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | 239.739                        | 0,02                 |
| 2.677.168 US\$     | 89.792.231 THB      | 06.07.2023       | Citibank NA                    | 1         | 144.365                        | 0,01                 |
| 5.975.256 US\$     | 183.051.382 TWD     | 17.07.2023       | Citibank NA                    | 1         | 101.452                        | 0,01                 |
| 1.262.160 US\$     | 1.625.877.227 KRW   | 20.09.2023       | Citibank NA                    | 1         | 22.893                         | 0,00                 |
| 1.534.985 US\$     | 37.312.427 TRY      | 21.07.2023       | Citibank NA                    | 1         | 109.620                        | 0,01                 |
| 8.337.817 US\$     | 202.767.380 TRY     | 21.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 591.934                        | 0,05                 |
| 6.021.833 US\$     | 5.491.580 €         | 05.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 30.518                         | 0,00                 |
| 6.936.596 US\$     | 128.292.405 ZAR     | 12.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 150.029                        | 0,01                 |
| 582.943 US\$       | 17.222.482 TWD      | 06.07.2023       | HSBC Bank Plc                  | 1         | 30.009                         | 0,00                 |
| 4.736.434 US\$     | 115.190.083 TRY     | 21.07.2023       | HSBC Bank Plc                  | 1         | 336.077                        | 0,03                 |
| 3.214.656 US\$     | 109.999.421 THB     | 06.07.2023       | HSBC Bank Plc                  | 1         | 111.860                        | 0,01                 |
| 30.642.043 US\$    | 147.670.132 BRL     | 05.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 30.490                         | 0,00                 |
| 2.452.487 US\$     | 11.261.793 MYR      | 20.09.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | 27.154                         | 0,00                 |
| 4.058.651 US\$     | 70.433.143 MXN      | 20.09.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 13.136                         | 0,00                 |
| 7.741.740 US\$     | 145.694.986 ZAR     | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | 34.590                         | 0,00                 |
| 5.895.336 US\$     | 180.951.438 TWD     | 13.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 89.060                         | 0,01                 |
| 4.516.550 US\$     | 4.127.826 €         | 05.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | 13.090                         | 0,00                 |
| 5.207.017 US\$     | 97.668.845 ZAR      | 12.07.2023       | Morgan Stanley                 | 1         | 40.412                         | 0,00                 |
| 14.017.612 US\$    | 455.438.734 THB     | 06.07.2023       | Morgan Stanley                 | 2         | 1.170.878                      | 0,09                 |
| 3.643.981 US\$     | 17.629.582 BRL      | 25.07.2023       | Morgan Stanley                 | 1         | 3.275                          | 0,00                 |
| 24.244.645 US\$    | 115.438.454 BRL     | 05.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | 314.617                        | 0,03                 |
| 13.330.811 US\$    | 198.802.380.372 IDR | 20.09.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | 125.762                        | 0,01                 |
| 6.031.473 US\$     | 5.517.992 €         | 05.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 11.341                         | 0,00                 |

## Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 1,19 % (31. Dezember 2022: 1,08 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 18.321.207 UYU  | 457.002 US\$        | 10.08.2023       | Citibank NA                 | 1         | 30.329                         | 0,00                 |
| 50.774.980 UYU  | 1.278.645 US\$      | 10.08.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 71.933                         | 0,01                 |
| 165.713.129 ZAR   | 8.380.465 US\$      | 06.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | 390.649                        | 0,03                 |
| 165.713.129 ZAR   | 8.358.509 US\$      | 06.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 412.605                        | 0,03                 |
| 364.916.437 ZAR   | 18.374.171 US\$     | 06.07.2023       | Morgan Stanley              | 2         | 940.675                        | 0,08                 |
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i>   |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 170.480 AUD   | 113.091 US\$        | 14.09.2023       | Goldman Sachs International | 1         | 619                            | 0,00                 |
| 139 AUD   | 92 US\$             | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 1         | 0                              | 0,00                 |
| 127.418 US\$  | 187.787 AUD         | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 13        | 2.165                          | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>   |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 13.099.023 €  | 14.169.328 US\$     | 14.09.2023       | Goldman Sachs International | 3         | 173.600                        | 0,02                 |
| 13.170.373 €  | 14.248.404 US\$     | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 6         | 172.649                        | 0,01                 |
| 20.253 US\$   | 18.438 €            | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 5         | 64                             | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>   |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 37.956 £  | 47.699 US\$         | 14.09.2023       | Goldman Sachs International | 2         | 567                            | 0,00                 |
| 2.366 £   | 2.975 US\$          | 14.09.2023       | UBS AG                      | 3         | 34                             | 0,00                 |
| 37.956 £  | 47.685 US\$         | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 2         | 581                            | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen SEK</i>   |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 556.243.496 SEK   | 51.530.759 US\$     | 14.09.2023       | Goldman Sachs International | 2         | 144.207                        | 0,01                 |
| 556.193.001 SEK   | 51.529.982 US\$     | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 4         | 140.293                        | 0,01                 |
| 57 US\$   | 609 SEK             | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 1         | 1                              | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>   |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 34.525 US\$   | 46.246 SGD          | 14.09.2023       | Goldman Sachs International | 1         | 260                            | 0,00                 |
| 36.601 US\$   | 48.976 SGD          | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 7         | 312                            | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen ZAR</i>   |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 6.211.647 US\$  | 117.581.507 ZAR     | 14.09.2023       | Goldman Sachs International | 1         | 33.029                         | 0,00                 |
| 6.832.272 US\$  | 129.357.971 ZAR     | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 21        | 34.829                         | 0,00                 |
| 1.776 ZAR   | 93 US\$             | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 1         | 0                              | 0,00                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                             |           | <b>15.082.218</b>              | <b>1,19</b>          |

### Zinsswap-Kontrakte 0,80 % (31. Dezember 2022: 0,64 %)

|     | Nominalwert    | Fälligkeit | Gegenpartei                              | Erhalt/(Zahlung) <sup>#</sup> | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-----|----------------|------------|--|-------------------------------|-----------------|--------------------|--------------------------------|----------------------|
| BRL | 105.671.287    | 04.01.2027 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 12,76 %         | 1D BROIS           | 2.044.564                      | 0,16                 |
| MXN | 512.441.055    | 31.08.2029 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | Erhalt                        | 6,92 %          | 28D MXIBTIE        | 1.827.241                      | 0,14                 |
| BRL | 86.253.227     | 04.01.2027 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 12,67 %         | 1D BROIS           | 1.606.437                      | 0,13                 |
| BRL | 70.829.782     | 04.01.2027 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 12,68 %         | 1D BROIS           | 1.328.885                      | 0,11                 |
| MXN | 198.851.383    | 10.11.2031 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | Erhalt                        | 7,38 %          | 28D MXIBTIE        | 509.255                        | 0,04                 |
| COP | 85.928.260.876 | 13.04.2024 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | Erhalt                        | 8,37 %          | 1D COOIVBR         | 496.732                        | 0,04                 |



## Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Zinsswap-Kontrakte 0,80 % (31. Dezember 2022: 0,64 %) (Fortsetzung)

|  | Nominalwert    | Fälligkeit | Gegenpartei                              | Erhalt/(Zahlung) <sup>#</sup> | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|----------------|------------|--|-------------------------------|-----------------|--------------------|--------------------------------|----------------------|
| BRL  | 86.110.250     | 02.01.2026 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 11,57 %         | 1D BROIS           | 414.426                        | 0,03                 |
| BRL  | 24.637.956     | 02.01.2030 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 11,50 %         | 1D BROIS           | 375.657                        | 0,03                 |
| COP  | 56.328.682.161 | 31.01.2027 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | Erhalt                        | 7,14 %          | 1D COOVIBR         | 351.078                        | 0,03                 |
| BRL  | 65.515.347     | 02.01.2026 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 11,40 %         | 1D BROIS           | 266.550                        | 0,02                 |
| COP  | 16.091.111.994 | 06.01.2027 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | Erhalt                        | 6,40 %          | 1D COOVIBR         | 186.454                        | 0,02                 |
| CZK  | 166.683.551    | 17.04.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 5,05 %          | 6M PRIBOR          | 169.433                        | 0,01                 |
| MXN  | 328.685.527    | 03.02.2028 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 8,58 %          | 28D MXIBTIIE       | 126.152                        | 0,01                 |
| CZK  | 326.674.561    | 11.04.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 4,70 %          | 6M PRIBOR          | 109.871                        | 0,01                 |
| CZK  | 316.645.923    | 11.05.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 4,69 %          | 6M PRIBOR          | 106.008                        | 0,01                 |
| COP  | 7.078.194.753  | 07.01.2027 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | Erhalt                        | 6,45 %          | 1D COOVIBR         | 79.256                         | 0,01                 |
| HUF  | 559.561.178    | 10.02.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 8,72 %          | 6M BUBOR           | 49.264                         | 0,00                 |
| CZK  | 41.963.961     | 21.04.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 5,01 %          | 6M PRIBOR          | 39.532                         | 0,00                 |
| HUF  | 5.635.719.514  | 03.07.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 10,29 %         | 6M BUBOR           | 32.764                         | 0,00                 |
| BRL  | 34.373.160     | 02.01.2031 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 10,43 %         | 1D BROIS           | 7.933                          | 0,00                 |
| PLN  | 30.912.470     | 29.06.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 4,97 %          | 6M WIBOR           | 6.490                          | 0,00                 |
| THB  | 594.600.000    | 12.01.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 1,89 %          | 1D THOR            | 3.090                          | 0,00                 |
| THB  | 254.000.000    | 12.01.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 2,18 %          | 1D THOR            | 2.432                          | 0,00                 |
| MXN  | 256.541.706    | 20.03.2025 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | Erhalt                        | 10,05 %         | 28D MXIBTIIE       | 2.024                          | 0,00                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Zinsswapkontrakten <sup>∞</sup></b> |                |            |  |                               |                 |                    | <b>10.141.528</b>              | <b>0,80</b>          |

<sup>#</sup>Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

|  | Zeitwert US\$        | % des Nettovermögens |
|--|----------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> | <b>1.226.574.066</b> | <b>96,99</b>         |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (0,75 %) (31. Dezember 2022: (0,69 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 7.316.929 BRL      | 1.518.287 US\$      | 05.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (1.511)                         | (0,00)               |
| 22.283.703 BRL     | 4.623.942 US\$      | 05.07.2023       | HSBC Bank Plc               | 1         | (4.601)                         | (0,00)               |
| 115.438.454 BRL    | 24.012.658 US\$     | 28.08.2023       | Standard Chartered Bank     | 1         | (322.771)                       | (0,03)               |
| 118.069.500 BRL    | 24.499.813 US\$     | 05.07.2023       | Standard Chartered Bank     | 2         | (24.378)                        | (0,00)               |
| 85.890.590 CNH     | 11.980.565 US\$     | 20.07.2023       | BNP Paribas                 | 1         | (159.413)                       | (0,01)               |
| 176.611.690 CNH    | 24.812.994 US\$     | 20.09.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (375.380)                       | (0,03)               |
| 63.735.447 CNH     | 8.966.045 US\$      | 20.09.2023       | UBS AG                      | 1         | (147.024)                       | (0,01)               |

## Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (0,75 %) (31. Dezember 2022: (0,69 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 156.030.686 EGP    | 4.869.872 US\$      | 24.08.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (20.935)                        | (0,00)               |
| 8.158.545 €        | 37.095.592 PLN      | 06.07.2023       | Barclays Bank Plc           | 1         | (228.366)                       | (0,02)               |
| 18.766.795 €       | 93.351.205 RON      | 25.07.2023       | Citibank NA                 | 3         | (26.575)                        | (0,00)               |
| 8.232.146 €        | 9.056.033 US\$      | 05.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | (74.758)                        | (0,01)               |
| 3.315.527 €        | 16.495.308 RON      | 25.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | (5.347)                         | (0,00)               |
| 1.473.003 €        | 35.350.190 CZK      | 20.09.2023       | Morgan Stanley              | 1         | (4.405)                         | (0,00)               |
| 835.981 €          | 4.161.657 RON       | 25.07.2023       | UBS AG                      | 1         | (1.900)                         | (0,00)               |
| 8.039.769 €        | 36.348.647 PLN      | 20.09.2023       | UBS AG                      | 1         | (105.975)                       | (0,01)               |
| 7.968.053.603 HUF  | 21.121.468 €        | 11.08.2023       | Citibank NA                 | 2         | (25.285)                        | (0,00)               |
| 79.426.648 HUF     | 211.291 €           | 01.08.2023       | Morgan Stanley              | 1         | (382)                           | (0,00)               |
| 86.495.565.937 IDR | 5.810.921 US\$      | 07.07.2023       | Citibank NA                 | 1         | (46.516)                        | (0,00)               |
| 89.408.840.244 IDR | 5.979.489 US\$      | 20.07.2023       | HSBC Bank Plc               | 1         | (34.534)                        | (0,00)               |
| 57.200.201.985 IDR | 3.800.930 US\$      | 20.09.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | (1.522)                         | (0,00)               |
| 2.843.047.730 IDR  | 191.469 US\$        | 07.07.2023       | Morgan Stanley              | 1         | (1.997)                         | (0,00)               |
| 68.080.930 KRW     | 53.630 US\$         | 20.09.2023       | HSBC Bank Plc               | 1         | (1.738)                         | (0,00)               |
| 15.283.157 MXN     | 892.534 US\$        | 06.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | (1.586)                         | (0,00)               |
| 80.578.024 MYR     | 17.521.867 US\$     | 20.09.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 2         | (168.629)                       | (0,01)               |
| 135.609.787 THB    | 3.905.821 US\$      | 06.07.2023       | BNP Paribas                 | 2         | (80.625)                        | (0,01)               |
| 267.275.093 THB    | 8.019.055 US\$      | 06.07.2023       | Citibank NA                 | 1         | (479.924)                       | (0,04)               |
| 1.359.392.360 THB  | 39.508.540 US\$     | 20.09.2023       | Goldman Sachs International | 2         | (871.144)                       | (0,07)               |
| 627.157.175 THB    | 19.454.033 US\$     | 06.07.2023       | Standard Chartered Bank     | 1         | (1.763.572)                     | (0,14)               |
| 22.992.750 THB     | 670.794 US\$        | 20.09.2023       | UBS AG                      | 1         | (17.282)                        | (0,00)               |
| 213.557.657 TWD    | 7.372.803 US\$      | 06.07.2023       | Morgan Stanley              | 1         | (516.453)                       | (0,04)               |
| 9.250.371 US\$     | 33.861.907 PEN      | 18.08.2023       | Citibank NA                 | 1         | (54.498)                        | (0,00)               |
| 15.138.928 US\$    | 13.940.559 €        | 05.07.2023       | Citibank NA                 | 3         | (70.226)                        | (0,01)               |
| 6.221.350 US\$     | 31.214.987 BRL      | 25.07.2023       | Citibank NA                 | 2         | (224.895)                       | (0,02)               |
| 39.480.844 US\$    | 769.991.512 ZAR     | 12.07.2023       | Citibank NA                 | 1         | (1.251.096)                     | (0,10)               |
| 9.138.647 US\$     | 40.917.653.250 COP  | 06.07.2023       | Citibank NA                 | 1         | (657.125)                       | (0,05)               |
| 5.790.686 US\$     | 24.734.586.151 COP  | 20.09.2023       | Goldman Sachs International | 2         | (8.091)                         | (0,00)               |
| 2.933.038 US\$     | 110.975.815 UYU     | 10.08.2023       | Goldman Sachs International | 2         | (18.838)                        | (0,00)               |
| 1.447.444 US\$     | 7.316.929 BRL       | 05.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (69.333)                        | (0,01)               |
| 8.736.734 US\$     | 11.528.295.806 KRW  | 06.07.2023       | HSBC Bank Plc               | 1         | (12.921)                        | (0,00)               |
| 3.722.442 US\$     | 3.433.100 €         | 05.07.2023       | HSBC Bank Plc               | 1         | (23.071)                        | (0,00)               |
| 2.776.739 US\$     | 105.049.585 UYU     | 10.08.2023       | HSBC Bank Plc               | 2         | (17.505)                        | (0,00)               |
| 4.474.406 US\$     | 22.283.703 BRL      | 05.07.2023       | HSBC Bank Plc               | 1         | (144.936)                       | (0,01)               |
| 6.011.568 US\$     | 5.517.992 €         | 03.08.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | (17.957)                        | (0,00)               |
| 16.595.616 US\$    | 15.387.677 €        | 05.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 3         | (192.345)                       | (0,02)               |
| 8.742.974 US\$     | 155.663.140 MXN     | 06.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | (331.583)                       | (0,03)               |
| 2.680.531 US\$     | 11.445.867.854 COP  | 20.09.2023       | Morgan Stanley              | 1         | (2.838)                         | (0,00)               |
| 2.048.953 US\$     | 10.036.737 BRL      | 25.07.2023       | Standard Chartered Bank     | 1         | (23.745)                        | (0,00)               |
| 516.424 US\$       | 2.631.046 BRL       | 05.07.2023       | Standard Chartered Bank     | 1         | (28.984)                        | (0,00)               |

## Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (0,75 %) (31. Dezember 2022: (0,69 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 3.567.468 US\$   | 61.954.616 MXN      | 06.07.2023       | Standard Chartered Bank     | 1         | (44.246)                        | (0,00)               |
| 49.893.786 ZAR   | 2.719.223 US\$      | 12.07.2023       | Citibank NA                 | 1         | (79.881)                        | (0,01)               |
| 11.070.330 ZAR   | 604.152 US\$        | 12.07.2023       | Morgan Stanley              | 1         | (18.540)                        | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 16.403.384 AUD   | 11.049.156 US\$     | 14.09.2023       | UBS AG                      | 2         | (108.030)                       | (0,01)               |
| 17.380.104 AUD   | 11.710.153 US\$     | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 9         | (117.549)                       | (0,01)               |
| 159.249 US\$   | 239.764 AUD         | 14.09.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (675)                           | (0,00)               |
| 4.891 US\$   | 7.392 AUD           | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 3         | (40)                            | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 160.307 €  | 176.210 US\$        | 14.09.2023       | Citibank NA                 | 1         | (679)                           | (0,00)               |
| 172.014 €  | 188.494 US\$        | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 6         | (145)                           | (0,00)               |
| 198.791 US\$   | 182.127 €           | 14.09.2023       | Citibank NA                 | 1         | (631)                           | (0,00)               |
| 418.893 US\$   | 383.771 €           | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 10        | (1.322)                         | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 464 £  | 593 US\$            | 14.09.2023       | Citibank NA                 | 1         | (3)                             | (0,00)               |
| 697 US\$   | 552 £               | 14.09.2023       | Citibank NA                 | 1         | (5)                             | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen SEK</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 78.902 SEK   | 7.342 US\$          | 14.09.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (12)                            | (0,00)               |
| 452.981 SEK  | 42.622 US\$         | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 5         | (539)                           | (0,00)               |
| 4.540 US\$   | 49.125 SEK          | 14.09.2023       | Citibank NA                 | 1         | (24)                            | (0,00)               |
| 51.227.571 US\$  | 552.970.893 SEK     | 14.09.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (143.371)                       | (0,01)               |
| 51.231.463 US\$  | 552.970.893 SEK     | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 1         | (139.479)                       | (0,01)               |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 5.541 SGD  | 4.109 US\$          | 14.09.2023       | Citibank NA                 | 1         | (3)                             | (0,00)               |
| 467.420 SGD  | 348.974 US\$        | 14.09.2023       | Goldman Sachs International | 3         | (2.653)                         | (0,00)               |
| 574.183 SGD  | 429.009 US\$        | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 5         | (3.584)                         | (0,00)               |
| 4.793 US\$   | 6.479 SGD           | 14.09.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (8)                             | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen ZAR</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 44.085 US\$  | 839.254 ZAR         | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 3         | (15)                            | (0,00)               |
| 481.304.489 ZAR  | 25.436.126 US\$     | 14.09.2023       | Goldman Sachs International | 3         | (144.757)                       | (0,01)               |
| 22.647.568 ZAR   | 1.192.564 US\$      | 14.09.2023       | UBS AG                      | 2         | (2.490)                         | (0,00)               |
| 478.699.391 ZAR  | 25.252.098 US\$     | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 5         | (97.620)                        | (0,01)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                             |           | <b>(9.570.816)</b>              | <b>(0,75)</b>        |

### Futures-Kontrakte (0,03 %) (31. Dezember 2022: (0,05 %))

| Anzahl Kontrakte  | Beschreibung  | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---|---------------------------------|----------------------|
| 1.115   | South Korea 3-Year Bond Future September 2023       | (220.362)                       | (0,02)               |
| 292   | US Treasury 5-Year Note (CBT) Future September 2023 | (129.859)                       | (0,01)               |
| 56  | US Treasury Ultra Bond (CBT) Future September 2023  | (4.125)                         | (0,00)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten <sup>*</sup></b> |   | <b>(354.346)</b>                | <b>(0,03)</b>        |

## Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Zinsswap-Kontrakte (1,45 %) (31. Dezember 2022: (3,40 %))

|   | Nominalwert     | Fälligkeit | Gegenpartei                              | Erhalt/(Zahlung) <sup>#</sup> | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|-----------------|------------|--|-------------------------------|-----------------|--------------------|---------------------------------|----------------------|
| BRL   | 427.249         | 02.01.2024 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 11,66 %         | 1D BROIS           | (2.308)                         | (0,00)               |
| ILS   | 10.249.220      | 06.04.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 3,64 %          | 3M TELBOR          | (8.020)                         | (0,00)               |
| PLN   | 30.926.591      | 29.06.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 5,01 %          | 6M WIBOR           | (9.198)                         | (0,00)               |
| CLP   | 45.161.320      | 24.08.2030 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 2,15 %          | 1D CLICP           | (9.964)                         | (0,00)               |
| HUF   | 9.519.296.019   | 03.07.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 10,43 %         | 6M BUBOR           | (11.223)                        | (0,00)               |
| ILS   | 56.150.273      | 15.06.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 3,68 %          | 3M TELBOR          | (11.224)                        | (0,00)               |
| CZK   | 182.928.027     | 27.01.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 4,52 %          | 6M PRIBOR          | (19.733)                        | (0,00)               |
| PLN   | 30.739.645      | 03.07.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 5,05 %          | 6M WIBOR           | (20.612)                        | (0,00)               |
| PLN   | 30.910.219      | 30.06.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 5,07 %          | 6M WIBOR           | (26.256)                        | (0,00)               |
| PLN   | 8.775.179       | 15.05.2033 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 5,20 %          | 6M WIBOR           | (28.642)                        | (0,00)               |
| MXN   | 132.917.273     | 25.03.2026 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 9,33 %          | 28D MXIBTIIE       | (30.613)                        | (0,00)               |
| PLN   | 8.775.181       | 15.05.2033 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 5,22 %          | 6M WIBOR           | (32.346)                        | (0,00)               |
| PLN   | 17.550.358      | 15.05.2033 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 5,14 %          | 6M WIBOR           | (37.288)                        | (0,00)               |
| CZK   | 361.114.425     | 06.12.2027 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 4,51 %          | 6M PRIBOR          | (68.784)                        | (0,00)               |
| ILS   | 44.442.611      | 09.01.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 3,47 %          | 3M TELBOR          | (129.566)                       | (0,01)               |
| ILS   | 52.795.993      | 06.01.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 3,50 %          | 3M TELBOR          | (134.154)                       | (0,01)               |
| MXN   | 34.061.309      | 08.12.2025 | Goldman Sachs International              | (Zahlung)                     | 6,21 %          | 28D MXIBTIIE       | (135.422)                       | (0,01)               |
| MXN   | 242.308.506     | 07.01.2028 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 8,04 %          | 28D MXIBTIIE       | (199.270)                       | (0,02)               |
| MXN   | 199.017.695     | 02.06.2033 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 8,35 %          | 28D MXIBTIIE       | (204.460)                       | (0,02)               |
| CZK   | 490.728.827     | 23.01.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 4,35 %          | 6M PRIBOR          | (204.749)                       | (0,02)               |
| COP   | 8.472.548.430   | 11.08.2032 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | Erhalt                        | 9,02 %          | 1D COOVIBR         | (210.158)                       | (0,02)               |
| MXN   | 60.000.000      | 08.04.2026 | Goldman Sachs International              | (Zahlung)                     | 5,95 %          | 28D MXIBTIIE       | (269.061)                       | (0,02)               |
| MXN   | 75.000.000      | 18.06.2026 | JPMorgan Chase Bank                      | (Zahlung)                     | 6,13 %          | 28D MXIBTIIE       | (323.524)                       | (0,03)               |
| MXN   | 76.391.828      | 28.05.2026 | JPMorgan Chase Bank                      | (Zahlung)                     | 6,16 %          | 28D MXIBTIIE       | (324.332)                       | (0,03)               |
| MXN   | 90.000.000      | 21.05.2026 | JPMorgan Chase Bank                      | (Zahlung)                     | 6,33 %          | 28D MXIBTIIE       | (358.758)                       | (0,03)               |
| COP   | 92.844.930.245  | 05.06.2025 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | Erhalt                        | 10,27 %         | 1D COOVIBR         | (378.372)                       | (0,03)               |
| MXN   | 95.000.000      | 16.09.2026 | Goldman Sachs International              | (Zahlung)                     | 6,38 %          | 28D MXIBTIIE       | (380.621)                       | (0,03)               |
| MXN   | 94.552.835      | 05.03.2026 | Goldman Sachs International              | (Zahlung)                     | 6,17 %          | 28D MXIBTIIE       | (391.407)                       | (0,03)               |
| PLN   | 11.813.679      | 28.10.2032 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 7,32 %          | 6M WIBOR           | (480.883)                       | (0,04)               |
| COP   | 123.410.125.662 | 02.06.2025 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | Erhalt                        | 10,28 %         | 1D COOVIBR         | (502.177)                       | (0,04)               |
| CLP   | 29.962.297.165  | 14.09.2024 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | Erhalt                        | 9,80 %          | 1D CLICP           | (794.765)                       | (0,06)               |
| BRL   | 40.209.304      | 02.01.2025 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 6,82 %          | 1D BROIS           | (851.498)                       | (0,07)               |
| BRL   | 107.195.155     | 02.01.2024 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 5,76 %          | 1D BROIS           | (2.503.656)                     | (0,20)               |
| BRL   | 136.490.816     | 01.07.2024 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 5,92 %          | 1D BROIS           | (4.518.709)                     | (0,36)               |
| BRL   | 138.112.873     | 02.01.2025 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 5,65 %          | 1D BROIS           | (4.694.427)                     | (0,37)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Zinsswapkontrakten <sup>∞</sup></b> |                 |            |  |                               |                 |                    | <b>(18.306.180)</b>             | <b>(1,45)</b>        |

<sup>#</sup>Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

## Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

|   | Zeitwert<br>US\$     | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|----------------------|------------------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(28.231.342)</b>  | <b>(2,23)</b>                |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>1.198.342.724</b> | <b>94,76</b>                 |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>66.237.845</b>    | <b>5,24</b>                  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>1.264.580.569</b> | <b>100,00</b>                |
| <b>Portfolioanalyse</b>   |                      |                              |
|   | <b>US\$</b>          | <b>Gesamtver-<br/>mögens</b> |
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind   | 869.352.877          | 65,85                        |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden              | 316.111.243          | 23,94                        |
| μ Investmentfonds   | 15.886.200           | 1,20                         |
| ± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden                            | (354.346)            | (0,03)                       |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap                              | (2.653.250)          | (0,20)                       |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>1.198.342.724</b> | <b>90,76</b>                 |

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Schatzwechsel 0,42 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)</b>          |   |        |                       |                  |                              |
| <b>Thailändischer Baht</b>                                       |   |        |                       |                  |                              |
| 39.000.000   | Bank of Thailand Bill   | 0,00 % | 17.08.2023            | 1.097.433        | 0,22                         |
| 34.618.000   | Bank of Thailand Bill   | 0,00 % | 09.05.2024            | 959.788          | 0,20                         |
| <b>Schatzwechsel insgesamt **</b>                                |   |        |                       | <b>2.057.221</b> | <b>0,42</b>                  |
| <b>Unternehmensanleihen 28,66 % (31. Dezember 2022: 31,88 %)</b> |   |        |                       |                  |                              |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi</b>                                |   |        |                       |                  |                              |
| 670.000  | Bank of Chengdu Co Ltd*   | 0,40 % | 03.03.2028            | 107.670          | 0,02                         |
| 1.750.000  | China Southern Airlines Co Ltd*   | 0,60 % | 15.10.2026            | 301.461          | 0,06                         |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt</b>                      |   |        |                       | <b>409.131</b>   | <b>0,08</b>                  |
| <b>Kolumbianischer Peso</b>                                      |   |        |                       |                  |                              |
| 4.060.000.000  | Empresas Publicas de Medellin ESP*  | 7,63 % | 10.09.2024            | 906.763          | 0,18                         |
| 17.077.000.000   | Empresas Publicas de Medellin ESP*  | 8,38 % | 08.11.2027            | 3.288.864        | 0,67                         |
| <b>Kolumbianischer Peso insgesamt</b>                            |   |        |                       | <b>4.195.627</b> | <b>0,85</b>                  |
| <b>Euro</b>  |   |        |                       |                  |                              |
| 2.082.000  | NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance Plc*                                  | 7,13 % | 19.07.2026            | 846.051          | 0,17                         |
| 821.000  | Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara*                    | 1,88 % | 05.11.2031            | 680.485          | 0,14                         |
| <b>Euro insgesamt</b>  |   |        |                       | <b>1.526.536</b> | <b>0,31</b>                  |
| <b>Mexikanischer Peso</b>  |   |        |                       |                  |                              |
| 17.700.000   | Asian Infrastructure Investment Bank*   | 0,00 % | 08.02.2038            | 268.256          | 0,05                         |
| 46.510.400   | Comision Federal de Electricidad*   | 7,35 % | 25.11.2025            | 2.498.272        | 0,51                         |
| 43.963.800   | Comision Federal de Electricidad*   | 8,18 % | 23.12.2027            | 2.348.441        | 0,48                         |
| <b>Mexikanischer Peso insgesamt</b>                              |   |        |                       | <b>5.114.969</b> | <b>1,04</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 537.000  | Abu Dhabi Commercial Bank PJSC*   | 4,50 % | 14.09.2027            | 529.305          | 0,11                         |
| 1.439.000  | Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC*   | 4,60 % | 02.11.2047            | 1.338.421        | 0,27                         |
| 400.000  | Abu Dhabi National Energy Co PJSC*  | 2,00 % | 29.04.2028            | 356.278          | 0,07                         |
| 351.000  | Abu Dhabi National Energy Co PJSC*  | 4,70 % | 24.04.2033            | 349.453          | 0,07                         |
| 500.000  | Adani Electricity Mumbai Ltd*   | 3,95 % | 12.02.2030            | 372.228          | 0,08                         |
| 400.000  | Adani Green Energy UP Ltd/Prayatna Developers Pvt Ltd/Parampujya Solar Energ* | 6,25 % | 10.12.2024            | 383.919          | 0,08                         |
| 362.000  | Aeropuerto Internacional de Tocumen SA**                                      | 5,13 % | 11.08.2061            | 279.450          | 0,06                         |
| 538.000  | Africa Finance Corp*  | 2,88 % | 28.04.2028            | 445.195          | 0,09                         |
| 497.000  | African Export-Import Bank*   | 3,99 % | 21.09.2029            | 421.041          | 0,09                         |
| 200.000  | AIA Group Ltd*  | 3,20 % | 16.09.2040            | 153.555          | 0,03                         |
| 250.000  | AIA Group Ltd**   | 3,38 % | 07.04.2030            | 228.846          | 0,05                         |
| 200.000  | AIA Group Ltd**   | 4,95 % | 04.04.2033            | 200.205          | 0,04                         |
| 400.000  | Akbank TAS*   | 5,13 % | 31.03.2025            | 378.158          | 0,08                         |

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                       | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 28,66 % (31. Dezember 2022: 31,88 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 400.000  | Akbank TAS**                                | 6,80 % | 06.02.2026            | 382.660          | 0,08                         |
| 400.000  | Aldar Investment Properties Sukuk Ltd*      | 4,88 % | 24.05.2033            | 397.500          | 0,08                         |
| 838.844  | Alfa Desarrollo SpA**                       | 4,55 % | 27.09.2051            | 616.303          | 0,13                         |
| 600.000  | Alfa SAB de CV**                            | 6,88 % | 25.03.2044            | 603.031          | 0,12                         |
| 394.000  | Alibaba Group Holding Ltd*                  | 4,00 % | 06.12.2037            | 330.573          | 0,07                         |
| 500.000  | Alpek SAB de CV*                            | 3,25 % | 25.02.2031            | 404.425          | 0,08                         |
| 300.000  | Alsea SAB de CV**                           | 7,75 % | 14.12.2026            | 297.969          | 0,06                         |
| 500.000  | Altice Financing SA*                        | 5,00 % | 15.01.2028            | 400.125          | 0,08                         |
| 200.000  | Altice Financing SA**                       | 5,75 % | 15.08.2029            | 155.152          | 0,03                         |
| 300.000  | America Movil SAB de CV*                    | 4,70 % | 21.07.2032            | 289.597          | 0,06                         |
| 625.000  | Anglo American Capital Plc*                 | 3,88 % | 16.03.2029            | 568.777          | 0,12                         |
| 400.000  | AngloGold Ashanti Holdings Plc*             | 3,38 % | 01.11.2028            | 350.723          | 0,07                         |
| 310.000  | Antofagasta Plc*                            | 5,63 % | 13.05.2032            | 308.497          | 0,06                         |
| 400.000  | Arabian Centres Sukuk II Ltd*               | 5,63 % | 07.10.2026            | 366.946          | 0,07                         |
| 200.000  | Banco Bradesco SA**                         | 4,38 % | 18.03.2027            | 189.665          | 0,04                         |
| 225.000  | Banco BTG Pactual SA*                       | 2,75 % | 11.01.2026            | 205.336          | 0,04                         |
| 635.000  | Banco Davivienda SA**                       | 6,65 % | 29.12.2049            | 467.912          | 0,10                         |
| 400.000  | Banco de Chile**                            | 2,99 % | 09.12.2031            | 341.868          | 0,07                         |
| 531.000  | Banco de Credito del Peru SA**              | 3,13 % | 01.07.2030            | 487.831          | 0,10                         |
| 375.000  | Banco de Credito e Inversiones SA**         | 2,88 % | 14.10.2031            | 310.982          | 0,06                         |
| 500.000  | Banco do Brasil SA**                        | 6,25 % | 18.04.2030            | 497.375          | 0,10                         |
| 292.000  | Banco do Brasil SA**                        | 9,00 % | 29.12.2049            | 293.723          | 0,06                         |
| 500.000  | Banco Mercantil del Norte SA*               | 7,63 % | 29.12.2049            | 455.558          | 0,09                         |
| 400.000  | Banco Santander Chile**                     | 3,18 % | 26.10.2031            | 346.914          | 0,07                         |
| 400.000  | Bancolombia SA*                             | 4,63 % | 18.12.2029            | 340.816          | 0,07                         |
| 1.000.000  | Bangkok Bank PCL**                          | 3,73 % | 25.09.2034            | 848.901          | 0,17                         |
| 402.000  | Bangkok Bank PCL*                           | 4,30 % | 15.06.2027            | 390.995          | 0,08                         |
| 854.000  | Bangkok Bank PCL**                          | 5,00 % | 29.12.2049            | 810.121          | 0,16                         |
| 500.000  | Bank Leumi Le-Israel BM*                    | 3,28 % | 29.01.2031            | 448.070          | 0,09                         |
| 300.000  | Bank Muscat SAOG*                           | 4,75 % | 17.03.2026            | 290.851          | 0,06                         |
| 418.000  | Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT**      | 3,75 % | 30.03.2026            | 387.105          | 0,08                         |
| 500.000  | Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT*       | 4,30 % | 29.12.2049            | 414.377          | 0,08                         |
| 1.708.000  | Banque Ouest Africaine de Developpement*    | 4,70 % | 22.10.2031            | 1.387.827        | 0,28                         |
| 400.000  | Bidvest Group UK Plc*                       | 3,63 % | 23.09.2026            | 357.550          | 0,07                         |
| 800.000  | BOC Aviation Ltd*                           | 3,00 % | 11.09.2029            | 703.828          | 0,14                         |
| 274.000  | BOC Aviation Ltd**                          | 3,50 % | 18.09.2027            | 256.220          | 0,05                         |
| 493.000  | Braskem Netherlands Finance BV*             | 7,25 % | 13.02.2033            | 484.765          | 0,10                         |
| 523.500  | Brazil Minas SPE via State of Minas Gerais† | 5,33 % | 15.02.2028            | 514.203          | 0,10                         |
| 200.000  | BRF SA**                                    | 4,88 % | 24.01.2030            | 162.850          | 0,03                         |
| 665.000  | BSF Finance*                                | 5,50 % | 23.11.2027            | 676.873          | 0,14                         |

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 28,66 % (31. Dezember 2022: 31,88 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 550.000  | C&W Senior Financing DAC**  | 6,88 % | 15.09.2027            | 480.370          | 0,10                         |
| 263.000  | Canacol Energy Ltd**  | 5,75 % | 24.11.2028            | 225.196          | 0,05                         |
| 500.000  | CBQ Finance Ltd*  | 2,00 % | 15.09.2025            | 464.576          | 0,09                         |
| 400.000  | CBQ Finance Ltd*  | 2,00 % | 12.05.2026            | 365.430          | 0,07                         |
| 300.000  | CDBL Funding 2 <sup>†</sup>   | 2,00 % | 04.03.2026            | 273.054          | 0,06                         |
| 300.000  | Celulosa Arauco y Constitucion SA**                                     | 4,25 % | 30.04.2029            | 271.642          | 0,06                         |
| 200.000  | Cemex SAB de CV**   | 5,13 % | 29.12.2049            | 178.165          | 0,04                         |
| 622.000  | Cemex SAB de CV**   | 9,13 % | 29.12.2049            | 630.706          | 0,13                         |
| 700.000  | Cencosud SA*  | 4,38 % | 17.07.2027            | 665.067          | 0,14                         |
| 645.000  | Central American Bottling Corp/CBC Bottling Holdco SL/Beliv Holdco SL** | 5,25 % | 27.04.2029            | 596.563          | 0,12                         |
| 300.000  | Champion Path Holdings Ltd <sup>†</sup>                                 | 4,85 % | 27.01.2028            | 243.000          | 0,05                         |
| 300.000  | China Cinda Finance 2017 I Ltd <sup>†</sup>                             | 4,75 % | 08.02.2028            | 288.589          | 0,06                         |
| 300.000  | China Construction Bank Corp*   | 2,45 % | 24.06.2030            | 280.937          | 0,06                         |
| 400.000  | China Hongqiao Group Ltd*   | 6,25 % | 08.06.2024            | 393.280          | 0,08                         |
| 300.000  | China Overseas Finance Cayman VI Ltd*                                   | 5,95 % | 08.05.2024            | 299.495          | 0,06                         |
| 410.000  | Cibanco SA Ibm/PLA Administradora Industrial S de RL de CV**            | 4,96 % | 18.07.2029            | 385.466          | 0,08                         |
| 500.000  | CIFI Holdings Group Co Ltd*   | 5,95 % | 20.10.2025            | 57.970           | 0,01                         |
| 400.000  | CK Hutchison International 23 Ltd <sup>†</sup>                          | 4,88 % | 21.04.2033            | 396.033          | 0,08                         |
| 400.000  | CMB International Leasing Management Ltd <sup>†</sup>                   | 1,88 % | 12.08.2025            | 369.548          | 0,08                         |
| 214.000  | Colbun SA**   | 3,15 % | 19.01.2032            | 181.014          | 0,04                         |
| 669.000  | Comision Federal de Electricidad <sup>†</sup>                           | 3,35 % | 09.02.2031            | 527.168          | 0,11                         |
| 664.000  | Comision Federal de Electricidad <sup>†</sup>                           | 4,69 % | 15.05.2029            | 598.350          | 0,12                         |
| 275.000  | Comision Federal de Electricidad <sup>†</sup>                           | 6,26 % | 15.02.2052            | 231.910          | 0,05                         |
| 800.000  | Commercial Bank PSQC*   | 4,50 % | 29.12.2049            | 725.080          | 0,15                         |
| 531.000  | Compania Cervecerias Unidas SA**  | 3,35 % | 19.01.2032            | 453.139          | 0,09                         |
| 372.000  | Continuum Energy Levanter Pte Ltd**                                     | 4,50 % | 09.02.2027            | 346.890          | 0,07                         |
| 200.000  | Corp Nacional del Cobre de Chile*                                       | 3,00 % | 30.09.2029            | 175.931          | 0,04                         |
| 200.000  | Corp. Nacional del Cobre de Chile <sup>†</sup>                          | 5,13 % | 02.02.2033            | 197.458          | 0,04                         |
| 300.000  | Country Garden Holdings Co Ltd <sup>†</sup>                             | 3,13 % | 22.10.2025            | 94.545           | 0,02                         |
| 300.000  | Country Garden Holdings Co Ltd <sup>†</sup>                             | 4,80 % | 06.08.2030            | 86.884           | 0,02                         |
| 700.000  | CSN Resources SA**  | 4,63 % | 10.06.2031            | 535.043          | 0,11                         |
| 344.000  | CT Trust**  | 5,13 % | 03.02.2032            | 276.401          | 0,06                         |
| 600.000  | DBS Group Holdings Ltd*   | 4,52 % | 11.12.2028            | 595.659          | 0,12                         |
| 600.000  | DIB Sukuk Ltd <sup>†</sup>  | 2,95 % | 16.01.2026            | 567.756          | 0,12                         |
| 489.000  | DIB Sukuk Ltd <sup>†</sup>  | 4,80 % | 16.08.2028            | 488.589          | 0,10                         |
| 692.000  | DIB Sukuk Ltd <sup>†</sup>  | 5,49 % | 30.11.2027            | 708.805          | 0,14                         |
| 497.000  | DIB Tier 1 Sukuk 3 Ltd <sup>†</sup>                                     | 6,25 % | 29.12.2049            | 497.248          | 0,10                         |
| 1.190.000  | DP World Ltd <sup>†</sup>   | 6,85 % | 02.07.2037            | 1.289.176        | 0,26                         |
| 726.000  | Ecopetrol SA*   | 5,88 % | 28.05.2045            | 498.103          | 0,10                         |
| 500.000  | Ecopetrol SA*   | 6,88 % | 29.04.2030            | 456.506          | 0,09                         |



## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                          | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 28,66 % (31. Dezember 2022: 31,88 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |         |                       |                  |                              |
| 599.000  | Ecopetrol SA*                                  | 8,88 %  | 13.01.2033            | 593.666          | 0,12                         |
| 596.000  | El Sukuk Co Ltd*                               | 1,83 %  | 23.09.2025            | 552.795          | 0,11                         |
| 200.000  | EIG Pearl Holdings Sarl*                       | 3,55 %  | 31.08.2036            | 170.979          | 0,03                         |
| 300.000  | EIG Pearl Holdings Sarl*                       | 4,39 %  | 30.11.2046            | 236.094          | 0,05                         |
| 300.000  | Elect Global Investments Ltd*                  | 4,10 %  | 29.12.2049            | 270.240          | 0,05                         |
| 300.000  | Emaar Sukuk Ltd**                              | 3,64 %  | 15.09.2026            | 284.844          | 0,06                         |
| 250.000  | Embraer Netherlands Finance BV*                | 6,95 %  | 17.01.2028            | 248.859          | 0,05                         |
| 600.000  | Emirates NBD Bank PJSC*                        | 6,13 %  | 29.12.2049            | 593.438          | 0,12                         |
| 550.000  | Empresa de los Ferrocarriles del Estado*       | 3,07 %  | 18.08.2050            | 336.605          | 0,07                         |
| 941.000  | Empresa de Transmision Electrica SA*           | 5,13 %  | 02.05.2049            | 770.746          | 0,16                         |
| 362.000  | Empresa Nacional del Petroleo**                | 3,45 %  | 16.09.2031            | 303.398          | 0,06                         |
| 440.000  | Empresa Nacional del Petroleo**                | 3,75 %  | 05.08.2026            | 417.525          | 0,08                         |
| 206.000  | Empresa Nacional del Petroleo**                | 4,50 %  | 14.09.2047            | 155.005          | 0,03                         |
| 700.000  | Endeavour Mining Plc**                         | 5,00 %  | 14.10.2026            | 622.650          | 0,13                         |
| 403.425  | Energean Israel Finance Ltd*                   | 4,88 %  | 30.03.2026            | 375.454          | 0,08                         |
| 200.000  | Energean Israel Finance Ltd*                   | 5,88 %  | 30.03.2031            | 174.900          | 0,04                         |
| 470.588  | Energean Israel Finance Ltd**                  | 8,50 %  | 30.09.2033            | 470.294          | 0,10                         |
| 400.000  | ENN Clean Energy International Investment Ltd* | 3,38 %  | 12.05.2026            | 370.607          | 0,08                         |
| 1.200.000  | First Quantum Minerals Ltd**                   | 6,88 %  | 15.10.2027            | 1.172.418        | 0,24                         |
| 320.000  | First Quantum Minerals Ltd**                   | 7,50 %  | 01.04.2025            | 320.051          | 0,06                         |
| 500.000  | Franshion Brilliant Ltd*                       | 4,25 %  | 23.07.2029            | 394.225          | 0,08                         |
| 550.000  | FS Luxembourg Sarl**                           | 10,00 % | 15.12.2025            | 564.049          | 0,11                         |
| 700.000  | Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd*              | 2,63 %  | 31.03.2036            | 566.240          | 0,11                         |
| 759.880  | Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd*              | 2,94 %  | 30.09.2040            | 611.463          | 0,12                         |
| 433.000  | GC Treasury Center Co Ltd*                     | 2,98 %  | 18.03.2031            | 358.063          | 0,07                         |
| 800.000  | GC Treasury Center Co Ltd*                     | 4,40 %  | 30.03.2032            | 723.366          | 0,15                         |
| 324.000  | GCC SAB de CV**                                | 3,61 %  | 20.04.2032            | 275.569          | 0,06                         |
| 700.000  | GENM Capital Labuan Ltd*                       | 3,88 %  | 19.04.2031            | 566.907          | 0,12                         |
| 700.000  | Globe Telecom Inc*                             | 4,20 %  | 29.12.2049            | 651.875          | 0,13                         |
| 241.000  | Gohl Capital Ltd*                              | 4,25 %  | 24.01.2027            | 223.895          | 0,05                         |
| 415.480  | Greenko Dutch BV**                             | 3,85 %  | 29.03.2026            | 373.992          | 0,08                         |
| 463.751  | Greenko Power II Ltd*                          | 4,30 %  | 13.12.2028            | 404.234          | 0,08                         |
| 427.000  | Greensaif Pipelines Bidco Sarl*                | 6,51 %  | 23.02.2042            | 443.843          | 0,09                         |
| 550.000  | Grupo Aval Ltd*                                | 4,38 %  | 04.02.2030            | 431.928          | 0,09                         |
| 600.000  | Grupo de Inversiones Suramericana SA*          | 5,50 %  | 29.04.2026            | 568.896          | 0,12                         |
| 200.000  | Grupo Televisa SAB*                            | 6,63 %  | 15.01.2040            | 207.766          | 0,04                         |
| 547.357  | Guara Norte Sarl**                             | 5,20 %  | 15.06.2034            | 479.909          | 0,10                         |
| 600.000  | HDFC Bank Ltd**                                | 3,70 %  | 29.12.2049            | 521.200          | 0,11                         |
| 200.000  | Huarong Finance 2017 Co Ltd*                   | 4,25 %  | 07.11.2027            | 166.744          | 0,03                         |
| 500.000  | Huarong Finance II Co Ltd*                     | 5,50 %  | 16.01.2025            | 475.726          | 0,10                         |

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                       | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 28,66 % (31. Dezember 2022: 31,88 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 416.000  | Hunt Oil Co of Peru LLC Sucursal Del Peru** | 6,38 % | 01.06.2028            | 400.400          | 0,08                         |
| 557.000  | Hyundai Capital America**                   | 2,75 % | 27.09.2026            | 506.998          | 0,10                         |
| 200.000  | Hyundai Capital America**                   | 5,68 % | 26.06.2028            | 198.506          | 0,04                         |
| 700.000  | IHS Netherlands Holdco BV**                 | 8,00 % | 18.09.2027            | 639.800          | 0,13                         |
| 400.000  | Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT*          | 3,54 % | 27.04.2032            | 337.000          | 0,07                         |
| 400.000  | InRetail Consumer**                         | 3,25 % | 22.03.2028            | 343.888          | 0,07                         |
| 333.000  | Inversiones CMPC SA**                       | 6,13 % | 23.06.2033            | 335.428          | 0,07                         |
| 320.000  | Israel Electric Corp Ltd**                  | 3,75 % | 22.02.2032            | 273.844          | 0,06                         |
| 260.000  | Israel Electric Corp Ltd*                   | 4,25 % | 14.08.2028            | 242.917          | 0,05                         |
| 300.000  | JMH Co Ltd*                                 | 2,50 % | 09.04.2031            | 252.644          | 0,05                         |
| 300.000  | JSW Steel Ltd*                              | 5,05 % | 05.04.2032            | 242.687          | 0,05                         |
| 200.000  | Kallpa Generacion SA*                       | 4,13 % | 16.08.2027            | 186.971          | 0,04                         |
| 408.000  | Kasikornbank PCL*                           | 5,46 % | 07.03.2028            | 408.439          | 0,08                         |
| 200.000  | KazMunayGas National Co JSC*                | 3,50 % | 14.04.2033            | 155.516          | 0,03                         |
| 350.000  | KazMunayGas National Co JSC*                | 5,38 % | 24.04.2030            | 325.720          | 0,07                         |
| 1.885.000  | KazMunayGas National Co JSC*                | 5,75 % | 19.04.2047            | 1.541.053        | 0,31                         |
| 200.000  | Klabin Austria GmbH**                       | 3,20 % | 12.01.2031            | 160.050          | 0,03                         |
| 300.000  | Klabin Austria GmbH*                        | 7,00 % | 03.04.2049            | 287.812          | 0,06                         |
| 400.000  | KOC Holding AS*                             | 6,50 % | 11.03.2025            | 395.920          | 0,08                         |
| 700.000  | Kookmin Bank**                              | 2,50 % | 04.11.2030            | 568.663          | 0,12                         |
| 400.000  | Kosmos Energy Ltd*                          | 7,13 % | 04.04.2026            | 352.136          | 0,07                         |
| 300.000  | Kyobo Life Insurance Co Ltd*                | 5,90 % | 15.06.2052            | 294.606          | 0,06                         |
| 500.000  | Lenovo Group Ltd*                           | 3,42 % | 02.11.2030            | 421.680          | 0,09                         |
| 606.985  | Leviathan Bond Ltd*                         | 6,50 % | 30.06.2027            | 585.194          | 0,12                         |
| 475.000  | Longfor Group Holdings Ltd*                 | 3,95 % | 16.09.2029            | 353.975          | 0,07                         |
| 700.000  | MAF Global Securities Ltd*                  | 7,88 % | 29.12.2049            | 711.098          | 0,14                         |
| 600.000  | MARB BondCo Plc*                            | 3,95 % | 29.01.2031            | 430.008          | 0,09                         |
| 541.101  | MC Brazil Downstream Trading Sarl**         | 7,25 % | 30.06.2031            | 365.996          | 0,07                         |
| 364.000  | MDGH GMTN RSC Ltd*                          | 4,38 % | 22.11.2033            | 351.215          | 0,07                         |
| 750.000  | Medco Bell Pte Ltd*                         | 6,38 % | 30.01.2027            | 702.777          | 0,14                         |
| 300.000  | MEGlobal BV**                               | 2,63 % | 28.04.2028            | 261.983          | 0,05                         |
| 400.000  | MEGlobal Canada ULC*                        | 5,00 % | 18.05.2025            | 392.325          | 0,08                         |
| 300.000  | MEGlobal Canada ULC*                        | 5,88 % | 18.05.2030            | 303.423          | 0,06                         |
| 200.000  | Meituan*                                    | 3,05 % | 28.10.2030            | 158.564          | 0,03                         |
| 600.000  | Melco Resorts Finance Ltd**                 | 5,63 % | 17.07.2027            | 544.155          | 0,11                         |
| 500.000  | Melco Resorts Finance Ltd*                  | 5,75 % | 21.07.2028            | 442.500          | 0,09                         |
| 885.000  | Mexico City Airport Trust*                  | 5,50 % | 31.07.2047            | 774.159          | 0,16                         |
| 250.000  | Millicom International Cellular SA**        | 4,50 % | 27.04.2031            | 192.387          | 0,04                         |
| 540.000  | Millicom International Cellular SA*         | 5,13 % | 15.01.2028            | 472.011          | 0,10                         |
| 180.000  | Millicom International Cellular SA*         | 6,25 % | 25.03.2029            | 161.557          | 0,03                         |

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                      | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 28,66 % (31. Dezember 2022: 31,88 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |         |                       |                  |                              |
| 900.000  | Minera Mexico SA de CV**                                   | 4,50 %  | 26.01.2050            | 707.346          | 0,14                         |
| 800.000  | Minsur SA**  | 4,50 %  | 28.10.2031            | 703.716          | 0,14                         |
| 240.000  | MSU Energy SA/UGEN SA/UENSA SA**                           | 6,88 %  | 01.02.2025            | 168.235          | 0,03                         |
| 350.000  | MTR Corp Ltd*  | 1,63 %  | 19.08.2030            | 288.718          | 0,06                         |
| 369.019  | MV24 Capital BV*   | 6,75 %  | 01.06.2034            | 333.369          | 0,07                         |
| 345.077  | Nakilat Inc**  | 6,07 %  | 31.12.2033            | 362.238          | 0,07                         |
| 300.000  | Nanyang Commercial Bank Ltd*                               | 3,80 %  | 20.11.2029            | 286.765          | 0,06                         |
| 700.000  | NBK Tier 1 Financing 2 Ltd*                                | 4,50 %  | 29.12.2049            | 644.252          | 0,13                         |
| 600.000  | Nexa Resources SA**  | 5,38 %  | 04.05.2027            | 560.431          | 0,11                         |
| 1.000.000  | NWD MTN Ltd*   | 4,13 %  | 18.07.2029            | 820.220          | 0,17                         |
| 320.000  | Oil & Gas Holding Co BSCC**                                | 7,50 %  | 25.10.2027            | 325.356          | 0,07                         |
| 670.000  | Oil & Gas Holding Co BSCC*                                 | 8,38 %  | 07.11.2028            | 707.249          | 0,14                         |
| 545.000  | Ooredoo International Finance Ltd*                         | 2,63 %  | 08.04.2031            | 470.606          | 0,10                         |
| 600.000  | Orbia Advance Corp SAB de CV**                             | 6,75 %  | 19.09.2042            | 592.836          | 0,12                         |
| 300.000  | Oryx Funding Ltd*  | 5,80 %  | 03.02.2031            | 289.515          | 0,06                         |
| 800.000  | Oversea-Chinese Banking Corp Ltd**                         | 1,83 %  | 10.09.2030            | 729.752          | 0,15                         |
| 394.000  | Oversea-Chinese Banking Corp Ltd*                          | 4,60 %  | 15.06.2032            | 382.003          | 0,08                         |
| 400.000  | Oztel Holdings SPC Ltd*                                    | 6,63 %  | 24.04.2028            | 415.785          | 0,08                         |
| 600.000  | Periama Holdings LLC*                                      | 5,95 %  | 19.04.2026            | 579.243          | 0,12                         |
| 339.000  | Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara* | 4,38 %  | 05.02.2050            | 255.480          | 0,05                         |
| 510.000  | Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara* | 5,25 %  | 15.05.2047            | 448.186          | 0,09                         |
| 1.230.000  | Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara* | 6,15 %  | 21.05.2048            | 1.190.388        | 0,24                         |
| 300.000  | Petrobras Global Finance BV*                               | 5,50 %  | 10.06.2051            | 236.398          | 0,05                         |
| 429.000  | Petrobras Global Finance BV**                              | 6,50 %  | 03.07.2033            | 420.420          | 0,09                         |
| 7.391.600  | Petroleos de Venezuela SA*                                 | 5,38 %  | 12.04.2027            | 260.995          | 0,05                         |
| 1.580.000  | Petroleos de Venezuela SA*                                 | 5,50 %  | 12.04.2037            | 61.225           | 0,01                         |
| 13.366.824   | Petroleos de Venezuela SA*                                 | 6,00 %  | 16.05.2024            | 517.964          | 0,11                         |
| 12.004.188   | Petroleos de Venezuela SA**                                | 6,00 %  | 15.11.2026            | 417.146          | 0,08                         |
| 723.000  | Petroleos del Peru SA*                                     | 4,75 %  | 19.06.2032            | 547.668          | 0,11                         |
| 1.870.000  | Petroleos del Peru SA*                                     | 5,63 %  | 19.06.2047            | 1.207.894        | 0,25                         |
| 1.254.000  | Petroleos Mexicanos*                                       | 5,95 %  | 28.01.2031            | 917.051          | 0,19                         |
| 2.924.000  | Petroleos Mexicanos*                                       | 7,69 %  | 23.01.2050            | 1.984.355        | 0,40                         |
| 278.000  | Petroleos Mexicanos**                                      | 10,00 % | 07.02.2033            | 254.890          | 0,05                         |
| 300.000  | Petrorio Luxembourg Trading Sarl**                         | 6,13 %  | 09.06.2026            | 288.456          | 0,06                         |
| 500.000  | Power Finance Corp Ltd*                                    | 3,95 %  | 23.04.2030            | 445.120          | 0,09                         |
| 600.000  | Prosus NV*   | 3,83 %  | 08.02.2051            | 368.989          | 0,07                         |
| 550.000  | Prudential Funding Asia Plc*                               | 2,95 %  | 03.11.2033            | 465.029          | 0,09                         |
| 825.000  | QNB Finance Ltd*   | 2,63 %  | 12.05.2025            | 783.797          | 0,16                         |
| 300.000  | REC Ltd*   | 2,25 %  | 01.09.2026            | 268.020          | 0,05                         |
| 400.000  | Rede D'or Finance Sarl**                                   | 4,50 %  | 22.01.2030            | 341.300          | 0,07                         |

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung  | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 28,66 % (31. Dezember 2022: 31,88 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |        |                       |                  |                              |
| 475.000  | Reliance Industries Ltd*   | 2,88 % | 12.01.2032            | 396.425          | 0,08                         |
| 359.000  | Reliance Industries Ltd*   | 3,63 % | 12.01.2052            | 256.572          | 0,05                         |
| 500.000  | ReNew Wind Energy AP2/ReNew Power Pvt Ltd other 9 Subsidiaries** | 4,50 % | 14.07.2028            | 426.593          | 0,09                         |
| 580.000  | SA Global Sukuk Ltd*   | 2,69 % | 17.06.2031            | 500.387          | 0,10                         |
| 300.000  | SABIC Capital I BV*  | 2,15 % | 14.09.2030            | 252.585          | 0,05                         |
| 295.000  | Sagcor Financial Co Ltd**  | 5,30 % | 13.05.2028            | 278.864          | 0,06                         |
| 360.000  | Sands China Ltd**  | 4,30 % | 08.01.2026            | 338.757          | 0,07                         |
| 497.000  | Sands China Ltd*   | 5,63 % | 08.08.2025            | 485.192          | 0,10                         |
| 700.000  | Sands China Ltd*   | 5,90 % | 08.08.2028            | 667.905          | 0,14                         |
| 800.000  | Sasol Financing USA LLC*   | 6,50 % | 27.09.2028            | 716.091          | 0,15                         |
| 393.000  | Sasol Financing USA LLC*   | 8,75 % | 03.05.2029            | 383.256          | 0,08                         |
| 1.485.000  | Saudi Arabian Oil Co*  | 4,25 % | 16.04.2039            | 1.312.577        | 0,27                         |
| 1.095.000  | Saudi Arabian Oil Co*  | 4,38 % | 16.04.2049            | 937.457          | 0,19                         |
| 200.000  | Saudi Electricity Global Sukuk Co 4*                             | 4,72 % | 27.09.2028            | 202.105          | 0,04                         |
| 200.000  | Saudi Electricity Sukuk Programme Co*                            | 5,68 % | 11.04.2053            | 199.042          | 0,04                         |
| 700.000  | SEPLAT Energy Plc*   | 7,75 % | 01.04.2026            | 590.114          | 0,12                         |
| 513.000  | SF Holding Investment 2021 Ltd*                                  | 3,13 % | 17.11.2031            | 437.727          | 0,09                         |
| 300.000  | Shanghai Port Group BVI Development Co Ltd*                      | 2,85 % | 11.09.2029            | 266.454          | 0,05                         |
| 484.000  | Shelf Drilling Holdings Ltd**                                    | 8,25 % | 15.02.2025            | 452.359          | 0,09                         |
| 1.298.000  | Shinhan Bank Co Ltd*   | 4,38 % | 13.04.2032            | 1.183.769        | 0,24                         |
| 500.000  | SierraCol Energy Andina LLC**                                    | 6,00 % | 15.06.2028            | 368.138          | 0,07                         |
| 300.000  | Sino-Ocean Land Treasure IV Ltd*                                 | 4,75 % | 05.08.2029            | 61.234           | 0,01                         |
| 400.000  | Sitios Latinoamerica SAB de CV**                                 | 5,38 % | 04.04.2032            | 362.635          | 0,07                         |
| 293.000  | SK Hynix Inc*  | 6,38 % | 17.01.2028            | 294.260          | 0,06                         |
| 500.000  | SK Hynix Inc*  | 6,50 % | 17.01.2033            | 505.136          | 0,10                         |
| 200.000  | SNB Funding Ltd*   | 2,75 % | 02.10.2024            | 192.914          | 0,04                         |
| 400.000  | SNB Sukuk Ltd*   | 2,34 % | 19.01.2027            | 368.147          | 0,07                         |
| 600.000  | Southern Copper Corp*  | 6,75 % | 16.04.2040            | 661.923          | 0,13                         |
| 1.831.000  | Southern Gas Corridor CJSC*                                      | 6,88 % | 24.03.2026            | 1.863.409        | 0,38                         |
| 579.000  | Standard Chartered Plc*  | 6,30 % | 06.07.2034            | 579.970          | 0,12                         |
| 2.226.000  | State Oil Co of the Azerbaijan Republic*                         | 6,95 % | 18.03.2030            | 2.299.369        | 0,47                         |
| 800.000  | Stillwater Mining Co*  | 4,00 % | 16.11.2026            | 714.504          | 0,15                         |
| 300.000  | Studio City Finance Ltd*   | 6,00 % | 15.07.2025            | 278.845          | 0,06                         |
| 500.000  | Studio City Finance Ltd*   | 6,50 % | 15.01.2028            | 418.040          | 0,08                         |
| 400.000  | Sun Hung Kai Properties Capital Market Ltd*                      | 3,75 % | 25.02.2029            | 372.361          | 0,08                         |
| 604.000  | Suzano Austria GmbH**  | 7,00 % | 16.03.2047            | 609.398          | 0,12                         |
| 400.000  | Telecom Argentina SA**   | 8,00 % | 18.07.2026            | 362.410          | 0,07                         |
| 400.000  | Telecomunicaciones Digitales SA**                                | 4,50 % | 30.01.2030            | 340.527          | 0,07                         |
| 700.000  | Telefonica Celular del Paraguay SA**                             | 5,88 % | 15.04.2027            | 643.044          | 0,13                         |
| 400.000  | Tencent Holdings Ltd*  | 3,24 % | 03.06.2050            | 262.785          | 0,05                         |

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                            | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|---------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 28,66 % (31. Dezember 2022: 31,88 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                    |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |         |                       |                    |                              |
| 200.000  | Tencent Holdings Ltd**                           | 3,68 %  | 22.04.2041            | 154.997            | 0,03                         |
| 600.000  | Tengizchevroil Finance Co International Ltd**    | 3,25 %  | 15.08.2030            | 459.270            | 0,09                         |
| 600.000  | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV*  | 3,15 %  | 01.10.2026            | 538.383            | 0,11                         |
| 800.000  | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV*  | 4,10 %  | 01.10.2046            | 527.003            | 0,11                         |
| 200.000  | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV** | 8,13 %  | 15.09.2031            | 209.866            | 0,04                         |
| 834.000  | Thaioil Treasury Center Co Ltd*                  | 3,75 %  | 18.06.2050            | 558.290            | 0,11                         |
| 750.000  | TNB Global Ventures Capital Bhd*                 | 4,85 %  | 01.11.2028            | 737.803            | 0,15                         |
| 600.000  | Total Play Telecomunicaciones SA de CV*          | 6,38 %  | 20.09.2028            | 349.095            | 0,07                         |
| 200.000  | Transnet SOC Ltd*                                | 8,25 %  | 06.02.2028            | 194.750            | 0,04                         |
| 566.000  | Transportadora de Gas del Sur SA*                | 6,75 %  | 02.05.2025            | 536.607            | 0,11                         |
| 200.000  | Trust Fibra Uno**                                | 5,25 %  | 15.12.2024            | 195.630            | 0,04                         |
| 200.000  | TSMC Arizona Corp*                               | 2,50 %  | 25.10.2031            | 167.797            | 0,03                         |
| 600.000  | TSMC Arizona Corp*                               | 4,25 %  | 22.04.2032            | 582.046            | 0,12                         |
| 400.000  | Turk Telekomunikasyon AS*                        | 4,88 %  | 19.06.2024            | 382.040            | 0,08                         |
| 300.000  | Turk Telekomunikasyon AS*                        | 6,88 %  | 28.02.2025            | 285.345            | 0,06                         |
| 400.000  | Turkcell Iletisim Hizmetleri AS*                 | 5,80 %  | 11.04.2028            | 356.136            | 0,07                         |
| 400.000  | Turkiye Is Bankasi AS*                           | 6,13 %  | 25.04.2024            | 392.948            | 0,08                         |
| 300.000  | Turkiye Petrol Rafinerileri AS*                  | 4,50 %  | 18.10.2024            | 287.511            | 0,06                         |
| 400.000  | Turkiye Sise ve Cam Fabrikalari AS*              | 6,95 %  | 14.03.2026            | 390.000            | 0,08                         |
| 600.000  | Turkiye Vakiflar Bankasi TAO*                    | 5,50 %  | 01.10.2026            | 530.328            | 0,11                         |
| 200.000  | Unigel Luxembourg SA*                            | 8,75 %  | 01.10.2026            | 65.750             | 0,01                         |
| 955.000  | United Overseas Bank Ltd*                        | 2,00 %  | 14.10.2031            | 839.489            | 0,17                         |
| 428.000  | United Overseas Bank Ltd*                        | 3,86 %  | 07.10.2032            | 401.195            | 0,08                         |
| 228.000  | Vale Overseas Ltd*                               | 3,75 %  | 08.07.2030            | 200.913            | 0,04                         |
| 455.000  | Vale Overseas Ltd*                               | 6,13 %  | 12.06.2033            | 456.383            | 0,09                         |
| 350.000  | Vale Overseas Ltd*                               | 6,88 %  | 21.11.2036            | 366.313            | 0,07                         |
| 500.000  | Vedanta Resources Finance II Plc*                | 8,95 %  | 11.03.2025            | 378.015            | 0,08                         |
| 250.000  | Vedanta Resources Finance II Plc*                | 13,88 % | 21.01.2024            | 228.329            | 0,05                         |
| 100.000  | Vnesheconombank Via VEB Finance Plc*             | 6,80 %  | 22.11.2025            | 6.016              | 0,00                         |
| 1.337.000  | VTR Finance NV**                                 | 6,38 %  | 15.07.2028            | 514.703            | 0,10                         |
| 200.000  | Woori Bank*                                      | 4,88 %  | 26.01.2028            | 198.144            | 0,04                         |
| 1.200.000  | Wynn Macau Ltd*                                  | 5,63 %  | 26.08.2028            | 1.048.404          | 0,21                         |
| 200.000  | XP Inc**   | 3,25 %  | 01.07.2026            | 177.394            | 0,04                         |
| 350.000  | Yapi ve Kredi Bankasi AS*                        | 5,85 %  | 21.06.2024            | 341.691            | 0,07                         |
| 300.000  | YPF SA**   | 7,00 %  | 15.12.2047            | 204.276            | 0,04                         |
| 500.000  | YPF SA*  | 8,50 %  | 28.07.2025            | 460.347            | 0,10                         |
| 300.000  | YPF SA**   | 9,00 %  | 30.06.2029            | 273.673            | 0,06                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |  |         |                       | <b>129.792.619</b> | <b>26,38</b>                 |
| <b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>  |  |         |                       | <b>141.038.882</b> | <b>28,66</b>                 |

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                           | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|---------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 61,54 % (31. Dezember 2022: 61,28 %)</b> |   |         |                       |                   |                              |
| <b>Chilenischer Peso</b>                                   |   |         |                       |                   |                              |
| 1.100.765.740  | Bonos de la Tesoreria de la Republica*          | 1,90 %  | 01.09.2030            | 1.366.574         | 0,28                         |
| 320.000.000  | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos* | 4,70 %  | 01.09.2030            | 392.605           | 0,08                         |
| 420.000.000  | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos* | 5,00 %  | 01.03.2035            | 528.603           | 0,11                         |
| 5.000.000  | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos* | 5,10 %  | 15.07.2050            | 6.349             | 0,00                         |
| 865.000.000  | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos* | 6,00 %  | 01.04.2033            | 1.159.221         | 0,23                         |
| 335.000.000  | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos* | 7,00 %  | 01.05.2034            | 484.588           | 0,10                         |
| <b>Chilenischer Peso insgesamt</b>                         |   |         |                       | <b>3.937.940</b>  | <b>0,80</b>                  |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi</b>                          |   |         |                       |                   |                              |
| 16.000.000   | China Government Bond**                         | 1,99 %  | 09.04.2025            | 2.197.168         | 0,45                         |
| 7.000.000  | China Government Bond**                         | 2,62 %  | 25.09.2029            | 964.512           | 0,20                         |
| 2.000.000  | China Government Bond**                         | 2,64 %  | 15.01.2028            | 278.038           | 0,06                         |
| 8.600.000  | China Government Bond**                         | 2,75 %  | 15.06.2029            | 1.195.995         | 0,24                         |
| 3.000.000  | China Government Bond**                         | 2,80 %  | 24.03.2029            | 419.092           | 0,08                         |
| 7.000.000  | China Government Bond**                         | 2,80 %  | 25.03.2030            | 974.295           | 0,20                         |
| 3.900.000  | China Government Bond**                         | 2,80 %  | 15.11.2032            | 541.024           | 0,11                         |
| 2.400.000  | China Government Bond**                         | 2,88 %  | 25.02.2033            | 336.234           | 0,07                         |
| 8.000.000  | China Government Bond**                         | 2,91 %  | 14.10.2028            | 1.124.958         | 0,23                         |
| 5.000.000  | China Government Bond**                         | 2,94 %  | 17.10.2024            | 697.001           | 0,14                         |
| 3.000.000  | China Government Bond**                         | 3,01 %  | 13.05.2028            | 424.286           | 0,09                         |
| 12.800.000   | China Government Bond**                         | 3,02 %  | 22.10.2025            | 1.795.467         | 0,36                         |
| 3.000.000  | China Government Bond**                         | 3,02 %  | 27.05.2031            | 424.045           | 0,09                         |
| 1.200.000  | China Government Bond**                         | 3,12 %  | 25.10.2052            | 168.242           | 0,03                         |
| 6.000.000  | China Government Bond**                         | 3,13 %  | 21.11.2029            | 855.139           | 0,17                         |
| 950.000  | China Government Bond**                         | 3,19 %  | 15.04.2053            | 135.955           | 0,03                         |
| 5.000.000  | China Government Bond**                         | 3,27 %  | 19.11.2030            | 722.929           | 0,15                         |
| 3.650.000  | China Government Bond**                         | 3,72 %  | 12.04.2051            | 563.718           | 0,11                         |
| 6.400.000  | China Government Bond**                         | 3,81 %  | 14.09.2050            | 1.001.544         | 0,20                         |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt</b>                |   |         |                       | <b>14.819.642</b> | <b>3,01</b>                  |
| <b>Kolumbianischer Peso</b>                                |   |         |                       |                   |                              |
| 19.214.400.000   | Colombian TES*                                  | 5,75 %  | 03.11.2027            | 3.963.988         | 0,81                         |
| 32.804.500.000   | Colombian TES*                                  | 6,00 %  | 28.04.2028            | 6.739.268         | 1,37                         |
| 7.416.400.000  | Colombian TES*                                  | 7,00 %  | 26.03.2031            | 1.498.711         | 0,30                         |
| 5.785.500.000  | Colombian TES*                                  | 7,00 %  | 30.06.2032            | 1.137.000         | 0,23                         |
| 3.417.700.000  | Colombian TES*                                  | 7,25 %  | 18.10.2034            | 660.918           | 0,13                         |
| 5.092.800.000  | Colombian TES*                                  | 9,25 %  | 28.05.2042            | 1.092.614         | 0,22                         |
| 17.690.100.000   | Colombian TES*                                  | 13,25 % | 09.02.2033            | 4.973.881         | 1,01                         |
| 2.356.900.000  | Colombian TES Series G*                         | 7,00 %  | 26.03.2031            | 476.284           | 0,10                         |

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                             | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 61,54 % (31. Dezember 2022: 61,28 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                   |                              |
| <b>Kolumbianischer Peso (Fortsetzung)</b>                                |   |        |                       |                   |                              |
| 171.000.000  | Financiera de Desarrollo Territorial SA Findeter* | 7,88 % | 12.08.2024            | 38.398            | 0,01                         |
| <b>Kolumbianischer Peso insgesamt</b>                                    |   |        |                       | <b>20.581.062</b> | <b>4,18</b>                  |
| <b>Tschechische Krone</b>  |   |        |                       |                   |                              |
| 42.650.000   | Czech Republic Government Bond*                   | 0,05 % | 29.11.2029            | 1.486.799         | 0,30                         |
| 16.760.000   | Czech Republic Government Bond*                   | 0,25 % | 10.02.2027            | 653.746           | 0,13                         |
| 75.850.000   | Czech Republic Government Bond*                   | 1,00 % | 26.06.2026            | 3.097.241         | 0,63                         |
| 71.790.000   | Czech Republic Government Bond*                   | 1,20 % | 13.03.2031            | 2.624.637         | 0,53                         |
| 30.900.000   | Czech Republic Government Bond*                   | 2,00 % | 13.10.2033            | 1.150.234         | 0,23                         |
| 23.780.000   | Czech Republic Government Bond*                   | 2,50 % | 25.08.2028            | 990.503           | 0,20                         |
| 43.050.000   | Czech Republic Government Bond*                   | 2,75 % | 23.07.2029            | 1.797.775         | 0,37                         |
| 16.820.000   | Czech Republic Government Bond*                   | 4,20 % | 04.12.2036            | 760.737           | 0,16                         |
| <b>Tschechische Krone insgesamt</b>                                      |   |        |                       | <b>12.561.672</b> | <b>2,55</b>                  |
| <b>Peso Dominikanische Republik</b>                                      |   |        |                       |                   |                              |
| 36.550.000   | Dominican Republic International Bond*            | 9,75 % | 05.06.2026            | 677.392           | 0,14                         |
| <b>Peso Dominikanische Republik insgesamt</b>                            |   |        |                       | <b>677.392</b>    | <b>0,14</b>                  |
| <b>Euro</b>  |   |        |                       |                   |                              |
| 456.000  | Bank Gospodarstwa Krajowego*                      | 5,13 % | 22.02.2033            | 516.917           | 0,11                         |
| 166.000  | Benin Government International Bond*              | 4,88 % | 19.01.2032            | 137.977           | 0,03                         |
| 413.000  | Benin Government International Bond*              | 4,95 % | 22.01.2035            | 319.621           | 0,06                         |
| 136.000  | Benin Government International Bond*              | 6,88 % | 19.01.2052            | 105.375           | 0,02                         |
| 300.000  | Chile Government International Bond*              | 1,88 % | 27.05.2030            | 287.974           | 0,06                         |
| 1.740.000  | Egypt Government International Bond*              | 6,38 % | 11.04.2031            | 1.059.391         | 0,22                         |
| 300.000  | Indonesia Government International Bond*          | 1,10 % | 12.03.2033            | 243.201           | 0,05                         |
| 468.000  | Indonesia Government International Bond*          | 1,30 % | 23.03.2034            | 377.355           | 0,08                         |
| 922.000  | Indonesia Government International Bond*          | 1,40 % | 30.10.2031            | 796.861           | 0,16                         |
| 590.000  | Indonesia Government International Bond*          | 3,75 % | 14.06.2028            | 639.682           | 0,13                         |
| 2.293.000  | Ivory Coast Government International Bond*        | 6,63 % | 22.03.2048            | 1.780.542         | 0,36                         |
| 1.920.000  | Ivory Coast Government International Bond*        | 6,88 % | 17.10.2040            | 1.596.091         | 0,32                         |
| 750.000  | Kazakhstan Government International Bond*         | 1,50 % | 30.09.2034            | 589.993           | 0,12                         |
| 250.000  | Mexico Government International Bond*             | 2,38 % | 11.02.2030            | 242.460           | 0,05                         |
| 1.795.000  | Peruvian Government International Bond*           | 1,25 % | 11.03.2033            | 1.479.355         | 0,30                         |
| 835.000  | Peruvian Government International Bond*           | 1,95 % | 17.11.2036            | 661.304           | 0,13                         |
| 400.000  | Philippine Government International Bond*         | 1,75 % | 28.04.2041            | 285.338           | 0,06                         |
| 987.877  | Provincia de Buenos Aires*                        | 4,00 % | 01.09.2037            | 367.316           | 0,07                         |
| 615.000  | Republic of Cameroon International Bond*          | 5,95 % | 07.07.2032            | 484.507           | 0,10                         |
| 404.000  | Republic of Poland Government International Bond* | 4,25 % | 14.02.2043            | 434.250           | 0,09                         |
| 750.000  | Romanian Government International Bond*           | 2,00 % | 28.01.2032            | 602.694           | 0,12                         |

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|---------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 61,54 % (31. Dezember 2022: 61,28 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                   |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |   |         |                       |                   |                              |
| 238.000  | Romanian Government International Bond* | 2,00 %  | 14.04.2033            | 184.014           | 0,04                         |
| 186.000  | Romanian Government International Bond* | 2,63 %  | 02.12.2040            | 123.950           | 0,03                         |
| 322.000  | Romanian Government International Bond* | 2,88 %  | 13.04.2042            | 216.735           | 0,04                         |
| 2.266.000  | Romanian Government International Bond* | 3,38 %  | 28.01.2050            | 1.554.033         | 0,32                         |
| 1.156.000  | Romanian Government International Bond* | 3,75 %  | 07.02.2034            | 1.022.849         | 0,21                         |
| 100.000  | Romanian Government International Bond* | 4,63 %  | 03.04.2049            | 84.535            | 0,02                         |
| 1.007.000  | Serbia International Bond*              | 1,50 %  | 26.06.2029            | 851.899           | 0,17                         |
| 566.000  | Serbia International Bond*              | 1,65 %  | 03.03.2033            | 412.693           | 0,08                         |
| 1.072.000  | Serbia International Bond*              | 2,05 %  | 23.09.2036            | 720.306           | 0,15                         |
| 412.000  | Serbia International Bond*              | 3,13 %  | 15.05.2027            | 404.839           | 0,08                         |
| 488.000  | Tunisian Republic*                      | 5,63 %  | 17.02.2024            | 442.585           | 0,09                         |
| 417.000  | Tunisian Republic*                      | 6,38 %  | 15.07.2026            | 265.685           | 0,05                         |
| <b>Euro insgesamt</b>  |   |         |                       | <b>19.292.327</b> | <b>3,92</b>                  |
| <b>Ghanaischer Cedi</b>  |   |         |                       |                   |                              |
| 9.799.000  | Republic of Ghana Government Bonds*     | 19,25 % | 18.12.2023            | 790.815           | 0,16                         |
| <b>Ghanaischer Cedi insgesamt</b>  |   |         |                       | <b>790.815</b>    | <b>0,16</b>                  |
| <b>Ungarischer Forint</b>  |   |         |                       |                   |                              |
| 187.490.000  | Hungary Government Bond*                | 2,00 %  | 23.05.2029            | 416.561           | 0,08                         |
| 456.280.000  | Hungary Government Bond*                | 2,25 %  | 20.04.2033            | 916.996           | 0,19                         |
| 400.730.000  | Hungary Government Bond*                | 3,00 %  | 27.10.2027            | 976.484           | 0,20                         |
| 138.490.000  | Hungary Government Bond*                | 3,00 %  | 21.08.2030            | 314.917           | 0,06                         |
| 502.570.000  | Hungary Government Bond*                | 3,25 %  | 22.10.2031            | 1.145.455         | 0,23                         |
| 297.370.000  | Hungary Government Bond*                | 4,50 %  | 23.03.2028            | 763.825           | 0,16                         |
| 266.770.000  | Hungary Government Bond*                | 4,75 %  | 24.11.2032            | 665.814           | 0,14                         |
| 453.630.000  | Hungary Government Bond*                | 5,50 %  | 24.06.2025            | 1.229.668         | 0,25                         |
| 93.980.000   | Hungary Government Bond*                | 6,75 %  | 22.10.2028            | 264.937           | 0,05                         |
| <b>Ungarischer Forint insgesamt</b>                                      |   |         |                       | <b>6.694.657</b>  | <b>1,36</b>                  |
| <b>Indonesische Rupiah</b>   |   |         |                       |                   |                              |
| 8.000.000.000  | Indonesia Treasury Bond*                | 6,25 %  | 15.06.2036            | 529.507           | 0,11                         |
| 39.982.000.000   | Indonesia Treasury Bond*                | 6,38 %  | 15.08.2028            | 2.723.580         | 0,55                         |
| 2.100.000.000  | Indonesia Treasury Bond*                | 6,38 %  | 15.04.2032            | 140.876           | 0,03                         |
| 1.800.000.000  | Indonesia Treasury Bond*                | 6,38 %  | 15.07.2037            | 119.185           | 0,02                         |
| 37.883.000.000   | Indonesia Treasury Bond*                | 6,63 %  | 15.05.2033            | 2.574.691         | 0,52                         |
| 12.300.000.000   | Indonesia Treasury Bond*                | 7,00 %  | 15.05.2027            | 850.477           | 0,17                         |
| 89.418.000.000   | Indonesia Treasury Bond*                | 7,00 %  | 15.02.2033            | 6.284.699         | 1,28                         |
| 26.900.000.000   | Indonesia Treasury Bond*                | 7,13 %  | 15.06.2038            | 1.905.057         | 0,39                         |
| 16.350.000.000   | Indonesia Treasury Bond*                | 7,13 %  | 15.06.2042            | 1.143.247         | 0,23                         |



## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                  | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 61,54 % (31. Dezember 2022: 61,28 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                   |                              |
| <b>Indonesische Rupie (Fortsetzung)</b>                                  |  |        |                       |                   |                              |
| 11.650.000.000   | Indonesia Treasury Bond*               | 7,13 % | 15.06.2043            | 824.263           | 0,17                         |
| 16.000.000.000   | Indonesia Treasury Bond*               | 7,50 % | 15.08.2032            | 1.154.740         | 0,24                         |
| 420.000.000  | Indonesia Treasury Bond*               | 7,50 % | 15.06.2035            | 30.377            | 0,01                         |
| 13.390.000.000   | Indonesia Treasury Bond*               | 7,50 % | 15.04.2040            | 968.364           | 0,20                         |
| 3.824.000.000  | Indonesia Treasury Bond*               | 8,25 % | 15.05.2029            | 281.499           | 0,06                         |
| 23.241.000.000   | Indonesia Treasury Bond*               | 8,25 % | 15.05.2036            | 1.786.934         | 0,36                         |
| 38.000.000.000   | Indonesia Treasury Bond*               | 8,38 % | 15.09.2026            | 2.718.047         | 0,55                         |
| 917.000.000  | Indonesia Treasury Bond*               | 8,38 % | 15.03.2034            | 70.465            | 0,01                         |
| 17.761.000.000   | Indonesia Treasury Bond*               | 8,75 % | 15.05.2031            | 1.362.824         | 0,28                         |
| <b>Indonesische Rupiah insgesamt</b>                                     |  |        |                       | <b>25.468.832</b> | <b>5,18</b>                  |
| <b>Malaysischer Ringgit</b>  |  |        |                       |                   |                              |
| 5.700.000  | Malaysia Government Bond**             | 2,63 % | 15.04.2031            | 1.120.689         | 0,23                         |
| 4.650.000  | Malaysia Government Bond**             | 3,58 % | 15.07.2032            | 976.416           | 0,20                         |
| 7.600.000  | Malaysia Government Bond**             | 3,73 % | 15.06.2028            | 1.636.327         | 0,33                         |
| 3.600.000  | Malaysia Government Bond**             | 3,76 % | 22.05.2040            | 734.281           | 0,15                         |
| 4.780.000  | Malaysia Government Bond**             | 3,83 % | 05.07.2034            | 1.006.606         | 0,20                         |
| 10.500.000   | Malaysia Government Bond**             | 3,90 % | 16.11.2027            | 2.273.514         | 0,46                         |
| 3.300.000  | Malaysia Government Bond**             | 3,90 % | 30.11.2026            | 715.077           | 0,15                         |
| 1.800.000  | Malaysia Government Bond**             | 3,91 % | 15.07.2026            | 390.377           | 0,08                         |
| 6.925.000  | Malaysia Government Bond**             | 4,06 % | 30.09.2024            | 1.493.688         | 0,30                         |
| 6.565.000  | Malaysia Government Bond**             | 4,07 % | 15.06.2050            | 1.372.082         | 0,28                         |
| 2.910.000  | Malaysia Government Bond**             | 4,25 % | 31.05.2035            | 633.506           | 0,13                         |
| 3.500.000  | Malaysia Government Bond**             | 4,50 % | 15.04.2030            | 784.759           | 0,16                         |
| 2.300.000  | Malaysia Government Bond**             | 4,50 % | 30.04.2029            | 512.081           | 0,10                         |
| 3.530.000  | Malaysia Government Bond**             | 4,64 % | 07.11.2033            | 803.720           | 0,16                         |
| 7.066.000  | Malaysia Government Bond**             | 4,70 % | 15.10.2042            | 1.631.133         | 0,33                         |
| 2.800.000  | Malaysia Government Bond**             | 4,76 % | 07.04.2037            | 640.674           | 0,13                         |
| 7.490.000  | Malaysia Government Bond**             | 4,89 % | 08.06.2038            | 1.760.804         | 0,36                         |
| 2.400.000  | Malaysia Government Bond**             | 4,94 % | 30.09.2043            | 569.488           | 0,12                         |
| 10.000.000   | Malaysia Government Investment Issue** | 4,07 % | 30.09.2026            | 2.178.798         | 0,44                         |
| 5.000.000  | Malaysia Government Investment Issue** | 4,37 % | 31.10.2028            | 1.106.697         | 0,23                         |
| <b>Malaysischer Ringgit insgesamt</b>                                    |  |        |                       | <b>22.340.717</b> | <b>4,54</b>                  |
| <b>Mexikanischer Peso</b>  |  |        |                       |                   |                              |
| 69.240.000   | Mexican Bonos*                         | 7,50 % | 26.05.2033            | 3.750.099         | 0,76                         |
| 106.754.600  | Mexican Bonos*                         | 7,75 % | 29.05.2031            | 5.890.877         | 1,20                         |
| 46.150.000   | Mexican Bonos*                         | 7,75 % | 13.11.2042            | 2.415.458         | 0,49                         |
| 4.130.800  | Mexican Bonos*                         | 8,00 % | 07.11.2047            | 220.239           | 0,04                         |
| 95.806.300   | Mexican Bonos*                         | 8,50 % | 31.05.2029            | 5.536.326         | 1,12                         |

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                    | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 61,54 % (31. Dezember 2022: 61,28 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                   |                              |
| <b>Mexikanischer Peso (Fortsetzung)</b>                                  |  |        |                       |                   |                              |
| 72.292.000   | Mexican Bonos*                           | 8,50 % | 18.11.2038            | 4.109.691         | 0,84                         |
| <b>Mexikanischer Peso insgesamt</b>                                      |  |        |                       | <b>21.922.690</b> | <b>4,45</b>                  |
| <b>Peruanischer Sol</b>  |  |        |                       |                   |                              |
| 12.864.000   | Fondo MIVIVIENDA SA*                     | 7,00 % | 14.02.2024            | 3.496.007         | 0,71                         |
| 2.110.000  | Peru Government Bond*                    | 5,35 % | 12.08.2040            | 484.853           | 0,10                         |
| 2.604.000  | Peru Government Bond*                    | 5,40 % | 12.08.2034            | 634.662           | 0,13                         |
| 8.967.000  | Peru Government Bond*                    | 6,15 % | 12.08.2032            | 2.364.127         | 0,48                         |
| 3.885.000  | Peru Government Bond*                    | 7,30 % | 12.08.2033            | 1.103.041         | 0,22                         |
| 2.542.000  | Peruvian Government International Bond** | 5,20 % | 12.09.2023            | 699.202           | 0,14                         |
| 3.153.000  | Peruvian Government International Bond*  | 5,40 % | 12.08.2034            | 768.467           | 0,16                         |
| 3.429.000  | Peruvian Government International Bond** | 6,90 % | 12.08.2037            | 932.921           | 0,19                         |
| 60.000   | Peruvian Government International Bond** | 8,20 % | 12.08.2026            | 17.574            | 0,00                         |
| <b>Peruanischer Sol insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>10.500.854</b> | <b>2,13</b>                  |
| <b>Polnischer Zloty</b>  |  |        |                       |                   |                              |
| 7.316.000  | Republic of Poland Government Bond*      | 0,25 % | 25.10.2026            | 1.512.232         | 0,31                         |
| 11.699.000   | Republic of Poland Government Bond**     | 1,25 % | 25.10.2030            | 2.147.886         | 0,44                         |
| 9.761.000  | Republic of Poland Government Bond*      | 1,75 % | 25.04.2032            | 1.754.383         | 0,36                         |
| 22.351.000   | Republic of Poland Government Bond*      | 2,50 % | 25.07.2026            | 5.020.798         | 1,02                         |
| 4.556.000  | Republic of Poland Government Bond**     | 2,75 % | 25.04.2028            | 987.426           | 0,20                         |
| 5.193.000  | Republic of Poland Government Bond*      | 2,75 % | 25.10.2029            | 1.090.352         | 0,22                         |
| 9.216.000  | Republic of Poland Government Bond*      | 3,75 % | 25.05.2027            | 2.128.167         | 0,43                         |
| 5.192.000  | Republic of Poland Government Bond*      | 6,00 % | 25.10.2033            | 1.305.300         | 0,26                         |
| 9.201.000  | Republic of Poland Government Bond*      | 7,50 % | 25.07.2028            | 2.446.241         | 0,50                         |
| <b>Polnischer Zloty insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>18.392.785</b> | <b>3,74</b>                  |
| <b>Rumänischer neuer Leu</b>   |  |        |                       |                   |                              |
| 12.060.000   | Romania Government Bond*                 | 2,50 % | 25.10.2027            | 2.254.413         | 0,46                         |
| 4.880.000  | Romania Government Bond*                 | 3,65 % | 24.09.2031            | 876.255           | 0,18                         |
| 5.250.000  | Romania Government Bond*                 | 4,75 % | 11.10.2034            | 974.749           | 0,20                         |
| 7.770.000  | Romania Government Bond**                | 4,85 % | 25.07.2029            | 1.555.077         | 0,32                         |
| 1.190.000  | Romania Government Bond*                 | 5,00 % | 12.02.2029            | 241.661           | 0,05                         |
| 330.000  | Romania Government Bond*                 | 6,70 % | 25.02.2032            | 72.550            | 0,01                         |
| 630.000  | Romania Government Bond*                 | 7,35 % | 28.04.2031            | 143.417           | 0,03                         |
| 1.310.000  | Romania Government Bond*                 | 7,90 % | 24.02.2038            | 315.863           | 0,06                         |
| <b>Rumänischer neuer Leu insgesamt</b>                                   |  |        |                       | <b>6.433.985</b>  | <b>1,31</b>                  |

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                     | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|---------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 61,54 % (31. Dezember 2022: 61,28 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                   |                              |
| <b>Serbischer Dinar</b>  |   |         |                       |                   |                              |
| 15.020.000   | Serbia Treasury Bonds*                    | 4,50 %  | 11.01.2026            | 138.324           | 0,03                         |
| 15.760.000   | Serbia Treasury Bonds*                    | 4,50 %  | 20.08.2032            | 130.664           | 0,03                         |
| 46.430.000   | Serbia Treasury Bonds*                    | 5,88 %  | 08.02.2028            | 445.948           | 0,09                         |
| <b>Serbischer Dinar insgesamt</b>  |   |         |                       | <b>714.936</b>    | <b>0,15</b>                  |
| <b>Südafrikanischer Rand</b>   |   |         |                       |                   |                              |
| 116.110.762  | Republic of South Africa Government Bond* | 7,00 %  | 28.02.2031            | 4.921.935         | 1,00                         |
| 231.085.346  | Republic of South Africa Government Bond* | 8,50 %  | 31.01.2037            | 9.357.175         | 1,90                         |
| 26.424.417   | Republic of South Africa Government Bond* | 8,75 %  | 31.01.2044            | 1.027.708         | 0,21                         |
| 165.761.363  | Republic of South Africa Government Bond* | 8,88 %  | 28.02.2035            | 7.193.339         | 1,46                         |
| 27.668.185   | Republic of South Africa Government Bond* | 9,00 %  | 31.01.2040            | 1.127.012         | 0,23                         |
| 76.539.832   | Republic of South Africa Government Bond* | 10,50 % | 21.12.2026            | 4.212.552         | 0,86                         |
| <b>Südafrikanischer Rand insgesamt</b>                                   |   |         |                       | <b>27.839.721</b> | <b>5,66</b>                  |
| <b>Thailändischer Baht</b>   |   |         |                       |                   |                              |
| 22.000.000   | Thailand Government Bond**                | 1,00 %  | 17.06.2027            | 591.124           | 0,12                         |
| 150.162.000  | Thailand Government Bond**                | 1,45 %  | 17.12.2024            | 4.194.438         | 0,85                         |
| 3.425.000  | Thailand Government Bond*                 | 1,59 %  | 17.12.2035            | 85.050            | 0,02                         |
| 10.000.000   | Thailand Government Bond**                | 1,60 %  | 17.06.2035            | 250.678           | 0,05                         |
| 74.400.000   | Thailand Government Bond**                | 2,00 %  | 17.12.2031            | 2.030.203         | 0,41                         |
| 33.500.000   | Thailand Government Bond**                | 2,00 %  | 17.06.2042            | 812.237           | 0,17                         |
| 72.000.000   | Thailand Government Bond**                | 2,65 %  | 17.06.2028            | 2.062.951         | 0,42                         |
| 8.831.000  | Thailand Government Bond**                | 2,88 %  | 17.06.2046            | 236.010           | 0,05                         |
| 53.284.000   | Thailand Government Bond**                | 3,30 %  | 17.06.2038            | 1.583.207         | 0,32                         |
| 18.000.000   | Thailand Government Bond**                | 3,35 %  | 17.06.2033            | 542.512           | 0,11                         |
| 15.000.000   | Thailand Government Bond**                | 3,39 %  | 17.06.2037            | 449.875           | 0,09                         |
| 55.278.000   | Thailand Government Bond**                | 3,40 %  | 17.06.2036            | 1.660.317         | 0,34                         |
| 29.200.000   | Thailand Government Bond**                | 3,45 %  | 17.06.2043            | 870.304           | 0,18                         |
| 125.000  | Thailand Government Bond**                | 3,65 %  | 20.06.2031            | 3.832             | 0,00                         |
| 43.380.000   | Thailand Government Bond**                | 3,78 %  | 25.06.2032            | 1.351.179         | 0,27                         |
| 67.595.000   | Thailand Government Bond**                | 4,88 %  | 22.06.2029            | 2.167.217         | 0,44                         |
| <b>Thailändischer Baht insgesamt</b>                                     |   |         |                       | <b>18.891.134</b> | <b>3,84</b>                  |
| <b>Türkische Lira</b>  |   |         |                       |                   |                              |
| 48.619.029   | Turkey Government Bond*                   | 1,50 %  | 18.06.2025            | 2.374.071         | 0,48                         |
| <b>Türkische Lira insgesamt</b>  |   |         |                       | <b>2.374.071</b>  | <b>0,48</b>                  |
| <b>Uganda-Schilling</b>  |   |         |                       |                   |                              |
| 4.469.700.000  | Republic of Uganda Government Bonds*      | 14,25 % | 22.06.2034            | 1.184.007         | 0,24                         |
| <b>Uganda-Schilling insgesamt</b>  |   |         |                       | <b>1.184.007</b>  | <b>0,24</b>                  |

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                             | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 61,54 % (31. Dezember 2022: 61,28 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 1.231.000  | Angolan Government International Bond*            | 8,75 % | 14.04.2032            | 1.037.825        | 0,21                         |
| 310.000  | Angolan Government International Bond*            | 9,13 % | 26.11.2049            | 239.862          | 0,05                         |
| 2.302.000  | Angolan Government International Bond*            | 9,38 % | 08.05.2048            | 1.827.581        | 0,37                         |
| 2.720.488  | Argentine Republic Government International Bond* | 0,50 % | 09.07.2030            | 910.183          | 0,18                         |
| 7.100.000  | Argentine Republic Government International Bond* | 1,50 % | 09.07.2035            | 2.135.729        | 0,43                         |
| 690.000  | Bahamas Government International Bond*            | 6,00 % | 21.11.2028            | 557.175          | 0,11                         |
| 240.000  | Bank Gospodarstwa Krajowego*                      | 5,38 % | 22.05.2033            | 238.873          | 0,05                         |
| 849.000  | Bermuda Government International Bond*            | 5,00 % | 15.07.2032            | 829.898          | 0,17                         |
| 1.056.000  | Brazilian Government International Bond*          | 5,00 % | 27.01.2045            | 825.719          | 0,17                         |
| 290.000  | Brazilian Government International Bond*          | 5,63 % | 07.01.2041            | 257.278          | 0,05                         |
| 200.000  | Brazilian Government International Bond*          | 5,63 % | 21.02.2047            | 168.884          | 0,03                         |
| 665.000  | Brazilian Government International Bond*          | 6,00 % | 20.10.2033            | 658.620          | 0,13                         |
| 417.000  | Chile Government International Bond*              | 3,25 % | 21.09.2071            | 271.574          | 0,06                         |
| 292.000  | Chile Government International Bond**             | 4,95 % | 05.01.2036            | 288.599          | 0,06                         |
| 250.000  | Colombia Government International Bond*           | 3,00 % | 30.01.2030            | 194.946          | 0,04                         |
| 1.150.000  | Colombia Government International Bond*           | 5,00 % | 15.06.2045            | 803.470          | 0,16                         |
| 2.403.000  | Colombia Government International Bond*           | 5,20 % | 15.05.2049            | 1.656.868        | 0,34                         |
| 635.000  | Colombia Government International Bond*           | 6,13 % | 18.01.2041            | 518.934          | 0,11                         |
| 1.010.000  | Colombia Government International Bond*           | 7,50 % | 02.02.2034            | 990.228          | 0,20                         |
| 425.000  | Colombia Government International Bond*           | 8,00 % | 20.04.2033            | 432.269          | 0,09                         |
| 561.000  | Corp Financiera de Desarrollo SA*                 | 5,25 % | 15.07.2029            | 545.342          | 0,11                         |
| 285.000  | Costa Rica Government International Bond*         | 6,55 % | 03.04.2034            | 286.568          | 0,06                         |
| 162.000  | Costa Rica Government International Bond*         | 7,16 % | 12.03.2045            | 160.842          | 0,03                         |
| 1.145.000  | Development Bank of Mongolia LLC*                 | 7,25 % | 23.10.2023            | 1.140.706        | 0,23                         |
| 2.174.000  | Dominican Republic International Bond*            | 5,88 % | 30.01.2060            | 1.690.155        | 0,34                         |
| 1.771.000  | Dominican Republic International Bond*            | 6,00 % | 22.02.2033            | 1.637.615        | 0,33                         |
| 314.000  | Dominican Republic International Bond*            | 6,40 % | 05.06.2049            | 268.320          | 0,05                         |
| 219.000  | Dominican Republic International Bond*            | 6,50 % | 15.02.2048            | 189.781          | 0,04                         |
| 387.000  | Dominican Republic International Bond*            | 6,85 % | 27.01.2045            | 352.249          | 0,07                         |
| 325.000  | Dominican Republic International Bond*            | 7,05 % | 03.02.2031            | 324.508          | 0,07                         |
| 576.446  | Ecuador Government International Bond*            | 1,50 % | 31.07.2040            | 180.716          | 0,04                         |
| 4.105.917  | Ecuador Government International Bond*            | 2,50 % | 31.07.2035            | 1.435.137        | 0,29                         |
| 614.179  | Ecuador Government International Bond*            | 5,50 % | 31.07.2030            | 298.386          | 0,06                         |
| 240.000  | Egypt Government International Bond*              | 8,15 % | 20.11.2059            | 125.167          | 0,03                         |
| 2.150.000  | Egypt Government International Bond*              | 8,70 % | 01.03.2049            | 1.164.786        | 0,24                         |
| 1.080.000  | Egypt Government International Bond*              | 8,88 % | 29.05.2050            | 585.004          | 0,12                         |
| 1.019.000  | El Salvador Government International Bond*        | 7,12 % | 20.01.2050            | 569.602          | 0,12                         |
| 3.513.000  | El Salvador Government International Bond*        | 9,50 % | 15.07.2052            | 2.227.290        | 0,45                         |
| 210.000  | Ghana Government International Bond*              | 7,88 % | 26.03.2027            | 93.383           | 0,02                         |
| 494.000  | Ghana Government International Bond*              | 8,63 % | 07.04.2034            | 212.790          | 0,04                         |

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                             | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 61,54 % (31. Dezember 2022: 61,28 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 311.000  | Ghana Government International Bond*              | 8,95 %  | 26.03.2051            | 130.278          | 0,03                         |
| 3.369.000  | Ghana Government International Bond*              | 10,75 % | 14.10.2030            | 2.275.635        | 0,46                         |
| 733.000  | Guatemala Government Bond*                        | 3,70 %  | 07.10.2033            | 593.276          | 0,12                         |
| 200.000  | Guatemala Government Bond*                        | 6,13 %  | 01.06.2050            | 184.235          | 0,04                         |
| 615.000  | Guatemala Government Bond*                        | 6,60 %  | 13.06.2036            | 619.563          | 0,13                         |
| 551.000  | Honduras Government International Bond*           | 5,63 %  | 24.06.2030            | 447.105          | 0,09                         |
| 351.000  | Honduras Government International Bond*           | 6,25 %  | 19.01.2027            | 320.409          | 0,07                         |
| 140.000  | Hungary Government International Bond*            | 7,63 %  | 29.03.2041            | 158.190          | 0,03                         |
| 790.000  | Indonesia Government International Bond*          | 8,50 %  | 12.10.2035            | 1.028.736        | 0,21                         |
| 193.125  | Iraq International Bond*                          | 5,80 %  | 15.01.2028            | 177.842          | 0,04                         |
| 200.000  | Jordan Government International Bond*             | 7,50 %  | 13.01.2029            | 201.598          | 0,04                         |
| 1.235.000  | Lebanon Government International Bond*            | 6,38 %  | 09.03.2020            | 84.607           | 0,02                         |
| 3.089.000  | Lebanon Government International Bond*            | 6,60 %  | 27.11.2026            | 209.558          | 0,04                         |
| 878.000  | Lebanon Government International Bond*            | 6,65 %  | 26.02.2030            | 59.265           | 0,01                         |
| 965.000  | Lebanon Government International Bond*            | 6,85 %  | 25.05.2029            | 64.385           | 0,01                         |
| 7.131.000  | Lebanon Government International Bond*            | 8,25 %  | 17.05.2034            | 480.344          | 0,10                         |
| 2.820.000  | Mexico Government International Bond*             | 5,75 %  | 12.10.2110            | 2.523.670        | 0,51                         |
| 201.000  | Mongolia Government International Bond*           | 3,50 %  | 07.07.2027            | 168.100          | 0,03                         |
| 400.000  | Mongolia Government International Bond*           | 5,13 %  | 07.04.2026            | 372.991          | 0,08                         |
| 943.000  | Mongolia Government International Bond*           | 8,65 %  | 19.01.2028            | 951.251          | 0,19                         |
| 375.000  | Mongolia Government International Bond*           | 8,75 %  | 09.03.2024            | 378.000          | 0,08                         |
| 260.000  | Morocco Government International Bond*            | 5,50 %  | 11.12.2042            | 224.472          | 0,05                         |
| 400.000  | Morocco Government International Bond*            | 6,50 %  | 08.09.2033            | 413.000          | 0,08                         |
| 627.000  | Nigeria Government International Bond*            | 7,88 %  | 16.02.2032            | 527.400          | 0,11                         |
| 477.000  | Nigeria Government International Bond*            | 8,25 %  | 28.09.2051            | 357.383          | 0,07                         |
| 806.000  | Nigeria Government International Bond*            | 8,75 %  | 21.01.2031            | 723.893          | 0,15                         |
| 1.930.000  | Oman Government International Bond*               | 6,75 %  | 17.01.2048            | 1.858.575        | 0,38                         |
| 380.000  | Panama Government International Bond*             | 4,50 %  | 19.01.2063            | 278.966          | 0,06                         |
| 730.000  | Panama Government International Bond*             | 6,40 %  | 14.02.2035            | 763.090          | 0,15                         |
| 245.000  | Panama Government International Bond*             | 6,70 %  | 26.01.2036            | 262.948          | 0,05                         |
| 200.000  | Panama Government International Bond*             | 6,85 %  | 28.03.2054            | 208.549          | 0,04                         |
| 485.000  | Papua New Guinea Government International Bond*   | 8,38 %  | 04.10.2028            | 454.465          | 0,09                         |
| 988.000  | Paraguay Government International Bond*           | 5,40 %  | 30.03.2050            | 846.237          | 0,17                         |
| 663.000  | Paraguay Government International Bond*           | 5,60 %  | 13.03.2048            | 583.170          | 0,12                         |
| 302.638  | Provincia de Cordoba*                             | 6,88 %  | 10.12.2025            | 228.492          | 0,05                         |
| 751.000  | Republic of Armenia International Bond*           | 3,60 %  | 02.02.2031            | 590.586          | 0,12                         |
| 1.450.000  | Republic of Azerbaijan International Bond*        | 5,13 %  | 01.09.2029            | 1.391.981        | 0,28                         |
| 200.000  | Republic of Kenya Government International Bond*  | 6,30 %  | 23.01.2034            | 151.539          | 0,03                         |
| 200.000  | Republic of Kenya Government International Bond*  | 8,25 %  | 28.02.2048            | 153.748          | 0,03                         |
| 427.000  | Republic of Poland Government International Bond* | 5,50 %  | 04.04.2053            | 430.822          | 0,09                         |

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|---------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 61,54 % (31. Dezember 2022: 61,28 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                    |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                    |                              |
| 1.846.000  | Republic of South Africa Government International Bond* | 5,75 %  | 30.09.2049            | 1.311.306          | 0,27                         |
| 922.000  | Republic of South Africa Government International Bond* | 7,30 %  | 20.04.2052            | 777.412            | 0,16                         |
| 164.000  | Romanian Government International Bond*                 | 7,13 %  | 17.01.2033            | 174.095            | 0,04                         |
| 500.000  | Romanian Government International Bond*                 | 7,63 %  | 17.01.2053            | 550.859            | 0,11                         |
| 254.000  | Serbia International Bond*                              | 6,50 %  | 26.09.2033            | 249.706            | 0,05                         |
| 473.000  | Sri Lanka Government International Bond*                | 6,20 %  | 11.05.2027            | 217.773            | 0,04                         |
| 2.816.000  | Sri Lanka Government International Bond*                | 6,75 %  | 18.04.2028            | 1.296.797          | 0,26                         |
| 1.075.000  | Sri Lanka Government International Bond*                | 6,83 %  | 18.07.2026            | 509.266            | 0,10                         |
| 1.196.000  | Sri Lanka Government International Bond*                | 6,85 %  | 14.03.2024            | 550.828            | 0,11                         |
| 1.913.000  | Sri Lanka Government International Bond*                | 6,85 %  | 03.11.2025            | 911.592            | 0,19                         |
| 1.129.000  | Sri Lanka Government International Bond*                | 7,55 %  | 28.03.2030            | 519.790            | 0,11                         |
| 910.000  | Sri Lanka Government International Bond*                | 7,85 %  | 14.03.2029            | 418.960            | 0,09                         |
| 524.000  | State Agency of Roads of Ukraine*                       | 6,25 %  | 24.06.2030            | 114.756            | 0,02                         |
| 393.000  | Turkey Government International Bond*                   | 6,50 %  | 20.09.2033            | 335.005            | 0,07                         |
| 870.000  | Turkey Government International Bond*                   | 9,13 %  | 13.07.2030            | 864.545            | 0,18                         |
| 378.000  | Turkey Government International Bond*                   | 9,38 %  | 14.03.2029            | 379.811            | 0,08                         |
| 217.000  | Turkiye Ihracat Kredi Bankasi AS*                       | 9,38 %  | 31.01.2026            | 216.441            | 0,04                         |
| 1.782.000  | Ukraine Government International Bond*                  | 6,88 %  | 21.05.2031            | 411.731            | 0,08                         |
| 529.000  | Ukraine Government International Bond*                  | 7,75 %  | 01.09.2027            | 128.812            | 0,03                         |
| 1.921.000  | Ukraine Government International Bond*                  | 7,75 %  | 01.08.2041            | 758.372            | 0,15                         |
| 621.000  | Uzbekneftegaz JSC*                                      | 4,75 %  | 16.11.2028            | 513.177            | 0,10                         |
| 7.776.600  | Venezuela Government International Bond*                | 8,25 %  | 13.10.2024            | 719.335            | 0,15                         |
| 660.000  | Zambia Government International Bond*                   | 5,38 %  | 30.12.2023            | 347.820            | 0,07                         |
| 2.236.000  | Zambia Government International Bond*                   | 8,97 %  | 30.07.2027            | 1.291.536          | 0,26                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |   |         |                       | <b>63.780.941</b>  | <b>12,96</b>                 |
| <b>Uruguayischer Peso</b>  |   |         |                       |                    |                              |
| 52.981.883   | Uruguay Government International Bond*                  | 8,25 %  | 21.05.2031            | 1.309.131          | 0,27                         |
| 72.068.000   | Uruguay Government International Bond*                  | 8,50 %  | 15.03.2028            | 1.838.578          | 0,37                         |
| <b>Uruguayischer Peso insgesamt</b>                                      |   |         |                       | <b>3.147.709</b>   | <b>0,64</b>                  |
| <b>Sambischer Kwacha</b>   |   |         |                       |                    |                              |
| 14.749.000   | Zambia Government Bond*                                 | 13,00 % | 25.01.2031            | 475.046            | 0,10                         |
| Total Zambian Kwacha   |   |         |                       | 475.046            | 0,10                         |
| <b>Staatsanleihen insgesamt</b>  |   |         |                       | <b>302.822.935</b> | <b>61,54</b>                 |

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der<br>Anteile                                     | Wertpapierbezeichnung            | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|----------------------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Investmentfonds 2,85 % (31. Dezember 2022: 2,84 %)</b> |                                  |                    |                              |
| <b>US-Dollar</b>  |                                  |                    |                              |
| 1.409.964   | Neuberger Berman China Bond Fund | 14.043.241         | 2,85                         |
| <b>Investmentfonds insgesamt <math>\mu</math></b>         |                                  | <b>14.043.241</b>  | <b>2,85</b>                  |
| <b>Anlagen insgesamt</b>                                  |                                  | <b>459.962.279</b> | <b>93,47</b>                 |

### Devisenterminkontrakte 0,91 % (31. Dezember 2022: 0,86 %)

| Geforderter<br>Betrag | Zu zahlender<br>Betrag | Fälligkeits-<br>datum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|-----------------------|------------------------|-----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------------|------------------------------|
| 137.545.771 BRL       | 27.287.038 US\$        | 25.07.2023            | Morgan Stanley              | 1         | 1.117.707                            | 0,23                         |
| 4.900.694 BRL         | 985.322 US\$           | 25.07.2023            | Standard Chartered Bank     | 2         | 26.726                               | 0,01                         |
| 4.541.114 CNH         | 624.976 US\$           | 20.07.2023            | Morgan Stanley              | 1         | 19                                   | 0,00                         |
| 7.425.617.508 COP     | 1.777.493 US\$         | 06.07.2023            | Citibank NA                 | 1         | 216                                  | 0,00                         |
| 6.343.955 CZK         | 263.650 €              | 20.09.2023            | Citibank NA                 | 1         | 1.552                                | 0,00                         |
| 12.460.968 CZK        | 519.359 €              | 20.09.2023            | Goldman Sachs International | 1         | 1.417                                | 0,00                         |
| 1.123.164 €           | 422.032.229 HUF        | 11.08.2023            | BNP Paribas                 | 1         | 6.208                                | 0,00                         |
| 36.777 €              | 40.134 US\$            | 03.08.2023            | Citibank NA                 | 1         | 53                                   | 0,00                         |
| 2.022.045 €           | 2.163.528 US\$         | 05.07.2023            | Citibank NA                 | 2         | 42.524                               | 0,01                         |
| 1.838.896 €           | 1.991.742 US\$         | 05.07.2023            | Goldman Sachs International | 3         | 14.495                               | 0,00                         |
| 1.123.361 €           | 1.222.075 US\$         | 05.07.2023            | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 3.512                                | 0,00                         |
| 233.027.932 HUF       | 616.288 €              | 01.08.2023            | Citibank NA                 | 1         | 2.827                                | 0,00                         |
| 397.650.335 HUF       | 1.054.580 €            | 01.08.2023            | HSBC Bank Plc               | 1         | 1.639                                | 0,00                         |
| 169.535.820 HUF       | 446.812 €              | 11.08.2023            | UBS AG                      | 1         | 2.292                                | 0,00                         |
| 96.753.345 INR        | 1.176.511 US\$         | 20.07.2023            | BNP Paribas                 | 1         | 1.942                                | 0,00                         |
| 2.904.031 MXN         | 167.313 US\$           | 06.07.2023            | Citibank NA                 | 1         | 1.981                                | 0,00                         |
| 45.484.195 MXN        | 2.599.800 US\$         | 20.09.2023            | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 12.706                               | 0,00                         |
| 14.402.414 MXN        | 823.523 US\$           | 20.09.2023            | Morgan Stanley              | 1         | 3.718                                | 0,00                         |
| 6.590.916 PHP         | 117.373 US\$           | 20.09.2023            | HSBC Bank Plc               | 1         | 1.559                                | 0,00                         |
| 1.957.946 PLN         | 434.597 €              | 20.09.2023            | Goldman Sachs International | 1         | 4.034                                | 0,00                         |
| 8.330.132 PLN         | 1.861.272 €            | 20.09.2023            | Morgan Stanley              | 1         | 3.724                                | 0,00                         |
| 31.520.038 RON        | 6.309.551 €            | 25.07.2023            | Goldman Sachs International | 2         | 38.525                               | 0,01                         |
| 2.475.754 RON         | 497.715 €              | 25.07.2023            | Société Générale            | 1         | 701                                  | 0,00                         |
| 487.826 US\$          | 8.477.885 MXN          | 20.09.2023            | Barclays Bank Plc           | 1         | 876                                  | 0,00                         |
| 10.263.538 US\$       | 43.537.003.088 COP     | 20.09.2023            | Barclays Bank Plc           | 1         | 56.721                               | 0,01                         |
| 2.335.740 US\$        | 16.739.896 CNH         | 20.07.2023            | BNP Paribas                 | 1         | 31.822                               | 0,01                         |
| 1.132.246 US\$        | 33.970.788 TWD         | 06.07.2023            | BNP Paribas                 | 1         | 41.601                               | 0,01                         |
| 376.769 US\$          | 9.158.505 TRY          | 21.07.2023            | Citibank NA                 | 1         | 26.907                               | 0,01                         |
| 1.228.475 US\$        | 1.123.361 €            | 05.07.2023            | Citibank NA                 | 1         | 2.888                                | 0,00                         |
| 1.145.279 US\$        | 35.085.498 TWD         | 17.07.2023            | Citibank NA                 | 1         | 19.445                               | 0,00                         |
| 1.135.059 US\$        | 20.992.923 ZAR         | 12.07.2023            | Goldman Sachs International | 1         | 24.550                               | 0,01                         |
| 1.406.141 US\$        | 10.007.942 CNH         | 20.09.2023            | Goldman Sachs International | 1         | 21.350                               | 0,01                         |
| 1.229.153 US\$        | 1.120.920 €            | 05.07.2023            | Goldman Sachs International | 1         | 6.229                                | 0,00                         |

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 0,91 % (31. Dezember 2022: 0,86 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 243.125 US\$   | 8.356.950 THB       | 20.09.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 5.600                          | 0,00                 |
| 1.526.627 US\$   | 37.126.031 TRY      | 21.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 108.381                        | 0,02                 |
| 1.145.288 US\$   | 1.046.484 €         | 05.07.2023       | HSBC Bank Plc                  | 1         | 3.574                          | 0,00                 |
| 788.059 US\$   | 19.165.599 TRY      | 21.07.2023       | HSBC Bank Plc                  | 1         | 55.917                         | 0,01                 |
| 465.779 US\$   | 15.649.843 THB      | 06.07.2023       | HSBC Bank Plc                  | 1         | 24.338                         | 0,01                 |
| 619.996 US\$   | 787.059.742 KRW     | 20.09.2023       | HSBC Bank Plc                  | 1         | 20.087                         | 0,00                 |
| 1.281.691 US\$   | 24.150.070 ZAR      | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | 4.171                          | 0,00                 |
| 1.159.245 US\$   | 35.581.861 TWD      | 13.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 17.513                         | 0,00                 |
| 1.413.008 US\$   | 1.290.882 €         | 05.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 3         | 4.656                          | 0,00                 |
| 612.635 US\$   | 2.810.503 MYR       | 20.09.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | 7.367                          | 0,00                 |
| 742.124 US\$   | 3.590.397 BRL       | 25.07.2023       | Morgan Stanley                 | 1         | 667                            | 0,00                 |
| 1.020.924 US\$   | 34.216.918 THB      | 06.07.2023       | Morgan Stanley                 | 2         | 55.754                         | 0,01                 |
| 1.319.591 US\$   | 19.753.919.620 IDR  | 20.09.2023       | Morgan Stanley                 | 2         | 7.477                          | 0,00                 |
| 870.757 US\$   | 16.332.932 ZAR      | 12.07.2023       | Morgan Stanley                 | 1         | 6.758                          | 0,00                 |
| 476.768 US\$   | 15.514.480 THB      | 06.07.2023       | Société Générale               | 1         | 39.145                         | 0,01                 |
| 3.077.400 US\$   | 45.893.273.303 IDR  | 20.09.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | 29.032                         | 0,01                 |
| 87.886 US\$  | 625.363 CNH         | 20.09.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | 1.355                          | 0,00                 |
| 1.190.028 US\$   | 21.914.119 ZAR      | 12.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 2         | 30.788                         | 0,01                 |
| 815.281 US\$   | 3.471.468.493 COP   | 20.09.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 1.430                          | 0,00                 |
| 939.107 US\$   | 857.363 €           | 05.07.2023       | UBS AG                         | 1         | 3.723                          | 0,00                 |
| 10.988.435 UYU   | 274.094 US\$        | 10.08.2023       | Citibank NA                    | 1         | 18.190                         | 0,00                 |
| 33.788.057 ZAR   | 1.708.734 US\$      | 06.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 79.651                         | 0,02                 |
| 33.788.057 ZAR   | 1.704.257 US\$      | 06.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 84.128                         | 0,02                 |
| 65.130.293 ZAR   | 3.279.422 US\$      | 06.07.2023       | Morgan Stanley                 | 1         | 167.892                        | 0,03                 |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>  |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 76.892.821 €   | 83.177.655 US\$     | 14.09.2023       | Goldman Sachs International    | 2         | 1.017.034                      | 0,21                 |
| 79.698.018 €   | 86.224.014 US\$     | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp           | 12        | 1.042.258                      | 0,21                 |
| 924.245 US\$   | 844.041 €           | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp           | 5         | 53                             | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>  |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 3.988.562 £  | 5.012.366 US\$      | 14.09.2023       | Goldman Sachs International    | 2         | 59.604                         | 0,01                 |
| 139.925 £  | 175.966 US\$        | 14.09.2023       | UBS AG                         | 1         | 1.966                          | 0,00                 |
| 3.996.382 £  | 5.020.701 US\$      | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp           | 8         | 61.214                         | 0,01                 |
| 60.774 US\$  | 47.700 £            | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp           | 7         | 117                            | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen NOK</i>  |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 62.204 NOK   | 5.781 US\$          | 14.09.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 40                             | 0,00                 |
| 64.114 NOK   | 5.932 US\$          | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp           | 2         | 68                             | 0,00                 |
| 120 US\$   | 1.266 NOK           | 14.09.2023       | Citibank NA                    | 1         | 2                              | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen SEK</i>  |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 8.515.026 SEK  | 788.870 US\$        | 14.09.2023       | Goldman Sachs International    | 2         | 2.175                          | 0,00                 |
| 8.543.428 SEK  | 791.524 US\$        | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp           | 4         | 2.160                          | 0,00                 |
| 843 US\$   | 8.963 SEK           | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp           | 4         | 11                             | 0,00                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>an</sup></b> |                     |                  |                                |           | <b>4.486.762</b>               | <b>0,91</b>          |



## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Futures-Kontrakte 0,06 % (31. Dezember 2022: 0,25 %)

| Anzahl Kontrakte  | Beschreibung   | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|--|--------------------------------|----------------------|
| (24)  | Euro-BOBL Future September 2023                      | 41.829                         | 0,01                 |
| (70)  | Euro-Bund Future September 2023                      | 110.327                        | 0,02                 |
| (4)   | Euro-Schatz Future September 2023                    | 4.080                          | 0,00                 |
| (38)  | US Treasury 10-Year Note (CBT) Future September 2023 | 80.750                         | 0,02                 |
| 40  | US Treasury Ultra Bond (CBT) Future September 2023   | 30.712                         | 0,01                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten *</b> |  | <b>267.698</b>                 | <b>0,06</b>          |

### Zinsswap-Kontrakte 0,54 % (31. Dezember 2022: 1,03 %)

|  | Nominalwert    | Fälligkeit | Gegenpartei                              | Erhalt/(Zahlung)# | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|----------------|------------|--|-------------------|-----------------|--------------------|--------------------------------|----------------------|
| CLP  | 3.154.502.226  | 05.06.2030 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | Erhalt            | 2,33 %          | 1D CLICP           | 635.716                        | 0,13                 |
| MXN  | 96.923.155     | 31.08.2029 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | Erhalt            | 6,92 %          | 28D MXIBTIIE       | 345.605                        | 0,07                 |
| BRL  | 17.142.169     | 04.01.2027 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)         | 12,76 %         | 1D BROIS           | 331.672                        | 0,07                 |
| BRL  | 13.941.828     | 04.01.2027 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)         | 12,67 %         | 1D BROIS           | 259.662                        | 0,05                 |
| BRL  | 9.439.141      | 04.01.2027 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)         | 12,68 %         | 1D BROIS           | 177.094                        | 0,04                 |
| BRL  | 34.632.671     | 02.01.2026 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)         | 11,57 %         | 1D BROIS           | 166.678                        | 0,03                 |
| COP  | 20.252.351.381 | 13.04.2024 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | Erhalt            | 8,37 %          | 1D COOVIBR         | 117.074                        | 0,02                 |
| MXN  | 63.783.049     | 01.01.2032 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | Erhalt            | 7,64 %          | 28D MXIBTIIE       | 104.963                        | 0,02                 |
| MXN  | 40.040.892     | 10.11.2031 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | Erhalt            | 7,38 %          | 28D MXIBTIIE       | 102.544                        | 0,02                 |
| COP  | 14.710.158.205 | 31.01.2027 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | Erhalt            | 7,14 %          | 1D COOVIBR         | 91.684                         | 0,02                 |
| BRL  | 3.909.270      | 04.01.2027 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)         | 13,02 %         | 1D BROIS           | 83.868                         | 0,02                 |
| COP  | 3.561.060.874  | 06.01.2027 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | Erhalt            | 6,40 %          | 1D COOVIBR         | 41.263                         | 0,01                 |
| BRL  | 9.300.630      | 04.01.2027 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | Erhalt            | 10,29 %         | 1D BROIS           | 40.574                         | 0,01                 |
| CZK  | 32.584.236     | 17.04.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)         | 5,05 %          | 6M PRIBOR          | 33.122                         | 0,01                 |
| ILS  | 3.294.227      | 09.03.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)         | 4,30 %          | 3M TELBOR          | 21.721                         | 0,01                 |
| CZK  | 64.300.062     | 11.05.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)         | 4,69 %          | 6M PRIBOR          | 21.527                         | 0,01                 |
| CZK  | 63.528.669     | 11.04.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)         | 4,70 %          | 6M PRIBOR          | 21.367                         | 0,00                 |
| MXN  | 54.330.570     | 03.02.2028 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)         | 8,58 %          | 28D MXIBTIIE       | 20.853                         | 0,00                 |
| BRL  | 2.478.894      | 02.01.2031 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)         | 10,96 %         | 1D BROIS           | 20.042                         | 0,00                 |
| COP  | 1.516.059.531  | 07.01.2027 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | Erhalt            | 6,45 %          | 1D COOVIBR         | 16.976                         | 0,00                 |
| HUF  | 1.148.092.976  | 03.07.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt            | 10,29 %         | 6M BUBOR           | 6.675                          | 0,00                 |
| HUF  | 36.159.122     | 10.02.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)         | 8,72 %          | 6M BUBOR           | 3.183                          | 0,00                 |
| BRL  | 8.615.804      | 02.01.2031 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)         | 10,43 %         | 1D BROIS           | 1.988                          | 0,00                 |
| PLN  | 6.297.395      | 29.06.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt            | 4,97 %          | 6M WIBOR           | 1.322                          | 0,00                 |
| THB  | 100.000.000    | 12.01.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt            | 1,89 %          | 1D THOR            | 520                            | 0,00                 |
| THB  | 41.000.000     | 12.01.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt            | 2,18 %          | 1D THOR            | 393                            | 0,00                 |
| MXN  | 37.047.081     | 20.03.2025 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | Erhalt            | 10,05 %         | 28D MXIBTIIE       | 292                            | 0,00                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Zinsswapkontrakten <sup>∞</sup></b> |                |            |  |                   |                 |                    | <b>2.668.378</b>               | <b>0,54</b>          |

#Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Credit-Default-Swap-Kontrakten 0,23 % (31. Dezember 2022: 0,35 %)

|  | Nominalwert | Fälligkeit | Gegenpartei                 | Referenzverbindlichkeit                   | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|-------------|------------|-----------------------------|---|------------------|------------------------------|
| USD  | 23.391.728  | 20.06.2028 | ICE Clear U.S. <sup>1</sup> | Buying default protection on CDX.EM.39.V1 | 1.130.242        | 0,23                         |
| <b>Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten insgesamt *</b> |             |            |                             |   | <b>1.130.242</b> | <b>0,23</b>                  |

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

|  | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------|------------------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> | <b>468.515.359</b> | <b>95,21</b>                 |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (0,32 %) (31. Dezember 2022: (0,44 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 2.609.920 BRL      | 539.184 US\$        | 25.07.2023       | Standard Chartered Bank     | 1         | (206)                           | (0,00)               |
| 1.331.702.757 CLP  | 1.645.683 US\$      | 20.09.2023       | Barclays Bank Plc           | 1         | (1.277)                         | (0,00)               |
| 236.283.424 CLP    | 293.578 US\$        | 20.09.2023       | Morgan Stanley              | 1         | (1.812)                         | (0,00)               |
| 4.694.917 CNH      | 660.679 US\$        | 20.09.2023       | Barclays Bank Plc           | 1         | (11.048)                        | (0,00)               |
| 17.548.623 CNH     | 2.447.793 US\$      | 20.07.2023       | BNP Paribas                 | 1         | (32.570)                        | (0,01)               |
| 54.373.515 CNH     | 7.639.187 US\$      | 20.09.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (115.568)                       | (0,02)               |
| 2.590.723 CNH      | 366.171 US\$        | 20.09.2023       | Morgan Stanley              | 1         | (7.695)                         | (0,00)               |
| 30.714.828 EGP     | 958.640 US\$        | 24.08.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (4.121)                         | (0,00)               |
| 507.895 €          | 12.198.785 CZK      | 20.09.2023       | Barclays Bank Plc           | 1         | (1.974)                         | (0,00)               |
| 1.561.665 €        | 7.100.639 PLN       | 06.07.2023       | Barclays Bank Plc           | 1         | (43.713)                        | (0,01)               |
| 3.821.127 €        | 19.007.337 RON      | 25.07.2023       | Citibank NA                 | 3         | (5.411)                         | (0,00)               |
| 3.488.394 €        | 15.772.509 PLN      | 20.09.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (46.254)                        | (0,01)               |
| 1.842.096 €        | 2.015.058 US\$      | 05.07.2023       | HSBC Bank Plc               | 1         | (5.330)                         | (0,00)               |
| 674.980 €          | 3.358.140 RON       | 25.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | (1.089)                         | (0,00)               |
| 1.636.296 €        | 1.800.059 US\$      | 05.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | (14.860)                        | (0,00)               |
| 341.747 €          | 1.534.241 PLN       | 20.09.2023       | Morgan Stanley              | 1         | (1.849)                         | (0,00)               |
| 1.388.685.334 HUF  | 3.681.401 €         | 11.08.2023       | Citibank NA                 | 2         | (4.753)                         | (0,00)               |
| 129.933.378 HUF    | 344.784 €           | 11.08.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (807)                           | (0,00)               |
| 136.223.640 HUF    | 362.382 €           | 01.08.2023       | Morgan Stanley              | 1         | (654)                           | (0,00)               |
| 27.580.480.778 IDR | 1.852.904 US\$      | 07.07.2023       | Citibank NA                 | 1         | (14.832)                        | (0,00)               |
| 18.249.724.113 IDR | 1.220.506 US\$      | 20.07.2023       | HSBC Bank Plc               | 1         | (7.049)                         | (0,00)               |
| 9.344.822.163 IDR  | 620.960 US\$        | 20.09.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | (249)                           | (0,00)               |
| 13.047.272.934 IDR | 872.430 US\$        | 20.09.2023       | Morgan Stanley              | 1         | (5.791)                         | (0,00)               |
| 6.683.032.423 IDR  | 450.078 US\$        | 07.07.2023       | Morgan Stanley              | 1         | (4.695)                         | (0,00)               |
| 309.604.605 KRW    | 240.345 US\$        | 20.09.2023       | Citibank NA                 | 1         | (4.359)                         | (0,00)               |
| 7.490.088 MXN      | 437.420 US\$        | 06.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | (777)                           | (0,00)               |
| 9.677.911 MYR      | 2.104.004 US\$      | 20.09.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 2         | (19.775)                        | (0,00)               |

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (0,32 %) (31. Dezember 2022: (0,44 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag              | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 27.849.751 THB                  | 806.361 US\$        | 06.07.2023       | BNP Paribas                 | 2         | (20.792)                        | (0,00)               |
| 53.364.597 THB                  | 1.593.031 US\$      | 06.07.2023       | Citibank NA                 | 2         | (87.755)                        | (0,02)               |
| 134.369.541 THB                 | 3.895.347 US\$      | 20.09.2023       | Goldman Sachs International | 2         | (76.223)                        | (0,02)               |
| 14.502.703 THB                  | 423.783 US\$        | 06.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (14.700)                        | (0,00)               |
| 35.935.704 THB                  | 1.046.599 US\$      | 20.09.2023       | UBS AG                      | 1         | (25.215)                        | (0,01)               |
| 370.615 TWD                     | 12.545 US\$         | 06.07.2023       | HSBC Bank Plc               | 1         | (646)                           | (0,00)               |
| 33.341.058 TWD                  | 1.151.057 US\$      | 06.07.2023       | Morgan Stanley              | 1         | (80.630)                        | (0,02)               |
| 505.607 US\$                    | 2.593.296 BRL       | 25.07.2023       | Citibank NA                 | 1         | (29.937)                        | (0,01)               |
| 4.130.039 US\$                  | 15.118.422 PEN      | 18.08.2023       | Citibank NA                 | 1         | (24.332)                        | (0,01)               |
| 8.661.522 US\$                  | 168.924.925 ZAR     | 12.07.2023       | Citibank NA                 | 1         | (274.472)                       | (0,06)               |
| 1.658.455 US\$                  | 7.425.617.508 COP   | 06.07.2023       | Citibank NA                 | 1         | (119.253)                       | (0,02)               |
| 599.871 US\$                    | 10.478.373 MXN      | 20.09.2023       | Citibank NA                 | 1         | (1.983)                         | (0,00)               |
| 730.782 US\$                    | 677.323 €           | 05.07.2023       | Citibank NA                 | 2         | (8.178)                         | (0,00)               |
| 13.671.400 US\$                 | 12.781.228 €        | 05.07.2023       | Deutsche Bank AG            | 2         | (272.924)                       | (0,06)               |
| 257.791 US\$                    | 1.286.271 BRL       | 25.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (7.838)                         | (0,00)               |
| 520.785 US\$                    | 19.706.451 UYU      | 10.08.2023       | Goldman Sachs International | 2         | (3.392)                         | (0,00)               |
| 1.025.481 US\$                  | 4.380.541.778 COP   | 20.09.2023       | Goldman Sachs International | 2         | (1.494)                         | (0,00)               |
| 554.162 US\$                    | 20.965.069 UYU      | 10.08.2023       | HSBC Bank Plc               | 2         | (3.493)                         | (0,00)               |
| 1.672.324 US\$                  | 2.206.665.512 KRW   | 06.07.2023       | HSBC Bank Plc               | 1         | (2.473)                         | (0,00)               |
| 1.223.844 US\$                  | 1.123.361 €         | 03.08.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | (3.656)                         | (0,00)               |
| 1.673.531 US\$                  | 29.796.162 MXN      | 06.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | (63.470)                        | (0,01)               |
| 3.673.390 US\$                  | 3.392.845 €         | 05.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 5         | (28.205)                        | (0,01)               |
| 505.804 US\$                    | 2.159.784.928 COP   | 20.09.2023       | Morgan Stanley              | 1         | (536)                           | (0,00)               |
| 669.811 US\$                    | 11.632.301 MXN      | 06.07.2023       | Standard Chartered Bank     | 1         | (8.307)                         | (0,00)               |
| 10.198.350 ZAR                  | 548.372 US\$        | 12.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (8.887)                         | (0,00)               |
| 15.845.540 ZAR                  | 863.885 US\$        | 12.07.2023       | Morgan Stanley              | 1         | (25.668)                        | (0,01)               |
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 54.598 AUD                      | 36.530 US\$         | 14.09.2023       | Citibank NA                 | 1         | (113)                           | (0,00)               |
| 2.069.290 AUD                   | 1.394.079 US\$      | 14.09.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (13.854)                        | (0,00)               |
| 2.157.284 AUD                   | 1.452.870 US\$      | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 3         | (13.952)                        | (0,01)               |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 7.956.767 €                     | 8.722.280 US\$      | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 8         | (9.925)                         | (0,00)               |
| 182.089 US\$                    | 168.054 €           | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 7         | (1.925)                         | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 65.853 £                        | 84.203 US\$         | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 4         | (463)                           | (0,00)               |
| 138.711 US\$                    | 109.916 £           | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 9         | (1.061)                         | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen NOK</i> |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 1.507 NOK                       | 141 US\$            | 14.09.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (0)                             | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen SEK</i> |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 571.588 SEK                     | 53.702 US\$         | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 6         | (601)                           | (0,00)               |
| 182.496 US\$                    | 1.969.938 SEK       | 14.09.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (511)                           | (0,00)               |

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (0,32 %) (31. Dezember 2022: (0,44 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen SEK (Fortsetzung)</i>                                    |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 183.103 US\$   | 1.976.332 SEK       | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 3         | (498)                           | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 1.208.917 SGD  | 902.651 US\$        | 14.09.2023       | Goldman Sachs International | 4         | (6.939)                         | (0,00)               |
| 872.053 SGD  | 651.641 US\$        | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 3         | (5.517)                         | (0,00)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                             |           | <b>(1.608.336)</b>              | <b>(0,32)</b>        |

### Futures-Kontrakte (0,17 %) (31. Dezember 2022: (0,03 %))

| Anzahl Kontrakte   | Beschreibung   | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|--|---------------------------------|----------------------|
| (23)   | Euro-Buxl 30-Year Bond Future September 2023             | (33.908)                        | (0,01)               |
| 216  | South Korea 3-Year Bond Future March 2020 September 2023 | (42.739)                        | (0,01)               |
| 71   | US Treasury 10-Year Note (CBT) Future September 2023     | (134.500)                       | (0,03)               |
| 22   | US Treasury 2-Year Note (CBT) Future September 2023      | (64.453)                        | (0,01)               |
| 331  | US Treasury 5-Year Note (CBT) Future September 2023      | (527.356)                       | (0,11)               |
| 2  | US Treasury Long Bond (CBT) Future September 2023        | (1.313)                         | (0,00)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten *</b> |  | <b>(804.269)</b>                | <b>(0,17)</b>        |

### Zinsswap-Kontrakte (1,23 %) (31. Dezember 2022: (2,46 %))

|     | Nominalwert   | Fälligkeit | Gegenpartei                              | Erhalt/(Zahlung)# | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-----|---------------|------------|--|-------------------|-----------------|--------------------|---------------------------------|----------------------|
| MXN | 63.984.030    | 27.05.2027 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)         | 8,58 %          | 28D MXIBTIIE       | (612)                           | (0,00)               |
| ILS | 989.254       | 06.04.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)         | 3,64 %          | 3M TELBOR          | (774)                           | (0,00)               |
| ILS | 8.064.705     | 15.06.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)         | 3,68 %          | 3M TELBOR          | (1.612)                         | (0,00)               |
| HUF | 1.729.707.213 | 03.07.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt            | 10,43 %         | 6M BUBOR           | (2.039)                         | (0,00)               |
| PLN | 8.203.745     | 29.06.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt            | 5,01 %          | 6M WIBOR           | (2.440)                         | (0,00)               |
| CZK | 31.446.626    | 27.01.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)         | 4,52 %          | 6M PRIBOR          | (3.392)                         | (0,00)               |
| PLN | 6.262.194     | 03.07.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt            | 5,05 %          | 6M WIBOR           | (4.199)                         | (0,00)               |
| PLN | 1.621.573     | 15.05.2033 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt            | 5,20 %          | 6M WIBOR           | (5.293)                         | (0,00)               |
| PLN | 6.292.750     | 30.06.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt            | 5,07 %          | 6M WIBOR           | (5.345)                         | (0,00)               |
| PLN | 1.621.573     | 15.05.2033 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt            | 5,22 %          | 6M WIBOR           | (5.977)                         | (0,00)               |
| PLN | 3.243.147     | 15.05.2033 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt            | 5,14 %          | 6M WIBOR           | (6.890)                         | (0,00)               |
| CZK | 49.562.879    | 06.12.2027 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)         | 4,51 %          | 6M PRIBOR          | (9.441)                         | (0,00)               |
| MXN | 34.597.992    | 07.01.2028 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)         | 8,14 %          | 28D MXIBTIIE       | (20.614)                        | (0,00)               |
| MXN | 28.121.151    | 07.01.2028 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)         | 8,04 %          | 28D MXIBTIIE       | (23.126)                        | (0,00)               |
| ILS | 9.174.171     | 06.01.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)         | 3,50 %          | 3M TELBOR          | (23.311)                        | (0,00)               |
| MXN | 34.560.994    | 07.01.2028 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)         | 8,09 %          | 28D MXIBTIIE       | (24.369)                        | (0,01)               |
| ILS | 8.718.234     | 09.01.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)         | 3,47 %          | 3M TELBOR          | (25.417)                        | (0,01)               |
| MXN | 27.574.229    | 02.06.2033 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt            | 8,35 %          | 28D MXIBTIIE       | (28.328)                        | (0,01)               |
| CZK | 74.423.157    | 23.01.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)         | 4,35 %          | 6M PRIBOR          | (31.052)                        | (0,01)               |
| ZAR | 32.694.907    | 12.01.2033 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)         | 10,14 %         | 3M JIBAR           | (34.202)                        | (0,01)               |
| CLP | 2.698.258.379 | 13.04.2025 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | Erhalt            | 7,51 %          | 1D CLICP           | (36.648)                        | (0,01)               |
| MXN | 9.645.130     | 08.12.2025 | Goldman Sachs International              | (Zahlung)         | 6,21 %          | 28D MXIBTIIE       | (38.347)                        | (0,01)               |

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Zinsswap-Kontrakte (1,23 %) (31. Dezember 2022: (2,46 %)) (Fortsetzung)

|   | Nominalwert    | Fälligkeit | Gegenpartei                              | Erhalt/(Zahlung) <sup>#</sup> | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|----------------|------------|--|-------------------------------|-----------------|--------------------|---------------------------------|----------------------|
| ZAR   | 47.339.793     | 12.01.2033 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 10,21 %         | 3M JIBAR           | (44.951)                        | (0,01)               |
| ILS   | 9.027.933      | 16.01.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 3,10 %          | 3M TELBOR          | (62.382)                        | (0,01)               |
| CLP   | 2.479.849.388  | 14.09.2024 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | Erhalt                        | 9,80 %          | 1D CLICP           | (65.779)                        | (0,01)               |
| COP   | 3.223.342.325  | 11.08.2032 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | Erhalt                        | 9,02 %          | 1D COOVIBR         | (79.954)                        | (0,02)               |
| PLN   | 2.553.479      | 30.09.2032 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 6,86 %          | 6M WIBOR           | (83.021)                        | (0,02)               |
| COP   | 23.764.723.280 | 02.06.2025 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | Erhalt                        | 10,28 %         | 1D COOVIBR         | (96.703)                        | (0,02)               |
| COP   | 27.609.558.079 | 05.06.2025 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | Erhalt                        | 10,27 %         | 1D COOVIBR         | (112.518)                       | (0,02)               |
| MXN   | 37.080.494     | 05.03.2026 | Goldman Sachs International              | (Zahlung)                     | 6,17 %          | 28D MXIBTIE        | (153.497)                       | (0,03)               |
| ZAR   | 157.126.736    | 05.04.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 8,16 %          | 3M JIBAR           | (160.689)                       | (0,03)               |
| CLP   | 1.254.313.506  | 23.01.2030 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 3,06 %          | 1D CLICP           | (178.901)                       | (0,04)               |
| MXN   | 47.500.000     | 18.06.2026 | JPMorgan Chase Bank                      | (Zahlung)                     | 6,13 %          | 28D MXIBTIE        | (204.899)                       | (0,04)               |
| MXN   | 60.000.000     | 16.09.2026 | Goldman Sachs International              | (Zahlung)                     | 6,38 %          | 28D MXIBTIE        | (240.392)                       | (0,05)               |
| CLP   | 1.377.149.008  | 24.08.2030 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 2,15 %          | 1D CLICP           | (303.829)                       | (0,06)               |
| CLP   | 3.115.406.937  | 23.06.2025 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 1,16 %          | 1D CLICP           | (391.992)                       | (0,08)               |
| CLP   | 3.388.538.669  | 17.06.2025 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 1,36 %          | 1D CLICP           | (408.882)                       | (0,08)               |
| BRL   | 29.000.000     | 04.01.2027 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 7,67 %          | 1D BROIS           | (894.549)                       | (0,18)               |
| BRL   | 68.736.587     | 02.01.2024 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 4,84 %          | 1D BROIS           | (2.242.435)                     | (0,46)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Zinsswapkontrakten <sup>∞</sup></b> |                |            |  |                               |                 |                    | <b>(6.058.801)</b>              | <b>(1,23)</b>        |

<sup>#</sup>Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

|   | Zeitwert US\$      | % des Nettovermögens |
|---|--------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(8.471.406)</b> | <b>(1,72)</b>        |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>460.043.953</b> | <b>93,49</b>         |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>32.067.049</b>  | <b>6,51</b>          |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>492.111.002</b> | <b>100,00</b>        |

| Portfolioanalyse  | US\$               | % des Gesamtvermögens |
|---|--------------------|-----------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 345.029.150        | 67,71                 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden            | 100.375.685        | 19,70                 |
| † Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente  | 514.203            | 0,10                  |
| µ Investmentfonds   | 14.043.241         | 2,76                  |
| ± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden                          | (536.571)          | (0,11)                |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap                            | 618.245            | 0,12                  |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>460.043.953</b> | <b>90,28</b>          |

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                   | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Schatzwechsel 0,22 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)</b>          |   |        |                       |                  |                              |
| <b>Thailändischer Baht</b>                                       |   |        |                       |                  |                              |
| 3.500.000  | Bank of Thailand Bill                   | 0,00 % | 17.08.2023            | 98.487           | 0,16                         |
| 1.300.000  | Bank of Thailand Bill                   | 0,00 % | 09.05.2024            | 36.043           | 0,06                         |
| <b>Schatzwechsel insgesamt **</b>                                |   |        |                       | <b>134.530</b>   | <b>0,22</b>                  |
| <b>Unternehmensanleihen 13,01 % (31. Dezember 2022: 13,84 %)</b> |   |        |                       |                  |                              |
| <b>Euro</b>  |   |        |                       |                  |                              |
| 100.000  | Banque Ouest Africaine de Developpement | 2,75 % | 22.01.2033            | 79.780           | 0,13                         |
| <b>Euro insgesamt</b>  |   |        |                       | <b>79.780</b>    | <b>0,13</b>                  |
| <b>Mexikanischer Peso</b>  |   |        |                       |                  |                              |
| 3.000.000  | Asian Infrastructure Investment Bank    | 0,00 % | 08.02.2038            | 45.467           | 0,07                         |
| <b>Mexikanischer Peso insgesamt</b>                              |   |        |                       | <b>45.467</b>    | <b>0,07</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 200.000  | Abu Dhabi Commercial Bank PJSC          | 3,50 % | 31.03.2027            | 189.326          | 0,30                         |
| 200.000  | Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC        | 4,60 % | 02.11.2047            | 186.021          | 0,30                         |
| 200.000  | African Export-Import Bank              | 2,63 % | 17.05.2026            | 180.531          | 0,29                         |
| 200.000  | African Export-Import Bank              | 3,80 % | 17.05.2031            | 161.071          | 0,26                         |
| 200.000  | African Export-Import Bank              | 3,99 % | 21.09.2029            | 169.433          | 0,27                         |
| 200.000  | Banco de Credito e Inversiones SA       | 3,50 % | 12.10.2027            | 184.784          | 0,30                         |
| 200.000  | Bank Leumi Le-Israel BM                 | 3,28 % | 29.01.2031            | 179.228          | 0,29                         |
| 200.000  | Bank Mandiri Persero Tbk PT             | 4,75 % | 13.05.2025            | 196.233          | 0,31                         |
| 880.000  | Banque Ouest Africaine de Developpement | 4,70 % | 22.10.2031            | 715.040          | 1,15                         |
| 205.000  | Banque Ouest Africaine de Developpement | 5,00 % | 27.07.2027            | 187.664          | 0,30                         |
| 200.000  | Braskem Netherlands Finance BV          | 7,25 % | 13.02.2033            | 196.659          | 0,31                         |
| 200.000  | Cencosud SA                             | 4,38 % | 17.07.2027            | 190.019          | 0,30                         |
| 300.000  | Corp Nacional del Cobre de Chile        | 3,15 % | 14.01.2030            | 266.000          | 0,43                         |
| 200.000  | Corp Nacional del Cobre de Chile        | 3,70 % | 30.01.2050            | 151.741          | 0,24                         |
| 200.000  | DIB Sukuk Ltd                           | 4,80 % | 16.08.2028            | 199.832          | 0,32                         |
| 200.000  | DP World Ltd                            | 6,85 % | 02.07.2037            | 216.668          | 0,35                         |
| 436.000  | Empresa de los Ferrocarriles del Estado | 3,83 % | 14.09.2061            | 297.489          | 0,48                         |
| 200.000  | Empresa de Transmision Electrica SA     | 5,13 % | 02.05.2049            | 163.814          | 0,26                         |
| 203.000  | First Abu Dhabi Bank PJSC               | 5,13 % | 13.10.2027            | 205.869          | 0,33                         |
| 400.000  | LG Chem Ltd                             | 2,38 % | 07.07.2031            | 329.203          | 0,53                         |
| 200.000  | MDGH GMTN RSC Ltd                       | 2,50 % | 03.06.2031            | 171.793          | 0,28                         |
| 200.000  | MDGH GMTN RSC Ltd                       | 3,38 % | 28.03.2032            | 180.758          | 0,29                         |
| 200.000  | MTR Corp Ltd                            | 1,63 % | 19.08.2030            | 164.982          | 0,26                         |
| 292.000  | NBK SPC Ltd                             | 1,63 % | 15.09.2027            | 260.639          | 0,42                         |

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                           | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 13,01 % (31. Dezember 2022: 13,84 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 200.000  | NBK Tier 1 Ltd                                  | 3,63 % | 29.12.2049            | 173.576          | 0,28                         |
| 200.000  | Ooredoo International Finance Ltd               | 2,63 % | 08.04.2031            | 172.700          | 0,28                         |
| 400.000  | Shinhan Bank Co Ltd                             | 4,00 % | 23.04.2029            | 364.690          | 0,58                         |
| 200.000  | Shinhan Financial Group Co Ltd                  | 3,34 % | 05.02.2030            | 191.549          | 0,31                         |
| 200.000  | Sigma Alimentos SA de CV                        | 4,13 % | 02.05.2026            | 190.901          | 0,31                         |
| 200.000  | Sigma Finance Netherlands BV                    | 4,88 % | 27.03.2028            | 192.195          | 0,31                         |
| 200.000  | SK Hynix Inc                                    | 6,50 % | 17.01.2033            | 202.054          | 0,32                         |
| 1.000.000  | Tencent Holdings Ltd                            | 3,24 % | 03.06.2050            | 656.962          | 1,05                         |
| 220.000  | TSMC Arizona Corp                               | 3,25 % | 25.10.2051            | 169.271          | 0,27                         |
| 400.000  | UltraTech Cement Ltd                            | 2,80 % | 16.02.2031            | 328.932          | 0,53                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |   |        |                       | <b>7.987.627</b> | <b>12,81</b>                 |
| <b>Unternehmensanleihen insgesamt *</b>  |   |        |                       | <b>8.112.874</b> | <b>13,01</b>                 |
| <b>Staatsanleihen 79,73 % (31. Dezember 2022: 77,91 %)</b>                     |   |        |                       |                  |                              |
| <b>Chilenischer Peso</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 90.226.700   | Bonos de la Tesoreria de la Republica*          | 1,90 % | 01.09.2030            | 112.014          | 0,18                         |
| 55.000.000   | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos* | 2,80 % | 01.10.2033            | 56.276           | 0,09                         |
| 40.000.000   | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos* | 4,50 % | 01.03.2026            | 49.270           | 0,08                         |
| 25.000.000   | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos* | 4,70 % | 01.09.2030            | 30.672           | 0,05                         |
| 35.000.000   | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos* | 5,00 % | 01.03.2035            | 44.050           | 0,07                         |
| 75.000.000   | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos* | 6,00 % | 01.04.2033            | 100.511          | 0,16                         |
| 20.000.000   | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos* | 6,00 % | 01.01.2043            | 28.330           | 0,05                         |
| 15.000.000   | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos* | 7,00 % | 01.05.2034            | 21.698           | 0,03                         |
| <b>Chilenischer Peso insgesamt</b>   |   |        |                       | <b>442.821</b>   | <b>0,71</b>                  |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi</b>  |   |        |                       |                  |                              |
| 100.000  | China Government Bond**                         | 1,99 % | 09.04.2025            | 13.732           | 0,02                         |
| 300.000  | China Government Bond**                         | 2,44 % | 15.10.2027            | 41.375           | 0,07                         |
| 900.000  | China Government Bond**                         | 2,47 % | 02.09.2024            | 124.598          | 0,20                         |
| 300.000  | China Government Bond**                         | 2,60 % | 01.09.2032            | 40.956           | 0,07                         |
| 800.000  | China Government Bond**                         | 2,62 % | 25.09.2029            | 110.230          | 0,18                         |
| 560.000  | China Government Bond**                         | 2,68 % | 21.05.2030            | 77.382           | 0,12                         |
| 1.200.000  | China Government Bond**                         | 2,69 % | 12.08.2026            | 167.176          | 0,27                         |
| 500.000  | China Government Bond**                         | 2,75 % | 15.06.2029            | 69.535           | 0,11                         |
| 1.200.000  | China Government Bond**                         | 2,79 % | 15.12.2029            | 166.946          | 0,27                         |
| 300.000  | China Government Bond**                         | 2,80 % | 24.03.2029            | 41.909           | 0,07                         |
| 350.000  | China Government Bond**                         | 2,80 % | 25.03.2030            | 48.715           | 0,08                         |
| 300.000  | China Government Bond**                         | 2,80 % | 15.11.2032            | 41.617           | 0,07                         |

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung           | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---------------------------------|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 79,73 % (31. Dezember 2022: 77,91 %) (Fortsetzung)</b> |                                 |         |                       |                  |                              |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi (Fortsetzung)</b>                          |                                 |         |                       |                  |                              |
| 330.000  | China Government Bond**         | 2,85 %  | 04.06.2027            | 46.261           | 0,07                         |
| 950.000  | China Government Bond**         | 2,88 %  | 25.02.2033            | 133.092          | 0,21                         |
| 200.000  | China Government Bond**         | 2,89 %  | 18.11.2031            | 27.943           | 0,05                         |
| 400.000  | China Government Bond**         | 2,91 %  | 14.10.2028            | 56.248           | 0,09                         |
| 200.000  | China Government Bond**         | 2,94 %  | 17.10.2024            | 27.880           | 0,04                         |
| 1.400.000  | China Government Bond**         | 3,02 %  | 22.10.2025            | 196.379          | 0,32                         |
| 300.000  | China Government Bond**         | 3,02 %  | 27.05.2031            | 42.404           | 0,07                         |
| 500.000  | China Government Bond**         | 3,03 %  | 11.03.2026            | 70.326           | 0,11                         |
| 100.000  | China Government Bond**         | 3,12 %  | 05.12.2026            | 14.150           | 0,02                         |
| 570.000  | China Government Bond**         | 3,12 %  | 25.10.2052            | 79.915           | 0,13                         |
| 220.000  | China Government Bond**         | 3,19 %  | 15.04.2053            | 31.484           | 0,05                         |
| 200.000  | China Government Bond**         | 3,27 %  | 19.11.2030            | 28.917           | 0,05                         |
| 2.240.000  | China Government Bond**         | 3,28 %  | 03.12.2027            | 320.765          | 0,51                         |
| 460.000  | China Government Bond**         | 3,72 %  | 12.04.2051            | 71.044           | 0,11                         |
| 400.000  | China Government Bond**         | 3,81 %  | 14.09.2050            | 62.597           | 0,10                         |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt</b>                              |                                 |         |                       | <b>2.153.576</b> | <b>3,46</b>                  |
| <b>Kolumbianischer Peso</b>  |                                 |         |                       |                  |                              |
| 773.800.000  | Colombian TES*                  | 5,75 %  | 03.11.2027            | 159.637          | 0,26                         |
| 859.300.000  | Colombian TES*                  | 6,00 %  | 28.04.2028            | 176.532          | 0,28                         |
| 583.600.000  | Colombian TES*                  | 7,00 %  | 26.03.2031            | 117.934          | 0,19                         |
| 1.001.800.000  | Colombian TES Series G*         | 7,00 %  | 26.03.2031            | 202.445          | 0,32                         |
| 1.798.000.000  | Colombian TES*                  | 7,00 %  | 30.06.2032            | 353.353          | 0,57                         |
| 335.400.000  | Colombian TES*                  | 7,25 %  | 18.10.2034            | 64.860           | 0,10                         |
| 690.500.000  | Colombian TES*                  | 7,75 %  | 18.09.2030            | 147.212          | 0,24                         |
| 32.300.000   | Colombian TES*                  | 9,25 %  | 28.05.2042            | 6.930            | 0,01                         |
| 1.248.100.000  | Colombian TES*                  | 13,25 % | 09.02.2033            | 350.925          | 0,56                         |
| <b>Kolumbianischer Peso insgesamt</b>                                    |                                 |         |                       | <b>1.579.828</b> | <b>2,53</b>                  |
| <b>Tschechische Krone</b>  |                                 |         |                       |                  |                              |
| 1.550.000  | Czech Republic Government Bond* | 0,05 %  | 29.11.2029            | 54.034           | 0,09                         |
| 3.240.000  | Czech Republic Government Bond* | 0,25 %  | 10.02.2027            | 126.380          | 0,20                         |
| 3.080.000  | Czech Republic Government Bond* | 0,95 %  | 15.05.2030            | 112.968          | 0,18                         |
| 2.960.000  | Czech Republic Government Bond* | 1,00 %  | 26.06.2026            | 120.868          | 0,19                         |
| 9.220.000  | Czech Republic Government Bond* | 1,20 %  | 13.03.2031            | 337.083          | 0,54                         |
| 1.730.000  | Czech Republic Government Bond* | 1,75 %  | 23.06.2032            | 64.745           | 0,10                         |
| 2.520.000  | Czech Republic Government Bond* | 2,00 %  | 13.10.2033            | 93.806           | 0,15                         |
| 270.000  | Czech Republic Government Bond* | 2,50 %  | 25.08.2028            | 11.246           | 0,02                         |



## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                             | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 79,73 % (31. Dezember 2022: 77,91 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                   |                              |
| <b>Tschechische Krone (Fortsetzung)</b>                                  |   |        |                       |                   |                              |
| 2.000.000  | Czech Republic Government Bond*                   | 2,75 % | 23.07.2029            | 83.520            | 0,14                         |
| 720.000  | Czech Republic Government Bond*                   | 4,20 % | 04.12.2036            | 32.564            | 0,05                         |
| 590.000  | Czech Republic Government Bond*                   | 5,50 % | 12.12.2028            | 28.475            | 0,05                         |
| <b>Tschechische Krone insgesamt</b>                                      |   |        |                       | <b>1.065.689</b>  | <b>1,71</b>                  |
| <b>Euro</b>  |   |        |                       |                   |                              |
| 410.000  | Bank Gospodarstwa Krajowego*                      | 5,13 % | 22.02.2033            | 464.772           | 0,75                         |
| 400.000  | Bulgaria Government International Bond*           | 4,13 % | 23.09.2029            | 432.952           | 0,69                         |
| 180.000  | Bulgaria Government International Bond*           | 4,50 % | 27.01.2033            | 194.920           | 0,31                         |
| 750.000  | Chile Government International Bond*              | 0,83 % | 02.07.2031            | 645.599           | 1,04                         |
| 710.000  | Chile Government International Bond*              | 1,88 % | 27.05.2030            | 681.539           | 1,09                         |
| 453.000  | Hungary Government International Bond*            | 1,63 % | 28.04.2032            | 377.092           | 0,61                         |
| 750.000  | Indonesia Government International Bond*          | 0,90 % | 14.02.2027            | 732.350           | 1,17                         |
| 400.000  | Indonesia Government International Bond*          | 1,10 % | 12.03.2033            | 324.268           | 0,52                         |
| 1.770.000  | Indonesia Government International Bond*          | 1,40 % | 30.10.2031            | 1.529.767         | 2,45                         |
| 340.000  | Indonesia Government International Bond*          | 3,75 % | 14.06.2028            | 368.630           | 0,59                         |
| 400.000  | Kazakhstan Government International Bond*         | 0,60 % | 30.09.2026            | 385.974           | 0,62                         |
| 600.000  | Kazakhstan Government International Bond*         | 1,50 % | 30.09.2034            | 471.994           | 0,76                         |
| 940.000  | Kazakhstan Government International Bond*         | 2,38 % | 09.11.2028            | 929.329           | 1,49                         |
| 350.000  | Latvia Government International Bond*             | 0,25 % | 23.01.2030            | 304.464           | 0,49                         |
| 250.000  | Lithuania Government International Bond*          | 2,13 % | 01.06.2032            | 240.281           | 0,39                         |
| 841.000  | Mexico Government International Bond*             | 2,25 % | 12.08.2036            | 681.081           | 1,09                         |
| 250.000  | Mexico Government International Bond*             | 2,38 % | 11.02.2030            | 242.460           | 0,39                         |
| 838.000  | Peruvian Government International Bond*           | 1,25 % | 11.03.2033            | 690.641           | 1,11                         |
| 200.000  | Peruvian Government International Bond*           | 1,95 % | 17.11.2036            | 158.396           | 0,25                         |
| 1.000.000  | Philippine Government International Bond*         | 0,70 % | 03.02.2029            | 909.106           | 1,46                         |
| 200.000  | Philippine Government International Bond*         | 1,20 % | 28.04.2033            | 167.236           | 0,27                         |
| 800.000  | Philippine Government International Bond*         | 1,75 % | 28.04.2041            | 570.675           | 0,92                         |
| 276.000  | Republic of Poland Government International Bond* | 4,25 % | 14.02.2043            | 296.666           | 0,48                         |
| 387.000  | Romanian Government International Bond*           | 2,00 % | 14.04.2033            | 299.215           | 0,48                         |
| 37.000   | Romanian Government International Bond*           | 2,88 % | 13.04.2042            | 24.904            | 0,04                         |
| 400.000  | Romanian Government International Bond**          | 3,38 % | 08.02.2038            | 314.699           | 0,50                         |
| 1.410.000  | Romanian Government International Bond*           | 3,75 % | 07.02.2034            | 1.247.592         | 2,00                         |
| 633.000  | Romanian Government International Bond*           | 3,88 % | 29.10.2035            | 549.019           | 0,88                         |
| 193.000  | Romanian Government International Bond*           | 4,63 % | 03.04.2049            | 163.152           | 0,26                         |
| <b>Euro insgesamt</b>  |   |        |                       | <b>14.398.773</b> | <b>23,10</b>                 |

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung      | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|----------------------------|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 79,73 % (31. Dezember 2022: 77,91 %) (Fortsetzung)</b> |                            |        |                       |                  |                              |
| <b>Ungarischer Forint</b>  |                            |        |                       |                  |                              |
| 25.900.000   | Hungary Government Bond*   | 2,00 % | 23.05.2029            | 57.544           | 0,09                         |
| 23.610.000   | Hungary Government Bond*   | 2,25 % | 20.04.2033            | 47.450           | 0,07                         |
| 51.790.000   | Hungary Government Bond*   | 3,00 % | 27.10.2027            | 126.200          | 0,20                         |
| 10.040.000   | Hungary Government Bond*   | 3,00 % | 21.08.2030            | 22.830           | 0,04                         |
| 12.620.000   | Hungary Government Bond*   | 3,25 % | 22.10.2031            | 28.763           | 0,05                         |
| 99.900.000   | Hungary Government Bond*   | 4,50 % | 23.03.2028            | 256.603          | 0,41                         |
| 11.540.000   | Hungary Government Bond*   | 4,75 % | 24.11.2032            | 28.802           | 0,05                         |
| 34.840.000   | Hungary Government Bond*   | 5,50 % | 24.06.2025            | 94.442           | 0,15                         |
| 12.990.000   | Hungary Government Bond*   | 6,75 % | 22.10.2028            | 36.620           | 0,06                         |
| <b>Ungarischer Forint insgesamt</b>                                      |                            |        |                       | <b>699.254</b>   | <b>1,12</b>                  |
| <b>Indonesische Rupiah</b>   |                            |        |                       |                  |                              |
| 4.000.000.000  | Indonesia Treasury Bond*   | 5,13 % | 15.04.2027            | 262.389          | 0,42                         |
| 1.050.000.000  | Indonesia Treasury Bond*   | 5,50 % | 15.04.2026            | 69.721           | 0,11                         |
| 300.000.000  | Indonesia Treasury Bond*   | 6,25 % | 15.06.2036            | 19.857           | 0,03                         |
| 7.512.000.000  | Indonesia Treasury Bond*   | 6,38 % | 15.08.2028            | 511.719          | 0,82                         |
| 2.700.000.000  | Indonesia Treasury Bond*   | 6,38 % | 15.04.2032            | 181.126          | 0,29                         |
| 300.000.000  | Indonesia Treasury Bond*   | 6,38 % | 15.07.2037            | 19.864           | 0,03                         |
| 1.900.000.000  | Indonesia Treasury Bond*   | 6,50 % | 15.06.2025            | 128.291          | 0,21                         |
| 5.406.000.000  | Indonesia Treasury Bond*   | 6,50 % | 15.02.2031            | 364.092          | 0,58                         |
| 186.000.000  | Indonesia Treasury Bond*   | 6,63 % | 15.05.2033            | 12.641           | 0,02                         |
| 300.000.000  | Indonesia Treasury Bond*   | 7,00 % | 15.05.2027            | 20.743           | 0,03                         |
| 12.032.000.000   | Indonesia Treasury Bond*   | 7,00 % | 15.02.2033            | 845.663          | 1,36                         |
| 1.800.000.000  | Indonesia Treasury Bond*   | 7,13 % | 15.06.2038            | 127.476          | 0,20                         |
| 1.850.000.000  | Indonesia Treasury Bond*   | 7,13 % | 15.06.2042            | 129.358          | 0,21                         |
| 1.300.000.000  | Indonesia Treasury Bond*   | 7,13 % | 15.06.2043            | 91.978           | 0,15                         |
| 3.550.000.000  | Indonesia Treasury Bond*   | 7,50 % | 15.06.2035            | 256.761          | 0,41                         |
| 1.791.000.000  | Indonesia Treasury Bond*   | 7,50 % | 15.04.2040            | 129.525          | 0,21                         |
| 222.000.000  | Indonesia Treasury Bond*   | 8,25 % | 15.05.2036            | 17.069           | 0,03                         |
| 100.000.000  | Indonesia Treasury Bond*   | 8,38 % | 15.03.2034            | 7.684            | 0,01                         |
| 131.000.000  | Indonesia Treasury Bond*   | 8,38 % | 15.04.2039            | 10.204           | 0,02                         |
| <b>Indonesische Rupiah insgesamt</b>                                     |                            |        |                       | <b>3.206.161</b> | <b>5,14</b>                  |
| <b>Malaysischer Ringgit</b>  |                            |        |                       |                  |                              |
| 645.000  | Malaysia Government Bond** | 2,63 % | 15.04.2031            | 126.815          | 0,20                         |
| 620.000  | Malaysia Government Bond** | 3,48 % | 14.06.2024            | 133.062          | 0,21                         |
| 710.000  | Malaysia Government Bond** | 3,50 % | 31.05.2027            | 151.367          | 0,24                         |
| 870.000  | Malaysia Government Bond** | 3,58 % | 15.07.2032            | 182.684          | 0,29                         |

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                    | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 79,73 % (31. Dezember 2022: 77,91 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                  |                              |
| <b>Malaysischer Ringgit (Fortsetzung)</b>                                |  |        |                       |                  |                              |
| 690.000  | Malaysia Government Bond**               | 3,73 % | 15.06.2028            | 148.561          | 0,24                         |
| 923.000  | Malaysia Government Bond**               | 3,76 % | 22.05.2040            | 188.262          | 0,30                         |
| 265.000  | Malaysia Government Bond**               | 3,83 % | 05.07.2034            | 55.806           | 0,09                         |
| 70.000   | Malaysia Government Bond**               | 3,90 % | 30.11.2026            | 15.168           | 0,03                         |
| 1.400.000  | Malaysia Government Bond**               | 3,90 % | 16.11.2027            | 303.135          | 0,49                         |
| 70.000   | Malaysia Government Bond**               | 3,91 % | 15.07.2026            | 15.181           | 0,03                         |
| 900.000  | Malaysia Government Bond**               | 3,96 % | 15.09.2025            | 194.660          | 0,31                         |
| 250.000  | Malaysia Government Bond**               | 4,07 % | 15.06.2050            | 52.250           | 0,08                         |
| 550.000  | Malaysia Government Bond**               | 4,25 % | 31.05.2035            | 119.735          | 0,19                         |
| 850.000  | Malaysia Government Bond**               | 4,50 % | 30.04.2029            | 189.247          | 0,30                         |
| 400.000  | Malaysia Government Bond**               | 4,50 % | 15.04.2030            | 89.687           | 0,15                         |
| 990.000  | Malaysia Government Bond**               | 4,70 % | 15.10.2042            | 228.534          | 0,37                         |
| 520.000  | Malaysia Government Bond**               | 4,76 % | 07.04.2037            | 118.982          | 0,19                         |
| 583.000  | Malaysia Government Bond**               | 4,89 % | 08.06.2038            | 137.056          | 0,22                         |
| <b>Malaysischer Ringgit insgesamt</b>                                    |  |        |                       | <b>2.450.192</b> | <b>3,93</b>                  |
| <b>Mexikanischer Peso</b>  |  |        |                       |                  |                              |
| 11.896.000   | Mexican Bonos*                           | 7,50 % | 03.06.2027            | 660.261          | 1,06                         |
| 5.500.000  | Mexican Bonos*                           | 7,50 % | 26.05.2033            | 297.885          | 0,48                         |
| 19.055.900   | Mexican Bonos*                           | 7,75 % | 29.05.2031            | 1.051.533        | 1,69                         |
| 4.632.100  | Mexican Bonos*                           | 7,75 % | 13.11.2042            | 242.441          | 0,39                         |
| 903.800  | Mexican Bonos*                           | 8,00 % | 07.11.2047            | 48.187           | 0,08                         |
| 14.708.500   | Mexican Bonos*                           | 8,50 % | 31.05.2029            | 849.955          | 1,36                         |
| 3.540.000  | Mexican Bonos*                           | 8,50 % | 18.11.2038            | 201.243          | 0,32                         |
| <b>Mexikanischer Peso insgesamt</b>                                      |  |        |                       | <b>3.351.505</b> | <b>5,38</b>                  |
| <b>Peruanischer Sol</b>  |  |        |                       |                  |                              |
| 71.000   | Peru Government Bond*                    | 5,35 % | 12.08.2040            | 16.315           | 0,03                         |
| 86.000   | Peru Government Bond*                    | 5,40 % | 12.08.2034            | 20.960           | 0,03                         |
| 308.000  | Peru Government Bond*                    | 5,94 % | 12.02.2029            | 83.342           | 0,13                         |
| 625.000  | Peru Government Bond*                    | 6,15 % | 12.08.2032            | 164.780          | 0,26                         |
| 253.000  | Peru Government Bond*                    | 7,30 % | 12.08.2033            | 71.832           | 0,12                         |
| 44.000   | Peruvian Government International Bond** | 5,20 % | 12.09.2023            | 12.103           | 0,02                         |
| 56.000   | Peruvian Government International Bond*  | 5,40 % | 12.08.2034            | 13.649           | 0,02                         |
| 724.000  | Peruvian Government International Bond** | 6,90 % | 12.08.2037            | 196.977          | 0,32                         |
| <b>Peruanischer Sol insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>579.958</b>   | <b>0,93</b>                  |

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                            | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 79,73 % (31. Dezember 2022: 77,91 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                  |                              |
| <b>Polnischer Zloty</b>  |  |        |                       |                  |                              |
| 95.000   | Republic of Poland Government Bond <sup>*</sup>  | 0,25 % | 25.10.2026            | 19.637           | 0,03                         |
| 1.468.000  | Republic of Poland Government Bond <sup>**</sup> | 1,25 % | 25.10.2030            | 269.518          | 0,43                         |
| 680.000  | Republic of Poland Government Bond <sup>*</sup>  | 1,75 % | 25.04.2032            | 122.219          | 0,20                         |
| 414.000  | Republic of Poland Government Bond <sup>*</sup>  | 2,50 % | 25.07.2026            | 92.999           | 0,15                         |
| 609.000  | Republic of Poland Government Bond <sup>*</sup>  | 2,50 % | 25.07.2027            | 133.091          | 0,21                         |
| 1.020.000  | Republic of Poland Government Bond <sup>*</sup>  | 2,75 % | 25.10.2029            | 214.165          | 0,34                         |
| 143.000  | Republic of Poland Government Bond <sup>**</sup> | 3,25 % | 25.07.2025            | 33.499           | 0,05                         |
| 482.000  | Republic of Poland Government Bond <sup>*</sup>  | 6,00 % | 25.10.2033            | 121.178          | 0,20                         |
| 673.000  | Republic of Poland Government Bond <sup>*</sup>  | 7,50 % | 25.07.2028            | 178.928          | 0,29                         |
| <b>Polnischer Zloty insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>1.185.234</b> | <b>1,90</b>                  |
| <b>Rumänischer neuer Leu</b>   |  |        |                       |                  |                              |
| 1.380.000  | Romania Government Bond <sup>*</sup>             | 2,50 % | 25.10.2027            | 257.968          | 0,41                         |
| 255.000  | Romania Government Bond <sup>*</sup>             | 3,25 % | 24.06.2026            | 51.451           | 0,08                         |
| 130.000  | Romania Government Bond <sup>*</sup>             | 3,65 % | 24.09.2031            | 23.343           | 0,04                         |
| 290.000  | Romania Government Bond <sup>*</sup>             | 4,15 % | 24.10.2030            | 54.511           | 0,09                         |
| 155.000  | Romania Government Bond <sup>*</sup>             | 4,75 % | 11.10.2034            | 28.778           | 0,05                         |
| 955.000  | Romania Government Bond <sup>**</sup>            | 4,85 % | 25.07.2029            | 191.132          | 0,31                         |
| 5.000  | Romania Government Bond <sup>*</sup>             | 5,00 % | 12.02.2029            | 1.015            | 0,00                         |
| 125.000  | Romania Government Bond <sup>*</sup>             | 6,70 % | 25.02.2032            | 27.481           | 0,04                         |
| 35.000   | Romania Government Bond <sup>*</sup>             | 7,35 % | 28.04.2031            | 7.968            | 0,01                         |
| <b>Rumänischer neuer Leu insgesamt</b>                                   |  |        |                       | <b>643.647</b>   | <b>1,03</b>                  |
| <b>Thailändischer Baht</b>   |  |        |                       |                  |                              |
| 6.000.000  | Thailand Government Bond <sup>**</sup>           | 0,75 % | 17.09.2024            | 166.512          | 0,27                         |
| 1.500.000  | Thailand Government Bond <sup>**</sup>           | 0,95 % | 17.06.2025            | 41.332           | 0,07                         |
| 3.600.000  | Thailand Government Bond <sup>**</sup>           | 1,00 % | 17.06.2027            | 96.729           | 0,15                         |
| 1.330.000  | Thailand Government Bond <sup>**</sup>           | 1,45 % | 17.12.2024            | 37.151           | 0,06                         |
| 7.188.000  | Thailand Government Bond <sup>*</sup>            | 1,59 % | 17.12.2035            | 178.494          | 0,29                         |
| 7.674.000  | Thailand Government Bond <sup>**</sup>           | 1,60 % | 17.12.2029            | 205.849          | 0,33                         |
| 8.280.000  | Thailand Government Bond <sup>**</sup>           | 2,00 % | 17.12.2031            | 225.942          | 0,36                         |
| 5.600.000  | Thailand Government Bond <sup>**</sup>           | 2,00 % | 17.06.2042            | 135.777          | 0,22                         |
| 10.200.000   | Thailand Government Bond <sup>**</sup>           | 2,65 % | 17.06.2028            | 292.251          | 0,47                         |
| 250.000  | Thailand Government Bond <sup>**</sup>           | 2,88 % | 17.12.2028            | 7.235            | 0,01                         |
| 62.000   | Thailand Government Bond <sup>**</sup>           | 2,88 % | 17.06.2046            | 1.657            | 0,00                         |
| 3.332.000  | Thailand Government Bond <sup>**</sup>           | 3,30 % | 17.06.2038            | 99.002           | 0,16                         |
| 4.800.000  | Thailand Government Bond <sup>**</sup>           | 3,35 % | 17.06.2033            | 144.670          | 0,23                         |
| 3.600.000  | Thailand Government Bond <sup>**</sup>           | 3,39 % | 17.06.2037            | 107.970          | 0,17                         |

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                               | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 79,73 % (31. Dezember 2022: 77,91 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                   |                              |
| <b>Thailändischer Baht (Fortsetzung)</b>                                 |   |        |                       |                   |                              |
| 1.400.000  | Thailand Government Bond**                          | 3,45 % | 17.06.2043            | 41.727            | 0,07                         |
| 200.000  | Thailand Government Bond**                          | 3,78 % | 25.06.2032            | 6.229             | 0,01                         |
| <b>Thailändischer Baht insgesamt</b>                                     |   |        |                       | <b>1.788.527</b>  | <b>2,87</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>   |   |        |                       |                   |                              |
| 200.000  | Abu Dhabi Government International Bond*            | 3,00 % | 15.09.2051            | 142.301           | 0,23                         |
| 200.000  | Bank Gospodarstwa Krajowego*                        | 5,38 % | 22.05.2033            | 199.061           | 0,32                         |
| 800.000  | Bermuda Government International Bond*              | 3,72 % | 25.01.2027            | 764.000           | 1,23                         |
| 400.000  | Bermuda Government International Bond*              | 5,00 % | 15.07.2032            | 391.000           | 0,63                         |
| 231.000  | Chile Government International Bond*                | 2,55 % | 27.07.2033            | 189.346           | 0,30                         |
| 200.000  | Chile Government International Bond*                | 3,25 % | 21.09.2071            | 130.251           | 0,21                         |
| 200.000  | Chile Government International Bond*                | 4,34 % | 07.03.2042            | 178.053           | 0,29                         |
| 200.000  | Export-Import Bank of Korea*                        | 4,50 % | 15.09.2032            | 197.076           | 0,32                         |
| 90.000   | Hungary Government International Bond*              | 7,63 % | 29.03.2041            | 101.694           | 0,16                         |
| 200.000  | Indonesia Government International Bond*            | 4,85 % | 11.01.2033            | 199.525           | 0,32                         |
| 150.000  | Indonesia Government International Bond*            | 6,63 % | 17.02.2037            | 171.196           | 0,27                         |
| 1.710.000  | Indonesia Government International Bond*            | 8,50 % | 12.10.2035            | 2.226.758         | 3,57                         |
| 359.000  | Korea Mine Rehabilitation & Mineral Resources Corp* | 1,75 % | 15.04.2026            | 320.214           | 0,51                         |
| 250.000  | Malaysia Wakala Sukuk Bhd                           | 3,08 % | 28.04.2051            | 192.054           | 0,31                         |
| 200.000  | Mexico Government International Bond*               | 4,88 % | 19.05.2033            | 191.212           | 0,31                         |
| 1.326.000  | Mexico Government International Bond*               | 5,75 % | 12.10.2110            | 1.186.662         | 1,90                         |
| 200.000  | Mexico Government International Bond*               | 6,35 % | 09.02.2035            | 210.758           | 0,34                         |
| 588.000  | Panama Government International Bond*               | 4,50 % | 19.01.2063            | 431.663           | 0,69                         |
| 400.000  | Panama Government International Bond*               | 6,40 % | 14.02.2035            | 418.132           | 0,67                         |
| 2.008.000  | Panama Government International Bond*               | 6,70 % | 26.01.2036            | 2.155.097         | 3,46                         |
| 430.000  | Panama Government International Bond*               | 9,38 % | 01.04.2029            | 518.986           | 0,83                         |
| 1.730.000  | Peruvian Government International Bond*             | 8,75 % | 21.11.2033            | 2.198.133         | 3,53                         |
| 200.000  | Philippine Government International Bond*           | 6,38 % | 23.10.2034            | 223.722           | 0,36                         |
| 660.000  | Philippine Government International Bond*           | 9,50 % | 02.02.2030            | 828.501           | 1,33                         |
| 290.000  | Romanian Government International Bond*             | 7,13 % | 17.01.2033            | 307.850           | 0,49                         |
| 124.000  | Romanian Government International Bond*             | 7,63 % | 17.01.2053            | 136.613           | 0,22                         |
| 480.000  | UAE International Government Bond*                  | 4,95 % | 07.07.2052            | 476.700           | 0,77                         |
| 600.000  | Uruguay Government International Bond*              | 4,38 % | 23.01.2031            | 592.564           | 0,95                         |
| 280.000  | Uruguay Government International Bond*              | 5,10 % | 18.06.2050            | 279.696           | 0,45                         |
| 300.000  | Uruguay Government International Bond*              | 7,88 % | 15.01.2033            | 370.548           | 0,59                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |   |        |                       | <b>15.929.366</b> | <b>25,56</b>                 |

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                  | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 79,73 % (31. Dezember 2022: 77,91 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                   |                              |
| <b>Uruguayischer Peso</b>  |  |        |                       |                   |                              |
| 3.034.144  | Uruguay Government International Bond* | 8,25 % | 21.05.2031            | 74.971            | 0,12                         |
| 5.908.000  | Uruguay Government International Bond* | 8,50 % | 15.03.2028            | 150.723           | 0,24                         |
| <b>Uruguayischer Peso insgesamt</b>                                      |  |        |                       | <b>225.694</b>    | <b>0,36</b>                  |
| <b>Staatsanleihen insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>49.700.225</b> | <b>79,73</b>                 |
| <b>Anlagen insgesamt</b>   |  |        |                       | <b>57.947.629</b> | <b>92,96</b>                 |

Devisenterminkontrakte 0,45 % (31. Dezember 2022: 0,83 %)

| Geforderter<br>Betrag | Zu zahlender<br>Betrag | Fälligkeits-<br>datum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|-----------------------|------------------------|-----------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------------|------------------------------|
| 748.409 CNH           | 103.001 US\$           | 20.07.2023            | Morgan Stanley                 | 1         | 3                                    | 0,00                         |
| 3.357.301 CZK         | 139.527 €              | 20.09.2023            | Citibank NA                    | 1         | 821                                  | 0,00                         |
| 1.095.397 CZK         | 45.677 €               | 20.09.2023            | Goldman Sachs International    | 1         | 101                                  | 0,00                         |
| 95.898 €              | 36.034.065 HUF         | 11.08.2023            | BNP Paribas                    | 1         | 530                                  | 0,00                         |
| 399.755 €             | 436.243 US\$           | 03.08.2023            | Citibank NA                    | 1         | 570                                  | 0,00                         |
| 277.467 €             | 297.004 US\$           | 05.07.2023            | Citibank NA                    | 2         | 5.712                                | 0,01                         |
| 102.207 €             | 110.452 US\$           | 05.07.2023            | Goldman Sachs International    | 1         | 1.056                                | 0,00                         |
| 486.486 €             | 524.564 US\$           | 05.07.2023            | JPMorgan Chase Bank            | 2         | 6.193                                | 0,01                         |
| 34.451.473 HUF        | 91.114 €               | 01.08.2023            | Citibank NA                    | 1         | 418                                  | 0,00                         |
| 34.424.327 HUF        | 91.294 €               | 01.08.2023            | HSBC Bank Plc                  | 1         | 142                                  | 0,00                         |
| 8.369.842 INR         | 101.776 US\$           | 20.07.2023            | BNP Paribas                    | 1         | 168                                  | 0,00                         |
| 1.423.682 MXN         | 81.553 US\$            | 20.09.2023            | State Street Bank and Trust Co | 1         | 220                                  | 0,00                         |
| 535.107 PHP           | 9.529 US\$             | 20.09.2023            | HSBC Bank Plc                  | 1         | 127                                  | 0,00                         |
| 1.074.403 PLN         | 237.625 €              | 20.09.2023            | Goldman Sachs International    | 1         | 3.151                                | 0,01                         |
| 890.570 PLN           | 198.851 €              | 20.09.2023            | Morgan Stanley                 | 2         | 548                                  | 0,00                         |
| 2.595.407 RON         | 519.728 €              | 25.07.2023            | Goldman Sachs International    | 3         | 2.965                                | 0,01                         |
| 35.057 US\$           | 28.368.809 CLP         | 20.09.2023            | Barclays Bank Plc              | 1         | 27                                   | 0,00                         |
| 278.768 US\$          | 1.182.506.661 COP      | 20.09.2023            | Barclays Bank Plc              | 1         | 1.541                                | 0,00                         |
| 85.557 US\$           | 2.566.954 TWD          | 06.07.2023            | BNP Paribas                    | 1         | 3.144                                | 0,01                         |
| 45.147 US\$           | 1.572.802 THB          | 06.07.2023            | BNP Paribas                    | 1         | 782                                  | 0,00                         |
| 235.302 US\$          | 1.686.373 CNH          | 20.07.2023            | BNP Paribas                    | 1         | 3.206                                | 0,01                         |
| 98.734 US\$           | 3.024.702 TWD          | 17.07.2023            | Citibank NA                    | 1         | 1.676                                | 0,00                         |
| 573.963 US\$          | 521.921 €              | 05.07.2023            | Citibank NA                    | 2         | 4.547                                | 0,01                         |
| 29.431 US\$           | 870.392 TWD            | 06.07.2023            | Citibank NA                    | 1         | 1.487                                | 0,00                         |
| 102.400 US\$          | 93.383 €               | 05.07.2023            | Goldman Sachs International    | 1         | 519                                  | 0,00                         |
| 32.715 US\$           | 41.529.967 KRW         | 20.09.2023            | HSBC Bank Plc                  | 1         | 1.060                                | 0,00                         |
| 24.543 US\$           | 824.619 THB            | 06.07.2023            | HSBC Bank Plc                  | 1         | 1.282                                | 0,00                         |
| 104.485 US\$          | 1.813.209 MXN          | 20.09.2023            | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 338                                  | 0,00                         |
| 101.235 US\$          | 3.107.313 TWD          | 13.07.2023            | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 1.529                                | 0,00                         |
| 150.871 US\$          | 691.707 MYR            | 20.09.2023            | JPMorgan Chase Bank            | 2         | 1.906                                | 0,00                         |

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 0,45 % (31. Dezember 2022: 0,83 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 91.984 US\$   | 84.066 €            | 05.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 2         | 268                            | 0,00                 |
| 151.332 US\$  | 2.260.585.800 IDR   | 20.09.2023       | Morgan Stanley              | 2         | 1.177                          | 0,00                 |
| 218.320 US\$  | 3.255.804.961 IDR   | 20.09.2023       | Standard Chartered Bank     | 1         | 2.060                          | 0,01                 |
| 56.201 US\$   | 401.276 CNH         | 20.09.2023       | Standard Chartered Bank     | 2         | 677                            | 0,00                 |
| 1.985.832 UYU   | 49.534 US\$         | 10.08.2023       | Citibank NA                 | 1         | 3.287                          | 0,01                 |
| <i>Abgesicherte Klassen NOK</i>   |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 124.696.613 NOK   | 11.588.124 US\$     | 14.09.2023       | Goldman Sachs International | 1         | 80.852                         | 0,13                 |
| 139.379.038 NOK   | 12.902.069 US\$     | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 7         | 140.873                        | 0,23                 |
| 229.986 US\$  | 2.419.556 NOK       | 14.09.2023       | Citibank NA                 | 1         | 3.566                          | 0,00                 |
| 808 US\$  | 8.625 NOK           | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 2         | 1                              | 0,00                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                             |           | <b>278.530</b>                 | <b>0,45</b>          |

### Futures-Kontrakte 0,30 % (31. Dezember 2022: 1,12 %)

| Anzahl Kontrakte  | Beschreibung   | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|--|--------------------------------|----------------------|
| (25)  | Euro-BOBL Future September 2023                      | 46.989                         | 0,07                 |
| (60)  | Euro-Bund Future September 2023                      | 99.281                         | 0,16                 |
| (1)   | US Treasury 10-Year Note (CBT) Future September 2023 | 8.469                          | 0,01                 |
| 34  | US Treasury Ultra Bond (CBT) Future September 2023   | 35.461                         | 0,06                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten *</b> |  | <b>190.200</b>                 | <b>0,30</b>          |

### Zinsswap-Kontrakte 0,04 % (31. Dezember 2022: 0,08 %)

| Nominalwert     | Fälligkeit | Gegenpartei                              | Erhalt/(Zahlung) <sup>#</sup> | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------------|------------|--|-------------------------------|-----------------|--------------------|--------------------------------|----------------------|
| COP 186.628.026 | 31.01.2027 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | Erhalt                        | 7,14 %          | 1D COOVIBR         | 1.163                          | 0,00                 |
| COP 711.742.190 | 13.04.2024 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | Erhalt                        | 8,37 %          | 1D COOVIBR         | 4.115                          | 0,01                 |
| COP 193.997.409 | 06.01.2027 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | Erhalt                        | 6,40 %          | 1D COOVIBR         | 2.248                          | 0,01                 |
| COP 125.606.377 | 07.01.2027 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | Erhalt                        | 6,45 %          | 1D COOVIBR         | 1.407                          | 0,00                 |
| MXN 614.956     | 10.11.2031 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | Erhalt                        | 7,38 %          | 28D MXIBTIE        | 1.575                          | 0,00                 |
| MXN 494.101     | 10.11.2031 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | Erhalt                        | 7,35 %          | 28D MXIBTIE        | 1.317                          | 0,00                 |
| CLP 6.474.990   | 05.06.2030 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | Erhalt                        | 2,33 %          | 1D CLICP           | 1.305                          | 0,00                 |
| CZK 2.670.301   | 17.04.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 5,05 %          | 6M PRIBOR          | 2.714                          | 0,01                 |
| ILS 366.741     | 09.03.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 4,30 %          | 3M TELBOR          | 2.418                          | 0,01                 |
| CZK 5.570.824   | 11.05.2028 | Merrill Lynch International <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 4,69 %          | 6M PRIBOR          | 1.865                          | 0,00                 |
| CZK 5.519.475   | 11.04.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 4,70 %          | 6M PRIBOR          | 1.856                          | 0,00                 |
| HUF 10.476.841  | 10.02.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 8,72 %          | 6M BUBOR           | 922                            | 0,00                 |
| CZK 967.666     | 21.04.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 5,01 %          | 6M PRIBOR          | 912                            | 0,00                 |
| HUF 98.252.972  | 03.07.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 10,29 %         | 6M BUBOR           | 571                            | 0,00                 |

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Zinsswap-Kontrakte 0,04 % (31. Dezember 2022: 0,08 %) (Fortsetzung)

|  | Nominalwert | Fälligkeit | Gegenpartei                   | Erhalt/(Zahlung) <sup>#</sup> | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|-------------|------------|-------------------------------|-------------------------------|-----------------|--------------------|--------------------------------|----------------------|
| PLN  | 537.398     | 29.06.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | Erhalt                        | 4,97 %          | 6M WIBOR           | 113                            | 0,00                 |
| THB  | 7.200.000   | 12.01.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | Erhalt                        | 1,89 %          | 1D THOR            | 37                             | 0,00                 |
| THB  | 3.000.000   | 12.01.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | Erhalt                        | 2,18 %          | 1D THOR            | 29                             | 0,00                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Zinsswapkontrakten <sup>∞</sup></b> |             |            |                               |                               |                 |                    | <b>24.567</b>                  | <b>0,04</b>          |

<sup>#</sup>Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

|  | Zeitwert US\$     | % des Nettovermögens |
|--|-------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> | <b>58.440.926</b> | <b>93,75</b>         |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (0,78 %) (31. Dezember 2022: (0,63 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 16.784.407 CLP     | 20.732 US\$         | 20.09.2023       | Standard Chartered Bank     | 1         | (6)                             | (0,00)               |
| 765.449 CNH        | 107.716 US\$        | 20.09.2023       | Barclays Bank Plc           | 1         | (1.801)                         | (0,00)               |
| 2.008.322 CNH      | 280.088 US\$        | 20.07.2023       | BNP Paribas                 | 2         | (3.682)                         | (0,01)               |
| 5.354.439 CNH      | 752.270 US\$        | 20.09.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (11.381)                        | (0,02)               |
| 324.285 €          | 1.613.082 RON       | 25.07.2023       | Citibank NA                 | 3         | (459)                           | (0,00)               |
| 213.065 €          | 234.016 US\$        | 05.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 2         | (1.562)                         | (0,00)               |
| 57.721 €           | 287.173 RON         | 25.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | (93)                            | (0,00)               |
| 40.523 €           | 971.610 CZK         | 20.09.2023       | Morgan Stanley              | 1         | (81)                            | (0,00)               |
| 83.757.885 HUF     | 222.115 €           | 11.08.2023       | Citibank NA                 | 2         | (366)                           | (0,00)               |
| 10.524.489 HUF     | 27.927 €            | 11.08.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (65)                            | (0,00)               |
| 10.285.145 HUF     | 27.361 €            | 01.08.2023       | Morgan Stanley              | 1         | (49)                            | (0,00)               |
| 10.788.308 HUF     | 28.576 €            | 11.08.2023       | Standard Chartered Bank     | 1         | (11)                            | (0,00)               |
| 1.523.992.611 IDR  | 102.384 US\$        | 07.07.2023       | Citibank NA                 | 1         | (820)                           | (0,00)               |
| 1.520.371.316 IDR  | 101.679 US\$        | 20.07.2023       | HSBC Bank Plc               | 1         | (587)                           | (0,00)               |
| 986.243.840 IDR    | 65.561 US\$         | 20.09.2023       | HSBC Bank Plc               | 1         | (52)                            | (0,00)               |
| 469.072.479 IDR    | 31.170 US\$         | 20.09.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | (12)                            | (0,00)               |
| 1.061.506.748 IDR  | 71.489 US\$         | 07.07.2023       | Morgan Stanley              | 1         | (746)                           | (0,00)               |
| 1.093.789 MYR      | 237.710 US\$        | 20.09.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 2         | (2.153)                         | (0,00)               |
| 1.697.196 THB      | 48.753 US\$         | 06.07.2023       | BNP Paribas                 | 1         | (880)                           | (0,00)               |
| 7.930.762 THB      | 243.411 US\$        | 06.07.2023       | Citibank NA                 | 2         | (19.705)                        | (0,03)               |
| 6.112.345 THB      | 177.693 US\$        | 20.09.2023       | Goldman Sachs International | 2         | (3.964)                         | (0,01)               |



## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (0,78 %) (31. Dezember 2022: (0,63 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 1.407.718 THB  | 43.096 US\$         | 06.07.2023       | Morgan Stanley                 | 1         | (3.388)                         | (0,01)               |
| 5.737.094 THB  | 177.900 US\$        | 06.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | (16.071)                        | (0,03)               |
| 934.192 TWD  | 31.620 US\$         | 06.07.2023       | HSBC Bank Plc                  | 1         | (1.628)                         | (0,00)               |
| 2.481.605 TWD  | 85.674 US\$         | 06.07.2023       | Morgan Stanley                 | 1         | (6.001)                         | (0,01)               |
| 494.884 US\$   | 454.728 €           | 05.07.2023       | Citibank NA                    | 2         | (1.225)                         | (0,00)               |
| 13.023 US\$  | 47.671 PEN          | 18.08.2023       | Citibank NA                    | 1         | (77)                            | (0,00)               |
| 40.184 US\$  | 37.137 €            | 05.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | (333)                           | (0,00)               |
| 25.553 US\$  | 968.347 UYU         | 10.08.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | (204)                           | (0,00)               |
| 109.785 US\$   | 468.932.460 COP     | 20.09.2023       | Goldman Sachs International    | 3         | (150)                           | (0,00)               |
| 47.313 US\$  | 1.789.973 UYU       | 10.08.2023       | HSBC Bank Plc                  | 2         | (298)                           | (0,00)               |
| 339.523 US\$   | 313.846 €           | 05.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 4         | (2.883)                         | (0,01)               |
| 104.658 US\$   | 96.065 €            | 03.08.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (313)                           | (0,00)               |
| 64.767 US\$  | 1.133.111 MXN       | 20.09.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (317)                           | (0,00)               |
| 71.668 US\$  | 1.250.985 MXN       | 20.09.2023       | Morgan Stanley                 | 1         | (186)                           | (0,00)               |
| 15.299.147 US\$  | 14.298.858 €        | 05.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 2         | (300.912)                       | (0,48)               |
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i>  |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 7.705.520 AUD  | 5.190.480 US\$      | 14.09.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (50.867)                        | (0,08)               |
| 160.871 AUD  | 107.634 US\$        | 14.09.2023       | Citibank NA                    | 1         | (332)                           | (0,00)               |
| 7.705.520 AUD  | 5.187.011 US\$      | 14.09.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (47.397)                        | (0,08)               |
| <i>Abgesicherte Klassen NOK</i>  |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 2.507.065 NOK  | 235.293 US\$        | 14.09.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | (684)                           | (0,00)               |
| 1.263.507 NOK  | 119.260 US\$        | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp           | 2         | (1.022)                         | (0,00)               |
| 149.722 US\$   | 1.611.117 NOK       | 14.09.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | (1.045)                         | (0,00)               |
| 179.688 US\$   | 1.942.947 NOK       | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp           | 2         | (2.130)                         | (0,01)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                                |           | <b>(485.938)</b>                | <b>(0,78)</b>        |

### Futures-Kontrakte (0,31 %) (31. Dezember 2022: (0,12 %))

| Anzahl Kontrakte  | Beschreibung   | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|--|---------------------------------|----------------------|
| (9)   | Euro-Buxl 30-Year Bond Future September 2023         | (12.568)                        | (0,02)               |
| 5   | Euro-Schatz Future September 2023                    | (5.128)                         | (0,01)               |
| 18  | South Korea 3-Year Bond Future September 2023        | (3.552)                         | (0,01)               |
| 3   | US Treasury 10-Year Note (CBT) Future September 2023 | (953)                           | (0,00)               |
| 13  | US Treasury 2-Year Note (CBT) Future September 2023  | (38.086)                        | (0,06)               |
| 69  | US Treasury 5-Year Note (CBT) Future September 2023  | (125.642)                       | (0,20)               |
| 22  | US Treasury Long Bond (CBT) Future September 2023    | (5.508)                         | (0,01)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten <sup>*</sup></b> |  | <b>(191.437)</b>                | <b>(0,31)</b>        |

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Zinsswap-Kontrakte (0,08 %) (31. Dezember 2022: (0,25 %))

|   | Nominalwert   | Fälligkeit | Gegenpartei                              | Erhalt/(Zahlung) <sup>#</sup> | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------|------------|--|-------------------------------|-----------------|--------------------|---------------------------------|----------------------|
| ILS   | 82.175        | 06.04.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 3,64 %          | 3M TELBOR          | (64)                            | (0,00)               |
| PLN   | 571.512       | 29.06.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 5,01 %          | 6M WIBOR           | (170)                           | (0,00)               |
| ILS   | 851.622       | 15.06.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 3,68 %          | 3M TELBOR          | (170)                           | (0,00)               |
| HUF   | 149.208.087   | 03.07.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 10,43 %         | 6M BUBOR           | (176)                           | (0,00)               |
| CZK   | 3.260.043     | 27.01.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 4,52 %          | 6M PRIBOR          | (352)                           | (0,00)               |
| PLN   | 535.914       | 03.07.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 5,05 %          | 6M WIBOR           | (359)                           | (0,00)               |
| PLN   | 538.127       | 30.06.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 5,07 %          | 6M WIBOR           | (457)                           | (0,00)               |
| PLN   | 141.220       | 15.05.2033 | Merrill Lynch International <sup>1</sup> | Erhalt                        | 5,20 %          | 6M WIBOR           | (461)                           | (0,00)               |
| PLN   | 141.220       | 15.05.2033 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 5,22 %          | 6M WIBOR           | (521)                           | (0,00)               |
| ILS   | 521.348       | 06.01.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 3,47 %          | 3M TELBOR          | (1.513)                         | (0,00)               |
| MXN   | 6.749.247     | 25.03.2026 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 9,33 %          | 28D MXIBTIIE       | (1.555)                         | (0,00)               |
| ILS   | 241.555       | 27.01.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 3,14 %          | 3M TELBOR          | (1.563)                         | (0,00)               |
| ILS   | 540.233       | 09.01.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 3,47 %          | 3M TELBOR          | (1.575)                         | (0,00)               |
| CLP   | 94.826.734    | 13.04.2025 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | Erhalt                        | 7,51 %          | 1D CLICP           | (1.288)                         | (0,00)               |
| MXN   | 1.855.718     | 02.06.2033 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 8,35 %          | 28D MXIBTIIE       | (1.906)                         | (0,00)               |
| CZK   | 5.110.007     | 23.01.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 4,35 %          | 6M PRIBOR          | (2.132)                         | (0,00)               |
| MXN   | 4.046.686     | 07.01.2028 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 8,07 %          | 28D MXIBTIIE       | (3.065)                         | (0,01)               |
| MXN   | 4.427.182     | 07.01.2028 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 8,09 %          | 28D MXIBTIIE       | (3.122)                         | (0,01)               |
| COP   | 129.448.750   | 11.08.2032 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | Erhalt                        | 9,02 %          | 1D COOVIBR         | (3.211)                         | (0,01)               |
| CLP   | 17.013.289    | 09.11.2025 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 1,24 %          | 1D CLICP           | (2.335)                         | (0,00)               |
| CZK   | 3.639.165     | 06.12.2027 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 4,51 %          | 6M PRIBOR          | (693)                           | (0,00)               |
| ILS   | 1.306.804     | 16.01.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 3,10 %          | 3M TELBOR          | (9.030)                         | (0,02)               |
| COP   | 4.000.000.000 | 07.06.2025 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | Erhalt                        | 10,29 %         | 1D COOVIBR         | (16.999)                        | (0,03)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Zinsswapkontrakten <sup>∞</sup></b> |               |            |  |                               |                 |                    | <b>(52.717)</b>                 | <b>(0,08)</b>        |

<sup>#</sup>Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

|   | Zeitwert US\$     | % des Nettovermögens |
|---|-------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(730.092)</b>  | <b>(1,17)</b>        |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>57.710.834</b> | <b>92,58</b>         |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>4.628.099</b>  | <b>7,42</b>          |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>62.338.933</b> | <b>100,00</b>        |

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

| Portfolioanalyse  | US\$              | % des<br>Gesamtver-<br>mögens |
|---|-------------------|-------------------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 50.581.370        | 79,85                         |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden            | 7.366.259         | 11,63                         |
| ± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden                          | (1.237)           | (0,00)                        |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap                            | (235.558)         | (0,37)                        |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>57.710.834</b> | <b>91,11</b>                  |

## Emerging Markets Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der<br>Anteile                              | Wertpapierbezeichnung                               | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|-------------------|------------------------------|
| <b>Aktien 95,69 % (31. Dezember 2022: 98,40 %)</b> |   |                   |                              |
| <b>Brasilianischer Real</b>                        |   |                   |                              |
| 270.448  | B3 SA - Brasil Bolsa Balcao*                        | 819.081           | 0,69                         |
| 109.567  | Hypera SA*  | 1.045.020         | 0,87                         |
| 268.601  | Itau Unibanco Holding SA - Preferred Shares*        | 1.582.429         | 1,33                         |
| 216.782  | Petroleo Brasileiro SA - Preferred Shares*          | 1.327.026         | 1,11                         |
| <b>Brasilianischer Real insgesamt</b>              |   | <b>4.773.556</b>  | <b>4,00</b>                  |
| <b>Kanadischer Dollar</b>                          |   |                   |                              |
| 37.633   | Parex Resources Inc**                               | 755.362           | 0,63                         |
| <b>Kanadischer Dollar insgesamt</b>                |   | <b>755.362</b>    | <b>0,63</b>                  |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi</b>                  |   |                   |                              |
| 336.700  | Bank of Ningbo Co Ltd Class A*                      | 1.173.213         | 0,98                         |
| 374.600  | CITIC Securities Co Ltd Class A*                    | 1.020.688         | 0,86                         |
| 331.000  | Foxconn Industrial Internet Co Ltd Class A*         | 1.146.456         | 0,96                         |
| 5.186  | Kweichow Moutai Co Ltd Class A*                     | 1.207.092         | 1,01                         |
| 145.000  | Midea Group Co Ltd Class A*                         | 1.176.920         | 0,99                         |
| 369.504  | NARI Technology Co Ltd Class A*                     | 1.174.885         | 0,98                         |
| 129.300  | Shenzhen Inovance Technology Co Ltd Class A*        | 1.144.375         | 0,96                         |
| 642.634  | Shenzhen Topband Co Ltd Class A*                    | 1.155.992         | 0,97                         |
| 55.400   | Sungrow Power Supply Co Ltd Class A*                | 891.077           | 0,75                         |
| 199.847  | Zhejiang Juhua Co Ltd Class A*                      | 379.009           | 0,32                         |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt</b>        |   | <b>10.469.707</b> | <b>8,78</b>                  |
| <b>Hongkong-Dollar</b>                             |   |                   |                              |
| 408.924  | Alibaba Group Holding Ltd*                          | 4.256.504         | 3,57                         |
| 37.500   | BYD Co Ltd - H Shares*                              | 1.202.333         | 1,01                         |
| 352.000  | China Mengniu Dairy Co Ltd*                         | 1.330.208         | 1,12                         |
| 161.000  | Galaxy Entertainment Group Ltd*                     | 1.025.607         | 0,86                         |
| 68.100   | H World Group Ltd*                                  | 263.892           | 0,22                         |
| 30.500   | Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd*                 | 1.155.526         | 0,97                         |
| 113.000  | Hua Hong Semiconductor Ltd*                         | 371.797           | 0,31                         |
| 219.500  | Li Ning Co Ltd*                                     | 1.185.249         | 0,99                         |
| 93.000   | Ping An Insurance Group Co of China Ltd - H Shares* | 593.938           | 0,50                         |
| 132.000  | Tencent Holdings Ltd*                               | 5.596.527         | 4,69                         |
| 117.000  | Tsingtao Brewery Co Ltd - H Shares*                 | 1.068.125         | 0,90                         |
| <b>Hongkong-Dollar insgesamt</b>                   |   | <b>18.049.706</b> | <b>15,14</b>                 |
| <b>Ungarischer Forint</b>                          |   |                   |                              |
| 57.495   | Richter Gedeon Nyrt*                                | 1.415.983         | 1,19                         |
| <b>Ungarischer Forint insgesamt</b>                |   | <b>1.415.983</b>  | <b>1,19</b>                  |

## Emerging Markets Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile  | Wertpapierbezeichnung                               | Zeitwert US\$     | % des Nettovermögens |
|---|---|-------------------|----------------------|
| <b>Aktien 95,69% (31. Dezember 2022: 98,40 %) (Fortsetzung)</b> |   |                   |                      |
| <b>Indische Rupie</b>   |   |                   |                      |
| 24.594  | Apollo Hospitals Enterprise Ltd*                    | 1.531.448         | 1,28                 |
| 265.722   | Aptus Value Housing Finance India Ltd*              | 807.094           | 0,68                 |
| 30.410  | Avalon Technologies Ltd*                            | 203.879           | 0,17                 |
| 24.865  | Best Agrolife Ltd*                                  | 350.083           | 0,29                 |
| 675.449   | Bharat Electronics Ltd*                             | 1.033.600         | 0,87                 |
| 308.549   | EPL Ltd*  | 807.451           | 0,68                 |
| 38.521  | GMM Pfaudler Ltd*                                   | 698.126           | 0,59                 |
| 99.028  | HDFC Bank Ltd*                                      | 2.053.419         | 1,72                 |
| 12.807  | Housing Development Finance Corp Ltd*               | 441.610           | 0,37                 |
| 276.179   | ICICI Bank Ltd*                                     | 3.160.617         | 2,65                 |
| 108.290   | IndusInd Bank Ltd*                                  | 1.820.964         | 1,53                 |
| 30.473  | JB Chemicals & Pharmaceuticals Ltd*                 | 881.246           | 0,74                 |
| 18.025  | Larsen & Toubro Ltd*                                | 543.807           | 0,46                 |
| 63.418  | Rainbow Children's Medicare Ltd*                    | 748.805           | 0,63                 |
| 69.150  | Reliance Industries Ltd*                            | 2.157.805         | 1,81                 |
| 88.704  | State Bank of India*                                | 620.733           | 0,52                 |
| 45.609  | Sun Pharmaceutical Industries Ltd*                  | 583.577           | 0,49                 |
| 163.991   | Syrma SGS Technology Ltd*                           | 896.078           | 0,75                 |
|   | <b>Indische Rupie insgesamt</b>                     | <b>19.340.342</b> | <b>16,23</b>         |
| <b>Indonesische Rupiah</b>                                      |   |                   |                      |
| 1.187.700   | Bank Central Asia Tbk PT*                           | 728.415           | 0,61                 |
| 2.055.000   | Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT*               | 1.260.847         | 1,06                 |
|   | <b>Indonesische Rupiah insgesamt</b>                | <b>1.989.262</b>  | <b>1,67</b>          |
| <b>Mexikanischer Peso</b>                                       |   |                   |                      |
| 64.716  | Grupo Aeroportuario del Pacifico SAB de CV Class B* | 1.162.401         | 0,97                 |
| 109.825   | Grupo Financiero Banorte SAB de CV Class O*         | 901.755           | 0,76                 |
| 146.486   | Wal-Mart de Mexico SAB de CV*                       | 579.863           | 0,49                 |
|   | <b>Mexikanischer Peso insgesamt</b>                 | <b>2.644.019</b>  | <b>2,22</b>          |
| <b>Neuer taiwanesischer Dollar</b>                              |   |                   |                      |
| 79.200  | Accton Technology Corp*                             | 890.858           | 0,75                 |
| 70.000  | Chroma ATE Inc*                                     | 564.917           | 0,47                 |
| 288.000   | Chunghwa Telecom Co Ltd*                            | 1.078.680         | 0,90                 |
| 161.425   | Hiwin Technologies Corp*                            | 1.236.239         | 1,04                 |
| 601.000   | Uni-President Enterprises Corp*                     | 1.473.544         | 1,24                 |
| 58.756  | Yageo Corp*   | 930.837           | 0,78                 |
|   | <b>Neuer taiwanesischer Dollar insgesamt</b>        | <b>6.175.075</b>  | <b>5,18</b>          |

## Emerging Markets Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile  | Wertpapierbezeichnung                    | Zeitwert US\$     | % des Nettovermögens |
|---|--|-------------------|----------------------|
| <b>Aktien 95,69% (31. Dezember 2022: 98,40 %) (Fortsetzung)</b> |  |                   |                      |
| <b>Philippinischer Peso</b>                                     |  |                   |                      |
| 372.640   | BDO Unibank Inc*                         | 933.121           | 0,78                 |
| 52.020  | SM Investments Corp*                     | 874.411           | 0,74                 |
|   | <b>Philippinischer Peso insgesamt</b>    | <b>1.807.532</b>  | <b>1,52</b>          |
| <b>Polnischer Zloty</b>   |  |                   |                      |
| 12.946  | Dino Polska SA*                          | 1.512.881         | 1,27                 |
|   | <b>Polnischer Zloty insgesamt</b>        | <b>1.512.881</b>  | <b>1,27</b>          |
| <b>Britisches Pfund</b>   |  |                   |                      |
| 31.042  | Anglo American Plc*                      | 881.259           | 0,74                 |
| 121.516   | Network International Holdings Plc*      | 592.621           | 0,50                 |
| 20.357  | Rio Tinto Plc*                           | 1.290.291         | 1,08                 |
|   | <b>Britisches Pfund insgesamt</b>        | <b>2.764.171</b>  | <b>2,32</b>          |
| <b>Saudi-Arabischer Riyal</b>                                   |  |                   |                      |
| 549.166   | Americana Restaurants International Plc* | 628.267           | 0,53                 |
| 16.424  | Arabian Drilling Co*                     | 679.101           | 0,57                 |
| 126.531   | Saudi Arabian Oil Co*                    | 1.096.018         | 0,92                 |
| 91.412  | Saudi National Bank*                     | 901.572           | 0,75                 |
|   | <b>Saudi-Arabischer Riyal insgesamt</b>  | <b>3.304.958</b>  | <b>2,77</b>          |
| <b>Südafrikanischer Rand</b>                                    |  |                   |                      |
| 108.184   | Absa Group Ltd*                          | 961.565           | 0,81                 |
| 64.510  | Bid Corp Ltd*                            | 1.411.306         | 1,18                 |
| 3.424   | Naspers Ltd Class N*                     | 616.062           | 0,52                 |
|   | <b>Südafrikanischer Rand insgesamt</b>   | <b>2.988.933</b>  | <b>2,51</b>          |
| <b>Südkoreanischer Won</b>                                      |  |                   |                      |
| 20.788  | Hana Financial Group Inc*                | 620.574           | 0,52                 |
| 3.516   | LG Chem Ltd*                             | 1.789.862         | 1,50                 |
| 3.031   | NCSOFT Corp*                             | 682.565           | 0,57                 |
| 12.077  | Orion Corp*                              | 1.101.415         | 0,92                 |
| 130.246   | Samsung Electronics Co Ltd*              | 7.171.772         | 6,02                 |
| 36.231  | Samsung Engineering Co Ltd*              | 781.331           | 0,66                 |
| 27.613  | SK Hynix Inc*                            | 2.426.200         | 2,04                 |
| 21.246  | SK Telecom Co Ltd*                       | 751.805           | 0,63                 |
|   | <b>Südkoreanischer Won insgesamt</b>     | <b>15.325.524</b> | <b>12,86</b>         |
| <b>Thailändischer Baht</b>                                      |  |                   |                      |
| 259.000   | Bangkok Bank PCL*                        | 1.162.575         | 0,98                 |

## Emerging Markets Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile  | Wertpapierbezeichnung                          | Zeitwert US\$      | % des Nettovermögens |
|---|--|--------------------|----------------------|
| <b>Aktien 95,69% (31. Dezember 2022: 98,40 %) (Fortsetzung)</b> |  |                    |                      |
| <b>Thailändischer Baht (Fortsetzung)</b>                        |  |                    |                      |
| 133.700   | PTT Exploration & Production PCL*              | 565.740            | 0,47                 |
| <b>Thailändischer Baht insgesamt</b>                            |  | <b>1.728.315</b>   | <b>1,45</b>          |
| <b>VAE-Dirham</b>   |  |                    |                      |
| 1.130.513   | Adnoc Gas Plc*                                 | 951.343            | 0,80                 |
| 463.910   | Dubai Islamic Bank PJSC*                       | 693.448            | 0,58                 |
| <b>Gesamt VAE-Dirham</b>  |  | <b>1.644.791</b>   | <b>1,38</b>          |
| <b>US-Dollar</b>  |  |                    |                      |
| 6.263   | Baidu Inc ADR*                                 | 857.467            | 0,72                 |
| 9.893   | Credicorp Ltd*                                 | 1.460.603          | 1,23                 |
| 5.050   | Globant SA*                                    | 907.586            | 0,76                 |
| 14.014  | H World Group Ltd ADR*                         | 543.463            | 0,46                 |
| 57.373  | Pagseguro Digital Ltd Class A*                 | 541.601            | 0,45                 |
| 11.738  | PDD Holdings Inc ADR*                          | 811.565            | 0,68                 |
| 9.176   | Sociedad Quimica y Minera de Chile SA ADR*     | 666.361            | 0,56                 |
| 105.045   | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR* | 10.601.142         | 8,89                 |
| 27.978  | Trip.com Group Ltd ADR*                        | 979.230            | 0,82                 |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>                                      |  | <b>17.369.018</b>  | <b>14,57</b>         |
| <b>Aktien insgesamt</b>   |  | <b>114.059.135</b> | <b>95,69</b>         |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  |  | <b>114.059.135</b> | <b>95,69</b>         |

Devisenterminkontrakte 0,27 % (31. Dezember 2022: 0,55 %)

| Geforderter Betrag              | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 85.538 AUD                      | 56.727 US\$         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 4         | 237                            | 0,00                 |
| 30.433 AUD                      | 19.986 US\$         | 20.07.2023       | UBS AG                      | 2         | 281                            | 0,00                 |
| 31.974 AUD                      | 21.149 US\$         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 12        | 143                            | 0,00                 |
| 47.067 US\$                     | 69.923 AUD          | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 3         | 501                            | 0,00                 |
| 3.960.478 US\$                  | 5.880.137 AUD       | 20.07.2023       | UBS AG                      | 2         | 44.545                         | 0,04                 |
| 153.591 US\$                    | 226.813 AUD         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 18        | 2.544                          | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen CAD</i> |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 996.422 CAD                     | 741.793 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 10        | 11.397                         | 0,01                 |
| 6.226.013 CAD                   | 4.630.769 US\$      | 20.07.2023       | Royal Bank of Canada        | 5         | 75.439                         | 0,06                 |
| 65.670 CAD                      | 48.554 US\$         | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | 1.086                          | 0,00                 |
| 5.791.606 CAD                   | 4.314.016 US\$      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 1         | 63.826                         | 0,06                 |
| 102.869 US\$                    | 135.491 CAD         | 20.07.2023       | Royal Bank of Canada        | 1         | 452                            | 0,00                 |
| 103.653 US\$                    | 136.158 CAD         | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | 732                            | 0,00                 |
| 111.765 US\$                    | 147.040 CAD         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 1         | 619                            | 0,00                 |

## Emerging Markets Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Devisenterminkontrakte 0,27 % (31. Dezember 2022: 0,55 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens                  |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|---------------------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                                       |
| 62.696 €   | 67.376 US\$         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 3         | 1.078                          | 0,00                                  |
| 24.054 €   | 26.153 US\$         | 20.07.2023       | UBS AG                      | 2         | 111                            | 0,00                                  |
| 67.379 €   | 72.890 US\$         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 6         | 676                            | 0,00                                  |
| 13.685 US\$  | 12.317 €            | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | 236                            | 0,00                                  |
| 107.163 US\$   | 97.120 €            | 20.07.2023       | UBS AG                      | 5         | 1.122                          | 0,00                                  |
| 4.182.404 US\$   | 3.807.717 €         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 7         | 24.954                         | 0,02                                  |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                                       |
| 27.021 £   | 33.917 US\$         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 7         | 440                            | 0,00                                  |
| 11.749 £   | 14.680 US\$         | 20.07.2023       | UBS AG                      | 2         | 259                            | 0,00                                  |
| 505.960 £  | 631.460 US\$        | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 10        | 11.861                         | 0,01                                  |
| 15.094 US\$  | 11.843 £            | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 2         | 36                             | 0,00                                  |
| 8.190 US\$   | 6.436 £             | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 2         | 6                              | 0,00                                  |
| <i>Abgesicherte Klassen ZAR</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                                       |
| 1.842.555 US\$   | 33.442.467 ZAR      | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 6         | 75.078                         | 0,06                                  |
| 41.844 US\$  | 777.028 ZAR         | 20.07.2023       | UBS AG                      | 2         | 777                            | 0,00                                  |
| 184.296 US\$   | 3.391.969 ZAR       | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 17        | 5.025                          | 0,01                                  |
| 2.088.847 ZAR  | 107.745 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 5         | 2.654                          | 0,00                                  |
| 302.691 ZAR  | 15.313 US\$         | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | 685                            | 0,00                                  |
| 1.365.080 ZAR  | 70.226 US\$         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 20        | 1.920                          | 0,00                                  |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>                        |                     |                  |                             |           | <b>328.720</b>                 | <b>0,27</b>                           |
|  |                     |                  |                             |           | <b>Zeitwert<br/>US\$</b>       | <b>% des<br/>Netto-<br/>vermögens</b> |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> |                     |                  |                             |           | <b>114.387.855</b>             | <b>95,96</b>                          |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

## Devisenterminkontrakte (0,24 %) (31. Dezember 2022: (0,35 %))

| Geforderter Betrag              | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 97.597 AUD                      | 66.297 US\$         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 4         | (1.302)                         | (0,00)               |
| 8.212.714 AUD                   | 5.531.415 US\$      | 20.07.2023       | UBS AG                      | 3         | (62.081)                        | (0,05)               |
| 86.331 AUD                      | 58.444 US\$         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 30        | (950)                           | (0,00)               |
| 46.429 US\$                     | 70.488 AUD          | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 3         | (513)                           | (0,00)               |
| 10.748 US\$                     | 16.208 AUD          | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | (46)                            | (0,00)               |
| 33.779 US\$                     | 51.217 AUD          | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 7         | (330)                           | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen CAD</i> |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 178.101 CAD                     | 134.989 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (363)                           | (0,00)               |



## Emerging Markets Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Devisenterminkontrakte (0,24 %) (31. Dezember 2022: (0,35 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens         |
|---|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|------------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen CAD (Fortsetzung)</i>   |                     |                  |                             |           |                                 |                              |
| 115.197 US\$  | 156.582 CAD         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 2         | (3.163)                         | (0,01)                       |
| 597.591 US\$  | 807.156 CAD         | 20.07.2023       | Royal Bank of Canada        | 7         | (12.534)                        | (0,01)                       |
| 170.458 US\$  | 227.924 CAD         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 2         | (1.829)                         | (0,00)                       |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>   |                     |                  |                             |           |                                 |                              |
| 65.666 €  | 72.219 US\$         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 4         | (521)                           | (0,00)                       |
| 2.683.815 €   | 2.942.901 US\$      | 20.07.2023       | UBS AG                      | 5         | (12.582)                        | (0,01)                       |
| 2.653.234 €   | 2.917.692 US\$      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 5         | (20.762)                        | (0,02)                       |
| 61.820 US\$   | 56.863 €            | 20.07.2023       | UBS AG                      | 4         | (266)                           | (0,00)                       |
| 22.247 US\$   | 20.652 €            | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 2         | (302)                           | (0,00)                       |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>   |                     |                  |                             |           |                                 |                              |
| 7.364 £   | 9.437 US\$          | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (74)                            | (0,00)                       |
| 16.504 US\$   | 13.117 £            | 20.07.2023       | UBS AG                      | 4         | (175)                           | (0,00)                       |
| 48.108 US\$   | 38.571 £            | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 9         | (936)                           | (0,00)                       |
| <i>Abgesicherte Klassen ZAR</i>   |                     |                  |                             |           |                                 |                              |
| 69.237 US\$   | 1.348.163 ZAR       | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 4         | (2.014)                         | (0,00)                       |
| 10.803 US\$   | 214.551 ZAR         | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | (536)                           | (0,00)                       |
| 42.679 US\$   | 813.811 ZAR         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 7         | (334)                           | (0,00)                       |
| 73.280.539 ZAR  | 4.039.580 US\$      | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 10        | (166.610)                       | (0,14)                       |
| 618.920 ZAR   | 33.893 US\$         | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | (1.182)                         | (0,00)                       |
| 1.421.092 ZAR   | 77.655 US\$         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 30        | (2.547)                         | (0,00)                       |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>                          |                     |                  |                             |           | <b>(291.952)</b>                | <b>(0,24)</b>                |
|   |                     |                  |                             |           | <b>Zeitwert US\$</b>            | <b>% des Nettovermögens</b>  |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> |                     |                  |                             |           | <b>(291.952)</b>                | <b>(0,24)</b>                |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              |                     |                  |                             |           | <b>114.095.903</b>              | <b>95,72</b>                 |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  |                     |                  |                             |           | <b>5.104.503</b>                | <b>4,28</b>                  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   |                     |                  |                             |           | <b>119.200.406</b>              | <b>100,00</b>                |
| <b>Portfolioanalyse</b>   |                     |                  |                             |           | <b>US\$</b>                     | <b>% des Gesamtvermögens</b> |
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind   |                     |                  |                             |           | 113.303.773                     | 92,88                        |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden              |                     |                  |                             |           | 755.362                         | 0,62                         |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente   |                     |                  |                             |           | 36.768                          | 0,03                         |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  |                     |                  |                             |           | <b>114.095.903</b>              | <b>93,53</b>                 |

## Emerging Markets Select Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der Anteile                                 | Wertpapierbezeichnung                              | Zeitwert US\$     | % des Nettovermögens |
|--|--|-------------------|----------------------|
| <b>Aktien 96,21 % (31. Dezember 2022: 96,44 %)</b> |  |                   |                      |
| <b>Brasilianischer Real</b>                        |  |                   |                      |
| 320.956  | B3 SA - Brasil Bolsa Balcao                        | 972.050           | 1,00                 |
| 89.103   | Hypera SA  | 849.840           | 0,88                 |
| 221.010  | Itau Unibanco Holding SA - Preferred Shares        | 1.302.053         | 1,35                 |
| <b>Brasilianischer Real insgesamt</b>              |  | <b>3.123.943</b>  | <b>3,23</b>          |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi</b>                  |  |                   |                      |
| 275.800  | Bank of Ningbo Co Ltd Class A                      | 961.010           | 0,99                 |
| 335.100  | CITIC Securities Co Ltd Class A                    | 913.061           | 0,94                 |
| 359.500  | Foxconn Industrial Internet Co Ltd Class A         | 1.245.169         | 1,29                 |
| 5.100  | Kweichow Moutai Co Ltd Class A                     | 1.187.075         | 1,23                 |
| 148.200  | Midea Group Co Ltd Class A                         | 1.202.894         | 1,24                 |
| 348.720  | NARI Technology Co Ltd Class A                     | 1.108.800         | 1,15                 |
| 130.900  | Shenzhen Inovance Technology Co Ltd Class A        | 1.158.535         | 1,20                 |
| 527.800  | Shenzhen Topband Co Ltd Class A                    | 949.425           | 0,98                 |
| 60.400   | Sungrow Power Supply Co Ltd Class A                | 971.498           | 1,00                 |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt</b>        |  | <b>9.697.467</b>  | <b>10,02</b>         |
| <b>Hongkong-Dollar</b>                             |  |                   |                      |
| 333.620  | Alibaba Group Holding Ltd                          | 3.472.662         | 3,59                 |
| 30.500   | BYD Co Ltd - H Shares                              | 977.897           | 1,01                 |
| 322.000  | China Mengniu Dairy Co Ltd                         | 1.216.838         | 1,26                 |
| 143.000  | Galaxy Entertainment Group Ltd                     | 910.943           | 0,94                 |
| 55.500   | H World Group Ltd                                  | 215.066           | 0,22                 |
| 27.100   | Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd                 | 1.026.714         | 1,06                 |
| 179.000  | Li Ning Co Ltd                                     | 966.559           | 1,00                 |
| 76.000   | Ping An Insurance Group Co of China Ltd - H Shares | 485.369           | 0,50                 |
| 108.000  | Tencent Holdings Ltd                               | 4.578.977         | 4,73                 |
| 98.888   | Tsingtao Brewery Co Ltd - H Shares                 | 902.775           | 0,94                 |
| <b>Hongkong-Dollar insgesamt</b>                   |  | <b>14.753.800</b> | <b>15,25</b>         |
| <b>Indische Rupie</b>                              |  |                   |                      |
| 22.538   | Apollo Hospitals Enterprise Ltd                    | 1.403.423         | 1,45                 |
| 108.312  | Aptus Value Housing Finance India Ltd              | 328.983           | 0,34                 |
| 127.161  | Axis Bank Ltd                                      | 1.532.116         | 1,58                 |
| 17.913   | Dixon Technologies India Ltd                       | 961.979           | 0,99                 |
| 20.129   | GMM Pfaudler Ltd                                   | 364.803           | 0,38                 |
| 29.989   | Housing Development Finance Corp Ltd               | 1.034.079         | 1,07                 |
| 91.816   | IndusInd Bank Ltd                                  | 1.543.944         | 1,60                 |
| 338  | InterGlobe Aviation Ltd                            | 10.860            | 0,01                 |

## Emerging Markets Select Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile  | Wertpapierbezeichnung                                  | Zeitwert US\$     | % des Nettovermögens |
|---|--|-------------------|----------------------|
| <b>Aktien 96,21% (31. Dezember 2022: 96,44 %) (Fortsetzung)</b> |  |                   |                      |
| <b>Indische Rupie (Fortsetzung)</b>                             |  |                   |                      |
| 19.646  | Larsen & Toubro Ltd                                    | 592.712           | 0,61                 |
| 64.344  | Reliance Industries Ltd                                | 2.007.835         | 2,08                 |
| 21.258  | Syrma SGS Technology Ltd                               | 116.158           | 0,12                 |
|   | <b>Indische Rupie insgesamt</b>                        | <b>9.896.892</b>  | <b>10,23</b>         |
| <b>Indonesische Rupiah</b>                                      |  |                   |                      |
| 2.110.300   | Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT                   | 1.294.777         | 1,34                 |
| 6.570.400   | Kalbe Farma Tbk PT                                     | 899.171           | 0,93                 |
|   | <b>Indonesische Rupiah insgesamt</b>                   | <b>2.193.948</b>  | <b>2,27</b>          |
| <b>Mexikanischer Peso</b>                                       |  |                   |                      |
| 94.169  | Grupo Aeroportuario del Centro Norte SAB de CV Class B | 999.315           | 1,03                 |
| 119.610   | Grupo Financiero Banorte SAB de CV Class O             | 982.099           | 1,02                 |
| 119.653   | Wal-Mart de Mexico SAB de CV                           | 473.645           | 0,49                 |
|   | <b>Mexikanischer Peso insgesamt</b>                    | <b>2.455.059</b>  | <b>2,54</b>          |
| <b>Neuer taiwanesischer Dollar</b>                              |  |                   |                      |
| 75.000  | Accton Technology Corp                                 | 843.615           | 0,87                 |
| 157.000   | Chroma ATE Inc   | 1.267.027         | 1,31                 |
| 235.000   | Chunghwa Telecom Co Ltd                                | 880.173           | 0,91                 |
| 31.000  | Eclat Textile Co Ltd                                   | 498.489           | 0,51                 |
| 129.800   | Hiwin Technologies Corp                                | 994.046           | 1,03                 |
| 507.000   | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd              | 9.365.980         | 9,68                 |
| 568.000   | Uni-President Enterprises Corp                         | 1.392.634         | 1,44                 |
| 47.796  | Yageo Corp   | 757.205           | 0,78                 |
|   | <b>Neuer taiwanesischer Dollar insgesamt</b>           | <b>15.999.169</b> | <b>16,53</b>         |
| <b>Philippinischer Peso</b>                                     |  |                   |                      |
| 304.220   | BDO Unibank Inc  | 761.792           | 0,79                 |
| 42.630  | SM Investments Corp                                    | 716.573           | 0,74                 |
|   | <b>Philippinischer Peso insgesamt</b>                  | <b>1.478.365</b>  | <b>1,53</b>          |
| <b>Polnischer Zloty</b>   |  |                   |                      |
| 11.429  | Dino Polska SA   | 1.335.603         | 1,38                 |
|   | <b>Polnischer Zloty insgesamt</b>                      | <b>1.335.603</b>  | <b>1,38</b>          |
| <b>Britisches Pfund</b>   |  |                   |                      |
| 25.298  | Anglo American Plc                                     | 718.191           | 0,74                 |
| 16.589  | Rio Tinto Plc  | 1.051.463         | 1,09                 |
|   | <b>Britisches Pfund insgesamt</b>                      | <b>1.769.654</b>  | <b>1,83</b>          |

## Emerging Markets Select Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile  | Wertpapierbezeichnung                     | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---|-------------------|------------------------------|
| <b>Aktien 96,21% (31. Dezember 2022: 96,44 %) (Fortsetzung)</b> |   |                   |                              |
| <b>Saudi-Arabischer Riyal</b>                                   |   |                   |                              |
| 687.888   | Americana Restaurants International Plc   | 786.971           | 0,81                         |
| 119.198   | Saudi National Bank                       | 1.175.617         | 1,22                         |
|   | <b>Saudi-Arabischer Riyal insgesamt</b>   | <b>1.962.588</b>  | <b>2,03</b>                  |
| <b>Südafrikanischer Rand</b>                                    |   |                   |                              |
| 89.089  | Absa Group Ltd                            | 791.844           | 0,82                         |
| 57.470  | Bid Corp Ltd                              | 1.257.290         | 1,30                         |
| 4.100   | Naspers Ltd Class N                       | 737.691           | 0,76                         |
|   | <b>Südafrikanischer Rand insgesamt</b>    | <b>2.786.825</b>  | <b>2,88</b>                  |
| <b>Südkoreanischer Won</b>                                      |   |                   |                              |
| 27.344  | Hana Financial Group Inc                  | 816.287           | 0,84                         |
| 2.732   | LG Chem Ltd                               | 1.390.757         | 1,44                         |
| 2.742   | NCSOFT Corp                               | 617.483           | 0,64                         |
| 12.494  | Orion Corp                                | 1.139.445         | 1,18                         |
| 105.796   | Samsung Electronics Co Ltd                | 5.825.475         | 6,02                         |
| 36.575  | Samsung Engineering Co Ltd                | 788.750           | 0,81                         |
| 25.347  | SK Hynix Inc                              | 2.227.099         | 2,30                         |
| 17.242  | SK Telecom Co Ltd                         | 610.121           | 0,63                         |
|   | <b>Südkoreanischer Won insgesamt</b>      | <b>13.415.417</b> | <b>13,86</b>                 |
| <b>Thailändischer Baht</b>                                      |   |                   |                              |
| 207.900   | Bangkok Bank PCL                          | 933.202           | 0,96                         |
|   | <b>Thailändischer Baht insgesamt</b>      | <b>933.202</b>    | <b>0,96</b>                  |
| <b>VAE-Dirham</b>   |   |                   |                              |
| 1.297.685   | Borouge Plc                               | 935.164           | 0,96                         |
|   | <b>Gesamt VAE-Dirham</b>                  | <b>935.164</b>    | <b>0,96</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>  |   |                   |                              |
| 6.258   | Baidu Inc ADR                             | 856.783           | 0,89                         |
| 8.157   | Credicorp Ltd                             | 1.204.299         | 1,24                         |
| 4.082   | Globant SA                                | 733.617           | 0,76                         |
| 11.410  | H World Group Ltd ADR                     | 442.480           | 0,46                         |
| 25.047  | HDFC Bank Ltd ADR                         | 1.745.776         | 1,80                         |
| 122.741   | ICICI Bank Ltd ADR                        | 2.832.862         | 2,93                         |
| 57.507  | Pagseguro Digital Ltd Class A             | 542.866           | 0,56                         |
| 9.548   | PDD Holdings Inc ADR                      | 660.149           | 0,68                         |
| 7.535   | Sociedad Química y Minera de Chile SA ADR | 547.192           | 0,57                         |

## Emerging Markets Select Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile  | Wertpapierbezeichnung                             | Zeitwert<br>US\$         | % des<br>Netto-<br>vermögens           |
|---|---|--------------------------|--|
| <b>Aktien 96,21% (31. Dezember 2022: 96,44 %) (Fortsetzung)</b>   |   |                          |  |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>  |   |                          |  |
| 22.706  | Trip.com Group Ltd ADR                            | 794.710                  | 0,82                                   |
|   | <b>US-Dollar insgesamt</b>                        | <b>10.360.734</b>        | <b>10,71</b>                           |
|   | <b>Aktien insgesamt *</b>                         | <b>93.097.830</b>        | <b>96,21</b>                           |
| <b>Immobilienaktiengesellschaften 0,05 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)</b>                                |   |                          |  |
| <b>Mexikanischer Peso</b>   |   |                          |  |
| 29.903  | FIBRA Macquarie Mexico                            | 52.882                   | 0,05                                   |
|   | <b>Immobilienaktiengesellschaften insgesamt *</b> | <b>52.882</b>            | <b>0,05</b>                            |
|   | <b>Anlagen insgesamt</b>                          | <b>93.150.712</b>        | <b>96,26</b>                           |
|   |   | <b>Zeitwert<br/>US\$</b> | <b>% des<br/>Netto-<br/>vermögens</b>  |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>  |   | <b>93.150.712</b>        | <b>96,26</b>                           |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>            |   | <b>93.150.712</b>        | <b>96,26</b>                           |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  |   | <b>3.617.706</b>         | <b>3,74</b>                            |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                 |   | <b>96.768.418</b>        | <b>100,00</b>                          |
| <b>Portfolioanalyse</b>   |   | <b>US\$</b>              | <b>% des<br/>Gesamtver-<br/>mögens</b> |
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind |   | 93.150.712               | 93,73                                  |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  |   | <b>93.150.712</b>        | <b>93,73</b>                           |

## Euro Bond Absolute Return - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital-<br>betrag  | Wertpapierbezeichnung  | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 0,97 % (31. Dezember 2022: 4,78 %)</b> |  |        |                       |                  |                              |
| <b>Euro</b>   |  |        |                       |                  |                              |
| 171.584   | Futura S.r.l. Series 2019-1 Class A  | 5,94 % | 31.07.2044            | 172.325          | 0,36                         |
| 393.021   | Gedesco Trade Receivables 2020-1 DAC Class A   | 4,56 % | 24.01.2026            | 294.766          | 0,61                         |
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) insgesamt **</b>                       |  |        |                       | <b>467.091</b>   | <b>0,97</b>                  |
| <b>Unternehmensanleihen 50,66 % (31. Dezember 2022: 49,33 %)</b>                          |  |        |                       |                  |                              |
| <b>Dänische Krone</b>   |  |        |                       |                  |                              |
| 3.500.000   | Nordea Kredit Realkreditaktieselskab <sup>*</sup>                                      | 1,00 % | 01.04.2026            | 437.579          | 0,91                         |
| 3.977.453   | Nykredit Realkredit AS <sup>†</sup>  | 3,00 % | 01.10.2053            | 470.078          | 0,98                         |
| 6.971.589   | Nykredit Realkredit AS <sup>†</sup>  | 4,00 % | 01.10.2053            | 886.580          | 1,84                         |
| 6.466.503   | Nykredit Realkredit AS <sup>†</sup>  | 5,00 % | 01.10.2053            | 860.213          | 1,78                         |
| <b>Dänische Krone insgesamt</b>   |  |        |                       | <b>2.654.450</b> | <b>5,51</b>                  |
| <b>Euro</b>   |  |        |                       |                  |                              |
| 500.000   | Akelius Residential Property AB <sup>*</sup>   | 3,88 % | 05.10.2078            | 497.953          | 1,03                         |
| 200.000   | Allwyn International AS <sup>**</sup>  | 3,88 % | 15.02.2027            | 188.348          | 0,39                         |
| 100.000   | Altice France SA <sup>*</sup>  | 3,38 % | 15.01.2028            | 73.234           | 0,15                         |
| 250.000   | AMCO - Asset Management Co SpA <sup>*</sup>  | 0,75 % | 20.04.2028            | 207.710          | 0,43                         |
| 150.000   | AMCO - Asset Management Co SpA <sup>*</sup>  | 4,63 % | 06.02.2027            | 149.213          | 0,31                         |
| 500.000   | American Tower Corp <sup>*</sup>   | 0,88 % | 21.05.2029            | 407.729          | 0,85                         |
| 200.000   | Apollo Swedish Bidco AB <sup>**</sup>  | 8,59 % | 05.07.2029            | 194.014          | 0,40                         |
| 100.000   | Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc <sup>*</sup> | 2,00 % | 01.09.2028            | 83.444           | 0,17                         |
| 200.000   | Arkema SA <sup>*</sup>   | 1,50 % | 29.12.2049            | 177.282          | 0,37                         |
| 400.000   | Aroundtown SA <sup>*</sup>   | 0,38 % | 15.04.2027            | 287.834          | 0,60                         |
| 200.000   | Aroundtown SA <sup>*</sup>   | 1,63 % | 31.01.2028            | 141.556          | 0,29                         |
| 200.000   | Aroundtown SA <sup>*</sup>   | 3,38 % | 29.12.2049            | 84.798           | 0,18                         |
| 300.000   | Ashland Services BV <sup>**</sup>  | 2,00 % | 30.01.2028            | 255.589          | 0,53                         |
| 400.000   | Athene Global Funding <sup>*</sup>   | 0,83 % | 08.01.2027            | 342.955          | 0,71                         |
| 100.000   | Athora Holding Ltd <sup>*</sup>  | 6,63 % | 16.06.2028            | 99.160           | 0,21                         |
| 600.000   | AusNet Services Holdings Pty Ltd <sup>*</sup>  | 1,63 % | 11.03.2081            | 512.250          | 1,06                         |
| 400.000   | Bank of New Zealand <sup>*</sup>   | 2,55 % | 29.06.2027            | 381.218          | 0,79                         |
| 200.000   | Banque Federative du Credit Mutuel SA <sup>*</sup>                                     | 3,21 % | 29.12.2049            | 154.700          | 0,32                         |
| 420.000   | Bayer AG <sup>*</sup>  | 4,63 % | 26.05.2033            | 426.795          | 0,89                         |
| 400.000   | BPCE SFH SA <sup>*</sup>   | 3,13 % | 24.01.2028            | 393.592          | 0,82                         |
| 300.000   | Caixa Central de Credito Agricola Mutuo CRL <sup>*</sup>                               | 8,38 % | 04.07.2027            | 300.209          | 0,62                         |
| 500.000   | Canadian Imperial Bank of Commerce <sup>*</sup>  | 3,25 % | 31.03.2027            | 491.001          | 1,02                         |
| 500.000   | Cie de Financement Foncier SA <sup>*</sup>   | 2,00 % | 07.05.2024            | 492.345          | 1,02                         |
| 100.000   | Cirsa Finance International Sarl <sup>*</sup>  | 4,50 % | 15.03.2027            | 91.767           | 0,19                         |
| 500.000   | Commerzbank AG <sup>*</sup>  | 6,75 % | 05.10.2033            | 496.559          | 1,03                         |
| 300.000   | Commonwealth Bank of Australia <sup>*</sup>  | 0,75 % | 28.02.2028            | 263.259          | 0,55                         |
| 400.000   | Commonwealth Bank of Australia <sup>*</sup>  | 3,25 % | 24.10.2025            | 393.767          | 0,82                         |

## Euro Bond Absolute Return - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                         | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|---------|-----------------------|-----------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 50,66 % (31. Dezember 2022: 49,33 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                 |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |   |         |                       |                 |                              |
| 100.000  | Credit Mutuel Home Loan SFH SA*               | 2,75 %  | 08.12.2027            | 96.905          | 0,20                         |
| 200.000  | Deutsche Postbank Funding Trust III*          | 3,13 %  | 29.12.2049            | 140.229         | 0,29                         |
| 600.000  | Digital Intrepid Holding BV*                  | 1,38 %  | 18.07.2032            | 430.127         | 0,89                         |
| 100.000  | easyJet FinCo BV*                             | 1,88 %  | 03.03.2028            | 87.430          | 0,18                         |
| 200.000  | Electricite de France SA*                     | 2,88 %  | 29.12.2049            | 171.070         | 0,36                         |
| 400.000  | EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG*           | 1,38 %  | 31.08.2081            | 319.753         | 0,66                         |
| 200.000  | EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG*           | 2,13 %  | 31.08.2081            | 142.973         | 0,30                         |
| 100.000  | Energizer Gamma Acquisition BV**              | 3,50 %  | 30.06.2029            | 80.883          | 0,17                         |
| 162.996  | European Union*                               | 1,25 %  | 04.02.2043            | 117.404         | 0,24                         |
| 851.000  | European Union*                               | 1,63 %  | 04.12.2029            | 780.276         | 1,62                         |
| 231.000  | European Union*                               | 2,75 %  | 04.12.2037            | 220.005         | 0,46                         |
| 47.010   | European Union*                               | 3,00 %  | 04.03.2053            | 44.718          | 0,09                         |
| 360.000  | European Union*                               | 3,38 %  | 04.11.2042            | 364.900         | 0,76                         |
| 200.000  | Evonik Industries AG*                         | 1,38 %  | 02.09.2081            | 166.585         | 0,35                         |
| 300.000  | Federation des Caisses Desjardins du Quebec*  | 3,25 %  | 18.04.2028            | 294.872         | 0,61                         |
| 500.000  | Global Payments Inc*                          | 4,88 %  | 17.03.2031            | 498.324         | 1,03                         |
| 100.000  | Grand City Properties SA*                     | 1,50 %  | 29.12.2049            | 40.865          | 0,09                         |
| 300.000  | Grand City Properties SA*                     | 2,50 %  | 29.12.2049            | 142.704         | 0,30                         |
| 400.000  | Heimstaden Bostad AB*                         | 3,38 %  | 29.12.2049            | 203.000         | 0,42                         |
| 400.000  | Holcim Finance Luxembourg SA*                 | 3,00 %  | 29.12.2049            | 389.510         | 0,81                         |
| 250.000  | HSBC Bank Canada*                             | 1,50 %  | 15.09.2027            | 229.369         | 0,48                         |
| 500.000  | ING Groep NV*                                 | 4,75 %  | 23.05.2034            | 500.965         | 1,04                         |
| 200.000  | International Consolidated Airlines Group SA* | 3,75 %  | 25.03.2029            | 175.000         | 0,36                         |
| 250.000  | Intesa Sanpaolo SpA*                          | 3,75 %  | 29.12.2049            | 213.154         | 0,44                         |
| 100.000  | Italmatch Chemicals SpA*                      | 10,00 % | 06.02.2028            | 97.748          | 0,20                         |
| 224.000  | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau*              | 0,00 %  | 15.09.2031            | 176.596         | 0,37                         |
| 544.000  | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau**             | 0,38 %  | 09.03.2026            | 503.253         | 1,04                         |
| 553.000  | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau**             | 0,75 %  | 28.06.2028            | 494.390         | 1,03                         |
| 551.000  | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau*              | 0,75 %  | 15.01.2029            | 486.759         | 1,01                         |
| 403.000  | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau*              | 1,25 %  | 30.06.2027            | 373.917         | 0,78                         |
| 200.000  | Lloyds Bank Plc*                              | 3,25 %  | 02.02.2026            | 196.969         | 0,41                         |
| 100.000  | Loxam SAS*                                    | 6,38 %  | 15.05.2028            | 99.209          | 0,21                         |
| 200.000  | Maxeda DIY Holding BV**                       | 5,88 %  | 01.10.2026            | 144.073         | 0,30                         |
| 500.000  | National Australia Bank Ltd*                  | 2,35 %  | 30.08.2029            | 466.334         | 0,97                         |
| 100.000  | PEU Finance Plc*                              | 7,25 %  | 01.07.2028            | 100.224         | 0,21                         |
| 200.000  | Playtech Plc*                                 | 5,88 %  | 28.06.2028            | 199.500         | 0,41                         |
| 300.000  | Realty Income Corp*                           | 5,13 %  | 06.07.2034            | 300.002         | 0,62                         |
| 200.000  | Repsol International Finance BV*              | 2,50 %  | 29.12.2049            | 174.658         | 0,36                         |

## Euro Bond Absolute Return - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                      | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 50,66 % (31. Dezember 2022: 49,33 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                   |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |  |        |                       |                   |                              |
| 200.000  | Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB <sup>†</sup>           | 2,63 % | 29.12.2049            | 40.450            | 0,08                         |
| 200.000  | SoftBank Group Corp <sup>†</sup>                           | 5,00 % | 15.04.2028            | 186.700           | 0,39                         |
| 300.000  | Solvay SA <sup>†</sup>                                     | 2,50 % | 29.12.2049            | 276.548           | 0,57                         |
| 470.000  | Southern Co <sup>†</sup>                                   | 1,88 % | 15.09.2081            | 368.916           | 0,77                         |
| 100.000  | Sumitomo Mitsui Banking Corp <sup>†</sup>                  | 3,60 % | 16.02.2026            | 98.760            | 0,21                         |
| 200.000  | TDC Net A/S <sup>†</sup>                                   | 5,62 % | 06.02.2030            | 196.431           | 0,41                         |
| 300.000  | Telecom Italia SpA <sup>†</sup>                            | 6,88 % | 15.02.2028            | 299.523           | 0,62                         |
| 200.000  | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV <sup>†</sup> | 1,63 % | 15.10.2028            | 155.054           | 0,32                         |
| 100.000  | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV <sup>†</sup> | 7,38 % | 15.09.2029            | 102.124           | 0,21                         |
| 400.000  | Thames Water Utilities Finance Plc <sup>†</sup>            | 4,38 % | 18.01.2031            | 356.890           | 0,74                         |
| 400.000  | TotalEnergies SE <sup>†</sup>                              | 2,00 % | 29.12.2049            | 349.444           | 0,73                         |
| 400.000  | UBS Group AG <sup>†</sup>                                  | 2,13 % | 13.10.2026            | 372.657           | 0,77                         |
| 200.000  | Unibail-Rodamco-Westfield SE <sup>†</sup>                  | 2,13 % | 29.12.2049            | 169.326           | 0,35                         |
| 400.000  | UniCredit SpA <sup>**</sup>                                | 3,88 % | 29.12.2049            | 302.610           | 0,63                         |
| 500.000  | Veolia Environnement SA <sup>†</sup>                       | 2,50 % | 29.12.2049            | 414.301           | 0,86                         |
| 200.000  | Vivion Investments Sarl <sup>†</sup>                       | 3,00 % | 08.08.2024            | 160.329           | 0,33                         |
| 300.000  | Vodafone Group Plc <sup>†</sup>                            | 3,00 % | 27.08.2080            | 242.439           | 0,50                         |
| 250.000  | Westpac Banking Corp <sup>†</sup>                          | 0,38 % | 02.04.2026            | 227.432           | 0,47                         |
| 200.000  | Wizz Air Finance Co BV <sup>†</sup>                        | 1,00 % | 19.01.2026            | 176.675           | 0,37                         |
| <b>Euro insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>21.749.543</b> | <b>45,15</b>                 |
| <b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>24.403.993</b> | <b>50,66</b>                 |
| <b>Staatsanleihen 45,13 % (31. Dezember 2022: 40,49 %)</b>                     |  |        |                       |                   |                              |
| <b>Dänische Krone</b>  |  |        |                       |                   |                              |
| 5.000.000  | Denmark Government Bond <sup>†</sup>                       | 2,25 % | 15.11.2033            | 645.791           | 1,34                         |
| <b>Dänische Krone insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>645.791</b>    | <b>1,34</b>                  |
| <b>Euro</b>  |  |        |                       |                   |                              |
| 210.000  | Acquirente Unico SpA <sup>†</sup>                          | 2,80 % | 20.02.2026            | 200.359           | 0,42                         |
| 857.000  | Bank Gospodarstwa Krajowego <sup>†</sup>                   | 3,00 % | 30.05.2029            | 795.553           | 1,65                         |
| 300.000  | Bank Gospodarstwa Krajowego <sup>†</sup>                   | 4,00 % | 08.09.2027            | 296.542           | 0,62                         |
| 200.000  | Bank Gospodarstwa Krajowego <sup>†</sup>                   | 5,13 % | 22.02.2033            | 207.737           | 0,43                         |
| 1.500.000  | Bundesobligation <sup>†</sup>                              | 2,20 % | 13.04.2028            | 1.473.900         | 3,06                         |
| 60.150   | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe <sup>†</sup>      | 2,50 % | 15.08.2046            | 61.299            | 0,13                         |
| 210.000  | Chile Government International Bond <sup>**</sup>          | 4,13 % | 05.07.2034            | 208.556           | 0,43                         |
| 503.000  | Croatia Government International Bond <sup>†</sup>         | 1,50 % | 17.06.2031            | 430.694           | 0,89                         |
| 450.000  | Croatia Government International Bond <sup>†</sup>         | 2,88 % | 22.04.2032            | 423.640           | 0,88                         |
| 450.000  | Croatia Government International Bond <sup>†</sup>         | 4,00 % | 14.06.2035            | 449.579           | 0,93                         |
| 358.000  | Estonia Government International Bond <sup>†</sup>         | 4,00 % | 12.10.2032            | 368.285           | 0,76                         |
| 520.000  | European Financial Stability Facility <sup>†</sup>         | 2,88 % | 16.02.2033            | 512.529           | 1,06                         |



## Euro Bond Absolute Return - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                             | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|-----------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 45,13 % (31. Dezember 2022: 40,49 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                 |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |   |        |                       |                 |                              |
| 220.000  | European Stability Mechanism*                     | 3,00 % | 23.08.2033            | 219.437         | 0,46                         |
| 359.000  | European Union*                                   | 3,38 % | 04.10.2038            | 363.593         | 0,75                         |
| 223.412  | French Republic Government Bond OAT*              | 0,10 % | 01.03.2036            | 211.652         | 0,44                         |
| 308.439  | French Republic Government Bond OAT*              | 0,55 % | 01.03.2039            | 307.899         | 0,64                         |
| 177.486  | French Republic Government Bond OAT*              | 0,75 % | 25.05.2052            | 96.700          | 0,20                         |
| 168.000  | French Republic Government Bond OAT*              | 1,25 % | 25.05.2036            | 135.718         | 0,28                         |
| 500.044  | French Republic Government Bond OAT*              | 1,25 % | 25.05.2038            | 388.041         | 0,81                         |
| 202.438  | French Republic Government Bond OAT*              | 1,75 % | 25.05.2066            | 138.247         | 0,29                         |
| 160.000  | French Republic Government Bond OAT**             | 5,75 % | 25.10.2032            | 196.745         | 0,41                         |
| 35.000   | Ireland Government Bond*                          | 0,55 % | 22.04.2041            | 22.804          | 0,05                         |
| 118.000  | Ireland Government Bond*                          | 3,00 % | 18.10.2043            | 116.076         | 0,24                         |
| 227.000  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**               | 0,00 % | 01.08.2026            | 202.546         | 0,42                         |
| 168.333  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*                | 0,65 % | 15.05.2026            | 162.966         | 0,34                         |
| 606.000  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**               | 1,20 % | 15.08.2025            | 574.268         | 1,19                         |
| 809.074  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**               | 1,40 % | 26.05.2025            | 801.055         | 1,66                         |
| 950.000  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**               | 1,75 % | 30.05.2024            | 932.394         | 1,93                         |
| 560.000  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*                | 1,85 % | 01.07.2025            | 539.495         | 1,12                         |
| 600.000  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*                | 3,40 % | 28.03.2025            | 595.428         | 1,24                         |
| 416.474  | Kingdom of Belgium Government Bond*               | 0,40 % | 22.06.2040            | 260.903         | 0,54                         |
| 231.000  | Kingdom of Belgium Government Bond*               | 3,00 % | 22.06.2033            | 229.910         | 0,48                         |
| 270.000  | Kingdom of Belgium Government Bond*               | 3,30 % | 22.06.2054            | 264.360         | 0,55                         |
| 500.000  | Kommunekredit*                                    | 0,88 % | 03.11.2036            | 375.452         | 0,78                         |
| 290.000  | Lithuania Government International Bond*          | 3,88 % | 14.06.2033            | 292.198         | 0,61                         |
| 330.390  | Netherlands Government Bond*                      | 0,00 % | 15.07.2030            | 274.244         | 0,57                         |
| 1.618.457  | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT*                | 1,65 % | 16.07.2032            | 1.433.476       | 2,98                         |
| 527.300  | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT*                | 1,95 % | 15.06.2029            | 498.373         | 1,03                         |
| 439.000  | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT*                | 3,50 % | 18.06.2038            | 439.389         | 0,91                         |
| 239.000  | Republic of Poland Government International Bond* | 3,88 % | 14.02.2033            | 238.082         | 0,49                         |
| 291.000  | Romanian Government International Bond*           | 1,75 % | 13.07.2030            | 222.474         | 0,46                         |
| 366.000  | Romanian Government International Bond*           | 2,00 % | 28.01.2032            | 269.633         | 0,56                         |
| 507.000  | Romanian Government International Bond*           | 3,62 % | 26.05.2030            | 445.516         | 0,92                         |
| 42.000   | Romanian Government International Bond*           | 3,88 % | 29.10.2035            | 33.383          | 0,07                         |
| 207.000  | Romanian Government International Bond*           | 6,63 % | 27.09.2029            | 215.214         | 0,45                         |
| 400.000  | Slovakia Government Bond*                         | 4,00 % | 19.10.2032            | 412.208         | 0,86                         |
| 313.000  | Slovenia Government Bond*                         | 1,50 % | 25.03.2035            | 252.475         | 0,52                         |
| 313.000  | Slovenia Government Bond*                         | 3,63 % | 11.03.2033            | 323.431         | 0,67                         |
| 350.000  | Spain Government Bond*                            | 0,50 % | 31.10.2031            | 279.839         | 0,58                         |
| 526.000  | Spain Government Bond*                            | 0,70 % | 30.04.2032            | 422.562         | 0,88                         |
| 528.000  | Spain Government Bond*                            | 0,80 % | 30.07.2029            | 457.474         | 0,95                         |

## Euro Bond Absolute Return - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                          | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 45,13 % (31. Dezember 2022: 40,49 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                   |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |  |        |                       |                   |                              |
| 206.000  | Spain Government Bond*                         | 3,15 % | 30.04.2033            | 201.911           | 0,42                         |
| 560.000  | Spain Government Bond*                         | 3,55 % | 31.10.2033            | 565.127           | 1,17                         |
| 186.000  | State of North Rhine-Westphalia Germany*       | 1,45 % | 16.02.2043            | 138.199           | 0,29                         |
| <b>Euro insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>19.979.570</b> | <b>41,47</b>                 |
| <b>Polnischer Zloty</b>  |  |        |                       |                   |                              |
| 2.000.000  | Republic of Poland Government Bond*            | 6,00 % | 25.10.2033            | 460.873           | 0,96                         |
| <b>Polnischer Zloty insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>460.873</b>    | <b>0,96</b>                  |
| <b>Britisches Pfund</b>  |  |        |                       |                   |                              |
| 410.000  | United Kingdom Gilt*                           | 0,63 % | 22.10.2050            | 194.006           | 0,40                         |
| <b>Britisches Pfund insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>194.006</b>    | <b>0,40</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>   |  |        |                       |                   |                              |
| 512.040  | United States Treasury Inflation Indexed Note* | 1,63 % | 15.10.2027            | 462.577           | 0,96                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |  |        |                       | <b>462.577</b>    | <b>0,96</b>                  |
| <b>Staatsanleihen insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>21.742.817</b> | <b>45,13</b>                 |
| <b>Anlagen insgesamt</b>   |  |        |                       | <b>46.613.901</b> | <b>96,76</b>                 |

Devisenterminkontrakte 0,38 % (31. Dezember 2022: 0,08 %)

| Geforderter<br>Betrag   | Zu zahlender<br>Betrag | Fälligkeits-<br>datum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn EUR | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|------------------------|-----------------------|--------------------------------|-----------|-------------------------------------|------------------------------|
| 8.856.381 CZK   | 371.022 €              | 20.07.2023            | BNP Paribas                    | 1         | 1.184                               | 0,01                         |
| 2.282.660 €   | 16.987.824 DKK         | 20.07.2023            | Deutsche Bank AG               | 1         | 786                                 | 0,00                         |
| 226.093 €   | 5.367.048 CZK          | 20.07.2023            | Deutsche Bank AG               | 1         | 533                                 | 0,00                         |
| 1.891 €   | 268.992 ¥              | 20.07.2023            | State Street Bank and Trust Co | 1         | 183                                 | 0,00                         |
| 137.328 €   | 3.244.150 CZK          | 20.07.2023            | State Street Bank and Trust Co | 1         | 986                                 | 0,00                         |
| 188.099 €   | 160.930 £              | 20.07.2023            | State Street Bank and Trust Co | 1         | 692                                 | 0,00                         |
| 508.152 £   | 579.103 €              | 20.07.2023            | BNP Paribas                    | 1         | 12.654                              | 0,03                         |
| 933 US\$  | 847 €                  | 20.07.2023            | Westpac Banking Corp           | 1         | 8                                   | 0,00                         |
| <i>Abgesicherte Klassen USD</i>   |                        |                       |                                |           |                                     |                              |
| 14.961.471 US\$   | 13.637.740 €           | 20.07.2023            | Deutsche Bank AG               | 1         | 65.135                              | 0,13                         |
| 478.652 US\$  | 434.711 €              | 20.07.2023            | Goldman Sachs International    | 1         | 3.676                               | 0,01                         |
| 14.961.471 US\$   | 13.605.394 €           | 20.07.2023            | Westpac Banking Corp           | 1         | 97.481                              | 0,20                         |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                        |                       |                                |           | <b>183.318</b>                      | <b>0,38</b>                  |

Futures-Kontrakte 0,04 % (31. Dezember 2022: 3,09 %)

| Anzahl<br>Kontrakte | Beschreibung                    | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn EUR | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---------------------|---------------------------------|-------------------------------------|------------------------------|
| (4)                 | Euro-BOBL Future September 2023 | 560                                 | 0,00                         |

## Euro Bond Absolute Return - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Futures-Kontrakte 0,04 % (31. Dezember 2022: 3,09 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte  | Beschreibung  | Nicht realisierter Gewinn EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|-------------------------------|----------------------|
| (33)  | Euro-Bund Future September 2023                     | 13.370                        | 0,03                 |
| (19)  | Euro-OAT Future September 2023                      | 3.040                         | 0,00                 |
| (3)   | US Treasury 5-Year Note (CBT) Future September 2023 | 3.760                         | 0,01                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten *</b> |   | <b>20.730</b>                 | <b>0,04</b>          |

### Inflation-Swap-Kontrakte 0,04 % (31. Dezember 2022: 0,13 %)

| Nominalwert  | Fälligkeit | Gegenpartei                   | Erhalt/(Zahlung) <sup>#</sup> | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Gewinn EUR | % des Nettovermögens |
|--|------------|-------------------------------|-------------------------------|-----------------|--------------------|-------------------------------|----------------------|
| EUR 1.000.000  | 19.05.2026 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | Erhalt                        | 3,52 %          | CPTFEMU            | 17.672                        | 0,04                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Inflation-Swap-Kontrakten<sup>+</sup></b> |            |                               |                               |                 |                    | <b>17.672</b>                 | <b>0,04</b>          |

<sup>#</sup>Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

### Zinsswap-Kontrakte 0,01 % (31. Dezember 2022: 0,03 %)

| Nominalwert   | Fälligkeit | Gegenpartei                   | Erhalt/(Zahlung) <sup>#</sup> | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Gewinn EUR | % des Nettovermögens |
|---|------------|-------------------------------|-------------------------------|-----------------|--------------------|-------------------------------|----------------------|
| EUR 1.000.000   | 02.03.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 3,43 %          | 6M EURIBOR         | 6.380                         | 0,01                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Zinsswapkontrakten <sup>oo</sup></b> |            |                               |                               |                 |                    | <b>6.380</b>                  | <b>0,01</b>          |

<sup>#</sup>Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

|  |  |  |  |  |  | Zeitwert EUR      | % des Nettovermögens |
|--|--|--|--|--|--|-------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> |  |  |  |  |  | <b>46.842.001</b> | <b>97,23</b>         |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (0,10 %) (31. Dezember 2022: (2,13 %))

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust EUR | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 433.307 €   | 2.052.395 PLN       | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (28.968)                       | (0,06)               |
| 111.523 €   | 830.952 DKK         | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (94)                           | (0,00)               |
| 467.090 €   | 515.024 US\$        | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (4.609)                        | (0,01)               |
| 952.305 €   | 7.090.357 DKK       | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 2         | (100)                          | (0,00)               |
| 577.013 €   | 507.985 £           | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 2         | (14.549)                       | (0,03)               |
| 1.316 €   | 1.450 US\$          | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 1         | (11)                           | (0,00)               |
| 1.008.941 ¥   | 7.094 €             | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (685)                          | (0,00)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>oo</sup></b> |                     |                  |                                |           | <b>(49.016)</b>                | <b>(0,10)</b>        |

## Euro Bond Absolute Return - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Futures-Kontrakte (0,20 %) (31. Dezember 2022: (0,21 %))

| Anzahl Kontrakte  | Beschreibung  | Nicht realisierter Verlust EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|--------------------------------|----------------------|
| (9)   | 10-Year Mini Japanese Government Bond Future September 2023       | (3.482)                        | (0,01)               |
| 17  | Canadian 2-Year Bond Future September 2023                        | (8.125)                        | (0,02)               |
| 25  | Euro-BOBL Call Option on Future August 2023, Strike Price EUR 116 | (1.236)                        | (0,00)               |
| (14)  | Euro-BTP Future September 2023                                    | (7.000)                        | (0,01)               |
| (19)  | Euro-Buxl 30-Year Bond Future September 2023                      | (76.760)                       | (0,16)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten <sup>‡</sup></b> |   | <b>(96.603)</b>                | <b>(0,20)</b>        |

### Inflation-Swap-Kontrakte (0,04 %) (31. Dezember 2022: (0,14 %))

| Nominalwert   | Fälligkeit | Gegenpartei                   | Erhalt/<br>(Zahlung) <sup>#</sup> | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Verlust EUR | % des Nettovermögens |
|---|------------|-------------------------------|-----------------------------------|-----------------|--------------------|--------------------------------|----------------------|
| EUR 1.000.000   | 19.05.2024 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | (Zahlung)                         | 4,73 %          | CPTFEMU            | (18.503)                       | (0,04)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Inflation-Swap-Kontrakten<sup>∞</sup></b> |            |                               |                                   |                 |                    | <b>(18.503)</b>                | <b>(0,04)</b>        |

<sup>#</sup>Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

### Zinsswap-Kontrakte (0,18 %) (31. Dezember 2022: (0,09 %))

| Nominalwert   | Fälligkeit | Gegenpartei                   | Erhalt/<br>(Zahlung) <sup>#</sup> | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Verlust EUR | % des Nettovermögens |
|---|------------|-------------------------------|-----------------------------------|-----------------|--------------------|--------------------------------|----------------------|
| GBP 530.000   | 16.06.2026 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | (Zahlung)                         | 5,03 %          | 1D SONIA           | (10.350)                       | (0,02)               |
| EUR 681.000   | 11.01.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | (Zahlung)                         | 2,65 %          | 1D €STR            | (12.178)                       | (0,02)               |
| GBP 1.470.000   | 16.06.2026 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | (Zahlung)                         | 5,29 %          | 1D SONIA           | (17.659)                       | (0,04)               |
| EUR 4.000.000   | 05.05.2026 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | (Zahlung)                         | 2,94 %          | 1D €STR            | (49.269)                       | (0,10)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Zinsswapkontrakten <sup>∞</sup></b> |            |                               |                                   |                 |                    | <b>(89.456)</b>                | <b>(0,18)</b>        |

<sup>#</sup>Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

### Credit-Default-Swap-Kontrakte (0,21 %) (31. Dezember 2022: (0,07 %))

| Nominalwert   | Fälligkeit | Gegenpartei                 | Referenzverbindlichkeit                                  | Zeitwert EUR    | % des Nettovermögens |
|---|------------|-----------------------------|--|-----------------|----------------------|
| EUR 2.500.000   | 20.06.2028 | ICE Clear U.S. <sup>1</sup> | Buying default protection on iTRAXX Europe Crossover S39 | (99.353)        | (0,21)               |
| <b>Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten insgesamt <sup>‡</sup></b> |            |                             |  | <b>(99.353)</b> | <b>(0,21)</b>        |

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

## Euro Bond Absolute Return - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

|   | Zeitwert<br>EUR   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------------|------------------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(352.931)</b>  | <b>(0,73)</b>                |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>46.489.070</b> | <b>96,50</b>                 |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>1.685.176</b>  | <b>3,50</b>                  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>48.174.246</b> | <b>100,00</b>                |

| Portfolioanalyse  | EUR               | % des<br>Gesamtver-<br>mögens |
|---|-------------------|-------------------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 41.068.086        | 81,08                         |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden            | 5.545.815         | 10,95                         |
| ± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden                          | (75.873)          | (0,15)                        |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap                            | (48.958)          | (0,10)                        |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>46.489.070</b> | <b>91,78</b>                  |

## Euro Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital-<br>betrag  | Wertpapierbezeichnung                        | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--|--------|-----------------------|-----------------|------------------------------|
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 0,52 % (31. Dezember 2022: 4,98 %)</b> |  |        |                       |                 |                              |
| <b>Euro</b>   |  |        |                       |                 |                              |
| 66.814  | Gedesco Trade Receivables 2020-1 DAC Class A | 4,56 % | 24.01.2026            | 50.110          | 0,52                         |
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) insgesamt **</b>                       |  |        |                       | <b>50.110</b>   | <b>0,52</b>                  |
| <b>Unternehmensanleihen 45,43 % (31. Dezember 2022: 43,88 %)</b>                          |  |        |                       |                 |                              |
| <b>Euro</b>   |  |        |                       |                 |                              |
| 100.000   | Akelius Residential Property AB*             | 3,88 % | 05.10.2078            | 99.590          | 1,04                         |
| 100.000   | Allwyn International AS**                    | 3,88 % | 15.02.2027            | 94.174          | 0,98                         |
| 100.000   | AMCO - Asset Management Co SpA*              | 0,75 % | 20.04.2028            | 83.084          | 0,87                         |
| 110.000   | AMCO - Asset Management Co SpA*              | 4,63 % | 06.02.2027            | 109.423         | 1,14                         |
| 100.000   | American Tower Corp*                         | 0,88 % | 21.05.2029            | 81.546          | 0,85                         |
| 100.000   | Apollo Swedish Bidco AB**                    | 8,59 % | 05.07.2029            | 97.007          | 1,01                         |
| 100.000   | Aroundtown SA*                               | 0,38 % | 15.04.2027            | 71.959          | 0,75                         |
| 100.000   | Ashland Services BV**                        | 2,00 % | 30.01.2028            | 85.196          | 0,89                         |
| 100.000   | Athene Global Funding*                       | 0,83 % | 08.01.2027            | 85.739          | 0,89                         |
| 100.000   | AusNet Services Holdings Pty Ltd*            | 1,63 % | 11.03.2081            | 85.375          | 0,89                         |
| 100.000   | Bank of New Zealand*                         | 2,55 % | 29.06.2027            | 95.304          | 0,99                         |
| 90.000  | Banque Federative du Credit Mutuel SA*       | 3,21 % | 29.12.2049            | 69.615          | 0,73                         |
| 100.000   | Bayer AG*                                    | 4,63 % | 26.05.2033            | 101.618         | 1,06                         |
| 100.000   | BCP V Modular Services Finance II Plc**      | 4,75 % | 30.11.2028            | 85.487          | 0,89                         |
| 100.000   | BPCE SFH SA*                                 | 3,13 % | 24.01.2028            | 98.398          | 1,03                         |
| 100.000   | Caixa Central de Credito Agricola Mutuo CRL* | 8,38 % | 04.07.2027            | 100.069         | 1,04                         |
| 100.000   | Canadian Imperial Bank of Commerce*          | 3,25 % | 31.03.2027            | 98.200          | 1,02                         |
| 100.000   | Cie de Financement Foncier SA*               | 2,00 % | 07.05.2024            | 98.469          | 1,03                         |
| 100.000   | Cirsa Finance International Sarl*            | 4,50 % | 15.03.2027            | 91.767          | 0,96                         |
| 100.000   | Commerzbank AG*                              | 6,75 % | 05.10.2033            | 99.312          | 1,03                         |
| 100.000   | Commonwealth Bank of Australia*              | 3,25 % | 24.10.2025            | 98.442          | 1,03                         |
| 60.000  | Deutsche Postbank Funding Trust III*         | 3,13 % | 29.12.2049            | 42.069          | 0,44                         |
| 100.000   | Dexia Credit Local SA*                       | 0,63 % | 17.01.2026            | 92.650          | 0,97                         |
| 100.000   | Digital Intrepid Holding BV*                 | 1,38 % | 18.07.2032            | 71.688          | 0,75                         |
| 100.000   | EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG*          | 1,38 % | 31.08.2081            | 79.938          | 0,83                         |
| 26.842  | European Union*                              | 1,25 % | 04.02.2043            | 19.334          | 0,20                         |
| 95.000  | European Union*                              | 1,63 % | 04.12.2029            | 87.105          | 0,91                         |
| 69.000  | European Union*                              | 2,75 % | 04.12.2037            | 65.716          | 0,68                         |
| 80.000  | European Union*                              | 3,38 % | 04.11.2042            | 81.089          | 0,84                         |
| 100.000   | Federation des Caisses Desjardins du Quebec* | 3,25 % | 18.04.2028            | 98.291          | 1,02                         |
| 100.000   | Flamingo Lux II SCA*                         | 5,00 % | 31.03.2029            | 69.993          | 0,73                         |
| 100.000   | Global Payments Inc*                         | 4,88 % | 17.03.2031            | 99.665          | 1,04                         |
| 100.000   | Grand City Properties SA*                    | 2,50 % | 29.12.2049            | 47.568          | 0,50                         |
| 100.000   | Heimstaden Bostad AB*                        | 3,38 % | 29.12.2049            | 50.750          | 0,53                         |
| 100.000   | ING Groep NV*                                | 4,75 % | 23.05.2034            | 100.193         | 1,04                         |

## Euro Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                          | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 45,43 % (31. Dezember 2022: 43,88 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                  |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |  |        |                       |                  |                              |
| 100.000  | Kleopatra Holdings 2 SCA*                      | 6,50 % | 01.09.2026            | 65.150           | 0,68                         |
| 97.000   | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau*               | 0,00 % | 15.06.2026            | 88.094           | 0,92                         |
| 55.000   | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau*               | 0,00 % | 15.09.2031            | 43.361           | 0,45                         |
| 100.000  | Loxam SAS*                                     | 6,38 % | 15.05.2028            | 99.209           | 1,03                         |
| 100.000  | Maxeda DIY Holding BV**                        | 5,88 % | 01.10.2026            | 72.036           | 0,75                         |
| 100.000  | National Australia Bank Ltd*                   | 2,35 % | 30.08.2029            | 93.267           | 0,97                         |
| 100.000  | Nationale-Niederlanden Bank NV*                | 1,00 % | 25.09.2028            | 88.791           | 0,92                         |
| 100.000  | Playtech Plc*                                  | 5,88 % | 28.06.2028            | 99.750           | 1,04                         |
| 100.000  | Realty Income Corp*                            | 5,13 % | 06.07.2034            | 100.000          | 1,04                         |
| 130.000  | Southern Co*                                   | 1,88 % | 15.09.2081            | 102.041          | 1,06                         |
| 100.000  | TDC Net A/S*                                   | 5,62 % | 06.02.2030            | 98.215           | 1,02                         |
| 100.000  | Telecom Italia SpA*                            | 6,88 % | 15.02.2028            | 99.841           | 1,04                         |
| 100.000  | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV* | 7,38 % | 15.09.2029            | 102.124          | 1,06                         |
| 100.000  | Thames Water Utilities Finance Plc*            | 4,38 % | 18.01.2031            | 89.222           | 0,93                         |
| 100.000  | UBS Group AG*                                  | 2,13 % | 13.10.2026            | 93.164           | 0,97                         |
| 100.000  | Westpac Banking Corp*                          | 0,38 % | 02.04.2026            | 90.973           | 0,95                         |
| <b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>4.361.061</b> | <b>45,43</b>                 |
| <b>Staatsanleihen 48,90 % (31. Dezember 2022: 43,09 %)</b>                     |  |        |                       |                  |                              |
| <b>Euro</b>  |  |        |                       |                  |                              |
| 100.000  | Acquirente Unico SpA*                          | 2,80 % | 20.02.2026            | 95.409           | 0,99                         |
| 75.000   | Autonomous Community of Madrid Spain*          | 2,08 % | 12.03.2030            | 68.769           | 0,72                         |
| 100.000  | Bank Gospodarstwa Krajowego*                   | 3,00 % | 30.05.2029            | 92.830           | 0,97                         |
| 100.000  | Bank Gospodarstwa Krajowego*                   | 4,00 % | 08.09.2027            | 98.847           | 1,03                         |
| 55.600   | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe*      | 0,00 % | 15.08.2030            | 47.060           | 0,49                         |
| 92.163   | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe*      | 1,25 % | 15.08.2048            | 73.168           | 0,76                         |
| 134.071  | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe*      | 1,70 % | 15.08.2032            | 126.787          | 1,32                         |
| 52.000   | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe*      | 4,75 % | 04.07.2034            | 63.618           | 0,66                         |
| 100.000  | Croatia Government International Bond*         | 4,00 % | 14.06.2035            | 99.906           | 1,04                         |
| 91.000   | Estonia Government International Bond*         | 4,00 % | 12.10.2032            | 93.614           | 0,98                         |
| 20.000   | European Financial Stability Facility*         | 2,88 % | 16.02.2033            | 19.713           | 0,21                         |
| 90.000   | European Stability Mechanism*                  | 1,00 % | 23.06.2027            | 82.550           | 0,86                         |
| 50.000   | European Stability Mechanism*                  | 3,00 % | 23.08.2033            | 49.872           | 0,52                         |
| 111.000  | European Union*                                | 2,00 % | 04.10.2027            | 105.869          | 1,10                         |
| 73.000   | European Union*                                | 3,38 % | 04.10.2038            | 73.934           | 0,77                         |
| 25.555   | French Republic Government Bond OAT*           | 0,75 % | 25.05.2052            | 13.923           | 0,14                         |
| 180.381  | French Republic Government Bond OAT*           | 1,25 % | 25.05.2038            | 139.978          | 1,46                         |
| 63.491   | French Republic Government Bond OAT*           | 1,50 % | 25.05.2031            | 57.668           | 0,60                         |
| 54.000   | French Republic Government Bond OAT*           | 1,50 % | 25.05.2050            | 37.529           | 0,39                         |
| 12.650   | French Republic Government Bond OAT*           | 1,75 % | 25.05.2066            | 8.639            | 0,09                         |

## Euro Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                             | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|-----------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 48,90 % (31. Dezember 2022: 43,09 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                 |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |   |        |                       |                 |                              |
| 21.000   | Ireland Government Bond*                          | 0,55 % | 22.04.2041            | 13.682          | 0,14                         |
| 20.800   | Ireland Government Bond*                          | 3,00 % | 18.10.2043            | 20.461          | 0,21                         |
| 55.000   | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**               | 0,00 % | 01.08.2026            | 49.075          | 0,51                         |
| 46.000   | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*                | 0,25 % | 15.03.2028            | 39.224          | 0,41                         |
| 85.000   | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**               | 1,20 % | 15.08.2025            | 80.549          | 0,84                         |
| 91.234   | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**               | 1,40 % | 26.05.2025            | 90.330          | 0,94                         |
| 60.000   | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*                | 1,45 % | 01.03.2036            | 44.426          | 0,46                         |
| 136.000  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**               | 1,60 % | 01.06.2026            | 128.055         | 1,33                         |
| 169.000  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**               | 1,75 % | 30.05.2024            | 165.868         | 1,73                         |
| 100.000  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*                | 1,85 % | 01.07.2025            | 96.338          | 1,00                         |
| 62.000   | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**               | 2,05 % | 01.08.2027            | 58.175          | 0,61                         |
| 44.000   | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**               | 2,50 % | 01.12.2032            | 39.135          | 0,41                         |
| 125.000  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*                | 3,00 % | 01.08.2029            | 119.986         | 1,25                         |
| 100.000  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*                | 3,40 % | 28.03.2025            | 99.238          | 1,03                         |
| 56.000   | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*                | 4,00 % | 01.02.2037            | 55.215          | 0,57                         |
| 51.000   | Kingdom of Belgium Government Bond*               | 0,35 % | 22.06.2032            | 40.513          | 0,42                         |
| 28.904   | Kingdom of Belgium Government Bond*               | 0,40 % | 22.06.2040            | 18.107          | 0,19                         |
| 77.696   | Kingdom of Belgium Government Bond*               | 1,45 % | 22.06.2037            | 62.638          | 0,65                         |
| 44.000   | Kingdom of Belgium Government Bond*               | 3,00 % | 22.06.2033            | 43.792          | 0,46                         |
| 54.000   | Kingdom of Belgium Government Bond*               | 3,30 % | 22.06.2054            | 52.872          | 0,55                         |
| 103.000  | Kommunekredit*                                    | 0,88 % | 03.11.2036            | 77.343          | 0,81                         |
| 60.000   | Lithuania Government International Bond*          | 3,88 % | 14.06.2033            | 60.455          | 0,63                         |
| 90.000   | Netherlands Government Bond*                      | 2,50 % | 15.07.2033            | 88.550          | 0,92                         |
| 157.000  | Netherlands Government Bond*                      | 4,00 % | 15.01.2037            | 178.441         | 1,86                         |
| 100.000  | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT*                | 0,30 % | 17.10.2031            | 80.198          | 0,84                         |
| 340.000  | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT*                | 1,65 % | 16.07.2032            | 301.140         | 3,14                         |
| 61.500   | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT*                | 1,95 % | 15.06.2029            | 58.126          | 0,61                         |
| 90.000   | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT*                | 3,50 % | 18.06.2038            | 90.080          | 0,94                         |
| 55.000   | Republic of Austria Government Bond*              | 0,90 % | 20.02.2032            | 46.381          | 0,48                         |
| 70.000   | Republic of Poland Government International Bond* | 3,88 % | 14.02.2033            | 69.731          | 0,73                         |
| 68.000   | Romanian Government International Bond*           | 1,75 % | 13.07.2030            | 51.987          | 0,54                         |
| 113.000  | Romanian Government International Bond*           | 2,00 % | 28.01.2032            | 83.247          | 0,87                         |
| 52.000   | Romanian Government International Bond**          | 2,88 % | 26.05.2028            | 46.783          | 0,49                         |
| 73.000   | Romanian Government International Bond*           | 3,62 % | 26.05.2030            | 64.147          | 0,67                         |
| 40.000   | Romanian Government International Bond*           | 3,88 % | 29.10.2035            | 31.793          | 0,33                         |
| 104.000  | Romanian Government International Bond*           | 6,63 % | 27.09.2029            | 108.127         | 1,13                         |
| 49.000   | Slovenia Government Bond*                         | 1,50 % | 25.03.2035            | 39.525          | 0,41                         |
| 46.000   | Slovenia Government Bond*                         | 3,63 % | 11.03.2033            | 47.533          | 0,49                         |
| 110.000  | Spain Government Bond*                            | 0,50 % | 31.10.2031            | 87.949          | 0,92                         |
| 123.000  | Spain Government Bond*                            | 0,85 % | 30.07.2037            | 85.884          | 0,89                         |



## Euro Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung  | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|------------------------|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 48,90 % (31. Dezember 2022: 43,09 %) (Fortsetzung)</b> |                        |        |                       |                  |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |                        |        |                       |                  |                              |
| 42.000   | Spain Government Bond* | 1,45 % | 31.10.2027            | 38.975           | 0,41                         |
| 21.000   | Spain Government Bond* | 2,90 % | 31.10.2046            | 18.182           | 0,19                         |
| 50.000   | Spain Government Bond* | 3,15 % | 30.04.2033            | 49.008           | 0,51                         |
| 47.000   | Spain Government Bond* | 3,55 % | 31.10.2033            | 47.430           | 0,49                         |
| 71.000   | Spain Government Bond* | 4,20 % | 31.01.2037            | 75.668           | 0,79                         |
| <b>Staatsanleihen insgesamt</b>  |                        |        |                       | <b>4.694.045</b> | <b>48,90</b>                 |
| <b>Anlagen insgesamt</b>   |                        |        |                       | <b>9.105.216</b> | <b>94,85</b>                 |

Futures-Kontrakte 0,06 % (31. Dezember 2022: 0,45 %)

| Anzahl<br>Kontrakte   | Beschreibung                                 | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn EUR | % des<br>Netto-<br>vermögens |             |
|---|--|-------------------------------------|------------------------------|-------------|
| (4)   | Euro-Bund Future September 2023              | 1.628                               | 0,02                         |             |
| 1   | Euro-Buxl 30-Year Bond Future September 2023 | 4.140                               | 0,04                         |             |
| 3   | Euro-Schatz Future September 2023            | 0                                   | 0,00                         |             |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten *</b> |  |                                     | <b>5.768</b>                 | <b>0,06</b> |

Zinsswap-Kontrakte 0,02 % (31. Dezember 2022: 0,02 %)

| Nominalwert  | Fälligkeit | Gegenpartei | Erhalt/ (Zahlung)#            | Fester<br>Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn EUR | % des<br>Netto-<br>vermögens |             |
|--|------------|-------------|-------------------------------|--------------------|--------------------|-------------------------------------|------------------------------|-------------|
| EUR  | 205.000    | 02.03.2028  | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | (Zahlung)          | 3,43 %             | 6M EURIBOR                          | 1.308                        | 0,02        |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Zinsswapkontrakten <sup>∞</sup></b> |            |             |                               |                    |                    |                                     | <b>1.308</b>                 | <b>0,02</b> |

#Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | Zeitwert<br>EUR | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-----------------|------------------------------|
|   | 9.112.292       | 94,93                        |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Futures-Kontrakte (0,18 %) (31. Dezember 2022: (0,88 %))

| Anzahl<br>Kontrakte  | Beschreibung  | Nicht<br>realisierter<br>Verlust EUR | % des<br>Netto-<br>vermögens |               |
|--|---|--------------------------------------|------------------------------|---------------|
| 20   | Euro-BOBL Future September 2023                                   | (17.170)                             | (0,18)                       |               |
| 1  | Euro-OAT Future September 2023                                    | (170)                                | (0,00)                       |               |
| 7  | Euro-BOBL Call Option on Future August 2023, Strike Price EUR 116 | (337)                                | (0,00)                       |               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten *</b> |   |                                      | <b>(17.677)</b>              | <b>(0,18)</b> |

## Euro Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Zinsswap-Kontrakte (0,25 %) (31. Dezember 2022: (0,26 %))

|  | Nominalwert | Fälligkeit | Gegenpartei                   | Erhalt/ (Zahlung) <sup>#</sup> | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Verlust EUR | % des Nettovermögens |
|--|-------------|------------|-------------------------------|--------------------------------|-----------------|--------------------|--------------------------------|----------------------|
| EUR  | 900.000     | 05.05.2026 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | (Zahlung)                      | 2,94 %          | 1D €STR            | (11.085)                       | (0,12)               |
| EUR  | 200.031     | 30.08.2032 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | (Zahlung)                      | 2,22 %          | 6M EURIBOR         | (12.531)                       | (0,13)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Zinsswapkontrakten<sup>∞</sup></b> |             |            |                               |                                |                 |                    | <b>(23.616)</b>                | <b>(0,25)</b>        |

<sup>#</sup>Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

## Credit-Default-Swap-Kontrakte (0,21 %) (31. Dezember 2022: (0,07 %))

|  | Nominalwert | Fälligkeit | Gegenpartei                 | Referenzverbindlichkeit                                  | Zeitwert EUR    | % des Nettovermögens |
|--|-------------|------------|-----------------------------|--|-----------------|----------------------|
| EUR  | 500.000     | 20.06.2028 | ICE Clear U.S. <sup>1</sup> | Buying default protection on iTRAXX Europe Crossover S39 | (19.870)        | (0,21)               |
| <b>Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten insgesamt<sup>±</sup></b> |             |            |                             |  | <b>(19.870)</b> | <b>(0,21)</b>        |

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

|   | Zeitwert EUR     | % des Nettovermögens |
|---|------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(61.163)</b>  | <b>(0,64)</b>        |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>9.051.129</b> | <b>94,29</b>         |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>548.160</b>   | <b>5,71</b>          |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>9.599.289</b> | <b>100,00</b>        |

| Portfolioanalyse  | Zeitwert EUR     | % des Gesamtvermögens |
|---|------------------|-----------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 7.963.236        | 77,34                 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden            | 1.141.980        | 11,09                 |
| ± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden                          | (11.909)         | (0,12)                |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap                            | (42.178)         | (0,41)                |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>9.051.129</b> | <b>87,90</b>          |

## European High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital-<br>betrag  | Wertpapierbezeichnung  | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 1,39 % (31. Dezember 2022: 0,66 %)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>Euro</b>   |  |         |                       |                  |                              |
| 300.000   | CVC Cordatus Loan Fund XXVII DAC Series 27X Class F                        | 14,16 % | 15.04.2035            | 282.249          | 0,36                         |
| 300.000   | Otranto Park CLO DAC Series 1X Class E                                     | 10,37 % | 15.05.2035            | 279.899          | 0,35                         |
| 350.000   | Vesey Park CLO DAC Series 1X Class E                                       | 13,23 % | 16.11.2032            | 334.215          | 0,42                         |
| <b>Euro insgesamt</b>   |  |         |                       | <b>896.363</b>   | <b>1,13</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>  |  |         |                       |                  |                              |
| 250.000   | Flatiron CLO 17 Ltd Series 2017-1X Class ER                                | 11,22 % | 15.05.2030            | 205.893          | 0,26                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>  |  |         |                       | <b>205.893</b>   | <b>0,26</b>                  |
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) insgesamt **</b>                       |  |         |                       | <b>1.102.256</b> | <b>1,39</b>                  |
| <b>Unternehmensanleihen 95,01 % (31. Dezember 2022: 98,80 %)</b>                          |  |         |                       |                  |                              |
| <b>Euro</b>   |  |         |                       |                  |                              |
| 1.000.000   | Abertis Infraestructuras Finance BV*                                       | 3,25 %  | 29.12.2049            | 900.845          | 1,13                         |
| 104.617   | Adient Global Holdings Ltd*  | 3,50 %  | 15.08.2024            | 102.793          | 0,13                         |
| 320.000   | Afflelou SAS*  | 4,25 %  | 19.05.2026            | 307.464          | 0,39                         |
| 300.000   | Air France-KLM*  | 8,13 %  | 31.05.2028            | 311.276          | 0,39                         |
| 600.000   | Altice Financing SA*   | 2,25 %  | 15.01.2025            | 560.916          | 0,71                         |
| 250.000   | Altice Financing SA**  | 4,25 %  | 15.08.2029            | 192.717          | 0,24                         |
| 100.000   | Altice Finco SA*   | 4,75 %  | 15.01.2028            | 66.812           | 0,08                         |
| 149.000   | Altice France Holding SA*  | 4,00 %  | 15.02.2028            | 73.859           | 0,09                         |
| 250.000   | Altice France Holding SA*  | 8,00 %  | 15.05.2027            | 146.561          | 0,18                         |
| 500.000   | Altice France SA**   | 4,13 %  | 15.01.2029            | 364.012          | 0,46                         |
| 466.000   | Apollo Swedish Bidco AB**  | 8,59 %  | 05.07.2029            | 452.053          | 0,57                         |
| 400.000   | Aramark International Finance Sarl*  | 3,13 %  | 01.04.2025            | 386.360          | 0,49                         |
| 600.000   | Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc* | 3,00 %  | 01.09.2029            | 448.148          | 0,56                         |
| 450.000   | Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc*                      | 2,13 %  | 15.08.2026            | 401.345          | 0,51                         |
| 315.000   | Arena Luxembourg Finance Sarl*   | 1,88 %  | 01.02.2028            | 259.727          | 0,33                         |
| 400.000   | Ashland Services BV**  | 2,00 %  | 30.01.2028            | 340.786          | 0,43                         |
| 160.000   | Assemblin Group AB**   | 8,53 %  | 15.05.2025            | 160.234          | 0,20                         |
| 251.000   | Autostrade per l'Italia SpA*   | 1,88 %  | 26.09.2029            | 211.017          | 0,27                         |
| 150.000   | Avantor Funding Inc**  | 2,63 %  | 01.11.2025            | 144.245          | 0,18                         |
| 650.000   | Avantor Funding Inc*   | 3,88 %  | 15.07.2028            | 597.329          | 0,75                         |
| 200.000   | Azelis Finance NV*   | 5,75 %  | 15.03.2028            | 200.816          | 0,25                         |
| 870.000   | Banjijay Entertainment SASU**  | 3,50 %  | 01.03.2025            | 851.795          | 1,07                         |
| 193.000   | Banjijay Group SAS**   | 6,50 %  | 01.03.2026            | 192.347          | 0,24                         |
| 900.000   | Bayer AG*  | 5,38 %  | 25.03.2082            | 835.875          | 1,05                         |
| 500.000   | BCP V Modular Services Finance II Plc**                                    | 4,75 %  | 30.11.2028            | 427.438          | 0,54                         |
| 188.000   | BCP V Modular Services Finance Plc**                                       | 6,75 %  | 30.11.2029            | 143.350          | 0,18                         |
| 809.000   | Benteler International AG*   | 9,38 %  | 15.05.2028            | 819.113          | 1,03                         |
| 417.000   | BK LC Lux Finco1 Sarl*   | 5,25 %  | 30.04.2029            | 392.955          | 0,49                         |

## European High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                     | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|---------|-----------------------|-----------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 95,01 % (31. Dezember 2022: 98,80 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                 |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |   |         |                       |                 |                              |
| 437.000  | Bormioli Pharma SpA*                      | 8,81 %  | 15.05.2028            | 426.990         | 0,54                         |
| 400.000  | Canpack SA/Canpack US LLC*                | 2,38 %  | 01.11.2027            | 333.880         | 0,42                         |
| 160.000  | Castle UK Finco Plc**                     | 8,57 %  | 15.05.2028            | 140.408         | 0,18                         |
| 100.000  | Castor SpA*                               | 6,00 %  | 15.02.2029            | 86.243          | 0,11                         |
| 143.000  | Castor SpA*                               | 8,78 %  | 15.02.2029            | 133.347         | 0,17                         |
| 900.000  | CECONOMY AG*                              | 1,75 %  | 24.06.2026            | 707.285         | 0,89                         |
| 150.000  | Cedacri Mergeco SpA*                      | 7,95 %  | 15.05.2028            | 142.676         | 0,18                         |
| 300.000  | Cellnex Finance Co SA*                    | 1,50 %  | 08.06.2028            | 256.797         | 0,32                         |
| 1.100.000  | Cellnex Telecom SA*                       | 1,75 %  | 23.10.2030            | 889.705         | 1,12                         |
| 400.000  | Cheplapharm Arzneimittel GmbH**           | 4,38 %  | 15.01.2028            | 367.190         | 0,46                         |
| 130.000  | Cheplapharm Arzneimittel GmbH*            | 7,50 %  | 15.05.2030            | 130.861         | 0,16                         |
| 600.000  | Clarios Global LP/Clarios US Finance Co** | 4,38 %  | 15.05.2026            | 573.668         | 0,72                         |
| 402.000  | Constellium SE*                           | 3,13 %  | 15.07.2029            | 340.333         | 0,43                         |
| 200.000  | Constellium SE*                           | 4,25 %  | 15.02.2026            | 195.593         | 0,25                         |
| 400.000  | Coty Inc**                                | 3,88 %  | 15.04.2026            | 388.700         | 0,49                         |
| 420.000  | Ctec II GmbH**                            | 5,25 %  | 15.02.2030            | 349.146         | 0,44                         |
| 500.000  | Cullinan Holdco Scsp**                    | 4,63 %  | 15.10.2026            | 424.930         | 0,54                         |
| 365.000  | Dana Financing Luxembourg Sarl*           | 8,50 %  | 15.07.2031            | 377.592         | 0,48                         |
| 300.000  | Deutsche Lufthansa AG*                    | 3,00 %  | 29.05.2026            | 285.764         | 0,36                         |
| 300.000  | Deutsche Lufthansa AG*                    | 3,50 %  | 14.07.2029            | 272.390         | 0,34                         |
| 700.000  | Deutsche Lufthansa AG*                    | 3,75 %  | 11.02.2028            | 662.182         | 0,83                         |
| 860.000  | Douglas GmbH*                             | 6,00 %  | 08.04.2026            | 792.530         | 1,00                         |
| 1.100.000  | EDP - Energias de Portugal SA*            | 5,94 %  | 23.04.2083            | 1.091.870       | 1,38                         |
| 350.000  | eircom Finance DAC**                      | 3,50 %  | 15.05.2026            | 327.731         | 0,41                         |
| 400.000  | Electricite de France SA*                 | 2,63 %  | 29.12.2049            | 323.750         | 0,41                         |
| 300.000  | Electricite de France SA*                 | 4,00 %  | 29.12.2049            | 291.843         | 0,37                         |
| 600.000  | Electricite de France SA*                 | 5,00 %  | 29.12.2049            | 567.711         | 0,71                         |
| 1.000.000  | Electricite de France SA*                 | 7,50 %  | 29.12.2049            | 1.018.072       | 1,28                         |
| 244.000  | Emerald Debt Merger Sub LLC**             | 6,38 %  | 15.12.2030            | 243.877         | 0,31                         |
| 264.000  | Emeria SASU**                             | 3,38 %  | 31.03.2028            | 212.824         | 0,27                         |
| 310.000  | Emeria SASU**                             | 7,75 %  | 31.03.2028            | 288.035         | 0,36                         |
| 100.000  | Encore Capital Group Inc*                 | 4,88 %  | 15.10.2025            | 93.799          | 0,12                         |
| 530.000  | Fiber Bidco SpA*                          | 9,60 %  | 25.10.2027            | 532.995         | 0,67                         |
| 100.000  | Fiber Bidco SpA*                          | 11,00 % | 25.10.2027            | 107.185         | 0,14                         |
| 330.000  | Food Service Project SA*                  | 5,50 %  | 21.01.2027            | 315.676         | 0,40                         |
| 590.000  | Ford Motor Credit Co LLC*                 | 3,02 %  | 06.03.2024            | 582.938         | 0,73                         |
| 710.000  | Ford Motor Credit Co LLC*                 | 4,87 %  | 03.08.2027            | 697.742         | 0,88                         |
| 100.000  | Forvia*                                   | 2,38 %  | 15.06.2027            | 88.336          | 0,11                         |
| 200.000  | Forvia*                                   | 2,63 %  | 15.06.2025            | 191.125         | 0,24                         |
| 287.000  | Forvia*                                   | 2,75 %  | 15.02.2027            | 260.644         | 0,33                         |

## European High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                         | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|---------|-----------------------|-----------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 95,01 % (31. Dezember 2022: 98,80 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                 |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |   |         |                       |                 |                              |
| 200.000  | Forvia*                                       | 3,75 %  | 15.06.2028            | 181.628         | 0,23                         |
| 400.000  | Forvia*                                       | 7,25 %  | 15.06.2026            | 416.750         | 0,52                         |
| 531.000  | Grifols Escrow Issuer SA*                     | 3,88 %  | 15.10.2028            | 455.713         | 0,57                         |
| 200.000  | Gruenthal GmbH*                               | 3,63 %  | 15.11.2026            | 188.724         | 0,24                         |
| 300.000  | Gruenthal GmbH**                              | 4,13 %  | 15.05.2028            | 279.189         | 0,35                         |
| 400.000  | Grupo Antolin-Irausa SA*                      | 3,50 %  | 30.04.2028            | 293.250         | 0,37                         |
| 441.000  | Guala Closures SpA*                           | 3,25 %  | 15.06.2028            | 394.141         | 0,50                         |
| 200.000  | Heimstaden Bostad AB*                         | 3,00 %  | 29.12.2049            | 99.495          | 0,13                         |
| 570.000  | Heimstaden Bostad AB*                         | 3,25 %  | 29.12.2049            | 344.213         | 0,43                         |
| 415.000  | House of HR Group BV**                        | 9,00 %  | 03.11.2029            | 410.850         | 0,52                         |
| 350.000  | IHO Verwaltungs GmbH*                         | 3,75 %  | 15.09.2026            | 327.430         | 0,41                         |
| 400.000  | IHO Verwaltungs GmbH*                         | 3,88 %  | 15.05.2027            | 362.174         | 0,46                         |
| 529.000  | IHO Verwaltungs GmbH*                         | 8,75 %  | 15.05.2028            | 546.780         | 0,69                         |
| 480.000  | Iliad Holding SASU**                          | 5,13 %  | 15.10.2026            | 459.895         | 0,58                         |
| 200.000  | Iliad Holding SASU**                          | 5,63 %  | 15.10.2028            | 185.685         | 0,23                         |
| 200.000  | iliad SA*                                     | 5,38 %  | 14.06.2027            | 197.876         | 0,25                         |
| 600.000  | INEOS Quattro Finance 1 Plc*                  | 3,75 %  | 15.07.2026            | 529.920         | 0,67                         |
| 400.000  | Infineon Technologies AG*                     | 2,88 %  | 29.12.2049            | 381.608         | 0,48                         |
| 100.000  | Infineon Technologies AG*                     | 3,63 %  | 29.12.2049            | 91.541          | 0,12                         |
| 200.000  | International Consolidated Airlines Group SA* | 3,75 %  | 25.03.2029            | 175.000         | 0,22                         |
| 307.456  | Intrum AB*                                    | 3,13 %  | 15.07.2024            | 286.353         | 0,36                         |
| 297.000  | IPD 3 BV*                                     | 8,00 %  | 15.06.2028            | 303.680         | 0,38                         |
| 300.000  | IQVIA Inc*                                    | 2,88 %  | 15.09.2025            | 291.494         | 0,37                         |
| 480.000  | IQVIA Inc**                                   | 2,88 %  | 15.06.2028            | 433.534         | 0,55                         |
| 300.000  | Italmatch Chemicals SpA*                      | 10,00 % | 06.02.2028            | 293.244         | 0,37                         |
| 100.000  | Jaguar Land Rover Automotive Plc*             | 4,50 %  | 15.07.2028            | 87.640          | 0,11                         |
| 470.000  | Jaguar Land Rover Automotive Plc*             | 6,88 %  | 15.11.2026            | 468.074         | 0,59                         |
| 336.000  | Kapla Holding SAS*                            | 3,38 %  | 15.12.2026            | 306.010         | 0,39                         |
| 126.000  | Kapla Holding SAS*                            | 8,68 %  | 15.07.2027            | 127.590         | 0,16                         |
| 100.000  | KION Group AG*                                | 1,63 %  | 24.09.2025            | 93.761          | 0,12                         |
| 600.000  | Koninklijke KPN NV*                           | 6,00 %  | 29.12.2049            | 608.713         | 0,77                         |
| 385.000  | Kronos International Inc**                    | 3,75 %  | 15.09.2025            | 352.260         | 0,44                         |
| 1.300.000  | Lorca Telecom Bondco SA*                      | 4,00 %  | 18.09.2027            | 1.188.851       | 1,50                         |
| 352.000  | Loxam SAS*                                    | 5,75 %  | 15.07.2027            | 323.136         | 0,41                         |
| 298.000  | Loxam SAS*                                    | 6,38 %  | 15.05.2028            | 295.642         | 0,37                         |
| 350.000  | Lune Holdings Sarl**                          | 5,63 %  | 15.11.2028            | 286.912         | 0,36                         |
| 460.000  | Matterhorn Telecom SA**                       | 3,13 %  | 15.09.2026            | 429.125         | 0,54                         |
| 200.000  | Maxeda DIY Holding BV**                       | 5,88 %  | 01.10.2026            | 144.073         | 0,18                         |
| 297.000  | Monitchem HoldCo 3 SA*                        | 8,75 %  | 01.05.2028            | 294.076         | 0,37                         |
| 500.000  | Mooney Group SpA**                            | 7,42 %  | 17.12.2026            | 495.812         | 0,62                         |

## European High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                           | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|---------|-----------------------|-----------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 95,01 % (31. Dezember 2022: 98,80 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                 |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |   |         |                       |                 |                              |
| 315.000  | NH Hotel Group SA*                              | 4,00 %  | 02.07.2026            | 301.064         | 0,38                         |
| 550.000  | Nidda Healthcare Holding GmbH**                 | 7,50 %  | 21.08.2026            | 548.600         | 0,69                         |
| 400.000  | Olympus Water US Holding Corp*                  | 3,88 %  | 01.10.2028            | 316.677         | 0,40                         |
| 100.000  | Olympus Water US Holding Corp*                  | 5,38 %  | 01.10.2029            | 70.063          | 0,09                         |
| 200.000  | Olympus Water US Holding Corp*                  | 9,63 %  | 15.11.2028            | 192.500         | 0,24                         |
| 600.000  | Organon & Co/Organon Foreign Debt Co-Issuer BV* | 2,88 %  | 30.04.2028            | 522.249         | 0,66                         |
| 246.000  | PCF GmbH*                                       | 4,75 %  | 15.04.2026            | 190.208         | 0,24                         |
| 495.000  | PEU Finance Plc*                                | 7,25 %  | 01.07.2028            | 496.108         | 0,62                         |
| 150.000  | Picard Bondco SA*                               | 5,38 %  | 01.07.2027            | 131.139         | 0,17                         |
| 375.000  | Picard Groupe SAS*                              | 3,88 %  | 01.07.2026            | 345.234         | 0,43                         |
| 600.000  | PLT VII Finance Sarl**                          | 4,63 %  | 05.01.2026            | 584.475         | 0,74                         |
| 400.000  | PrestigeBidCo GmbH**                            | 9,18 %  | 15.07.2027            | 404.140         | 0,51                         |
| 720.000  | Primo Water Holdings Inc**                      | 3,88 %  | 31.10.2028            | 628.073         | 0,79                         |
| 100.000  | RCS & RDS SA*                                   | 2,50 %  | 05.02.2025            | 95.627          | 0,12                         |
| 100.000  | RCS & RDS SA*                                   | 3,25 %  | 05.02.2028            | 84.750          | 0,11                         |
| 700.000  | Rossini Sarl*                                   | 7,13 %  | 30.10.2025            | 699.895         | 0,88                         |
| 300.000  | Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB*            | 1,00 %  | 12.08.2027            | 195.286         | 0,25                         |
| 200.000  | Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB*            | 2,62 %  | 29.12.2049            | 40.580          | 0,05                         |
| 400.000  | Schaeffler AG*                                  | 3,38 %  | 12.10.2028            | 365.728         | 0,46                         |
| 500.000  | SES SA*   | 5,63 %  | 29.12.2049            | 497.465         | 0,63                         |
| 350.000  | SPCM SA*  | 2,63 %  | 01.02.2029            | 306.990         | 0,39                         |
| 680.000  | Summer BC Holdco B Sarl**                       | 5,75 %  | 31.10.2026            | 606.475         | 0,76                         |
| 400.000  | Summit Properties Ltd*                          | 2,00 %  | 31.01.2025            | 366.998         | 0,46                         |
| 200.000  | Synthomer Plc*                                  | 3,88 %  | 01.07.2025            | 185.518         | 0,23                         |
| 307.719  | Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH**        | 6,00 %  | 30.07.2026            | 302.738         | 0,38                         |
| 1.170.000  | Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH**        | 2,00 %  | 15.07.2025            | 1.115.123       | 1,40                         |
| 100.000  | Telecom Italia Finance SA*                      | 7,75 %  | 24.01.2033            | 104.831         | 0,13                         |
| 350.000  | Telecom Italia SpA**                            | 1,63 %  | 18.01.2029            | 269.520         | 0,34                         |
| 200.000  | Telecom Italia SpA*                             | 2,38 %  | 12.10.2027            | 170.973         | 0,22                         |
| 200.000  | Telecom Italia SpA*                             | 2,88 %  | 28.01.2026            | 186.847         | 0,24                         |
| 650.000  | Telecom Italia SpA**                            | 3,00 %  | 30.09.2025            | 614.737         | 0,77                         |
| 950.000  | Telecom Italia SpA**                            | 4,00 %  | 11.04.2024            | 938.894         | 1,18                         |
| 100.000  | Telecom Italia SpA*                             | 6,88 %  | 15.02.2028            | 99.841          | 0,13                         |
| 600.000  | Telefonica Europe BV*                           | 2,88 %  | 29.12.2049            | 517.558         | 0,65                         |
| 200.000  | Telefonica Europe BV*                           | 3,88 %  | 29.12.2049            | 185.193         | 0,23                         |
| 400.000  | Telefonica Europe BV*                           | 4,38 %  | 29.12.2049            | 391.000         | 0,49                         |
| 540.000  | Tendam Brands SAU*                              | 10,75 % | 31.03.2028            | 540.743         | 0,68                         |
| 570.000  | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV*  | 1,63 %  | 15.10.2028            | 441.904         | 0,56                         |
| 550.000  | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV*  | 4,38 %  | 09.05.2030            | 470.446         | 0,59                         |
| 600.000  | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV*  | 4,50 %  | 01.03.2025            | 594.624         | 0,75                         |

## European High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 95,01 % (31. Dezember 2022: 98,80 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                   |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |   |        |                       |                   |                              |
| 100.000  | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV <sup>*</sup>        | 7,38 % | 15.09.2029            | 102.124           | 0,13                         |
| 457.000  | Motion Finco Sarl <sup>*</sup>                                    | 7,38 % | 15.06.2030            | 455.526           | 0,57                         |
| 456.000  | Multiversity SRL <sup>*</sup>                                     | 7,50 % | 30.10.2028            | 451.528           | 0,57                         |
| 220.000  | Netflix Inc <sup>*</sup>  | 3,63 % | 15.06.2030            | 209.727           | 0,26                         |
| 202.000  | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV <sup>*</sup>        | 7,88 % | 15.09.2031            | 209.352           | 0,26                         |
| 694.000  | TI Automotive Finance Plc <sup>**</sup>                           | 3,75 % | 15.04.2029            | 555.793           | 0,70                         |
| 363.000  | Titan Holdings II BV <sup>*</sup>                                 | 5,13 % | 15.07.2029            | 289.130           | 0,36                         |
| 360.000  | TK Elevator Holdco GmbH <sup>**</sup>                             | 6,63 % | 15.07.2028            | 308.988           | 0,39                         |
| 400.000  | TK Elevator Midco GmbH <sup>**</sup>                              | 4,38 % | 15.07.2027            | 358.560           | 0,45                         |
| 300.000  | TMNL Holding BV <sup>**</sup>                                     | 3,75 % | 15.01.2029            | 262.660           | 0,33                         |
| 700.000  | Trivium Packaging Finance BV <sup>*</sup>                         | 3,75 % | 15.08.2026            | 647.967           | 0,82                         |
| 455.000  | UGI International LLC <sup>**</sup>                               | 2,50 % | 01.12.2029            | 358.549           | 0,45                         |
| 400.000  | United Group BV <sup>**</sup>                                     | 5,25 % | 01.02.2030            | 317.484           | 0,40                         |
| 150.000  | UPC Holding BV <sup>*</sup>                                       | 3,88 % | 15.06.2029            | 120.782           | 0,15                         |
| 400.000  | UPCB Finance VII Ltd <sup>*</sup>                                 | 3,63 % | 15.06.2029            | 344.394           | 0,43                         |
| 200.000  | Valeo <sup>*</sup>  | 1,00 % | 03.08.2028            | 162.455           | 0,20                         |
| 900.000  | Valeo <sup>*</sup>  | 5,38 % | 28.05.2027            | 901.372           | 1,14                         |
| 400.000  | Veolia Environnement SA <sup>*</sup>                              | 2,25 % | 29.12.2049            | 362.495           | 0,46                         |
| 400.000  | Verallia SA <sup>*</sup>  | 1,88 % | 10.11.2031            | 322.428           | 0,41                         |
| 1.000.000  | Verisure Holding AB <sup>*</sup>                                  | 3,88 % | 15.07.2026            | 940.708           | 1,18                         |
| 401.000  | Verisure Midholding AB <sup>*</sup>                               | 5,25 % | 15.02.2029            | 348.619           | 0,44                         |
| 400.000  | Virgin Media Finance Plc <sup>**</sup>                            | 3,75 % | 15.07.2030            | 316.744           | 0,40                         |
| 200.000  | Vodafone Group Plc <sup>*</sup>                                   | 2,63 % | 27.08.2080            | 180.737           | 0,23                         |
| 400.000  | Vodafone Group Plc <sup>*</sup>                                   | 4,20 % | 03.10.2078            | 366.512           | 0,46                         |
| 450.000  | WEPA Hygieneprodukte GmbH <sup>**</sup>                           | 2,88 % | 15.12.2027            | 390.820           | 0,49                         |
| 470.000  | WMG Acquisition Corp <sup>*</sup>                                 | 2,25 % | 15.08.2031            | 374.303           | 0,47                         |
| 300.000  | Wp/ap Telecom Holdings III BV <sup>**</sup>                       | 5,50 % | 15.01.2030            | 250.492           | 0,32                         |
| 300.000  | ZF Europe Finance BV <sup>*</sup>                                 | 3,00 % | 23.10.2029            | 253.845           | 0,32                         |
| 500.000  | ZF Finance GmbH <sup>*</sup>                                      | 3,00 % | 21.09.2025            | 474.781           | 0,60                         |
| 200.000  | ZF Finance GmbH <sup>*</sup>                                      | 3,75 % | 21.09.2028            | 180.458           | 0,23                         |
| 575.000  | Ziggo Bond Co BV <sup>*</sup>                                     | 3,38 % | 28.02.2030            | 425.023           | 0,54                         |
| <b>Euro insgesamt</b>  |   |        |                       | <b>65.603.563</b> | <b>82,62</b>                 |
| <b>Britisches Pfund</b>  |   |        |                       |                   |                              |
| 369.000  | AA Bond Co Ltd <sup>*</sup>                                       | 6,50 % | 31.01.2026            | 372.778           | 0,47                         |
| 434.000  | AA Bond Co Ltd <sup>*</sup>                                       | 7,38 % | 31.07.2029            | 457.730           | 0,58                         |
| 300.000  | Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc <sup>*</sup> | 4,75 % | 15.07.2027            | 278.174           | 0,35                         |
| 300.000  | Aroundtown SA <sup>*</sup>  | 4,75 % | 29.12.2049            | 126.146           | 0,16                         |
| 450.000  | B&M European Value Retail SA <sup>*</sup>                         | 3,63 % | 15.07.2025            | 505.374           | 0,64                         |
| 100.000  | B&M European Value Retail SA <sup>*</sup>                         | 4,00 % | 15.11.2028            | 100.142           | 0,13                         |

## European High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                         | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|---------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 95,01 % (31. Dezember 2022: 98,80 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                   |                              |
| <b>Britisches Pfund (Fortsetzung)</b>  |   |         |                       |                   |                              |
| 500.000  | Bellis Acquisition Co Plc**                   | 3,25 %  | 16.02.2026            | 489.067           | 0,61                         |
| 544.000  | British Telecommunications Plc*               | 8,38 %  | 20.12.2083            | 624.155           | 0,79                         |
| 300.000  | Castle UK Finco Plc**                         | 7,00 %  | 15.05.2029            | 280.887           | 0,35                         |
| 400.000  | CPUK Finance Ltd**                            | 6,50 %  | 28.08.2026            | 445.171           | 0,56                         |
| 100.000  | Encore Capital Group Inc*                     | 5,38 %  | 15.02.2026            | 102.476           | 0,13                         |
| 400.000  | Ford Motor Credit Co LLC*                     | 4,54 %  | 06.03.2025            | 443.257           | 0,56                         |
| 365.000  | Iceland Bondco Plc*                           | 4,63 %  | 15.03.2025            | 406.209           | 0,51                         |
| 452.000  | Maison Finco Plc**                            | 6,00 %  | 31.10.2027            | 409.260           | 0,51                         |
| 360.000  | Marks & Spencer Plc*                          | 3,75 %  | 19.05.2026            | 378.574           | 0,48                         |
| 400.000  | Mobico Group Plc*                             | 4,25 %  | 29.12.2049            | 408.536           | 0,51                         |
| 800.000  | NGG Finance Plc*                              | 5,63 %  | 18.06.2073            | 887.498           | 1,12                         |
| 250.000  | Pinewood Finance Co Ltd**                     | 3,25 %  | 30.09.2025            | 268.385           | 0,34                         |
| 162.000  | Pinnacle Bidco Plc*                           | 6,38 %  | 15.02.2025            | 180.278           | 0,23                         |
| 350.000  | RAC Bond Co Plc**                             | 5,25 %  | 04.11.2027            | 326.295           | 0,41                         |
| 111.000  | Sherwood Financing Plc**                      | 6,00 %  | 15.11.2026            | 108.536           | 0,14                         |
| 200.000  | Stonegate Pub Co Financing 2019 Plc**         | 8,25 %  | 31.07.2025            | 214.166           | 0,27                         |
| 250.000  | Travis Perkins Plc*                           | 3,75 %  | 17.02.2026            | 262.158           | 0,33                         |
| 481.000  | TVL Finance Plc*                              | 10,25 % | 28.04.2028            | 548.878           | 0,69                         |
| 300.000  | Virgin Media Secured Finance Plc*             | 5,00 %  | 15.04.2027            | 317.946           | 0,40                         |
| 500.000  | Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC** | 4,88 %  | 15.07.2028            | 463.717           | 0,58                         |
| 200.000  | Vodafone Group Plc*                           | 4,88 %  | 03.10.2078            | 218.654           | 0,27                         |
| 246.000  | Zenith Finco Plc**                            | 6,50 %  | 30.06.2027            | 218.869           | 0,27                         |
| <b>Britisches Pfund insgesamt</b>  |   |         |                       | <b>9.843.316</b>  | <b>12,39</b>                 |
| <b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>  |   |         |                       | <b>75.446.879</b> | <b>95,01</b>                 |
| <b>Mittelfristige Schuldverschreibungen 0,27 % (31. Dezember 2022: 0,63 %)</b> |   |         |                       |                   |                              |
| <b>Euro</b>  |   |         |                       |                   |                              |
| 94.016   | Aernnova Aerospace SAU                        | 6,48 %  | 26.02.2027            | 89.276            | 0,11                         |
| 24.107   | Aernnova Aerospace SAU                        | 6,59 %  | 26.02.2027            | 22.892            | 0,03                         |
| 100.000  | Rain Carbon Inc                               | 5,63 %  | 16.01.2025            | 99.125            | 0,13                         |
| <b>Mittelfristige Schuldverschreibungen insgesamt †</b>                        |   |         |                       | <b>211.293</b>    | <b>0,27</b>                  |
| <b>Anlagen insgesamt</b>   |   |         |                       | <b>76.760.428</b> | <b>96,67</b>                 |

Devisenterminkontrakte 0,31 % (31. Dezember 2022: 3,87 %)

| Geforderter<br>Betrag           | Zu zahlender<br>Betrag | Fälligkeits-<br>datum | Gegenpartei          | Kontrakte | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn EUR | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---------------------------------|------------------------|-----------------------|----------------------|-----------|-------------------------------------|------------------------------|
| 583.722 €                       | 500.000 £              | 20.07.2023            | UBS AG               | 1         | 1.458                               | 0,00                         |
| 597.322 US\$                    | 544.724 €              | 20.07.2023            | UBS AG               | 1         | 2.349                               | 0,00                         |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i> |                        |                       |                      |           |                                     |                              |
| 778.874 CHF                     | 792.730 €              | 20.07.2023            | Westpac Banking Corp | 6         | 5.915                               | 0,01                         |



## European High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 0,31 % (31. Dezember 2022: 3,87 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn EUR | % des Nettovermögens        |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|-------------------------------|-----------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen USD</i>  |                     |                  |                             |           |                               |                             |
| 473.830 US\$   | 430.332 €           | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | 3.639                         | 0,01                        |
| 42.235.008 US\$  | 38.449.097 €        | 20.07.2023       | UBS AG                      | 2         | 233.000                       | 0,29                        |
| 4.299 US\$   | 3.895 €             | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 6         | 42                            | 0,00                        |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>                        |                     |                  |                             |           | <b>246.403</b>                | <b>0,31</b>                 |
|  |                     |                  |                             |           | <b>Zeitwert</b>               | <b>% des Nettovermögens</b> |
|  |                     |                  |                             |           | <b>EUR</b>                    |                             |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> |                     |                  |                             |           | <b>77.006.831</b>             | <b>96,98</b>                |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (0,35 %) (31. Dezember 2022: (9,59 %))

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust EUR | % des Nettovermögens        |
|---|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|-----------------------------|
| 4.019.540 €   | 3.497.164 £         | 20.07.2023       | UBS AG                      | 10        | (53.004)                       | (0,07)                      |
| 810.778 €   | 892.477 US\$        | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 1         | (6.621)                        | (0,01)                      |
| 5.164.461 €   | 4.539.857 £         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 2         | (122.330)                      | (0,15)                      |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i>   |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 198.417 CHF   | 204.413 €           | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 3         | (959)                          | (0,00)                      |
| 11.282 €  | 11.035 CHF          | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 4         | (32)                           | (0,00)                      |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>   |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 556 €   | 611 US\$            | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | (3)                            | (0,00)                      |
| <i>Abgesicherte Klassen USD</i>   |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 14.389.958 €  | 15.806.873 US\$     | 20.07.2023       | UBS AG                      | 2         | (87.202)                       | (0,11)                      |
| 140.051 €   | 155.041 US\$        | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 3         | (1.947)                        | (0,00)                      |
| 144.445 US\$  | 133.154 €           | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (860)                          | (0,00)                      |
| 202.569 US\$  | 188.970 €           | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | (3.441)                        | (0,01)                      |
| 9.677 US\$  | 8.999 €             | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 4         | (137)                          | (0,00)                      |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>                          |                     |                  |                             |           | <b>(276.536)</b>               | <b>(0,35)</b>               |
|   |                     |                  |                             |           | <b>Zeitwert</b>                | <b>% des Nettovermögens</b> |
|   |                     |                  |                             |           | <b>EUR</b>                     |                             |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> |                     |                  |                             |           | <b>(276.536)</b>               | <b>(0,35)</b>               |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              |                     |                  |                             |           | <b>76.730.295</b>              | <b>96,63</b>                |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  |                     |                  |                             |           | <b>2.675.077</b>               | <b>3,37</b>                 |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   |                     |                  |                             |           | <b>79.405.372</b>              | <b>100,00</b>               |

## European High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

| Portfolioanalyse  | EUR               | % des<br>Gesamtver-<br>mögens |
|---|-------------------|-------------------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 53.026.840        | 65,33                         |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden            | 23.522.295        | 28,98                         |
| † Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente  | 211.293           | 0,26                          |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente   | (30.133)          | (0,04)                        |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>76.730.295</b> | <b>94,53</b>                  |

## European Sustainable Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der Anteile                                 | Wertpapierbezeichnung              | Zeitwert EUR      | % des Nettovermögens |
|--|------------------------------------|-------------------|----------------------|
| <b>Aktien 99,34 % (31. Dezember 2022: 99,17 %)</b> |                                    |                   |                      |
| <b>Dänische Krone</b>                              |                                    |                   |                      |
| 71.962   | Netcompany Group A/S               | 2.729.292         | 1,60                 |
| 54.581   | Novo Nordisk A/S Class B           | 8.058.967         | 4,71                 |
|  | <b>Dänische Krone insgesamt</b>    | <b>10.788.259</b> | <b>6,31</b>          |
| <b>Euro</b>  |                                    |                   |                      |
| 4.313  | Adyen NV                           | 6.839.555         | 4,00                 |
| 83.751   | Alfen NV                           | 5.157.387         | 3,02                 |
| 14.932   | ASML Holding NV                    | 9.899.916         | 5,79                 |
| 29.680   | Beiersdorf AG                      | 3.598.700         | 2,11                 |
| 149.552  | Cellnex Telecom SA                 | 5.531.929         | 3,24                 |
| 102.991  | Euronext NV                        | 6.416.339         | 3,75                 |
| 12.370   | Ferrari NV                         | 3.704.815         | 2,17                 |
| 196.922  | HelloFresh SE                      | 4.450.437         | 2,60                 |
| 11.667   | Kering SA                          | 5.898.835         | 3,45                 |
| 13.576   | L'Oreal SA                         | 5.798.310         | 3,39                 |
| 61.299   | RELX Plc                           | 1.872.072         | 1,09                 |
| 24.464   | Reply SpA                          | 2.546.702         | 1,49                 |
| 17.125   | Sartorius Stedim Biotech           | 3.916.488         | 2,29                 |
| 45.166   | Schneider Electric SE              | 7.518.332         | 4,40                 |
| 87.043   | Scout24 SE                         | 5.055.458         | 2,96                 |
| 121.747  | TeamViewer SE                      | 1.790.898         | 1,05                 |
| 112.915  | Zalando SE                         | 2.976.439         | 1,74                 |
|  | <b>Euro insgesamt</b>              | <b>82.972.612</b> | <b>48,54</b>         |
| <b>Norwegische Krone</b>                           |                                    |                   |                      |
| 100.767  | Bakkafrost P/F                     | 5.534.714         | 3,24                 |
|  | <b>Norwegische Krone insgesamt</b> | <b>5.534.714</b>  | <b>3,24</b>          |
| <b>Britisches Pfund</b>                            |                                    |                   |                      |
| 317.427  | 3i Group Plc                       | 7.207.499         | 4,22                 |
| 169.567  | CVS Group Plc                      | 3.910.457         | 2,29                 |
| 104.295  | Dechra Pharmaceuticals Plc         | 4.479.806         | 2,62                 |
| 63.197   | London Stock Exchange Group Plc    | 6.161.049         | 3,60                 |
|  | <b>Britisches Pfund insgesamt</b>  | <b>21.758.811</b> | <b>12,73</b>         |
| <b>Schwedische Krone</b>                           |                                    |                   |                      |
| 297.365  | Assa Abloy AB Class B              | 6.535.650         | 3,82                 |
| 507.629  | Atlas Copco AB Class A             | 6.694.169         | 3,92                 |
|  | <b>Schwedische Krone insgesamt</b> | <b>13.229.819</b> | <b>7,74</b>          |

## European Sustainable Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile  | Wertpapierbezeichnung              | Zeitwert EUR        | % des Nettovermögens         |
|---|------------------------------------|---------------------|------------------------------|
| <b>Aktien 99,34% (31. Dezember 2022: 99,17 %) (Fortsetzung)</b>   |                                    |                     |                              |
| <b>Schweizer Franken</b>  |                                    |                     |                              |
| 81.718  | Nestle SA                          | 9.008.491           | 5,27                         |
| 7.315   | Partners Group Holding AG          | 6.307.280           | 3,69                         |
| 48.265  | Straumann Holding AG               | 7.177.471           | 4,20                         |
| 15.582  | Tecan Group AG                     | 5.478.890           | 3,21                         |
| 13.450  | VAT Group AG                       | 5.098.543           | 2,98                         |
|   | <b>Schweizer Franken insgesamt</b> | <b>33.070.675</b>   | <b>19,35</b>                 |
| <b>US-Dollar</b>  |                                    |                     |                              |
| 9.928   | SolarEdge Technologies Inc         | 2.448.331           | 1,43                         |
|   | <b>US-Dollar insgesamt</b>         | <b>2.448.331</b>    | <b>1,43</b>                  |
|   | <b>Aktien insgesamt *</b>          | <b>169.803.221</b>  | <b>99,34</b>                 |
|   | <b>Anlagen insgesamt</b>           | <b>169.803.221</b>  | <b>99,34</b>                 |
|   |                                    | <b>Zeitwert EUR</b> | <b>% des Nettovermögens</b>  |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>  |                                    | <b>169.803.221</b>  | <b>99,34</b>                 |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>            |                                    | <b>169.803.221</b>  | <b>99,34</b>                 |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  |                                    | <b>1.126.081</b>    | <b>0,66</b>                  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                 |                                    | <b>170.929.302</b>  | <b>100,00</b>                |
| <b>Portfolioanalyse</b>   |                                    | <b>EUR</b>          | <b>% des Gesamtvermögens</b> |
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind |                                    | 169.803.221         | 98,86                        |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  |                                    | <b>169.803.221</b>  | <b>98,86</b>                 |

## Event Driven - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital-<br>betrag  | Wertpapierbezeichnung       | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-----------------------------|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Schatzwechsel 87,00 % (31. Dezember 2022: 81,61 %)</b> |                             |        |                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar</b>  |                             |        |                       |                   |                              |
| 3.000.000   | United States Treasury Bill | 0,00 % | 05.07.2023            | 2.999.183         | 3,48                         |
| 3.000.000   | United States Treasury Bill | 0,00 % | 06.07.2023            | 2.998.764         | 3,48                         |
| 3.000.000   | United States Treasury Bill | 0,00 % | 13.07.2023            | 2.995.832         | 3,48                         |
| 3.000.000   | United States Treasury Bill | 0,00 % | 20.07.2023            | 2.992.913         | 3,47                         |
| 4.000.000   | United States Treasury Bill | 0,00 % | 01.08.2023            | 3.983.704         | 4,63                         |
| 4.000.000   | United States Treasury Bill | 0,00 % | 10.08.2023            | 3.978.351         | 4,62                         |
| 4.000.000   | United States Treasury Bill | 0,00 % | 17.08.2023            | 3.974.215         | 4,61                         |
| 4.000.000   | United States Treasury Bill | 0,00 % | 24.08.2023            | 3.970.100         | 4,61                         |
| 8.650.000   | United States Treasury Bill | 0,00 % | 31.08.2023            | 8.576.896         | 9,96                         |
| 4.000.000   | United States Treasury Bill | 0,00 % | 07.09.2023            | 3.962.380         | 4,60                         |
| 4.000.000   | United States Treasury Bill | 0,00 % | 14.09.2023            | 3.958.179         | 4,60                         |
| 4.000.000   | United States Treasury Bill | 0,00 % | 19.09.2023            | 3.955.310         | 4,59                         |
| 4.000.000   | United States Treasury Bill | 0,00 % | 26.09.2023            | 3.951.549         | 4,59                         |
| 3.000.000   | United States Treasury Bill | 0,00 % | 03.10.2023            | 2.960.421         | 3,44                         |
| 3.000.000   | United States Treasury Bill | 0,00 % | 10.10.2023            | 2.957.378         | 3,43                         |
| 6.000.000   | United States Treasury Bill | 0,00 % | 17.10.2023            | 5.908.045         | 6,86                         |
| 4.000.000   | United States Treasury Bill | 0,00 % | 24.10.2023            | 3.934.648         | 4,57                         |
| 4.000.000   | United States Treasury Bill | 0,00 % | 02.11.2023            | 3.929.537         | 4,56                         |
| 3.000.000   | United States Treasury Bill | 0,00 % | 09.11.2023            | 2.944.297         | 3,42                         |
| <b>Schatzwechsel insgesamt **</b>                         |                             |        |                       | <b>74.931.702</b> | <b>87,00</b>                 |
| <b>Anlagen insgesamt</b>                                  |                             |        |                       | <b>74.931.702</b> | <b>87,00</b>                 |

## Devisenterminkontrakte 1,64 % (31. Dezember 2022: 2,21 %)

| Geforderter<br>Betrag   | Zu zahlender<br>Betrag | Fälligkeits-<br>datum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|------------------------|-----------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------------|------------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>   |                        |                       |                                |           |                                      |                              |
| 1.964 €   | 2.142 US\$             | 20.07.2023            | State Street Bank and Trust Co | 1         | 2                                    | 0,00                         |
| 3.131 US\$  | 2.831 €                | 20.07.2023            | State Street Bank and Trust Co | 1         | 40                                   | 0,00                         |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>   |                        |                       |                                |           |                                      |                              |
| 4.729.373 €   | 5.969.704 US\$         | 20.07.2023            | State Street Bank and Trust Co | 3         | 43.638                               | 0,05                         |
| 56.656.752 €  | 70.668.322 US\$        | 20.07.2023            | Westpac Banking Corp           | 55        | 1.370.067                            | 1,59                         |
| 74.480 US\$   | 58.460 €               | 20.07.2023            | Westpac Banking Corp           | 6         | 148                                  | 0,00                         |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                        |                       |                                |           | <b>1.413.895</b>                     | <b>1,64</b>                  |

## Event Driven - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

**Total Return Swap-Kontrakte 0,49 % (31. Dezember 2022: 0,04 %)**

| Nominalwert  | Datum der Schließung | Variabler Zinssatz | Referenzunternehmen | Nicht realisierter Gewinn US\$                             | % des Nettovermögens |      |
|--|----------------------|--------------------|---------------------|--|----------------------|------|
| USD  | 55.878.997           | 28.10.2024         | 0,25 <sup>1</sup>   | Alphas Managed Accounts Platform CXIV Limited <sup>2</sup> | 428.434              | 0,49 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Total Return Swap-Kontrakten <sup>∞</sup></b> |                      |                    |                     | <b>428.434</b>   | <b>0,49</b>          |      |

<sup>1</sup> Fester Zinssatz.

<sup>2</sup> Die Gegenpartei für die Total Return Swap-Kontrakte ist Morgan Stanley.

|  | Zeitwert US\$     | % des Nettovermögens |
|--|-------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> | <b>76.774.031</b> | <b>89,13</b>         |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

**Devisenterminkontrakte (0,07 %) (31. Dezember 2022: (0,04 %))**

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>  |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 195.079 €  | 213.910 US\$        | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 3         | (914)                           | (0,00)               |
| 190.248 €  | 209.216 US\$        | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 1         | (1.495)                         | (0,00)               |
| 4.412 US\$   | 4.096 €             | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 2         | (60)                            | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>  |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 259.910 £  | 331.223 US\$        | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 4         | (750)                           | (0,00)               |
| 5.216.817 US\$   | 4.131.992 £         | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 2         | (36.962)                        | (0,04)               |
| 1.043.390 US\$   | 837.431 £           | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 21        | (21.393)                        | (0,03)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                                |           | <b>(61.574)</b>                 | <b>(0,07)</b>        |

|   | Zeitwert US\$     | % des Nettovermögens |
|---|-------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(61.574)</b>   | <b>(0,07)</b>        |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>76.712.457</b> | <b>89,06</b>         |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>9.420.527</b>  | <b>10,94</b>         |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>86.132.984</b> | <b>100,00</b>        |

| Portfolioanalyse   | US\$              | % des Gesamtvermögens |
|--|-------------------|-----------------------|
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | 74.931.702        | 86,65                 |
| <sup>∞</sup> OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente                                     | 1.780.755         | 2,06                  |
| <b>Anlagen insgesamt</b>   | <b>76.712.457</b> | <b>88,71</b>          |

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital-<br>betrag  | Wertpapierbezeichnung  | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Agency Bonds 1,63 % (31. Dezember 2022: 1,80 %)</b>                                    |  |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar</b>  |  |        |                       |                  |                              |
| 540.000   | Federal Home Loan Banks*                                       | 5,50 % | 15.07.2036            | 609.830          | 0,45                         |
| 300.000   | Federal National Mortgage Association**                        | 0,50 % | 07.11.2025            | 271.957          | 0,20                         |
| 835.000   | Federal National Mortgage Association**                        | 0,75 % | 08.10.2027            | 724.775          | 0,53                         |
| 640.000   | Federal National Mortgage Association**                        | 0,88 % | 05.08.2030            | 514.803          | 0,38                         |
| 85.000  | Tennessee Valley Authority*                                    | 5,88 % | 01.04.2036            | 96.550           | 0,07                         |
| <b>Agency Bonds insgesamt</b>   |  |        |                       | <b>2.217.915</b> | <b>1,63</b>                  |
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 7,00 % (31. Dezember 2022: 6,57 %)</b> |  |        |                       |                  |                              |
| <b>Euro</b>   |  |        |                       |                  |                              |
| 92.932  | Dutch Property Finance BV Series 2022-2 Class A                | 4,14 % | 28.04.2062            | 101.210          | 0,07                         |
| 164.572   | European Residential Loan Securitisation 2019-NPL2 DAC Class A | 6,44 % | 24.02.2058            | 177.312          | 0,13                         |
| 399.918   | Last Mile Securities - PE 2021 DAC Series 2021-1X Class A2     | 4,41 % | 17.08.2031            | 412.967          | 0,30                         |
| 131.882   | LT Autorahoitus III DAC Series 3 Class A                       | 4,36 % | 17.12.2032            | 144.646          | 0,11                         |
| 198.421   | Primrose Residential Series 2021-1 Class A                     | 4,19 % | 24.03.2061            | 214.997          | 0,16                         |
| 600.000   | Shamrock Residential DAC Series 2022-1 Class C                 | 5,34 % | 24.01.2061            | 649.135          | 0,48                         |
| 291.845   | Shamrock Residential DAC Series 2023-1X Class A                | 4,44 % | 24.06.2071            | 315.505          | 0,23                         |
| <b>Euro insgesamt</b>   |  |        |                       | <b>2.015.772</b> | <b>1,48</b>                  |
| <b>Britisches Pfund</b>   |  |        |                       |                  |                              |
| 200.000   | Gemgarto 2021-1 Plc Series 2021-1X Class B                     | 5,99 % | 16.12.2067            | 251.930          | 0,18                         |
| 120.000   | Mortimer BTL 2021-1 Plc Series 2021-1 Class C                  | 6,37 % | 23.06.2053            | 147.074          | 0,11                         |
| 432.628   | Parkmore Point RMBS 2022-1 Plc                                 | 6,46 % | 25.07.2045            | 552.127          | 0,40                         |
| 300.000   | Sage AR Funding No 1 Plc Class A                               | 5,97 % | 17.11.2030            | 370.926          | 0,27                         |
| 245.591   | Together Asset Backed Securitisation Series 2021-CRE1 Class A  | 6,34 % | 20.01.2055            | 308.803          | 0,23                         |
| 200.000   | Tower Bridge Funding 2021-1 Plc Series 2021-1 Class B          | 6,46 % | 21.07.2064            | 254.244          | 0,19                         |
| <b>Britisches Pfund insgesamt</b>   |  |        |                       | <b>1.885.104</b> | <b>1,38</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>  |  |        |                       |                  |                              |
| 976.351   | CD 2017-CD6 Mortgage Trust Class ASB                           | 3,33 % | 13.11.2050            | 924.005          | 0,68                         |
| 987.123   | Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC27 Class XA         | 1,45 % | 10.02.2048            | 14.239           | 0,01                         |
| 305.000   | COMM 2014-CCRE15 Mortgage Trust Class AM                       | 4,43 % | 10.02.2047            | 298.933          | 0,22                         |
| 1.807.198   | COMM 2014-CCRE17 Mortgage Trust Class XA                       | 1,11 % | 10.05.2047            | 7.838            | 0,01                         |
| 1.920.225   | COMM 2014-LC15 Mortgage Trust Class XA                         | 1,21 % | 10.04.2047            | 6.499            | 0,00                         |
| 33.415  | COMM 2014-UBS2 Mortgage Trust Class ASB                        | 3,47 % | 10.03.2047            | 33.140           | 0,02                         |
| 1.591.996   | COMM 2014-UBS3 Mortgage Trust Class XA                         | 1,21 % | 10.06.2047            | 7.689            | 0,01                         |
| 586.000   | Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R01 Class 1M2         | 6,97 % | 25.12.2041            | 571.568          | 0,42                         |
| 2.350.812   | CSAIL 2015-C2 Commercial Mortgage Trust Class XA               | 0,85 % | 15.06.2057            | 21.806           | 0,02                         |
| 505.000   | CSAIL 2018-CX12 Commercial Mortgage Trust Class A4             | 4,22 % | 15.08.2051            | 472.259          | 0,35                         |
| 557.783   | Fannie Mae REMICS Class HS                                     | 0,85 % | 25.07.2042            | 61.582           | 0,05                         |
| 339.853   | Fannie Mae REMICS Class PI                                     | 3,50 % | 25.12.2042            | 53.521           | 0,04                         |

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag  | Wertpapierbezeichnung                             | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 7,00 % (31. Dezember 2022: 6,57 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>  |   |        |                       |                  |                              |
| 618.193   | Fannie Mae REMICS Class SA                        | 0,70 % | 25.07.2046            | 59.257           | 0,04                         |
| 602.505   | Freddie Mac REMICS Class HS                       | 1,26 % | 15.03.2042            | 71.342           | 0,05                         |
| 595.557   | Freddie Mac REMICS Class SA                       | 0,86 % | 15.04.2046            | 60.491           | 0,04                         |
| 1.073.100   | Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-HQA1 Class M1A | 7,17 % | 25.03.2042            | 1.075.463        | 0,79                         |
| 381.033   | Freddie Mac Strips Class S1                       | 0,76 % | 15.09.2043            | 38.155           | 0,03                         |
| 473.039   | Government National Mortgage Association Class AB | 1,00 % | 20.07.2050            | 372.473          | 0,27                         |
| 981.673   | Government National Mortgage Association Class AI | 2,00 % | 20.02.2051            | 103.911          | 0,08                         |
| 355.149   | Government National Mortgage Association Class HE | 2,00 % | 20.06.2051            | 299.193          | 0,22                         |
| 507.681   | Government National Mortgage Association Class IT | 3,50 % | 20.02.2043            | 74.821           | 0,06                         |
| 383.157   | Government National Mortgage Association Class KA | 1,00 % | 20.08.2050            | 300.527          | 0,22                         |
| 337.818   | Government National Mortgage Association Class NC | 1,50 % | 20.07.2051            | 276.838          | 0,20                         |
| 327.425   | Government National Mortgage Association Class WK | 1,00 % | 20.06.2050            | 256.521          | 0,19                         |
| 1.115.457   | GS Mortgage Securities Trust 2014-GC18 Class XA   | 1,18 % | 10.01.2047            | 2.080            | 0,00                         |
| 2.555.198   | GS Mortgage Securities Trust 2015-GC30 Class XA   | 0,86 % | 10.05.2050            | 26.856           | 0,02                         |
| 160.000   | Morgan Stanley Capital I Trust 2017-H1 Class C    | 4,28 % | 15.06.2050            | 126.727          | 0,09                         |
| 1.698.015   | WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C21 Class XA | 1,15 % | 15.08.2047            | 15.565           | 0,01                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>  |   |        |                       | <b>5.633.299</b> | <b>4,14</b>                  |
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) insgesamt **</b>                                     |   |        |                       | <b>9.534.175</b> | <b>7,00</b>                  |
| <b>Unternehmensanleihen 27,78 % (31. Dezember 2022: 32,90 %)</b>  |   |        |                       |                  |                              |
| <b>Dänische Krone</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 10.059.006  | Nykredit Realkredit AS*                           | 4,00 % | 01.10.2053            | 1.395.617        | 1,03                         |
| <b>Dänische Krone insgesamt</b>   |   |        |                       | <b>1.395.617</b> | <b>1,03</b>                  |
| <b>Euro</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 201.000   | American Tower Corp*                              | 0,50 % | 15.01.2028            | 184.563          | 0,14                         |
| 210.000   | American Tower Corp*                              | 1,00 % | 15.01.2032            | 171.723          | 0,13                         |
| 200.000   | American Tower Corp*                              | 4,13 % | 16.05.2027            | 215.898          | 0,16                         |
| 280.000   | Apple Inc*  | 2,00 % | 17.09.2027            | 289.032          | 0,21                         |
| 100.000   | AstraZeneca Plc*                                  | 3,75 % | 03.03.2032            | 110.160          | 0,08                         |
| 635.000   | AT&T Inc*   | 2,40 % | 15.03.2024            | 684.883          | 0,50                         |
| 200.000   | AT&T Inc*   | 2,45 % | 15.03.2035            | 182.498          | 0,13                         |
| 606.000   | Athene Global Funding*                            | 0,37 % | 10.09.2026            | 570.556          | 0,42                         |
| 130.000   | Australia & New Zealand Banking Group Ltd*        | 5,10 % | 03.02.2033            | 139.440          | 0,10                         |
| 175.000   | Bank of America Corp*                             | 2,82 % | 27.04.2033            | 170.256          | 0,12                         |
| 400.000   | BNP Paribas Home Loan SFH SA*                     | 3,00 % | 25.05.2028            | 428.392          | 0,31                         |
| 200.000   | BPCE SA*  | 5,75 % | 01.06.2033            | 218.152          | 0,16                         |
| 200.000   | BPCE SFH SA*                                      | 3,25 % | 12.04.2028            | 215.877          | 0,16                         |
| 300.000   | Canadian Imperial Bank of Commerce*               | 3,25 % | 31.03.2027            | 321.409          | 0,24                         |
| 220.000   | Citigroup Inc*                                    | 4,11 % | 22.09.2033            | 235.552          | 0,17                         |



## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                        | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 27,78 % (31. Dezember 2022: 32,90 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                  |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |  |        |                       |                  |                              |
| 200.000  | Commerzbank AG*                              | 5,13 % | 18.01.2030            | 217.974          | 0,16                         |
| 300.000  | DH Europe Finance II Sarl*                   | 0,75 % | 18.09.2031            | 259.700          | 0,19                         |
| 307.000  | Digital Dutch Finco BV*                      | 1,00 % | 15.01.2032            | 236.903          | 0,17                         |
| 100.000  | Elia Group SA*                               | 5,85 % | 29.12.2049            | 109.641          | 0,08                         |
| 135.000  | Exxon Mobil Corp*                            | 1,41 % | 26.06.2039            | 99.118           | 0,07                         |
| 200.000  | Federation des Caisses Desjardins du Quebec* | 3,25 % | 18.04.2028            | 214.470          | 0,16                         |
| 195.000  | Global Payments Inc*                         | 4,88 % | 17.03.2031            | 212.112          | 0,16                         |
| 210.000  | Heimstaden Bostad Treasury BV*               | 0,63 % | 24.07.2025            | 190.254          | 0,14                         |
| 150.000  | Heimstaden Bostad Treasury BV*               | 1,38 % | 24.07.2028            | 110.539          | 0,08                         |
| 100.000  | Linde Plc*                                   | 3,63 % | 12.06.2034            | 108.455          | 0,08                         |
| 100.000  | Magna International Inc*                     | 4,38 % | 17.03.2032            | 110.489          | 0,08                         |
| 130.000  | McDonald's Corp*                             | 4,25 % | 07.03.2035            | 145.596          | 0,11                         |
| 100.000  | Medtronic Global Holdings SCA*               | 1,38 % | 15.10.2040            | 73.373           | 0,05                         |
| 145.000  | Metropolitan Life Global Funding I*          | 4,00 % | 05.04.2028            | 157.806          | 0,12                         |
| 120.000  | Mizuho Financial Group Inc*                  | 4,42 % | 20.05.2033            | 131.214          | 0,10                         |
| 150.000  | Molson Coors Beverage Co*                    | 1,25 % | 15.07.2024            | 158.414          | 0,12                         |
| 265.000  | Morgan Stanley*                              | 1,75 % | 30.01.2025            | 278.165          | 0,20                         |
| 185.000  | Morgan Stanley*                              | 5,15 % | 25.01.2034            | 211.857          | 0,16                         |
| 100.000  | National Gas Transmission Plc*               | 4,25 % | 05.04.2030            | 108.845          | 0,08                         |
| 100.000  | National Grid North America Inc*             | 1,00 % | 12.07.2024            | 105.602          | 0,08                         |
| 153.000  | Nordea Bank Abp*                             | 0,63 % | 18.08.2031            | 145.863          | 0,11                         |
| 100.000  | Orsted A/S*                                  | 4,13 % | 01.03.2035            | 111.189          | 0,08                         |
| 100.000  | RWE AG*                                      | 4,13 % | 13.02.2035            | 106.520          | 0,08                         |
| 580.000  | UBS Group AG*                                | 4,38 % | 11.01.2031            | 616.655          | 0,45                         |
| 200.000  | Upjohn Finance BV*                           | 1,91 % | 23.06.2032            | 168.402          | 0,12                         |
| 229.000  | Verizon Communications Inc*                  | 0,75 % | 22.03.2032            | 191.403          | 0,14                         |
| 100.000  | Verizon Communications Inc*                  | 4,25 % | 31.10.2030            | 110.569          | 0,08                         |
| 200.000  | Vonovia SE*                                  | 0,75 % | 01.09.2032            | 150.195          | 0,11                         |
| 300.000  | Westpac Securities NZ Ltd*                   | 3,75 % | 20.04.2028            | 327.758          | 0,24                         |
| <b>Euro insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>9.307.472</b> | <b>6,83</b>                  |
| <b>Britisches Pfund</b>  |  |        |                       |                  |                              |
| 60.000   | Anglo American Capital Plc*                  | 3,38 % | 11.03.2029            | 64.648           | 0,05                         |
| 100.000  | BNP Paribas SA*                              | 5,75 % | 13.06.2032            | 120.815          | 0,09                         |
| 100.000  | British Telecommunications Plc*              | 5,75 % | 13.02.2041            | 117.610          | 0,09                         |
| 129.000  | Enel Finance International NV*               | 5,63 % | 14.08.2024            | 162.853          | 0,12                         |
| 200.000  | ING Groep NV*                                | 6,25 % | 20.05.2033            | 235.930          | 0,17                         |
| 300.000  | Lloyds Banking Group Plc*                    | 6,63 % | 02.06.2033            | 362.039          | 0,26                         |
| 210.000  | National Gas Transmission Plc*               | 1,38 % | 07.02.2031            | 189.988          | 0,14                         |

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                      | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 27,78 % (31. Dezember 2022: 32,90 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                  |                              |
| <b>Britisches Pfund (Fortsetzung)</b>  |  |        |                       |                  |                              |
| 265.000  | Principality Building Society*                             | 2,38 % | 23.11.2023            | 331.116          | 0,24                         |
| <b>Britisches Pfund insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>1.584.999</b> | <b>1,16</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>   |  |        |                       |                  |                              |
| 700.000  | AbbVie Inc*  | 2,95 % | 21.11.2026            | 654.286          | 0,48                         |
| 340.000  | AbbVie Inc**   | 3,80 % | 15.03.2025            | 330.742          | 0,24                         |
| 63.000   | AbbVie Inc*  | 4,05 % | 21.11.2039            | 54.883           | 0,04                         |
| 185.000  | American Tower Corp*                                       | 2,40 % | 15.03.2025            | 174.293          | 0,13                         |
| 494.000  | American Tower Corp*                                       | 3,65 % | 15.03.2027            | 462.994          | 0,34                         |
| 165.000  | Amgen Inc**  | 5,60 % | 02.03.2043            | 165.612          | 0,12                         |
| 350.000  | Amgen Inc**  | 5,75 % | 02.03.2063            | 355.331          | 0,26                         |
| 331.000  | Analog Devices Inc**                                       | 2,10 % | 01.10.2031            | 274.111          | 0,20                         |
| 190.000  | Anheuser-Busch Cos LLC/Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc* | 4,70 % | 01.02.2036            | 184.934          | 0,14                         |
| 240.000  | Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc*                        | 5,45 % | 23.01.2039            | 248.537          | 0,18                         |
| 115.000  | Apple Inc**  | 3,35 % | 09.02.2027            | 110.493          | 0,08                         |
| 65.000   | AT&T Inc*  | 3,50 % | 01.06.2041            | 49.963           | 0,04                         |
| 299.000  | AT&T Inc**   | 3,50 % | 15.09.2053            | 211.879          | 0,16                         |
| 440.000  | Bank of America Corp**                                     | 1,84 % | 04.02.2025            | 428.754          | 0,31                         |
| 470.000  | Bank of America Corp**                                     | 1,92 % | 24.10.2031            | 372.194          | 0,27                         |
| 245.000  | Bank of America Corp**                                     | 2,30 % | 21.07.2032            | 196.028          | 0,14                         |
| 235.000  | Barclays Plc**   | 7,12 % | 27.06.2034            | 235.039          | 0,17                         |
| 585.000  | Baxter International Inc**                                 | 5,53 % | 29.11.2024            | 580.144          | 0,43                         |
| 199.000  | Boeing Co*   | 5,04 % | 01.05.2027            | 196.669          | 0,14                         |
| 70.000   | Boeing Co*   | 5,71 % | 01.05.2040            | 69.879           | 0,05                         |
| 60.000   | Boeing Co*   | 5,81 % | 01.05.2050            | 59.832           | 0,04                         |
| 135.000  | BP Capital Markets America Inc*                            | 4,81 % | 13.02.2033            | 133.102          | 0,10                         |
| 160.000  | BP Capital Markets America Inc*                            | 4,89 % | 11.09.2033            | 158.426          | 0,12                         |
| 60.000   | Bristol-Myers Squibb Co*                                   | 3,55 % | 15.03.2042            | 49.806           | 0,04                         |
| 27.000   | Broadcom Inc**   | 3,15 % | 15.11.2025            | 25.661           | 0,02                         |
| 90.000   | Capital One Financial Corp**                               | 6,31 % | 08.06.2029            | 89.467           | 0,07                         |
| 70.000   | Capital One Financial Corp**                               | 6,38 % | 08.06.2034            | 69.537           | 0,05                         |
| 50.000   | Carrier Global Corp**                                      | 2,49 % | 15.02.2027            | 45.596           | 0,03                         |
| 585.000  | Caterpillar Financial Services Corp**                      | 5,36 % | 13.09.2024            | 584.369          | 0,43                         |
| 235.000  | CDW LLC/CDW Finance Corp**                                 | 2,67 % | 01.12.2026            | 211.270          | 0,16                         |
| 125.000  | CDW LLC/CDW Finance Corp**                                 | 3,57 % | 01.12.2031            | 105.658          | 0,08                         |
| 330.000  | Cigna Group*   | 2,40 % | 15.03.2030            | 280.587          | 0,21                         |
| 239.000  | Cigna Group*   | 3,75 % | 15.07.2023            | 238.788          | 0,18                         |
| 265.000  | Citigroup Inc**  | 3,29 % | 17.03.2026            | 253.583          | 0,19                         |
| 265.000  | Citigroup Inc**  | 3,35 % | 24.04.2025            | 259.138          | 0,19                         |
| 105.000  | Citigroup Inc**  | 3,89 % | 10.01.2028            | 99.568           | 0,07                         |

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                        | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 27,78 % (31. Dezember 2022: 32,90 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |        |                       |                  |                              |
| 130.000  | Comcast Corp**                               | 2,35 % | 15.01.2027            | 119.425          | 0,09                         |
| 275.000  | Comcast Corp**                               | 5,35 % | 15.05.2053            | 279.466          | 0,21                         |
| 325.000  | Constellation Brands Inc <sup>†</sup>        | 4,90 % | 01.05.2033            | 319.455          | 0,23                         |
| 430.000  | Corp. Andina de Fomento <sup>†</sup>         | 2,25 % | 08.02.2027            | 386.109          | 0,28                         |
| 80.000   | Cox Communications Inc**                     | 5,70 % | 15.06.2033            | 80.729           | 0,06                         |
| 70.000   | Crown Castle Inc <sup>†</sup>                | 1,05 % | 15.07.2026            | 61.335           | 0,04                         |
| 235.000  | CVS Health Corp <sup>†</sup>                 | 1,75 % | 21.08.2030            | 187.649          | 0,14                         |
| 135.000  | CVS Health Corp <sup>†</sup>                 | 3,00 % | 15.08.2026            | 126.609          | 0,09                         |
| 155.000  | CVS Health Corp <sup>†</sup>                 | 4,78 % | 25.03.2038            | 143.131          | 0,11                         |
| 245.000  | CVS Health Corp <sup>†</sup>                 | 5,30 % | 01.06.2033            | 244.741          | 0,18                         |
| 90.000   | Dell International LLC/EMC Corp <sup>†</sup> | 6,02 % | 15.06.2026            | 91.518           | 0,07                         |
| 185.000  | Diamondback Energy Inc**                     | 6,25 % | 15.03.2033            | 191.455          | 0,14                         |
| 120.000  | DTE Energy Co <sup>†</sup>                   | 1,05 % | 01.06.2025            | 109.962          | 0,08                         |
| 235.000  | Enbridge Inc <sup>†</sup>                    | 2,50 % | 14.02.2025            | 223.327          | 0,16                         |
| 445.000  | Entergy Texas Inc <sup>†</sup>               | 1,75 % | 15.03.2031            | 351.736          | 0,26                         |
| 210.000  | Essential Utilities Inc <sup>†</sup>         | 2,70 % | 15.04.2030            | 178.080          | 0,13                         |
| 55.000   | Evergy Inc <sup>†</sup>                      | 2,45 % | 15.09.2024            | 52.710           | 0,04                         |
| 330.000  | Exelon Corp**                                | 5,30 % | 15.03.2033            | 329.126          | 0,24                         |
| 140.000  | Exxon Mobil Corp <sup>†</sup>                | 3,10 % | 16.08.2049            | 102.569          | 0,08                         |
| 160.000  | General Motors Co <sup>†</sup>               | 6,80 % | 01.10.2027            | 166.312          | 0,12                         |
| 285.000  | General Motors Financial Co Inc <sup>†</sup> | 3,80 % | 07.04.2025            | 275.009          | 0,20                         |
| 440.000  | Goldman Sachs Group Inc**                    | 1,76 % | 24.01.2025            | 428.495          | 0,31                         |
| 455.000  | Goldman Sachs Group Inc**                    | 3,27 % | 29.09.2025            | 439.811          | 0,32                         |
| 130.000  | HCA Inc <sup>†</sup>                         | 5,90 % | 01.06.2053            | 128.907          | 0,09                         |
| 890.000  | Inter-American Development Bank <sup>†</sup> | 1,13 % | 13.01.2031            | 720.532          | 0,53                         |
| 250.000  | Inter-American Development Bank <sup>†</sup> | 4,50 % | 15.05.2026            | 249.356          | 0,18                         |
| 90.000   | Interstate Power & Light Co**                | 2,30 % | 01.06.2030            | 74.935           | 0,05                         |
| 465.000  | JPMorgan Chase & Co**                        | 1,56 % | 10.12.2025            | 435.588          | 0,32                         |
| 105.000  | JPMorgan Chase & Co**                        | 2,53 % | 19.11.2041            | 72.328           | 0,05                         |
| 130.000  | JPMorgan Chase & Co**                        | 2,74 % | 15.10.2030            | 112.107          | 0,08                         |
| 815.000  | JPMorgan Chase & Co**                        | 3,22 % | 01.03.2025            | 799.086          | 0,59                         |
| 90.000   | Kinder Morgan Inc <sup>†</sup>               | 5,55 % | 01.06.2045            | 83.021           | 0,06                         |
| 400.000  | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau <sup>†</sup> | 3,88 % | 15.06.2028            | 393.125          | 0,29                         |
| 145.000  | Magellan Midstream Partners LP <sup>†</sup>  | 3,25 % | 01.06.2030            | 127.790          | 0,09                         |
| 475.000  | Marathon Petroleum Corp**                    | 4,70 % | 01.05.2025            | 466.231          | 0,34                         |
| 435.000  | Mars Inc**                                   | 4,75 % | 20.04.2033            | 431.381          | 0,32                         |
| 55.000   | Merck & Co Inc <sup>†</sup>                  | 3,90 % | 07.03.2039            | 49.329           | 0,04                         |
| 320.000  | Meta Platforms Inc**                         | 4,95 % | 15.05.2033            | 319.882          | 0,23                         |
| 160.000  | Morgan Stanley**                             | 2,72 % | 22.07.2025            | 154.344          | 0,11                         |
| 180.000  | Morgan Stanley <sup>†</sup>                  | 3,63 % | 20.01.2027            | 171.053          | 0,13                         |

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                     | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 27,78 % (31. Dezember 2022: 32,90 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |        |                       |                   |                              |
| 270.000  | Morgan Stanley**                          | 5,25 % | 21.04.2034            | 266.738           | 0,20                         |
| 170.000  | Morgan Stanley**                          | 5,95 % | 19.01.2038            | 167.893           | 0,12                         |
| 100.000  | MPLX LP*                                  | 5,65 % | 01.03.2053            | 93.589            | 0,07                         |
| 105.000  | NextEra Energy Capital Holdings Inc*      | 4,90 % | 28.02.2028            | 104.058           | 0,08                         |
| 150.000  | NextEra Energy Capital Holdings Inc*      | 5,25 % | 28.02.2053            | 144.598           | 0,11                         |
| 220.000  | NXP BV/NXP Funding LLC/NXP USA Inc**      | 5,00 % | 15.01.2033            | 211.356           | 0,16                         |
| 114.000  | Occidental Petroleum Corp*                | 6,13 % | 01.01.2031            | 115.871           | 0,09                         |
| 455.000  | Occidental Petroleum Corp**               | 6,45 % | 15.09.2036            | 467.612           | 0,34                         |
| 215.000  | Paramount Global**                        | 4,20 % | 19.05.2032            | 180.271           | 0,13                         |
| 110.000  | Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd*    | 5,34 % | 19.05.2063            | 111.406           | 0,08                         |
| 115.000  | Phillips 66*                              | 1,30 % | 15.02.2026            | 103.991           | 0,08                         |
| 163.000  | Pioneer Natural Resources Co*             | 2,15 % | 15.01.2031            | 133.478           | 0,10                         |
| 650.000  | Roche Holdings Inc**                      | 5,65 % | 10.03.2025            | 652.451           | 0,48                         |
| 175.000  | Royal Bank of Canada**                    | 3,38 % | 14.04.2025            | 168.538           | 0,12                         |
| 695.000  | SBA Tower Trust†                          | 2,59 % | 15.10.2056            | 552.380           | 0,41                         |
| 160.000  | Sempra Energy*                            | 5,50 % | 01.08.2033            | 159.062           | 0,12                         |
| 255.000  | Societe Generale SA**                     | 1,49 % | 14.12.2026            | 224.545           | 0,16                         |
| 530.000  | Southern Co*                              | 5,20 % | 15.06.2033            | 526.041           | 0,39                         |
| 160.000  | Southern Co Gas Capital Corp*             | 1,75 % | 15.01.2031            | 125.817           | 0,09                         |
| 405.000  | Sprint Capital Corp**                     | 8,75 % | 15.03.2032            | 489.937           | 0,36                         |
| 110.000  | Stryker Corp*                             | 0,60 % | 01.12.2023            | 107.750           | 0,08                         |
| 200.000  | Takeda Pharmaceutical Co Ltd**            | 3,03 % | 09.07.2040            | 151.534           | 0,11                         |
| 225.000  | Texas Instruments Inc**                   | 5,05 % | 18.05.2063            | 225.638           | 0,17                         |
| 185.000  | T-Mobile USA Inc*                         | 2,55 % | 15.02.2031            | 153.832           | 0,11                         |
| 215.000  | T-Mobile USA Inc**                        | 3,38 % | 15.04.2029            | 194.349           | 0,14                         |
| 275.000  | T-Mobile USA Inc*                         | 3,88 % | 15.04.2030            | 253.513           | 0,19                         |
| 160.000  | T-Mobile USA Inc*                         | 4,38 % | 15.04.2040            | 141.409           | 0,10                         |
| 70.000   | Travelers Cos Inc*                        | 5,45 % | 25.05.2053            | 73.325            | 0,05                         |
| 280.000  | Ventas Realty LP*                         | 3,50 % | 15.04.2024            | 273.808           | 0,20                         |
| 90.000   | Verizon Communications Inc**              | 2,36 % | 15.03.2032            | 72.416            | 0,05                         |
| 50.000   | Verizon Communications Inc*               | 2,65 % | 20.11.2040            | 34.802            | 0,03                         |
| 135.000  | Verizon Communications Inc*               | 5,05 % | 09.05.2033            | 133.569           | 0,10                         |
| 585.000  | Verizon Communications Inc**              | 5,59 % | 22.03.2024            | 585.106           | 0,43                         |
| 110.000  | Volkswagen Group of America Finance LLC** | 3,75 % | 13.05.2030            | 99.371            | 0,07                         |
| 162.000  | Walmart Inc*                              | 4,50 % | 15.04.2053            | 158.122           | 0,12                         |
| 240.000  | Warnermedia Holdings Inc**                | 5,14 % | 15.03.2052            | 195.579           | 0,14                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |   |        |                       | <b>25.552.662</b> | <b>18,76</b>                 |
| <b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>  |   |        |                       | <b>37.840.750</b> | <b>27,78</b>                 |

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                     | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 40,46 % (31. Dezember 2022: 39,81 %)</b> |   |        |                       |                   |                              |
| <b>Australischer Dollar</b>                                |   |        |                       |                   |                              |
| 18.000   | Australia Government Bond*                | 3,00 % | 21.03.2047            | 9.617             | 0,01                         |
| 575.000  | New South Wales Treasury Corp*            | 4,25 % | 20.02.2036            | 358.798           | 0,26                         |
| 1.224.000  | Queensland Treasury Corp*                 | 4,50 % | 09.03.2033            | 813.903           | 0,60                         |
| 448.000  | Queensland Treasury Corp*                 | 4,50 % | 22.08.2035            | 292.096           | 0,21                         |
| <b>Australischer Dollar insgesamt</b>                      |   |        |                       | <b>1.474.414</b>  | <b>1,08</b>                  |
| <b>Kanadischer Dollar</b>                                  |   |        |                       |                   |                              |
| 890.000  | Canadian Government Bond*                 | 2,00 % | 01.12.2051            | 532.476           | 0,39                         |
| 5.758.000  | Canadian Government Bond*                 | 3,00 % | 01.11.2024            | 4.249.171         | 3,12                         |
| 637.000  | City of Toronto Canada**                  | 4,25 % | 11.07.2033            | 490.117           | 0,36                         |
| <b>Kanadischer Dollar insgesamt</b>                        |   |        |                       | <b>5.271.764</b>  | <b>3,87</b>                  |
| <b>Euro</b>  |   |        |                       |                   |                              |
| 742.000  | Autonomous Community of Madrid Spain*     | 3,36 % | 31.10.2028            | 806.627           | 0,59                         |
| 536.000  | Autonomous Community of Madrid Spain*     | 3,60 % | 30.04.2033            | 585.342           | 0,43                         |
| 153.000  | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe* | 2,30 % | 15.02.2033            | 165.568           | 0,12                         |
| 1.000.000  | European Union*                           | 0,00 % | 04.07.2031            | 861.072           | 0,63                         |
| 302.000  | European Union*                           | 0,40 % | 04.02.2037            | 230.792           | 0,17                         |
| 170.000  | European Union*                           | 0,45 % | 04.07.2041            | 115.760           | 0,09                         |
| 562.000  | European Union*                           | 1,00 % | 06.07.2032            | 517.267           | 0,38                         |
| 1.500.000  | Gemeinsame Deutsche Bundeslaender*        | 3,00 % | 26.04.2030            | 1.629.344         | 1,20                         |
| 545.000  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*        | 0,95 % | 01.03.2037            | 401.012           | 0,29                         |
| 134.000  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**       | 1,70 % | 01.09.2051            | 87.819            | 0,07                         |
| 242.000  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**       | 3,45 % | 01.03.2048            | 232.435           | 0,17                         |
| 700.000  | Junta de Castilla y Leon*                 | 3,50 % | 30.04.2033            | 752.533           | 0,55                         |
| 270.000  | Kingdom of Belgium Government Bond*       | 1,45 % | 22.06.2037            | 237.597           | 0,17                         |
| 342.000  | Kingdom of Belgium Government Bond*       | 1,60 % | 22.06.2047            | 267.383           | 0,20                         |
| 742.000  | Land Baden-Wuerttemberg*                  | 3,00 % | 27.06.2033            | 810.561           | 0,60                         |
| 250.000  | Land Berlin*                              | 2,88 % | 05.04.2029            | 269.478           | 0,20                         |
| 785.000  | Land Berlin*                              | 3,00 % | 04.05.2028            | 849.837           | 0,62                         |
| 30.000   | Spain Government Bond*                    | 0,35 % | 30.07.2023            | 32.654            | 0,02                         |
| 371.000  | Spain Government Bond*                    | 2,70 % | 31.10.2048            | 333.739           | 0,25                         |
| 790.000  | Spain Government Bond*                    | 3,15 % | 30.04.2033            | 845.140           | 0,62                         |
| 2.500.000  | State of Hesse*                           | 2,88 % | 04.07.2033            | 2.702.960         | 1,98                         |
| 722.000  | State of North Rhine-Westphalia Germany*  | 3,00 % | 27.01.2028            | 781.122           | 0,57                         |
| 450.000  | State of Schleswig-Holstein Germany*      | 2,88 % | 10.05.2028            | 484.644           | 0,36                         |
| 980.000  | State of Schleswig-Holstein Germany*      | 3,00 % | 05.06.2030            | 1.065.826         | 0,78                         |
| <b>Euro insgesamt</b>                                      |   |        |                       | <b>15.066.512</b> | <b>11,06</b>                 |

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                 | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---------------------------------------|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 40,46 % (31. Dezember 2022: 39,81 %) (Fortsetzung)</b> |                                       |        |                       |                  |                              |
| <b>Indonesische Rupiah</b>   |                                       |        |                       |                  |                              |
| 18.812.000.000   | Indonesia Treasury Bond*              | 6,38 % | 15.04.2032            | 1.261.980        | 0,92                         |
| 28.806.000.000   | Indonesia Treasury Bond*              | 6,63 % | 15.05.2033            | 1.957.779        | 1,44                         |
| <b>Indonesische Rupiah insgesamt</b>                                     |                                       |        |                       | <b>3.219.759</b> | <b>2,36</b>                  |
| <b>Japanischer Yen</b>   |                                       |        |                       |                  |                              |
| 385.900.000  | Japan Government Five Year Bond*      | 0,01 % | 20.09.2026            | 2.675.315        | 1,96                         |
| 118.850.000  | Japan Government Forty Year Bond*     | 0,40 % | 20.03.2056            | 626.757          | 0,46                         |
| 31.400.000   | Japan Government Forty Year Bond*     | 1,00 % | 20.03.2062            | 194.450          | 0,14                         |
| 19.500.000   | Japan Government Ten Year Bond*       | 0,50 % | 20.03.2033            | 136.314          | 0,10                         |
| 187.450.000  | Japan Government Thirty Year Bond*    | 0,70 % | 20.12.2048            | 1.165.114        | 0,86                         |
| 62.200.000   | Japan Government Twenty Year Bond*    | 0,40 % | 20.03.2039            | 405.503          | 0,30                         |
| 184.200.000  | Japan Government Twenty Year Bond*    | 0,50 % | 20.09.2041            | 1.182.724        | 0,87                         |
| 49.800.000   | Japan Government Twenty Year Bond*    | 1,10 % | 20.03.2043            | 351.225          | 0,26                         |
| <b>Japanischer Yen insgesamt</b>   |                                       |        |                       | <b>6.737.402</b> | <b>4,95</b>                  |
| <b>Mexikanischer Peso</b>  |                                       |        |                       |                  |                              |
| 17.600.000   | Mexican Bonos*                        | 7,50 % | 26.05.2033            | 953.232          | 0,70                         |
| <b>Mexikanischer Peso insgesamt</b>                                      |                                       |        |                       | <b>953.232</b>   | <b>0,70</b>                  |
| <b>Neuseeländischer Dollar</b>   |                                       |        |                       |                  |                              |
| 1.486.000  | New Zealand Government Bond*          | 4,25 % | 15.05.2034            | 878.803          | 0,65                         |
| <b>Neuseeländischer Dollar insgesamt</b>                                 |                                       |        |                       | <b>878.803</b>   | <b>0,65</b>                  |
| <b>Polnischer Zloty</b>  |                                       |        |                       |                  |                              |
| 1.958.000  | Republic of Poland Government Bond*   | 6,00 % | 25.10.2033            | 492.253          | 0,36                         |
| <b>Polnischer Zloty insgesamt</b>  |                                       |        |                       | <b>492.253</b>   | <b>0,36</b>                  |
| <b>Britisches Pfund</b>  |                                       |        |                       |                  |                              |
| 276.000  | United Kingdom Gilt*                  | 0,38 % | 22.10.2026            | 300.697          | 0,22                         |
| 1.140.000  | United Kingdom Gilt*                  | 0,63 % | 22.10.2050            | 588.433          | 0,43                         |
| 112.000  | United Kingdom Gilt*                  | 1,25 % | 22.10.2041            | 85.497           | 0,06                         |
| 73.000   | United Kingdom Gilt*                  | 1,75 % | 07.09.2037            | 66.415           | 0,05                         |
| 1.240.732  | United Kingdom Gilt*                  | 3,75 % | 22.10.2053            | 1.402.606        | 1,03                         |
| 1.742.684  | United Kingdom Inflation-Linked Gilt* | 1,25 % | 22.11.2032            | 2.364.330        | 1,74                         |
| <b>Britisches Pfund insgesamt</b>  |                                       |        |                       | <b>4.807.978</b> | <b>3,53</b>                  |
| <b>Südkoreanischer Won</b>   |                                       |        |                       |                  |                              |
| 4.557.750.000  | Korea Treasury Bond*                  | 2,13 % | 10.06.2027            | 3.268.330        | 2,40                         |
| 2.316.680.000  | Korea Treasury Bond*                  | 2,38 % | 10.12.2031            | 1.589.490        | 1,17                         |

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 40,46 % (31. Dezember 2022: 39,81 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                   |                              |
| <b>Südkoreanischer Won (Fortsetzung)</b>                                 |  |        |                       |                   |                              |
| 1.011.460.000  | Korea Treasury Bond*                                 | 2,50 % | 10.03.2052            | 605.474           | 0,44                         |
| <b>Südkoreanischer Won insgesamt</b>                                     |  |        |                       | <b>5.463.294</b>  | <b>4,01</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>   |  |        |                       |                   |                              |
| 250.000  | Abu Dhabi Government International Bond*             | 1,70 % | 02.03.2031            | 208.127           | 0,15                         |
| 1.200.000  | Croatia Government International Bond*               | 6,00 % | 26.01.2024            | 1.200.510         | 0,88                         |
| 290.000  | Development Bank of Japan Inc*                       | 1,00 % | 27.08.2030            | 227.539           | 0,17                         |
| 500.000  | Development Bank of Japan Inc*                       | 1,25 % | 28.01.2031            | 395.919           | 0,29                         |
| 300.000  | Indonesia Government International Bond*             | 3,55 % | 31.03.2032            | 272.199           | 0,20                         |
| 400.000  | Indonesia Government International Bond*             | 4,85 % | 11.01.2033            | 399.050           | 0,29                         |
| 270.000  | International Bank for Reconstruction & Development* | 3,88 % | 14.02.2030            | 265.976           | 0,20                         |
| 310.000  | Japan International Cooperation Agency*              | 4,00 % | 23.05.2028            | 300.139           | 0,22                         |
| 375.000  | Mexico Government International Bond*                | 4,75 % | 27.04.2032            | 358.216           | 0,26                         |
| 250.000  | Mexico Government International Bond*                | 6,35 % | 09.02.2035            | 263.448           | 0,19                         |
| 250.000  | Philippine Government International Bond*            | 5,61 % | 13.04.2033            | 264.478           | 0,19                         |
| 100.000  | Romanian Government International Bond*              | 3,00 % | 14.02.2031            | 83.134            | 0,06                         |
| 400.000  | Saudi Government International Bond*                 | 2,25 % | 02.02.2033            | 322.721           | 0,24                         |
| 200.000  | Saudi Government International Bond*                 | 5,00 % | 18.01.2053            | 185.549           | 0,14                         |
| 554.027  | United States Treasury Inflation Indexed Bonds*      | 1,63 % | 15.10.2027            | 546.055           | 0,40                         |
| 110.000  | United States Treasury Note/Bond*                    | 2,38 % | 15.02.2042            | 85.693            | 0,06                         |
| 507.000  | United States Treasury Note/Bond*                    | 2,38 % | 15.05.2051            | 377.200           | 0,28                         |
| 310.000  | United States Treasury Note/Bond*                    | 2,88 % | 15.05.2052            | 257.046           | 0,19                         |
| 860.000  | United States Treasury Note/Bond*                    | 3,38 % | 15.05.2033            | 829.497           | 0,61                         |
| 1.796.000  | United States Treasury Note/Bond*                    | 3,50 % | 31.01.2028            | 1.744.295         | 1,28                         |
| 285.000  | United States Treasury Note/Bond*                    | 3,50 % | 30.04.2030            | 276.762           | 0,20                         |
| 390.000  | United States Treasury Note/Bond*                    | 3,63 % | 15.02.2053            | 374.400           | 0,28                         |
| 230.000  | United States Treasury Note/Bond*                    | 3,63 % | 15.05.2053            | 221.087           | 0,16                         |
| 600.000  | United States Treasury Note/Bond*                    | 3,88 % | 15.05.2043            | 585.563           | 0,43                         |
| 315.000  | United States Treasury Note/Bond*                    | 4,00 % | 29.02.2028            | 312.730           | 0,23                         |
| 145.000  | United States Treasury Note/Bond*                    | 4,00 % | 28.02.2030            | 144.921           | 0,11                         |
| 235.000  | United States Treasury Note/Bond*                    | 4,00 % | 15.11.2052            | 241.462           | 0,18                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |  |        |                       | <b>10.743.716</b> | <b>7,89</b>                  |
| <b>Staatsanleihen insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>55.109.127</b> | <b>40,46</b>                 |
| <b>Mortgage-Backed Securities 18,88% (31. Dezember 2022: 14,14 %)</b>    |  |        |                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |  |        |                       |                   |                              |
| 337.327  | Fannie Mae Pool                                      | 2,00 % | 01.02.2051            | 277.675           | 0,20                         |
| 145.815  | Fannie Mae Pool                                      | 2,00 % | 01.04.2051            | 119.517           | 0,09                         |
| 76.285   | Fannie Mae Pool                                      | 2,00 % | 01.05.2051            | 62.566            | 0,05                         |
| 244.443  | Fannie Mae Pool                                      | 2,50 % | 01.08.2050            | 209.596           | 0,15                         |

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|-----------------------|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Mortgage-Backed Securities 18,88 % (31. Dezember 2022: 14,14 %) (Fortsetzung)</b> |                       |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |                       |        |                       |                  |                              |
| 127.094  | Fannie Mae Pool       | 2,50 % | 01.09.2050            | 108.545          | 0,08                         |
| 575.320  | Fannie Mae Pool       | 2,50 % | 01.01.2051            | 494.171          | 0,36                         |
| 687.743  | Fannie Mae Pool       | 2,50 % | 01.05.2051            | 586.068          | 0,43                         |
| 747.688  | Fannie Mae Pool       | 2,50 % | 01.06.2051            | 636.939          | 0,47                         |
| 442.051  | Fannie Mae Pool       | 2,50 % | 01.08.2051            | 376.022          | 0,28                         |
| 213.016  | Fannie Mae Pool       | 2,50 % | 01.09.2051            | 181.318          | 0,13                         |
| 63.661   | Fannie Mae Pool       | 2,50 % | 01.01.2052            | 54.033           | 0,04                         |
| 441.121  | Fannie Mae Pool       | 2,50 % | 01.02.2052            | 374.945          | 0,28                         |
| 212.867  | Fannie Mae Pool       | 2,50 % | 01.03.2052            | 180.757          | 0,13                         |
| 389.565  | Fannie Mae Pool       | 2,50 % | 01.04.2052            | 330.799          | 0,24                         |
| 151.257  | Fannie Mae Pool       | 3,00 % | 01.12.2047            | 136.068          | 0,10                         |
| 152.991  | Fannie Mae Pool       | 3,00 % | 01.11.2048            | 136.774          | 0,10                         |
| 160.958  | Fannie Mae Pool       | 3,00 % | 01.02.2049            | 145.423          | 0,11                         |
| 140.713  | Fannie Mae Pool       | 3,00 % | 01.03.2050            | 124.943          | 0,09                         |
| 141.336  | Fannie Mae Pool       | 3,00 % | 01.04.2050            | 125.658          | 0,09                         |
| 155.589  | Fannie Mae Pool       | 3,00 % | 01.04.2051            | 137.585          | 0,10                         |
| 53.884   | Fannie Mae Pool       | 3,00 % | 01.07.2051            | 47.607           | 0,04                         |
| 111.066  | Fannie Mae Pool       | 3,00 % | 01.02.2052            | 97.955           | 0,07                         |
| 49.398   | Fannie Mae Pool       | 3,50 % | 01.12.2041            | 46.280           | 0,03                         |
| 25.596   | Fannie Mae Pool       | 3,50 % | 01.04.2042            | 23.981           | 0,02                         |
| 30.587   | Fannie Mae Pool       | 3,50 % | 01.05.2042            | 28.656           | 0,02                         |
| 44.085   | Fannie Mae Pool       | 3,50 % | 01.01.2043            | 41.227           | 0,03                         |
| 66.884   | Fannie Mae Pool       | 3,50 % | 01.12.2044            | 62.346           | 0,05                         |
| 52.768   | Fannie Mae Pool       | 3,50 % | 01.03.2045            | 49.143           | 0,04                         |
| 79.475   | Fannie Mae Pool       | 3,50 % | 01.12.2045            | 74.359           | 0,05                         |
| 73.363   | Fannie Mae Pool       | 3,50 % | 01.05.2046            | 68.189           | 0,05                         |
| 24.029   | Fannie Mae Pool       | 3,50 % | 01.06.2047            | 22.220           | 0,02                         |
| 141.440  | Fannie Mae Pool       | 3,50 % | 01.02.2048            | 130.626          | 0,10                         |
| 97.450   | Fannie Mae Pool       | 3,50 % | 01.08.2051            | 89.070           | 0,07                         |
| 376.719  | Fannie Mae Pool       | 3,50 % | 01.07.2052            | 343.596          | 0,25                         |
| 168.565  | Fannie Mae Pool       | 3,50 % | 01.08.2052            | 153.766          | 0,11                         |
| 23.846   | Fannie Mae Pool       | 4,00 % | 01.12.2040            | 22.943           | 0,02                         |
| 79.915   | Fannie Mae Pool       | 4,00 % | 01.12.2041            | 77.441           | 0,06                         |
| 11.108   | Fannie Mae Pool       | 4,00 % | 01.10.2043            | 10.682           | 0,01                         |
| 240.502  | Fannie Mae Pool       | 4,00 % | 01.09.2044            | 229.482          | 0,17                         |
| 34.654   | Fannie Mae Pool       | 4,00 % | 01.01.2045            | 33.165           | 0,02                         |
| 60.315   | Fannie Mae Pool       | 4,00 % | 01.02.2045            | 57.717           | 0,04                         |
| 142.461  | Fannie Mae Pool       | 4,00 % | 01.02.2046            | 136.415          | 0,10                         |
| 33.162   | Fannie Mae Pool       | 4,00 % | 01.07.2046            | 31.686           | 0,02                         |
| 31.763   | Fannie Mae Pool       | 4,00 % | 01.03.2047            | 30.313           | 0,02                         |



## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung    | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Mortgage-Backed Securities 18,88 % (31. Dezember 2022: 14,14 %) (Fortsetzung)</b> |                          |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |                          |        |                       |                  |                              |
| 39.524   | Fannie Mae Pool          | 4,00 % | 01.05.2047            | 37.708           | 0,03                         |
| 48.558   | Fannie Mae Pool          | 4,00 % | 01.06.2047            | 46.327           | 0,03                         |
| 23.286   | Fannie Mae Pool          | 4,00 % | 01.10.2047            | 22.274           | 0,02                         |
| 26.632   | Fannie Mae Pool          | 4,00 % | 01.04.2048            | 25.408           | 0,02                         |
| 130.283  | Fannie Mae Pool          | 4,00 % | 01.03.2049            | 124.011          | 0,09                         |
| 438.546  | Fannie Mae Pool          | 4,00 % | 01.06.2052            | 411.924          | 0,30                         |
| 94.834   | Fannie Mae Pool          | 4,00 % | 01.07.2052            | 89.106           | 0,07                         |
| 228.718  | Fannie Mae Pool          | 4,00 % | 01.08.2052            | 214.917          | 0,16                         |
| 13.156   | Fannie Mae Pool          | 4,50 % | 01.03.2036            | 12.763           | 0,01                         |
| 65.761   | Fannie Mae Pool          | 4,50 % | 01.04.2041            | 64.981           | 0,05                         |
| 12.945   | Fannie Mae Pool          | 4,50 % | 01.09.2043            | 12.711           | 0,01                         |
| 10.162   | Fannie Mae Pool          | 4,50 % | 01.12.2043            | 9.959            | 0,01                         |
| 22.384   | Fannie Mae Pool          | 4,50 % | 01.05.2044            | 21.779           | 0,02                         |
| 6.643  | Fannie Mae Pool          | 4,50 % | 01.03.2047            | 6.526            | 0,00                         |
| 74.416   | Fannie Mae Pool          | 4,50 % | 01.07.2047            | 73.148           | 0,05                         |
| 443.147  | Fannie Mae Pool          | 4,50 % | 01.06.2052            | 426.423          | 0,31                         |
| 164.397  | Fannie Mae Pool          | 4,50 % | 01.07.2052            | 158.189          | 0,12                         |
| 273.827  | Fannie Mae Pool          | 4,50 % | 01.08.2052            | 263.471          | 0,19                         |
| 358.256  | Fannie Mae Pool          | 4,50 % | 01.08.2052            | 344.726          | 0,25                         |
| 215.854  | Fannie Mae Pool          | 4,50 % | 01.01.2053            | 207.652          | 0,15                         |
| 594  | Fannie Mae Pool          | 5,00 % | 01.10.2023            | 588              | 0,00                         |
| 10.544   | Fannie Mae Pool          | 5,00 % | 01.07.2035            | 10.597           | 0,01                         |
| 19.991   | Fannie Mae Pool          | 5,00 % | 01.06.2038            | 20.146           | 0,01                         |
| 28.941   | Fannie Mae Pool          | 5,00 % | 01.07.2039            | 29.165           | 0,02                         |
| 26.282   | Fannie Mae Pool          | 5,00 % | 01.09.2040            | 26.486           | 0,02                         |
| 31.186   | Fannie Mae Pool          | 5,00 % | 01.02.2041            | 31.428           | 0,02                         |
| 28.270   | Fannie Mae Pool          | 5,00 % | 01.01.2044            | 28.475           | 0,02                         |
| 8.285  | Fannie Mae Pool          | 5,00 % | 01.03.2044            | 8.244            | 0,01                         |
| 6.042  | Fannie Mae Pool          | 5,00 % | 01.06.2048            | 5.999            | 0,00                         |
| 43.080   | Fannie Mae Pool          | 5,00 % | 01.09.2048            | 42.989           | 0,03                         |
| 279.747  | Fannie Mae Pool          | 5,00 % | 01.08.2052            | 274.573          | 0,20                         |
| 70.488   | Fannie Mae Pool          | 5,00 % | 01.09.2052            | 69.164           | 0,05                         |
| 1.114.596  | Fannie Mae Pool          | 5,00 % | 01.01.2053            | 1.092.800        | 0,80                         |
| 681.107  | Fannie Mae Pool          | 5,00 % | 01.02.2053            | 667.775          | 0,49                         |
| 280.452  | Fannie Mae Pool          | 5,00 % | 01.04.2053            | 274.914          | 0,20                         |
| 405.232  | Fannie Mae Pool          | 5,50 % | 01.12.2052            | 404.660          | 0,30                         |
| 183.025  | Fannie Mae Pool          | 5,50 % | 01.02.2053            | 182.236          | 0,13                         |
| 24.600   | Fannie Mae Pool (AJ7686) | 4,00 % | 01.12.2041            | 23.668           | 0,02                         |
| 22.877   | Fannie Mae Pool (AL6432) | 4,00 % | 01.01.2045            | 21.904           | 0,02                         |
| 55.198   | Fannie Mae Pool (AS0657) | 4,00 % | 01.10.2043            | 53.020           | 0,04                         |

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung    | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Mortgage-Backed Securities 18,88 % (31. Dezember 2022: 14,14 %) (Fortsetzung)</b> |                          |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |                          |        |                       |                  |                              |
| 18.125   | Fannie Mae Pool (AS7558) | 4,00 % | 01.07.2046            | 17.307           | 0,01                         |
| 17.729   | Fannie Mae Pool (BH2877) | 4,00 % | 01.05.2047            | 16.920           | 0,01                         |
| 260.063  | Fannie Mae Pool (BV7959) | 5,00 % | 01.08.2052            | 255.237          | 0,19                         |
| 343.330  | Fannie Mae Pool (CB1552) | 2,50 % | 01.09.2051            | 291.650          | 0,21                         |
| 208.818  | Fannie Mae Pool (CB3298) | 2,50 % | 01.04.2052            | 178.171          | 0,13                         |
| 290.625  | Fannie Mae Pool (CB4133) | 4,50 % | 01.07.2052            | 279.657          | 0,21                         |
| 279.718  | Fannie Mae Pool (CB4211) | 4,50 % | 01.07.2052            | 269.208          | 0,20                         |
| 123.837  | Fannie Mae Pool (FS2485) | 4,00 % | 01.07.2052            | 116.752          | 0,09                         |
| 424.912  | Fannie Mae Pool (MA4325) | 2,00 % | 01.05.2051            | 348.308          | 0,26                         |
| 23.989   | Freddie Mac Gold Pool    | 3,50 % | 01.10.2042            | 22.494           | 0,02                         |
| 26.039   | Freddie Mac Gold Pool    | 3,50 % | 01.05.2043            | 24.349           | 0,02                         |
| 16.154   | Freddie Mac Gold Pool    | 3,50 % | 01.06.2043            | 15.101           | 0,01                         |
| 12.555   | Freddie Mac Gold Pool    | 3,50 % | 01.04.2045            | 11.679           | 0,01                         |
| 58.389   | Freddie Mac Gold Pool    | 3,50 % | 01.08.2045            | 54.426           | 0,04                         |
| 12.674   | Freddie Mac Gold Pool    | 3,50 % | 01.12.2045            | 11.808           | 0,01                         |
| 12.644   | Freddie Mac Gold Pool    | 3,50 % | 01.04.2046            | 11.781           | 0,01                         |
| 120.135  | Freddie Mac Gold Pool    | 3,50 % | 01.04.2047            | 111.289          | 0,08                         |
| 50.865   | Freddie Mac Gold Pool    | 3,50 % | 01.07.2047            | 47.199           | 0,03                         |
| 17.584   | Freddie Mac Gold Pool    | 3,50 % | 01.09.2047            | 16.258           | 0,01                         |
| 24.169   | Freddie Mac Gold Pool    | 3,50 % | 01.10.2047            | 22.346           | 0,02                         |
| 131.957  | Freddie Mac Gold Pool    | 3,50 % | 01.12.2047            | 122.004          | 0,09                         |
| 40.076   | Freddie Mac Gold Pool    | 4,00 % | 01.02.2041            | 38.601           | 0,03                         |
| 28.810   | Freddie Mac Gold Pool    | 4,00 % | 01.11.2041            | 27.749           | 0,02                         |
| 15.926   | Freddie Mac Gold Pool    | 4,00 % | 01.11.2044            | 15.260           | 0,01                         |
| 12.531   | Freddie Mac Gold Pool    | 4,00 % | 01.03.2046            | 11.985           | 0,01                         |
| 94.296   | Freddie Mac Gold Pool    | 4,00 % | 01.04.2046            | 90.180           | 0,07                         |
| 15.098   | Freddie Mac Gold Pool    | 4,00 % | 01.09.2046            | 14.433           | 0,01                         |
| 179.547  | Freddie Mac Gold Pool    | 4,00 % | 01.12.2046            | 171.713          | 0,13                         |
| 75.725   | Freddie Mac Gold Pool    | 4,00 % | 01.01.2047            | 72.365           | 0,05                         |
| 88.905   | Freddie Mac Gold Pool    | 4,00 % | 01.04.2047            | 84.914           | 0,06                         |
| 14.630   | Freddie Mac Gold Pool    | 4,00 % | 01.05.2047            | 13.975           | 0,01                         |
| 39.679   | Freddie Mac Gold Pool    | 4,50 % | 01.08.2039            | 39.254           | 0,03                         |
| 11.991   | Freddie Mac Gold Pool    | 4,50 % | 01.12.2039            | 11.863           | 0,01                         |
| 3.924  | Freddie Mac Gold Pool    | 4,50 % | 01.03.2041            | 3.882            | 0,00                         |
| 36.364   | Freddie Mac Gold Pool    | 4,50 % | 01.11.2043            | 35.749           | 0,03                         |
| 5.955  | Freddie Mac Gold Pool    | 4,50 % | 01.10.2046            | 5.854            | 0,00                         |
| 42.349   | Freddie Mac Gold Pool    | 4,50 % | 01.09.2048            | 41.470           | 0,03                         |
| 7.863  | Freddie Mac Gold Pool    | 5,00 % | 01.10.2035            | 7.934            | 0,01                         |
| 19.078   | Freddie Mac Gold Pool    | 5,00 % | 01.09.2038            | 19.249           | 0,01                         |
| 16.568   | Freddie Mac Gold Pool    | 5,00 % | 01.03.2047            | 16.543           | 0,01                         |

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung          | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------------|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Mortgage-Backed Securities 18,88 % (31. Dezember 2022: 14,14 %) (Fortsetzung)</b> |                                |        |                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |                                |        |                       |                   |                              |
| 10.264   | Freddie Mac Gold Pool (Q18306) | 3,50 % | 01.05.2043            | 9.597             | 0,01                         |
| 196.475  | Freddie Mac Pool               | 2,00 % | 01.07.2051            | 160.475           | 0,12                         |
| 478.551  | Freddie Mac Pool               | 2,50 % | 01.07.2051            | 407.158           | 0,30                         |
| 116.896  | Freddie Mac Pool               | 2,50 % | 01.08.2051            | 99.501            | 0,07                         |
| 74.330   | Freddie Mac Pool               | 3,00 % | 01.02.2050            | 66.279            | 0,05                         |
| 42.829   | Freddie Mac Pool               | 3,50 % | 01.03.2048            | 39.552            | 0,03                         |
| 571.440  | Freddie Mac Pool               | 3,50 % | 01.06.2052            | 521.414           | 0,38                         |
| 451.480  | Freddie Mac Pool               | 3,50 % | 01.11.2052            | 411.781           | 0,30                         |
| 46.815   | Freddie Mac Pool               | 4,00 % | 01.05.2052            | 43.969            | 0,03                         |
| 113.836  | Freddie Mac Pool               | 4,00 % | 01.07.2052            | 106.926           | 0,08                         |
| 211.378  | Freddie Mac Pool               | 4,00 % | 01.08.2052            | 198.623           | 0,15                         |
| 287.061  | Freddie Mac Pool               | 4,00 % | 01.10.2052            | 269.494           | 0,20                         |
| 141.085  | Freddie Mac Pool               | 4,50 % | 01.07.2052            | 135.761           | 0,10                         |
| 350.537  | Freddie Mac Pool               | 4,50 % | 01.08.2052            | 337.298           | 0,25                         |
| 334.378  | Freddie Mac Pool               | 4,50 % | 01.10.2052            | 321.732           | 0,24                         |
| 186.656  | Freddie Mac Pool               | 5,00 % | 01.08.2052            | 183.204           | 0,13                         |
| 327.106  | Freddie Mac Pool               | 5,00 % | 01.10.2052            | 320.771           | 0,24                         |
| 53.854   | Freddie Mac Pool               | 5,00 % | 01.02.2053            | 52.800            | 0,04                         |
| 253.406  | Freddie Mac Pool               | 5,50 % | 01.09.2052            | 253.231           | 0,19                         |
| 246.003  | Freddie Mac Pool               | 5,50 % | 01.11.2052            | 245.226           | 0,18                         |
| 347.914  | Freddie Mac Pool               | 5,50 % | 01.01.2053            | 346.443           | 0,25                         |
| 193.470  | Freddie Mac Pool               | 5,50 % | 01.03.2053            | 192.652           | 0,14                         |
| 669.460  | Freddie Mac Pool               | 5,50 % | 01.05.2053            | 666.622           | 0,49                         |
| 471.729  | Freddie Mac Pool               | 5,50 % | 01.06.2053            | 469.730           | 0,34                         |
| 394.023  | Freddie Mac Pool               | 6,00 % | 01.02.2053            | 397.659           | 0,29                         |
| 382.247  | Freddie Mac Pool               | 6,00 % | 01.03.2053            | 385.774           | 0,28                         |
| 364.064  | Freddie Mac Pool               | 6,00 % | 01.04.2053            | 367.424           | 0,27                         |
| 367.902  | Freddie Mac Pool               | 6,00 % | 01.05.2053            | 371.297           | 0,27                         |
| 231.805  | Freddie Mac Pool (QE6925)      | 4,50 % | 01.08.2052            | 223.045           | 0,16                         |
| 265.527  | Freddie Mac Pool (SD1818)      | 4,00 % | 01.10.2052            | 249.504           | 0,18                         |
| 474.499  | Freddie Mac Pool (SD3010)      | 5,50 % | 01.06.2053            | 473.024           | 0,35                         |
| 454.901  | Freddie Mac Pool (SD8221)      | 3,50 % | 01.06.2052            | 414.962           | 0,30                         |
| 225.160  | Ginnie Mae II Pool             | 2,00 % | 20.04.2051            | 190.006           | 0,14                         |
| 114.632  | Ginnie Mae II Pool             | 2,50 % | 20.03.2051            | 99.743            | 0,07                         |
| 439.360  | Ginnie Mae II Pool             | 2,50 % | 20.04.2051            | 382.210           | 0,28                         |
| 301.728  | Ginnie Mae II Pool             | 4,00 % | 20.09.2052            | 285.621           | 0,21                         |
| 194.285  | Ginnie Mae II Pool             | 4,50 % | 20.09.2052            | 187.706           | 0,14                         |
| 138.851  | Ginnie Mae II Pool             | 5,00 % | 20.03.2053            | 136.544           | 0,10                         |
| 173.494  | Ginnie Mae II Pool             | 5,50 % | 20.03.2053            | 172.832           | 0,13                         |
| <b>Mortgage-Backed Securities insgesamt **</b>                                       |                                |        |                       | <b>25.715.608</b> | <b>18,88</b>                 |

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                           | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Kommunalanleihen 1,20 % (31. Dezember 2022: 1,27 %)</b> |   |        |                       |                    |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |   |        |                       |                    |                              |
| 645.000  | New York City Municipal Water Finance Authority | 6,01 % | 15.06.2042            | 737.813            | 0,54                         |
| 550.000  | State of California                             | 4,60 % | 01.04.2038            | 528.261            | 0,39                         |
| 500.000  | State of Hawaii                                 | 2,85 % | 01.10.2040            | 375.368            | 0,27                         |
| <b>Kommunalanleihen insgesamt †</b>                        |   |        |                       | <b>1.641.442</b>   | <b>1,20</b>                  |
| <b>Anlagen insgesamt</b>                                   |   |        |                       | <b>132.059.017</b> | <b>96,95</b>                 |

## Devisenterminkontrakte 0,80 % (31. Dezember 2022: 1,96 %)

| Geforderter<br>Betrag | Zu zahlender<br>Betrag | Fälligkeits-<br>datum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|-----------------------|------------------------|-----------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------------|------------------------------|
| 182.137 AUD           | 120.854 US\$           | 20.07.2023            | State Street Bank and Trust Co | 2         | 441                                  | 0,00                         |
| 1.205.452 BRL         | 234.027 US\$           | 20.07.2023            | BNP Paribas                    | 1         | 15.152                               | 0,01                         |
| 1.798.283 BRL         | 350.223 US\$           | 20.07.2023            | Goldman Sachs International    | 2         | 21.501                               | 0,02                         |
| 943.257 CAD           | 700.010 US\$           | 20.07.2023            | BNP Paribas                    | 3         | 12.993                               | 0,01                         |
| 667.447 CAD           | 497.429 US\$           | 20.07.2023            | Citibank NA                    | 3         | 7.090                                | 0,01                         |
| 1.199.132 CAD         | 892.769 US\$           | 20.07.2023            | Goldman Sachs International    | 2         | 13.648                               | 0,01                         |
| 172.320 CAD           | 126.680 US\$           | 20.07.2023            | Société Générale               | 1         | 3.576                                | 0,00                         |
| 2.351.954 CAD         | 1.741.670 US\$         | 20.07.2023            | State Street Bank and Trust Co | 3         | 36.159                               | 0,03                         |
| 412.242 CHF           | 458.890 US\$           | 20.07.2023            | BNP Paribas                    | 1         | 2.642                                | 0,00                         |
| 772.696 CHF           | 859.821 US\$           | 20.07.2023            | Citibank NA                    | 3         | 5.261                                | 0,00                         |
| 637.106 CHF           | 711.408 US\$           | 20.07.2023            | Société Générale               | 1         | 1.872                                | 0,00                         |
| 579.551 CHF           | 642.953 US\$           | 20.07.2023            | State Street Bank and Trust Co | 2         | 5.891                                | 0,00                         |
| 17.224.053 CLP        | 20.925 US\$            | 20.07.2023            | Standard Chartered Bank        | 1         | 503                                  | 0,00                         |
| 562.437.353 COP       | 121.727 US\$           | 21.07.2023            | UBS AG                         | 1         | 12.233                               | 0,01                         |
| 1.672.242 €           | 1.820.904 US\$         | 20.07.2023            | BNP Paribas                    | 3         | 4.931                                | 0,00                         |
| 1.124.443 €           | 1.220.567 US\$         | 20.07.2023            | Citibank NA                    | 3         | 7.155                                | 0,01                         |
| 825.289 €             | 894.379 US\$           | 20.07.2023            | Goldman Sachs International    | 2         | 6.711                                | 0,01                         |
| 590.808 €             | 637.555 US\$           | 21.07.2023            | Société Générale               | 1         | 7.554                                | 0,01                         |
| 1.524.358 €           | 1.648.970 US\$         | 20.07.2023            | Standard Chartered Bank        | 1         | 15.398                               | 0,01                         |
| 117.882 €             | 126.389 US\$           | 21.07.2023            | State Street Bank and Trust Co | 1         | 2.327                                | 0,00                         |
| 903.220 £             | 1.140.114 US\$         | 20.07.2023            | BNP Paribas                    | 4         | 8.320                                | 0,01                         |
| 547.884 £             | 684.318 US\$           | 20.07.2023            | Citibank NA                    | 3         | 12.310                               | 0,01                         |
| 1.185.457 £           | 1.495.022 US\$         | 20.07.2023            | Goldman Sachs International    | 5         | 12.272                               | 0,01                         |
| 194.390 £             | 244.553 US\$           | 20.07.2023            | Standard Chartered Bank        | 2         | 2.612                                | 0,00                         |
| 697.854 £             | 877.972 US\$           | 20.07.2023            | State Street Bank and Trust Co | 3         | 9.342                                | 0,01                         |
| 216.363 £             | 269.307 US\$           | 20.07.2023            | Westpac Banking Corp           | 1         | 5.796                                | 0,00                         |
| 39.963.981 HUF        | 114.971 US\$           | 20.07.2023            | Goldman Sachs International    | 2         | 1.411                                | 0,00                         |

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Devisenterminkontrakte 0,80 % (31. Dezember 2022: 1,96 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 118.530.854 HUF    | 339.574 US\$        | 20.07.2023       | UBS AG                         | 2         | 5.605                          | 0,00                 |
| 94.699.305 ¥       | 655.701 US\$        | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | 1.076                          | 0,00                 |
| 94.703.558 ¥       | 656.141 US\$        | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | 666                            | 0,00                 |
| 7.300.000 MXN      | 416.548 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 7.774                          | 0,01                 |
| 2.504.291 MXN      | 135.597 US\$        | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | 9.968                          | 0,01                 |
| 7.559 MXN          | 412 US\$            | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 28                             | 0,00                 |
| 29.200.000 MXN     | 1.636.049 US\$      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 1         | 61.238                         | 0,05                 |
| 5.047.286 NOK      | 471.324 US\$        | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 1         | 56                             | 0,00                 |
| 1.026.202 NZD      | 620.963 US\$        | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 2         | 7.692                          | 0,01                 |
| 379.277 NZD        | 230.289 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 2.057                          | 0,00                 |
| 480.580 PEN        | 126.749 US\$        | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 5.630                          | 0,00                 |
| 84 PLN             | 20 US\$             | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | 1                              | 0,00                 |
| 475.389 PLN        | 113.814 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 3.096                          | 0,00                 |
| 22 PLN             | 5 US\$              | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 0                              | 0,00                 |
| 1.135.405 PLN      | 263.832 US\$        | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | 15.392                         | 0,01                 |
| 2.417.028 SEK      | 222.659 US\$        | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | 1.272                          | 0,00                 |
| 2.515.578 SEK      | 232.688 US\$        | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 373                            | 0,00                 |
| 1.347.959 US\$     | 1.228.532 €         | 21.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | 6.514                          | 0,01                 |
| 757.016 US\$       | 11.291.506.119 IDR  | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | 6.223                          | 0,00                 |
| 227.149 US\$       | 2.396.844 SEK       | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | 5.088                          | 0,00                 |
| 2.058.140 US\$     | 1.872.757 €         | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 4         | 13.373                         | 0,01                 |
| 30 US\$            | 204 CNY             | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | 2                              | 0,00                 |
| 190.444 US\$       | 248.963.660 KRW     | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 2         | 1.344                          | 0,00                 |
| 226.784 US\$       | 339.304 AUD         | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | 822                            | 0,00                 |
| 436.503 US\$       | 58.531.244 ¥        | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 2         | 30.566                         | 0,02                 |
| 228.587 US\$       | 203.111 CHF         | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | 1.191                          | 0,00                 |
| 1.142.552 US\$     | 12.166.883 NOK      | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 2         | 6.254                          | 0,01                 |
| 1.009.194 US\$     | 1.617.194 NZD       | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 2         | 18.495                         | 0,01                 |
| 793.963 US\$       | 11.841.258.256 IDR  | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 2         | 6.617                          | 0,01                 |
| 438.445 US\$       | 4.693.549 NOK       | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 1         | 101                            | 0,00                 |
| 1.482.368 US\$     | 1.313.692 CHF       | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 7         | 11.605                         | 0,01                 |
| 113.761 US\$       | 89.323 £            | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 1         | 188                            | 0,00                 |
| 429.083 US\$       | 637.289 AUD         | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 3         | 4.673                          | 0,00                 |
| 1.137.496 US\$     | 151.906.478 ¥       | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 4         | 83.964                         | 0,06                 |
| 3.049.882 US\$     | 2.775.448 €         | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 8         | 19.512                         | 0,01                 |
| 237.374 US\$       | 31.592.063 ¥        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 18.270                         | 0,01                 |
| 793.624 US\$       | 1.273.814 NZD       | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 3         | 13.280                         | 0,01                 |
| 150.183 US\$       | 719.677 BRL         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 1.418                          | 0,00                 |
| 230.635 US\$       | 180.157 £           | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 1.568                          | 0,00                 |
| 225.879 US\$       | 198.455 CHF         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 3.696                          | 0,00                 |
| 114.135 US\$       | 1.677.442.355 IDR   | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 2.599                          | 0,00                 |

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Devisenterminkontrakte 0,80 % (31. Dezember 2022: 1,96 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag              | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 1.685.710 US\$                  | 2.492.763 AUD       | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 4         | 25.631                         | 0,02                 |
| 2.484.723 US\$                  | 2.263.384 €         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 8         | 13.451                         | 0,01                 |
| 117.466 US\$                    | 39.716.438 HUF      | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 1.806                          | 0,00                 |
| 694.734 US\$                    | 915.649 CAD         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 2.600                          | 0,00                 |
| 791.651 US\$                    | 5.428.461 CNH       | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 2         | 44.531                         | 0,03                 |
| 223.922 US\$                    | 2.394.566 NOK       | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 287                            | 0,00                 |
| 87.003 US\$                     | 12.100.000 ¥        | 20.07.2023       | Royal Bank of Canada           | 1         | 3.085                          | 0,00                 |
| 214.324 US\$                    | 282.273 CAD         | 20.07.2023       | Royal Bank of Canada           | 1         | 956                            | 0,00                 |
| 276.246 US\$                    | 216.610 £           | 20.07.2023       | Royal Bank of Canada           | 1         | 828                            | 0,00                 |
| 220.590 US\$                    | 200.000 €           | 20.07.2023       | Société Générale               | 1         | 2.220                          | 0,00                 |
| 4 US\$                          | 553 ¥               | 20.07.2023       | Société Générale               | 1         | 0                              | 0,00                 |
| 1.128.981 US\$                  | 7.636.361 DKK       | 20.07.2023       | Société Générale               | 1         | 9.020                          | 0,01                 |
| 114.934 US\$                    | 186.662 NZD         | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | 584                            | 0,00                 |
| 684.694 US\$                    | 4.882.562 CNH       | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 2         | 10.057                         | 0,01                 |
| 893.165 US\$                    | 127.665.964 ¥       | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 2         | 7.751                          | 0,01                 |
| 648.766 US\$                    | 4.478.085 CNH       | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 2         | 32.446                         | 0,02                 |
| 636.345 US\$                    | 500.000 £           | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | 601                            | 0,00                 |
| 686.819 US\$                    | 612.265 CHF         | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | 1.349                          | 0,00                 |
| 911.618 US\$                    | 830.581 €           | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 3         | 4.750                          | 0,00                 |
| 115.255 US\$                    | 1.723.408.257 IDR   | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | 663                            | 0,00                 |
| 964 US\$                        | 22.267 TRY          | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | 113                            | 0,00                 |
| 72.052 US\$                     | 771.470 NOK         | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 2                              | 0,00                 |
| 223.860 US\$                    | 2.411.468 SEK       | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 445                            | 0,00                 |
| 1.026.906 US\$                  | 1.629.074 NZD       | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 28.930                         | 0,02                 |
| 76.040 US\$                     | 10.061.518 ¥        | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 6.259                          | 0,01                 |
| 115.226 US\$                    | 170.037 AUD         | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 1.988                          | 0,00                 |
| 343.531 US\$                    | 302.550 CHF         | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 2         | 4.807                          | 0,00                 |
| 880.820 US\$                    | 800.000 €           | 21.07.2023       | UBS AG                         | 1         | 7.293                          | 0,01                 |
| 1.023.492 US\$                  | 15.137.935.360 IDR  | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | 16.943                         | 0,01                 |
| 1.446.139 US\$                  | 197.220.843 ¥       | 20.07.2023       | UBS AG                         | 2         | 78.335                         | 0,06                 |
| 1.307.947 US\$                  | 13.371.798 SEK      | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | 69.087                         | 0,05                 |
| 4.149.541 US\$                  | 5.436.418.921 KRW   | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | 20.316                         | 0,02                 |
| 778.297 US\$                    | 103.436.045 ¥       | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 3         | 60.927                         | 0,05                 |
| 756.501 US\$                    | 1.198.782 NZD       | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 1         | 22.123                         | 0,02                 |
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 395 AUD                         | 260 US\$            | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 2         | 4                              | 0,00                 |
| 523 US\$                        | 781 AUD             | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 4         | 3                              | 0,00                 |
| 202 US\$                        | 298 AUD             | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | 3                              | 0,00                 |
| 360 US\$                        | 537 AUD             | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 2         | 2                              | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen USD</i> |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 32 CAD                          | 24 US\$             | 20.07.2023       | Royal Bank of Canada           | 1         | 0                              | 0,00                 |

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 0,80 % (31. Dezember 2022: 1,96 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen USD (Fortsetzung)</i>                                   |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 50 £  | 63 US\$             | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 1         | 1                              | 0,00                 |
| 117 SEK   | 11 US\$             | 20.07.2023       | Royal Bank of Canada           | 1         | 0                              | 0,00                 |
| 111 US\$  | 789 CNY             | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | 2                              | 0,00                 |
| 142 US\$  | 2.125.094 IDR       | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 1         | 1                              | 0,00                 |
| 6.552 US\$  | 5.951 €             | 20.07.2023       | Royal Bank of Canada           | 1         | 55                             | 0,00                 |
| 3.702 US\$  | 477.879 ¥           | 20.07.2023       | Royal Bank of Canada           | 1         | 388                            | 0,00                 |
| 67 US\$   | 88 SGD              | 20.07.2023       | Royal Bank of Canada           | 1         | 2                              | 0,00                 |
| 65 US\$   | 442 DKK             | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | 0                              | 0,00                 |
| 2.649 US\$  | 18.055 CNY          | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | 154                            | 0,00                 |
| 338 US\$  | 442.400 KRW         | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | 2                              | 0,00                 |
| 429 US\$  | 637 AUD             | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 1         | 5                              | 0,00                 |
| 125 US\$  | 1.286 SEK           | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 1         | 6                              | 0,00                 |
| 50 US\$   | 79 NZD              | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 1         | 1                              | 0,00                 |
| 95 US\$   | 3.181 THB           | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 1         | 5                              | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen ZAR</i>   |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 261 US\$  | 4.833 ZAR           | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 2         | 6                              | 0,00                 |
| 380 US\$  | 7.070 ZAR           | 20.07.2023       | UBS AG                         | 3         | 6                              | 0,00                 |
| 119 US\$  | 2.251 ZAR           | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 1         | 0                              | 0,00                 |
| 4.099 ZAR   | 209 US\$            | 20.07.2023       | UBS AG                         | 2         | 7                              | 0,00                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                                |           | <b>1.095.225</b>               | <b>0,80</b>          |

### Futures-Kontrakte 0,10 % (31. Dezember 2022: 0,20 %)

| Anzahl Kontrakte   | Beschreibung   | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |             |
|--|--|--------------------------------|----------------------|-------------|
| (12)   | Australian Government Bond 10-Year Future September 2023 | 3.654                          | 0,00                 |             |
| 1  | Euro-Buxl 30-Year Bond Future September 2023             | 1.222                          | 0,00                 |             |
| (12)   | Euro-OAT Future September 2023                           | 18.852                         | 0,02                 |             |
| (23)   | US Treasury 10-Year Note (CBT) Future September 2023     | 42.606                         | 0,03                 |             |
| (53)   | US Treasury 10-Year Ultra Future September 2023          | 54.159                         | 0,04                 |             |
| 1  | US Treasury Long Bond (CBT) Future September 2023        | 94                             | 0,00                 |             |
| 13   | US Treasury Ultra Bond (CBT) Future September 2023       | 13.100                         | 0,01                 |             |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten <sup>*</sup></b> |  |                                | <b>133.687</b>       | <b>0,10</b> |

### Verkaufte Optionskontrakte 0,00 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)

| Anzahl Kontrakte  | Fälligkeit | Art                                       | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|---|------------|---|---------------|----------------------|
| <b>Kaufoptionen</b>   |            |   |               |                      |
| 80  | 15.12.2023 | 3 Month SOFR Future, Strike Price \$98.00 | 4.000         | 0,00                 |
| <b>Beizulegender Zeitwert aus gekauften Optionskontrakten insgesamt ± (Prämie: (14.000) US\$)</b> |            |   | <b>4.000</b>  | <b>0,00</b>          |

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Zinsswap-Kontrakte 0,11 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)

|  | Nominalwert | Fälligkeit | Gegenpartei                   | Erhalt/(Zahlung) <sup>#</sup> | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|-------------|------------|-------------------------------|-------------------------------|-----------------|--------------------|--------------------------------|----------------------|
| NOK  | 16.382.562  | 04.05.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | Erhalt                        | 3,47 %          | 6M NIBOR           | 47.735                         | 0,03                 |
| NOK  | 16.000.000  | 10.03.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | Erhalt                        | 3,55 %          | 6M NIBOR           | 42.420                         | 0,03                 |
| NOK  | 16.000.000  | 23.05.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | Erhalt                        | 3,62 %          | 6M NIBOR           | 36.696                         | 0,03                 |
| CNY  | 10.700.000  | 31.05.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 2,50 %          | 7D CNRR            | 7.769                          | 0,01                 |
| CNY  | 33.960.000  | 28.11.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 2,60 %          | 7D CNRR            | 7.044                          | 0,01                 |
| CNY  | 10.160.000  | 30.11.2027 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 2,82 %          | 7D CNRR            | 3.746                          | 0,00                 |
| SEK  | 15.900.000  | 10.03.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 3,38 %          | 3M STIBOR          | 3.505                          | 0,00                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Zinsswapkontrakten <sup>∞</sup></b> |             |            |                               |                               |                 |                    | <b>148.915</b>                 | <b>0,11</b>          |

<sup>#</sup>Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

|  | Zeitwert US\$      | % des Nettovermögens |
|--|--------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> | <b>133.440.844</b> | <b>97,96</b>         |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (2,27 %) (31. Dezember 2022: (1,42 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 315.689 AUD        | 212.201 US\$        | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (1.965)                         | (0,00)               |
| 2.634.389 AUD      | 1.761.756 US\$      | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 7         | (7.360)                         | (0,01)               |
| 1.202.554 AUD      | 814.160 US\$        | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 2         | (13.308)                        | (0,01)               |
| 1.168.012 AUD      | 785.270 US\$        | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 1         | (7.421)                         | (0,01)               |
| 5.500.000 CAD      | 4.170.702 US\$      | 20.07.2023       | Royal Bank of Canada           | 1         | (13.282)                        | (0,01)               |
| 150.387 CAD        | 114.046 US\$        | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (369)                           | (0,00)               |
| 703.777 CHF        | 795.262 US\$        | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 2         | (7.339)                         | (0,01)               |
| 298.671 CHF        | 337.622 US\$        | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 2         | (3.240)                         | (0,00)               |
| 613.209 CHF        | 692.633 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 3         | (6.107)                         | (0,00)               |
| 419.337 CHF        | 470.273 US\$        | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 2         | (798)                           | (0,00)               |
| 2.363.708 CNH      | 332.911 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | (7.593)                         | (0,01)               |
| 2.825.010 CNY      | 402.800 US\$        | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 3         | (12.460)                        | (0,01)               |
| 1.418.152 CNY      | 200.587 US\$        | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | (4.637)                         | (0,00)               |
| 85.961.545 CNY     | 12.576.248 US\$     | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (698.704)                       | (0,51)               |
| 405.269 CZK        | 18.823 US\$         | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (226)                           | (0,00)               |
| 2.425.773 CZK      | 113.253 US\$        | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 1         | (1.941)                         | (0,00)               |



## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Devisenterminkontrakte (2,27 %) (31. Dezember 2022: (1,42 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 10.202 CZK         | 479 US\$            | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (10)                            | (0,00)               |
| 4.127.197 CZK      | 191.803 US\$        | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | (2.419)                         | (0,00)               |
| 40.994 DKK         | 6.113 US\$          | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (101)                           | (0,00)               |
| 211.097 €          | 233.360 US\$        | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (2.874)                         | (0,00)               |
| 452.196 €          | 495.831 US\$        | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 2         | (2.101)                         | (0,00)               |
| 1.000.000 €        | 1.096.064 US\$      | 03.07.2023       | Citibank NA                    | 1         | (5.063)                         | (0,00)               |
| 407.662 €          | 449.276 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 2         | (4.170)                         | (0,00)               |
| 524.142 €          | 577.646 US\$        | 20.07.2023       | Royal Bank of Canada           | 1         | (5.363)                         | (0,00)               |
| 1.105.019 €        | 1.207.476 US\$      | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 2         | (963)                           | (0,00)               |
| 1.000.000 €        | 1.099.900 US\$      | 21.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | (7.991)                         | (0,01)               |
| 2.263.029 €        | 2.498.645 US\$      | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 2         | (27.761)                        | (0,02)               |
| 6.751.598 €        | 7.428.146 US\$      | 20.07.2023       | UBS AG                         | 2         | (56.424)                        | (0,04)               |
| 909.121 €          | 1.000.000 US\$      | 21.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 1         | (7.322)                         | (0,01)               |
| 179.062 £          | 228.895 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | (1.219)                         | (0,00)               |
| 100.000 HKD        | 12.799 US\$         | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | (35)                            | (0,00)               |
| 123.568 HKD        | 15.805 US\$         | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (32)                            | (0,00)               |
| 1.144.345.292 IDR  | 76.564 US\$         | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (475)                           | (0,00)               |
| 5.146.524.884 IDR  | 344.376 US\$        | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 2         | (2.174)                         | (0,00)               |
| 568.748 ILS        | 159.073 US\$        | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | (5.750)                         | (0,00)               |
| 152.491.108 ¥      | 1.129.679 US\$      | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 4         | (72.093)                        | (0,05)               |
| 232.435.140 ¥      | 1.744.235 US\$      | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 7         | (132.207)                       | (0,10)               |
| 157.890.035 ¥      | 1.147.064 US\$      | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 3         | (52.035)                        | (0,04)               |
| 23.187.458 ¥       | 178.571 US\$        | 20.07.2023       | Royal Bank of Canada           | 1         | (17.756)                        | (0,01)               |
| 71.434.488 ¥       | 522.015 US\$        | 20.07.2023       | Société Générale               | 2         | (26.589)                        | (0,02)               |
| 189.357.389 ¥      | 1.358.926 US\$      | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 3         | (45.657)                        | (0,03)               |
| 1.323.813.859 ¥    | 10.229.436 US\$     | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | (1.048.266)                     | (0,77)               |
| 150.237.724 KRW    | 115.922 US\$        | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 1         | (1.810)                         | (0,00)               |
| 199.650.888 KRW    | 153.338 US\$        | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 2         | (1.693)                         | (0,00)               |
| 330.596 MYR        | 72.159 US\$         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | (1.194)                         | (0,00)               |
| 2.047.065 MYR      | 468.090 US\$        | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (28.675)                        | (0,02)               |
| 14.469.515 NOK     | 1.399.803 US\$      | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 2         | (48.455)                        | (0,04)               |
| 1.318.004 NOK      | 127.284 US\$        | 20.07.2023       | Société Générale               | 1         | (4.192)                         | (0,00)               |
| 513 NOK            | 48 US\$             | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (1)                             | (0,00)               |
| 1.465.881 NZD      | 915.641 US\$        | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 5         | (17.637)                        | (0,01)               |
| 1.859.172 NZD      | 1.144.006 US\$      | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 2         | (5.071)                         | (0,00)               |
| 807.519 NZD        | 498.626 US\$        | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 3         | (3.937)                         | (0,00)               |
| 4.702.638 SEK      | 457.880 US\$        | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (22.194)                        | (0,02)               |
| 3.519.714 SEK      | 342.530 US\$        | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 2         | (16.439)                        | (0,01)               |
| 2.078.136 SEK      | 202.719 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | (10.186)                        | (0,01)               |
| 6.968.015 SEK      | 668.168 US\$        | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 3         | (22.601)                        | (0,02)               |
| 441.754 SGD        | 334.354 US\$        | 20.07.2023       | Société Générale               | 1         | (7.750)                         | (0,01)               |

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Devisenterminkontrakte (2,27 %) (31. Dezember 2022: (1,42 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 13.530.200 THB     | 403.036 US\$        | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (20.822)                        | (0,02)               |
| 444.921 US\$       | 358.315 £           | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 2         | (10.673)                        | (0,01)               |
| 132.671 US\$       | 1.442.574 SEK       | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (980)                           | (0,00)               |
| 228.994 US\$       | 212.449 €           | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (2.968)                         | (0,00)               |
| 454.634 US\$       | 406.766 CHF         | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (766)                           | (0,00)               |
| 600.214 US\$       | 983.389 NZD         | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 2         | (2.214)                         | (0,00)               |
| 222.455 US\$       | 2.426.596 NOK       | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (4.172)                         | (0,00)               |
| 223.583 US\$       | 79.322.827 HUF      | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (7.417)                         | (0,01)               |
| 348.123 US\$       | 464.595 CAD         | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (3.061)                         | (0,00)               |
| 30.793 US\$        | 594.311 ZAR         | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (618)                           | (0,00)               |
| 222.596 US\$       | 4.078.329 MXN       | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (14.462)                        | (0,01)               |
| 1.029.721 US\$     | 1.377.495 CAD       | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 3         | (11.520)                        | (0,01)               |
| 233.722 US\$       | 209.894 CHF         | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 1         | (1.268)                         | (0,00)               |
| 869.148 US\$       | 1.315.683 AUD       | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 3         | (7.044)                         | (0,01)               |
| 1.670.375 US\$     | 1.332.901 £         | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 5         | (24.394)                        | (0,02)               |
| 114.889 US\$       | 475.418 PLN         | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 1         | (2.028)                         | (0,00)               |
| 799.854 US\$       | 1.066.199 CAD       | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 4         | (6.080)                         | (0,00)               |
| 227.894 US\$       | 342.536 AUD         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | (221)                           | (0,00)               |
| 1.405.978 US\$     | 1.294.570 €         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 3         | (7.497)                         | (0,01)               |
| 1.003.977 US\$     | 804.118 £           | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 2         | (18.449)                        | (0,01)               |
| 219.202 US\$       | 2.348.472 NOK       | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | (129)                           | (0,00)               |
| 110.545 US\$       | 2.439.348 CZK       | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | (1.389)                         | (0,00)               |
| 1.170.844 US\$     | 1.049.291 CHF       | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 3         | (3.904)                         | (0,00)               |
| 395.278 US\$       | 6.968.499 MXN       | 20.07.2023       | Royal Bank of Canada           | 1         | (9.775)                         | (0,01)               |
| 12.524 US\$        | 135.208 SEK         | 20.07.2023       | Royal Bank of Canada           | 1         | (2)                             | (0,00)               |
| 1.070.177 US\$     | 1.000.000 €         | 21.07.2023       | Société Générale               | 1         | (21.732)                        | (0,02)               |
| 496.877 US\$       | 400.000 £           | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | (11.718)                        | (0,01)               |
| 359.060 US\$       | 331.662 €           | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | (3.065)                         | (0,00)               |
| 1.749.859 US\$     | 1.617.811 €         | 21.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 2         | (16.644)                        | (0,01)               |
| 1.538.099 US\$     | 28.489.711 MXN      | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | (117.901)                       | (0,09)               |
| 7.026.055 US\$     | 9.451.154 CAD       | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | (118.020)                       | (0,09)               |
| 308.654 US\$       | 3.370.841 NOK       | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 2         | (6.159)                         | (0,01)               |
| 567.929 US\$       | 509.309 CHF         | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 2         | (2.275)                         | (0,00)               |
| 230.294 US\$       | 212.603 €           | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (1.837)                         | (0,00)               |
| 765.717 US\$       | 1.021.498 CAD       | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 2         | (6.428)                         | (0,01)               |
| 320.059 US\$       | 533.632 NZD         | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (6.845)                         | (0,01)               |
| 3.584.646 US\$     | 2.867.395 £         | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 3         | (61.213)                        | (0,05)               |
| 77.501 US\$        | 1.396.205 MXN       | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (3.655)                         | (0,00)               |
| 1.568.510 US\$     | 1.252.483 £         | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | (24.008)                        | (0,02)               |
| 223.855 US\$       | 206.910 €           | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | (2.060)                         | (0,00)               |
| 72.310 US\$        | 57.834 £            | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 1         | (1.225)                         | (0,00)               |

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (2,27 %) (31. Dezember 2022: (1,42 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 475.227 US\$  | 2.008.000 PLN       | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 1         | (18.589)                        | (0,01)               |
| 32.905 ZAR  | 1.820 US\$          | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | (81)                            | (0,00)               |
| 5.879 ZAR   | 319 US\$            | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (9)                             | (0,00)               |
| 588.432 ZAR   | 32.641 US\$         | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | (1.542)                         | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i>   |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 833 AUD   | 562 US\$            | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 3         | (7)                             | (0,00)               |
| 29.784 AUD  | 20.070 US\$         | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | (235)                           | (0,00)               |
| 156 AUD   | 105 US\$            | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 1         | (1)                             | (0,00)               |
| 106 US\$  | 160 AUD             | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (0)                             | (0,00)               |
| 205 US\$  | 315 AUD             | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | (4)                             | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen USD</i>   |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 1.214 US\$  | 970 £               | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | (20)                            | (0,00)               |
| 833 US\$  | 1.119 CAD           | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | (12)                            | (0,00)               |
| 160 US\$  | 143 CHF             | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | (0)                             | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen ZAR</i>   |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 388 US\$  | 7.525 ZAR           | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 3         | (10)                            | (0,00)               |
| 185 US\$  | 3.650 ZAR           | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | (8)                             | (0,00)               |
| 344.824 ZAR   | 19.056 US\$         | 20.07.2023       | Royal Bank of Canada           | 1         | (832)                           | (0,00)               |
| 12.900 ZAR  | 708 US\$            | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 3         | (26)                            | (0,00)               |
| 2.460 ZAR   | 135 US\$            | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | (5)                             | (0,00)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>oo</sup></b> |                     |                  |                                |           | <b>(3.093.454)</b>              | <b>(2,27)</b>        |

### Futures-Kontrakte (0,16 %) (31. Dezember 2022: (0,14 %))

| Anzahl Kontrakte  | Beschreibung  | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---|---------------------------------|----------------------|
| (23)  | 10-Year Mini Japanese Government Bond Future September 2023 | (5.817)                         | (0,01)               |
| 17  | Canadian 5-Year Bond Future September 2023                  | (18.371)                        | (0,01)               |
| 27  | Euro-BOBL Future September 2023                             | (48.953)                        | (0,04)               |
| 25  | Euro-Bund Future September 2023                             | (43.596)                        | (0,03)               |
| 45  | Euro-Schatz Future September 2023                           | (47.780)                        | (0,03)               |
| (15)  | United Kingdom Long Gilt Future September 2023              | (1.624)                         | (0,00)               |
| 6   | US Treasury 10-Year Note (CBT) Future September 2023        | (11.943)                        | (0,01)               |
| 12  | US Treasury 2-Year Note (CBT) Future September 2023         | (24.192)                        | (0,02)               |
| 14  | US Treasury 5-Year Note (CBT) Future September 2023         | (12.383)                        | (0,01)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten <sup>*</sup></b> |   | <b>(214.659)</b>                | <b>(0,16)</b>        |

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

|   | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------|------------------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(3.308.113)</b> | <b>(2,43)</b>                |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>130.132.731</b> | <b>95,53</b>                 |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>6.083.909</b>   | <b>4,47</b>                  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>136.216.640</b> | <b>100,00</b>                |

| <b>Portfolioanalyse</b>   | US\$               | % des<br>Gesamtver-<br>mögens |
|---|--------------------|-------------------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 78.201.609         | 54,15                         |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden            | 51.663.586         | 35,77                         |
| † Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente  | 2.193.822          | 1,52                          |
| ± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden                          | (76.972)           | (0,05)                        |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap                            | (1.849.314)        | (1,28)                        |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>130.132.731</b> | <b>90,11</b>                  |

## Global Diversified Income FMP - 2024 - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 92,82 % (31. Dezember 2022: 93,73 %)</b> |  |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |  |        |                       |                  |                              |
| 1.000.000  | ABJA Investment Co Pte Ltd**                         | 5,95 % | 31.07.2024            | 997.561          | 0,62                         |
| 2.000.000  | Adani Ports & Special Economic Zone Ltd**            | 3,38 % | 24.07.2024            | 1.911.582        | 1,19                         |
| 2.944.000  | Africa Finance Corp*                                 | 3,88 % | 13.04.2024            | 2.879.821        | 1,80                         |
| 1.444.000  | African Export-Import Bank*                          | 4,13 % | 20.06.2024            | 1.411.510        | 0,88                         |
| 1.583.000  | African Export-Import Bank*                          | 5,25 % | 11.10.2023            | 1.577.064        | 0,98                         |
| 3.000.000  | Air Lease Corp*                                      | 0,70 % | 15.02.2024            | 2.906.464        | 1,81                         |
| 1.000.000  | Air Lease Corp*                                      | 4,25 % | 01.02.2024            | 989.633          | 0,62                         |
| 1.100.000  | Anglo American Capital Plc*                          | 3,63 % | 11.09.2024            | 1.069.535        | 0,67                         |
| 1.500.000  | Ares Capital Corp**                                  | 4,20 % | 10.06.2024            | 1.464.636        | 0,91                         |
| 4.100.000  | Athene Global Funding**                              | 2,75 % | 25.06.2024            | 3.944.530        | 2,46                         |
| 3.120.000  | Avolon Holdings Funding Ltd**                        | 5,25 % | 15.05.2024            | 3.066.269        | 1,91                         |
| 4.040.000  | Ball Corp*   | 4,00 % | 15.11.2023            | 4.013.336        | 2,50                         |
| 3.389.000  | Bank Mandiri Persero Tbk PT*                         | 3,75 % | 11.04.2024            | 3.332.573        | 2,08                         |
| 3.250.000  | Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT*                | 3,95 % | 28.03.2024            | 3.201.254        | 2,00                         |
| 4.000.000  | Barclays Plc*  | 4,38 % | 11.09.2024            | 3.884.991        | 2,42                         |
| 435.000  | Bharti Airtel International Netherlands BV*          | 5,35 % | 20.05.2024            | 432.322          | 0,27                         |
| 2.500.000  | Black Sea Trade & Development Bank*                  | 3,50 % | 25.06.2024            | 2.355.285        | 1,47                         |
| 3.000.000  | BOC Aviation Ltd*                                    | 4,00 % | 25.01.2024            | 2.965.461        | 1,85                         |
| 620.000  | Buckeye Partners LP**                                | 4,15 % | 01.07.2023            | 620.000          | 0,39                         |
| 3.005.000  | Buckeye Partners LP**                                | 4,35 % | 15.10.2024            | 2.936.787        | 1,83                         |
| 240.000  | CICC Hong Kong Finance 2016 MTN Ltd*                 | 1,75 % | 10.08.2023            | 238.993          | 0,15                         |
| 750.000  | CSC Holdings LLC**                                   | 5,25 % | 01.06.2024            | 698.406          | 0,44                         |
| 1.333.000  | Eastern & Southern African Trade & Development Bank* | 4,88 % | 23.05.2024            | 1.283.932        | 0,80                         |
| 2.200.000  | Energy Transfer LP*                                  | 3,90 % | 15.05.2024            | 2.163.387        | 1,35                         |
| 3.685.000  | EQM Midstream Partners LP*                           | 4,00 % | 01.08.2024            | 3.608.224        | 2,25                         |
| 3.000.000  | ERAC USA Finance LLC**                               | 2,70 % | 01.11.2023            | 2.969.410        | 1,85                         |
| 1.000.000  | Ford Motor Credit Co LLC*                            | 3,37 % | 17.11.2023            | 990.649          | 0,62                         |
| 1.040.000  | Ford Motor Credit Co LLC*                            | 3,81 % | 09.01.2024            | 1.026.114        | 0,64                         |
| 3.385.000  | Ford Motor Credit Co LLC*                            | 5,58 % | 18.03.2024            | 3.364.170        | 2,10                         |
| 4.550.000  | General Motors Financial Co Inc*                     | 3,95 % | 13.04.2024            | 4.480.031        | 2,79                         |
| 944.000  | Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd*                 | 5,13 % | 15.05.2024            | 934.988          | 0,58                         |
| 4.750.000  | HSBC Holdings Plc*                                   | 4,25 % | 14.03.2024            | 4.690.564        | 2,92                         |
| 1.800.000  | Huarong Finance 2019 Co Ltd*                         | 3,25 % | 13.11.2024            | 1.689.713        | 1,05                         |
| 1.100.000  | Huarong Finance 2019 Co Ltd*                         | 3,75 % | 29.05.2024            | 1.057.595        | 0,66                         |
| 2.500.000  | Hyundai Capital America**                            | 3,40 % | 20.06.2024            | 2.438.267        | 1,52                         |
| 1.930.000  | Live Nation Entertainment Inc**                      | 4,88 % | 01.11.2024            | 1.902.405        | 1,19                         |
| 1.500.000  | Marriott International Inc**                         | 3,60 % | 15.04.2024            | 1.475.133        | 0,92                         |
| 3.800.000  | Mashreqbank PSC*                                     | 4,25 % | 26.02.2024            | 3.756.410        | 2,34                         |
| 889.000  | Minmetals Bounteous Finance BVI Ltd*                 | 3,38 % | 29.12.2049            | 861.948          | 0,54                         |
| 563.000  | MTN Mauritius Investments Ltd*                       | 4,76 % | 11.11.2024            | 549.488          | 0,34                         |

## Global Diversified Income FMP - 2024 - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 92,82 % (31. Dezember 2022: 93,73 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                    |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |        |                       |                    |                              |
| 3.000.000  | Nationwide Building Society*                                      | 0,55 % | 22.01.2024            | 2.912.201          | 1,82                         |
| 4.600.000  | NatWest Group Plc*  | 5,13 % | 28.05.2024            | 4.520.947          | 2,82                         |
| 3.840.000  | NOVA Chemicals Corp**   | 4,88 % | 01.06.2024            | 3.755.059          | 2,34                         |
| 4.000.000  | NRG Energy Inc**  | 3,75 % | 15.06.2024            | 3.866.896          | 2,41                         |
| 3.960.000  | OneMain Finance Corp**  | 6,13 % | 15.03.2024            | 3.950.055          | 2,46                         |
| 3.238.000  | Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc**          | 5,25 % | 15.04.2024            | 3.214.208          | 2,00                         |
| 1.500.000  | QIB Sukuk Ltd*  | 3,98 % | 26.03.2024            | 1.482.532          | 0,92                         |
| 1.000.000  | QIIB Senior Sukuk Ltd*  | 4,26 % | 05.03.2024            | 989.634            | 0,62                         |
| 2.500.000  | Rakfunding Cayman Ltd*  | 4,13 % | 09.04.2024            | 2.468.630          | 1,54                         |
| 1.250.000  | REC Ltd*  | 3,38 % | 25.07.2024            | 1.214.775          | 0,76                         |
| 450.000  | REC Ltd*  | 3,50 % | 12.12.2024            | 433.070            | 0,27                         |
| 989.000  | REC Ltd*  | 5,25 % | 13.11.2023            | 985.227            | 0,61                         |
| 1.889.000  | Saudi Electricity Global Sukuk Co 4*                              | 4,22 % | 27.01.2024            | 1.871.682          | 1,17                         |
| 1.165.000  | Service Properties Trust**  | 4,65 % | 15.03.2024            | 1.147.175          | 0,72                         |
| 1.000.000  | Shriram Finance Ltd*  | 4,40 % | 13.03.2024            | 978.573            | 0,61                         |
| 2.500.000  | SNB Funding Ltd*  | 2,75 % | 02.10.2024            | 2.411.425          | 1,50                         |
| 2.600.000  | Societe Generale SA**   | 2,63 % | 16.10.2024            | 2.461.721          | 1,53                         |
| 4.015.000  | Sprint LLC**  | 7,13 % | 15.06.2024            | 4.054.520          | 2,53                         |
| 1.950.000  | Starwood Property Trust Inc**                                     | 5,50 % | 01.11.2023            | 1.935.228          | 1,21                         |
| 3.850.000  | Synchrony Financial*  | 4,25 % | 15.08.2024            | 3.713.401          | 2,31                         |
| 2.930.000  | Taylor Morrison Communities Inc/Taylor Morrison Holdings II Inc** | 5,63 % | 01.03.2024            | 2.910.662          | 1,81                         |
| 3.180.000  | TRI Pointe Group Inc/TRI Pointe Homes Inc*                        | 5,88 % | 15.06.2024            | 3.159.012          | 1,97                         |
| 2.600.000  | Ventas Realty LP*   | 3,50 % | 15.04.2024            | 2.542.499          | 1,58                         |
| 4.000.000  | Warnermedia Holdings Inc†   | 3,53 % | 15.03.2024            | 3.928.628          | 2,45                         |
| 1.000.000  | Weibo Corp*   | 3,50 % | 05.07.2024            | 976.140            | 0,61                         |
| 889.000  | Wynn Macau Ltd*   | 4,88 % | 01.10.2024            | 867.788            | 0,54                         |
| <b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>  |   |        |                       | <b>148.892.129</b> | <b>92,82</b>                 |
| <b>Staatsanleihen 1,04 % (31. Dezember 2022: 2,45 %)</b>                       |   |        |                       |                    |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |   |        |                       |                    |                              |
| 1.300.000  | Egypt Government International Bond                               | 6,20 % | 01.03.2024            | 1.224.067          | 0,76                         |
| 444.000  | Republic of South Africa Government International Bond            | 4,67 % | 17.01.2024            | 440.226            | 0,28                         |
| <b>Staatsanleihen insgesamt *</b>  |   |        |                       | <b>1.664.293</b>   | <b>1,04</b>                  |
| <b>Anlagen insgesamt</b>   |   |        |                       | <b>150.556.422</b> | <b>93,86</b>                 |

Devisenterminkontrakte 0,03 % (31. Dezember 2022: 0,33 %)

| Geforderter<br>Betrag           | Zu zahlender<br>Betrag | Fälligkeits-<br>datum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---------------------------------|------------------------|-----------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------------|------------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> |                        |                       |                                |           |                                      |                              |
| 10.538 £                        | 13.152 US\$            | 20.07.2023            | State Street Bank and Trust Co | 1         | 247                                  | 0,00                         |

## Global Diversified Income FMP - 2024 - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 0,03 % (31. Dezember 2022: 0,33 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei          | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|----------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen GBP (Fortsetzung)</i>  |                     |                  |                      |           |                                |                      |
| 1.881.420 €  | 2.351.558 US\$      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp | 1         | 40.645                         | 0,03                 |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>  |                     |                  |                      |           |                                |                      |
| 347.022 US\$   | 459.250 SGD         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp | 2         | 7.483                          | 0,00                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>                        |                     |                  |                      |           | <b>48.375</b>                  | <b>0,03</b>          |
|  |                     |                  |                      |           | Zeitwert US\$                  | % des Nettovermögens |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> |                     |                  |                      |           | <b>150.604.797</b>             | <b>93,89</b>         |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (0,07 %) (31. Dezember 2022: (0,00 %))

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei          | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|----------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>   |                     |                  |                      |           |                                 |                      |
| 2.300.277 €   | 2.533.217 US\$      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp | 1         | (21.663)                        | (0,02)               |
| <i>Abgesicherte Klassen HKD</i>   |                     |                  |                      |           |                                 |                      |
| 6.821.713 HKD   | 873.221 US\$        | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp | 1         | (2.496)                         | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>   |                     |                  |                      |           |                                 |                      |
| 4.848.689 SGD   | 3.669.316 US\$      | 20.07.2023       | UBS AG               | 1         | (84.516)                        | (0,05)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>                          |                     |                  |                      |           | <b>(108.675)</b>                | <b>(0,07)</b>        |
|   |                     |                  |                      |           | Zeitwert US\$                   | % des Nettovermögens |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> |                     |                  |                      |           | <b>(108.675)</b>                | <b>(0,07)</b>        |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              |                     |                  |                      |           | <b>150.496.122</b>              | <b>93,82</b>         |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  |                     |                  |                      |           | <b>9.916.363</b>                | <b>6,18</b>          |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   |                     |                  |                      |           | <b>160.412.485</b>              | <b>100,00</b>        |

| Portfolioanalyse  | US\$               | % des Gesamtvermögens |
|---|--------------------|-----------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 94.907.284         | 58,96                 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden            | 51.720.510         | 32,13                 |
| † Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente  | 3.928.628          | 2,44                  |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente   | (60.300)           | (0,04)                |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>150.496.122</b> | <b>93,49</b>          |

## Global Equity Megatrends - Aufstellung des Wertpapierbests

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der Anteile                                  | Wertpapierbezeichnung             | Zeitwert US\$     | % des Nettovermögens |
|---|-----------------------------------|-------------------|----------------------|
| <b>Aktien 97,13 % (31. Dezember 2022: 100,15 %)</b> |                                   |                   |                      |
| <b>Kanadischer Dollar</b>                           |                                   |                   |                      |
| 335.872   | Element Fleet Management Corp     | 5.122.159         | 4,98                 |
| <b>Kanadischer Dollar insgesamt</b>                 |                                   | <b>5.122.159</b>  | <b>4,98</b>          |
| <b>Britisches Pfund</b>                             |                                   |                   |                      |
| 1.269.363   | Pets at Home Group Plc            | 6.077.588         | 5,91                 |
| <b>Britisches Pfund insgesamt</b>                   |                                   | <b>6.077.588</b>  | <b>5,91</b>          |
| <b>US-Dollar</b>                                    |                                   |                   |                      |
| 53.366  | Alibaba Group Holding Ltd ADR     | 4.448.056         | 4,33                 |
| 45.386  | Alphabet Inc Class A              | 5.432.704         | 5,29                 |
| 44.170  | Amdocs Ltd                        | 4.366.204         | 4,25                 |
| 7.108   | Aon Plc Class A                   | 2.453.682         | 2,39                 |
| 96.251  | ATI Inc                           | 4.257.182         | 4,14                 |
| 116.649   | Corning Inc                       | 4.087.381         | 3,98                 |
| 166.290   | Criteo SA ADR                     | 5.610.625         | 5,46                 |
| 120.494   | Delta Air Lines Inc               | 5.728.285         | 5,57                 |
| 584.323   | Despegar.com Corp                 | 4.119.477         | 4,01                 |
| 150.563   | Element Solutions Inc             | 2.890.810         | 2,81                 |
| 48.851  | Expedia Group Inc                 | 5.343.811         | 5,20                 |
| 240.103   | Gen Digital Inc                   | 4.453.911         | 4,33                 |
| 79.083  | ModivCare Inc                     | 3.575.342         | 3,48                 |
| 2.862   | Nice Ltd ADR                      | 591.003           | 0,58                 |
| 131.290   | Perrigo Co Plc                    | 4.457.295         | 4,34                 |
| 10.615  | Quanta Services Inc               | 2.085.317         | 2,03                 |
| 102.557   | Scholastic Corp                   | 3.988.442         | 3,88                 |
| 101.434   | Stericycle Inc                    | 4.710.595         | 4,58                 |
| 23.057  | TE Connectivity Ltd               | 3.231.669         | 3,15                 |
| 9.455   | Tetra Tech Inc                    | 1.548.162         | 1,51                 |
| 108.548   | Uber Technologies Inc             | 4.686.017         | 4,56                 |
| 179.858   | Vistra Corp                       | 4.721.272         | 4,59                 |
| 214.617   | Zeta Global Holdings Corp Class A | 1.832.829         | 1,78                 |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>                          |                                   | <b>88.620.071</b> | <b>86,24</b>         |
| <b>Aktien insgesamt *</b>                           |                                   | <b>99.819.818</b> | <b>97,13</b>         |
| <b>Anlagen insgesamt</b>                            |                                   | <b>99.819.818</b> | <b>97,13</b>         |



## Global Equity Megatrends - Aufstellung des Wertpapierbests (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

|   | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Netto-<br>vermögens  |
|---|--------------------|-------------------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>  | <b>99.819.818</b>  | <b>97,13</b>                  |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>            | <b>99.819.818</b>  | <b>97,13</b>                  |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>2.945.230</b>   | <b>2,87</b>                   |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                 | <b>102.765.048</b> | <b>100,00</b>                 |
| <br>  |                    |                               |
| <b>Portfolioanalyse</b>   | US\$               | % des<br>Gesamtver-<br>mögens |
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 99.819.818         | 96,85                         |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>99.819.818</b>  | <b>96,85</b>                  |

## Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der Anteile  | Wertpapierbezeichnung                                     |         |                  | Zeitwert US\$     | % des Nettovermögens |
|---|---|---------|------------------|-------------------|----------------------|
| <b>Aktien 1,67 % (31. Dezember 2022: 1,33 %)</b>  |   |         |                  |                   |                      |
| <b>US-Dollar</b>  |   |         |                  |                   |                      |
| 5.000   | McAfee LLC  |         |                  | 5.744.028         | 1,67                 |
| <b>Aktien insgesamt *</b>   |   |         |                  | <b>5.744.028</b>  | <b>1,67</b>          |
| Kapitalbetrag   | Wertpapierbezeichnung                                     | Kupon   | Fälligkeitsdatum | Zeitwert US\$     | % des Nettovermögens |
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 4,33 % (31. Dezember 2022: 6,10 %)</b> |   |         |                  |                   |                      |
| <b>US-Dollar</b>  |   |         |                  |                   |                      |
| 2.000.000   | AGL CLO 19 Ltd Series 2022-19X Class E                    | 13,07 % | 21.07.2035       | 1.967.579         | 0,57                 |
| 2.500.000   | Aimco CDO Series 2021-16X Class D                         | 8,16 %  | 17.01.2035       | 2.393.263         | 0,70                 |
| 1.950.000   | CIFC Funding 2018-I Ltd Class D                           | 7,91 %  | 18.04.2031       | 1.844.445         | 0,54                 |
| 500.000   | CIFC Funding 2018-II Ltd Class C                          | 8,10 %  | 20.04.2031       | 475.355           | 0,14                 |
| 241.000   | CSAIL 2018-C14 Commercial Mortgage Trust Class C          | 5,06 %  | 15.11.2051       | 187.723           | 0,05                 |
| 1.000.000   | Dryden 93 CLO Ltd Series 2021-93X Class D                 | 8,21 %  | 15.01.2034       | 922.031           | 0,27                 |
| 180.000   | GS Mortgage Securities Trust 2015-GS1 Class AS            | 4,04 %  | 10.11.2048       | 159.961           | 0,05                 |
| 359.000   | GS Mortgage Securities Trust 2016-GS4 Class B             | 3,98 %  | 10.11.2049       | 311.792           | 0,09                 |
| 1.125.000   | Invesco CLO Ltd Series 2021-3X Class D                    | 8,27 %  | 22.10.2034       | 1.040.405         | 0,30                 |
| 580.000   | Morgan Stanley Capital I Trust 2017-H1 Class C            | 4,28 %  | 15.06.2050       | 459.386           | 0,13                 |
| 279.000   | Morgan Stanley Capital I Trust 2018-H4 Class C            | 5,24 %  | 15.12.2051       | 234.705           | 0,07                 |
| 500.000   | Octagon Investment Partners 35 Ltd Series 2018-1X Class C | 7,85 %  | 20.01.2031       | 447.101           | 0,13                 |
| 2.000.000   | TCW CLO Ltd Series 2018-1X Class D                        | 8,17 %  | 25.04.2031       | 1.836.429         | 0,53                 |
| 1.000.000   | Trinitas CLO VII Ltd Series 2017-7X Class D1R             | 8,76 %  | 25.01.2035       | 891.083           | 0,26                 |
| 1.000.000   | Trinitas CLO XIX Ltd Series 2022-19X Class E              | 13,11 % | 23.10.2033       | 924.483           | 0,27                 |
| 390.000   | Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-NXS4 Class C   | 4,84 %  | 15.12.2048       | 349.709           | 0,10                 |
| 550.000   | Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-NXS6 Class C   | 4,53 %  | 15.11.2049       | 462.223           | 0,13                 |
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) insgesamt **</b>                       |   |         |                  | <b>14.907.673</b> | <b>4,33</b>          |
| <b>Unternehmensanleihen 81,02 % (31. Dezember 2022: 80,14 %)</b>                          |   |         |                  |                   |                      |
| <b>Euro</b>   |   |         |                  |                   |                      |
| 350.000   | 888 Acquisitions Ltd**                                    | 7,56 %  | 15.07.2027       | 360.753           | 0,10                 |
| 800.000   | Abertis Infraestructuras Finance BV*                      | 3,25 %  | 29.12.2049       | 786.664           | 0,23                 |
| 600.000   | ABN AMRO Bank NV*   | 4,38 %  | 29.12.2049       | 591.275           | 0,17                 |
| 500.000   | Ahlstrom Holding 3 Oy*                                    | 3,63 %  | 04.02.2028       | 453.523           | 0,13                 |
| 500.000   | Air France-KLM*   | 8,13 %  | 31.05.2028       | 565.690           | 0,16                 |
| 700.000   | Allwyn International AS**                                 | 3,88 %  | 15.02.2027       | 719.081           | 0,21                 |
| 750.000   | Altice Finco SA*  | 4,75 %  | 15.01.2028       | 548.227           | 0,16                 |
| 300.000   | Altice France Holding SA*                                 | 8,00 %  | 15.05.2027       | 192.063           | 0,06                 |
| 500.000   | Altice France SA**  | 2,13 %  | 15.02.2025       | 502.131           | 0,15                 |
| 200.000   | Altice France SA**  | 4,25 %  | 15.10.2029       | 157.504           | 0,05                 |
| 800.000   | American Tower Corp*                                      | 0,50 %  | 15.01.2028       | 734.578           | 0,21                 |
| 600.000   | Banco Santander SA*                                       | 4,13 %  | 29.12.2049       | 491.900           | 0,14                 |
| 700.000   | Bayer AG*   | 5,38 %  | 25.03.2082       | 709.286           | 0,21                 |

## Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                     | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 81,02 % (31. Dezember 2022: 80,14 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |   |         |                       |                  |                              |
| 1.399.000  | BCP V Modular Services Finance Plc**      | 6,75 %  | 30.11.2029            | 1.163.663        | 0,34                         |
| 800.000  | Benteler International AG*                | 9,38 %  | 15.05.2028            | 883.710          | 0,26                         |
| 1.000.000  | BK LC Lux Finco 1 Sarl*                   | 5,25 %  | 30.04.2029            | 1.028.080        | 0,30                         |
| 900.000  | BPCE SA*                                  | 5,13 %  | 25.01.2035            | 952.586          | 0,28                         |
| 500.000  | Cirsa Finance International Sarl*         | 4,50 %  | 15.03.2027            | 500.544          | 0,14                         |
| 599.000  | Cirsa Finance International Sarl*         | 10,38 % | 30.11.2027            | 701.284          | 0,20                         |
| 1.400.000  | Clarios Global LP/Clarios US Finance Co** | 4,38 %  | 15.05.2026            | 1.458.395        | 0,42                         |
| 600.000  | Commerzbank AG*                           | 6,50 %  | 29.12.2049            | 571.233          | 0,17                         |
| 600.000  | Cooperatieve Rabobank UA*                 | 4,38 %  | 29.12.2049            | 572.991          | 0,17                         |
| 1.000.000  | Ctec II GmbH**                            | 5,25 %  | 15.02.2030            | 906.873          | 0,26                         |
| 801.000  | Dana Financing Luxembourg Sarl*           | 8,50 %  | 15.07.2031            | 904.202          | 0,26                         |
| 600.000  | Deutsche Lufthansa AG*                    | 3,00 %  | 29.05.2026            | 623.362          | 0,18                         |
| 200.000  | Deutsche Lufthansa AG*                    | 3,50 %  | 14.07.2029            | 198.239          | 0,06                         |
| 1.200.000  | Digital Dutch Finco BV*                   | 1,25 %  | 01.02.2031            | 979.108          | 0,28                         |
| 1.000.000  | Dufry One BV**                            | 2,50 %  | 15.10.2024            | 1.067.800        | 0,31                         |
| 752.000  | eG Global Finance Plc*                    | 6,25 %  | 30.10.2025            | 781.934          | 0,23                         |
| 1.000.000  | Electricite de France SA*                 | 5,00 %  | 29.12.2049            | 1.032.441        | 0,30                         |
| 200.000  | Electricite de France SA*                 | 7,50 %  | 29.12.2049            | 222.175          | 0,06                         |
| 699.000  | Emerald Debt Merger Sub LLC*              | 6,38 %  | 15.12.2030            | 762.224          | 0,22                         |
| 503.000  | Emeria SASU**                             | 3,38 %  | 31.03.2028            | 442.814          | 0,13                         |
| 779.000  | Emeria SASU**                             | 7,75 %  | 31.03.2028            | 789.563          | 0,23                         |
| 1.430.000  | Fastighets AB Balder*                     | 2,87 %  | 02.06.2081            | 989.519          | 0,29                         |
| 802.000  | Flamingo Lux II SCA*                      | 5,00 %  | 31.03.2029            | 612.456          | 0,18                         |
| 500.000  | Forvia*                                   | 3,75 %  | 15.06.2028            | 494.551          | 0,14                         |
| 447.000  | Forvia*                                   | 7,25 %  | 15.06.2026            | 508.029          | 0,15                         |
| 929.000  | Gruenthal GmbH**                          | 4,13 %  | 15.05.2028            | 943.213          | 0,27                         |
| 1.250.000  | Guala Closures SpA*                       | 3,25 %  | 15.06.2028            | 1.218.650        | 0,35                         |
| 1.300.000  | Heimstad Bostad Treasury BV*              | 0,75 %  | 06.09.2029            | 860.816          | 0,25                         |
| 615.000  | HSBC Holdings Plc*                        | 4,75 %  | 29.12.2049            | 568.191          | 0,16                         |
| 1.102.000  | IHO Verwaltungs GmbH*                     | 8,75 %  | 15.05.2028            | 1.241.934        | 0,36                         |
| 1.500.000  | Iliad Holding SASU**                      | 5,63 %  | 15.10.2028            | 1.519.539        | 0,44                         |
| 352.000  | Intrum AB*                                | 9,25 %  | 15.03.2028            | 325.361          | 0,09                         |
| 501.000  | IPD 3 BV*                                 | 8,00 %  | 15.06.2028            | 558.612          | 0,16                         |
| 1.102.000  | Jaguar Land Rover Automotive Plc*         | 4,50 %  | 15.07.2028            | 1.052.809        | 0,31                         |
| 600.000  | Kronos International Inc**                | 3,75 %  | 15.09.2025            | 598.550          | 0,17                         |
| 520.000  | LHMC Finco 2 Sarl*                        | 7,25 %  | 02.10.2025            | 560.226          | 0,16                         |
| 900.000  | Liberty Mutual Group Inc*                 | 4,63 %  | 02.12.2030            | 953.668          | 0,28                         |
| 1.500.000  | Lorca Telecom Bondco SA*                  | 4,00 %  | 18.09.2027            | 1.496.675        | 0,43                         |
| 752.000  | Lottomatica SpA**                         | 7,13 %  | 01.06.2028            | 840.071          | 0,24                         |
| 1.160.000  | Loxam SAS*                                | 5,75 %  | 15.07.2027            | 1.161.547        | 0,34                         |

## Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                 | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 81,02 % (31. Dezember 2022: 80,14 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                   |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |   |        |                       |                   |                              |
| 500.000  | Lune Holdings Sarl**                                  | 5,63 % | 15.11.2028            | 447.113           | 0,13                         |
| 986.000  | Motion Bondco DAC*                                    | 4,50 % | 15.11.2027            | 942.413           | 0,27                         |
| 480.000  | Motion Finco Sarl*                                    | 7,38 % | 15.06.2030            | 521.991           | 0,15                         |
| 700.000  | Olympus Water US Holding Corp*                        | 3,88 % | 01.10.2028            | 604.331           | 0,18                         |
| 715.000  | Petroleos Mexicanos*                                  | 4,88 % | 21.02.2028            | 647.766           | 0,19                         |
| 400.000  | PEU Finance Plc*                                      | 7,25 % | 01.07.2028            | 437.377           | 0,13                         |
| 502.000  | Pinnacle Bidco Plc*                                   | 5,50 % | 15.02.2025            | 527.817           | 0,15                         |
| 602.000  | Playtech Plc*   | 5,88 % | 28.06.2028            | 655.140           | 0,19                         |
| 750.000  | Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB*                  | 2,62 % | 29.12.2049            | 165.696           | 0,05                         |
| 1.000.000  | Schaeffler AG*  | 3,38 % | 12.10.2028            | 997.072           | 0,29                         |
| 450.000  | Summer BC Holdco B Sarl**                             | 5,75 % | 31.10.2026            | 438.141           | 0,13                         |
| 750.000  | TeamSystem SpA*                                       | 3,50 % | 15.02.2028            | 716.292           | 0,21                         |
| 439.599  | Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH**              | 6,00 % | 30.07.2026            | 471.442           | 0,14                         |
| 1.750.000  | Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH**              | 2,00 % | 15.07.2025            | 1.818.530         | 0,53                         |
| 1.100.000  | Telecom Italia SpA**                                  | 3,00 % | 30.09.2025            | 1.134.726         | 0,33                         |
| 1.000.000  | Telefonica Europe BV*                                 | 4,38 % | 29.12.2049            | 1.066.725         | 0,31                         |
| 500.000  | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV*        | 3,75 % | 09.05.2027            | 494.424           | 0,14                         |
| 307.000  | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV*        | 7,38 % | 15.09.2029            | 342.001           | 0,10                         |
| 307.000  | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV*        | 7,88 % | 15.09.2031            | 346.854           | 0,10                         |
| 450.000  | Titan Holdings II BV*                                 | 5,13 % | 15.07.2029            | 391.042           | 0,11                         |
| 630.000  | TK Elevator Holdco GmbH**                             | 6,63 % | 15.07.2028            | 590.378           | 0,17                         |
| 200.000  | TMNL Holding BV**                                     | 3,75 % | 15.01.2029            | 191.048           | 0,06                         |
| 300.000  | United Group BV*                                      | 4,00 % | 15.11.2027            | 269.381           | 0,08                         |
| 800.000  | Verisure Holding AB*                                  | 3,25 % | 15.02.2027            | 777.676           | 0,23                         |
| 1.201.000  | Verisure Midholding AB*                               | 5,25 % | 15.02.2029            | 1.139.678         | 0,33                         |
| 400.000  | Wp/ap Telecom Holdings III BV**                       | 5,50 % | 15.01.2030            | 364.529           | 0,11                         |
| 900.000  | ZF Europe Finance BV*                                 | 3,00 % | 23.10.2029            | 830.852           | 0,24                         |
| 1.000.000  | ZF Finance GmbH*                                      | 3,75 % | 21.09.2028            | 983.787           | 0,29                         |
| <b>Euro insgesamt</b>  |   |        |                       | <b>58.174.535</b> | <b>16,89</b>                 |
| <b>Britisches Pfund</b>  |   |        |                       |                   |                              |
| 750.000  | Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc* | 4,75 % | 15.07.2027            | 759.024           | 0,22                         |
| 900.000  | Barclays Plc*   | 6,37 % | 31.01.2031            | 1.096.859         | 0,32                         |
| 500.000  | Bellis Acquisition Co Plc**                           | 3,25 % | 16.02.2026            | 533.832           | 0,16                         |
| 700.000  | Castle UK Finco Plc**                                 | 7,00 % | 15.05.2029            | 715.073           | 0,21                         |
| 501.000  | Constellation Automotive Financing Plc*               | 4,88 % | 15.07.2027            | 491.552           | 0,14                         |
| 998.000  | CPUK Finance Ltd**                                    | 6,50 % | 28.08.2026            | 1.210.767         | 0,35                         |
| 750.000  | Encore Capital Group Inc*                             | 4,25 % | 01.06.2028            | 731.098           | 0,21                         |
| 600.000  | Lloyds Banking Group Plc*                             | 5,13 % | 29.12.2049            | 689.974           | 0,20                         |
| 700.000  | Nationwide Building Society*                          | 5,75 % | 29.12.2049            | 758.571           | 0,22                         |

## Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|---------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 81,02 % (31. Dezember 2022: 80,14 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                   |                              |
| <b>Britisches Pfund (Fortsetzung)</b>  |   |         |                       |                   |                              |
| 800.000  | NatWest Group Plc*  | 5,13 %  | 29.12.2049            | 840.853           | 0,24                         |
| 490.000  | Santander UK Group Holdings Plc*                                  | 6,75 %  | 29.12.2049            | 584.336           | 0,17                         |
| 750.000  | Travis Perkins Plc*   | 3,75 %  | 17.02.2026            | 858.089           | 0,25                         |
| 402.000  | TVL Finance Plc*  | 10,25 % | 28.04.2028            | 500.474           | 0,15                         |
| 1.100.000  | Virgin Media Secured Finance Plc*                                 | 5,00 %  | 15.04.2027            | 1.271.937         | 0,37                         |
| <b>Britisches Pfund insgesamt</b>  |   |         |                       | <b>11.042.439</b> | <b>3,21</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>   |   |         |                       |                   |                              |
| 675.000  | 1011778 BC ULC/New Red Finance Inc**                              | 4,00 %  | 15.10.2030            | 578.497           | 0,17                         |
| 1.325.000  | AbbVie Inc*   | 4,25 %  | 21.11.2049            | 1.144.498         | 0,33                         |
| 251.000  | Abu Dhabi National Energy Co PJSC*                                | 4,70 %  | 24.04.2033            | 249.894           | 0,07                         |
| 400.000  | Adani Green Energy Ltd*   | 4,38 %  | 08.09.2024            | 369.967           | 0,11                         |
| 500.000  | Adani Ports & Special Economic Zone Ltd**                         | 4,38 %  | 03.07.2029            | 405.334           | 0,12                         |
| 2.585.000  | AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust*          | 3,30 %  | 30.01.2032            | 2.116.031         | 0,61                         |
| 297.000  | Agrosuper SA**  | 4,60 %  | 20.01.2032            | 252.095           | 0,07                         |
| 1.170.000  | Ahead DB Holdings LLC**   | 6,63 %  | 01.05.2028            | 952.813           | 0,28                         |
| 1.371.630  | Air Canada 2020-2 Class A Pass Through Trust**                    | 5,25 %  | 01.04.2029            | 1.331.468         | 0,39                         |
| 1.200.000  | Air Lease Corp*   | 4,63 %  | 01.10.2028            | 1.128.788         | 0,33                         |
| 1.326.648  | Alaska Airlines 2020-1 Class A Pass Through Trust**               | 4,80 %  | 15.08.2027            | 1.276.174         | 0,37                         |
| 1.905.000  | Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC** | 6,50 %  | 15.02.2028            | 1.910.324         | 0,55                         |
| 282.600  | Alfa Desarrollo SpA**   | 4,55 %  | 27.09.2051            | 207.628           | 0,06                         |
| 1.000.000  | Alfa SAB de CV**  | 6,88 %  | 25.03.2044            | 1.005.052         | 0,29                         |
| 333.000  | Alibaba Group Holding Ltd*  | 4,20 %  | 06.12.2047            | 262.007           | 0,08                         |
| 467.000  | Alibaba Group Holding Ltd*  | 4,40 %  | 06.12.2057            | 366.494           | 0,11                         |
| 1.810.000  | Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer**    | 6,75 %  | 15.04.2028            | 1.797.065         | 0,52                         |
| 750.000  | Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp**       | 6,00 %  | 01.06.2029            | 554.400           | 0,16                         |
| 229.000  | Ally Financial Inc**  | 4,70 %  | 29.12.2049            | 148.278           | 0,04                         |
| 145.000  | Ally Financial Inc**  | 4,70 %  | 29.12.2049            | 102.678           | 0,03                         |
| 700.000  | Alsea SAB de CV**   | 7,75 %  | 14.12.2026            | 695.260           | 0,20                         |
| 915.000  | Altice France Holding SA**  | 6,00 %  | 15.02.2028            | 447.184           | 0,13                         |
| 565.000  | American Airlines Inc**   | 7,25 %  | 15.02.2028            | 562.219           | 0,16                         |
| 2.725.000  | American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd**                 | 5,50 %  | 20.04.2026            | 2.702.082         | 0,78                         |
| 790.000  | American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd**                 | 5,75 %  | 20.04.2029            | 767.784           | 0,22                         |
| 1.325.000  | Amgen Inc**   | 4,66 %  | 15.06.2051            | 1.187.784         | 0,34                         |
| 1.155.000  | AmWINS Group Inc**  | 4,88 %  | 30.06.2029            | 1.044.210         | 0,30                         |
| 3.180.000  | APX Group Inc**   | 5,75 %  | 15.07.2029            | 2.764.367         | 0,80                         |
| 200.000  | Arabian Centres Sukuk II Ltd*                                     | 5,63 %  | 07.10.2026            | 183.473           | 0,05                         |
| 1.100.000  | Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc**            | 4,13 %  | 15.08.2026            | 1.025.917         | 0,30                         |
| 700.000  | Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc*             | 5,25 %  | 15.08.2027            | 593.870           | 0,17                         |
| 765.000  | Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc**            | 5,25 %  | 15.08.2027            | 649.016           | 0,19                         |

## Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 81,02 % (31. Dezember 2022: 80,14 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 1.630.000  | Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**                          | 5,88 %  | 30.06.2029            | 1.455.885        | 0,42                         |
| 135.000  | Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**                          | 7,00 %  | 01.11.2026            | 130.793          | 0,04                         |
| 1.450.000  | Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**                          | 8,25 %  | 31.12.2028            | 1.427.241        | 0,41                         |
| 2.380.000  | AssuredPartners Inc**   | 5,63 %  | 15.01.2029            | 2.062.326        | 0,60                         |
| 2.007.000  | AT&T Inc**  | 3,65 %  | 15.09.2059            | 1.398.739        | 0,41                         |
| 1.100.000  | Avient Corp**   | 7,13 %  | 01.08.2030            | 1.113.556        | 0,32                         |
| 725.000  | Banco Davivienda SA**   | 6,65 %  | 29.12.2049            | 534.230          | 0,15                         |
| 300.000  | Banco de Bogota SA*   | 6,25 %  | 12.05.2026            | 289.983          | 0,08                         |
| 500.000  | Banco de Credito e Inversiones SA**   | 2,88 %  | 14.10.2031            | 414.643          | 0,12                         |
| 520.000  | Banco do Brasil SA**  | 6,25 %  | 18.04.2030            | 517.270          | 0,15                         |
| 600.000  | Banco Mercantil del Norte SA**  | 6,63 %  | 29.12.2049            | 464.400          | 0,14                         |
| 600.000  | Bangkok Bank PCL**  | 5,00 %  | 29.12.2049            | 569.171          | 0,17                         |
| 750.000  | Barclays Plc*   | 4,38 %  | 29.12.2049            | 511.425          | 0,15                         |
| 400.000  | Bidvest Group UK Plc*   | 3,63 %  | 23.09.2026            | 357.550          | 0,10                         |
| 410.000  | BOC Aviation USA Corp**   | 4,88 %  | 03.05.2033            | 399.321          | 0,12                         |
| 2.550.000  | Boeing Co*  | 5,81 %  | 01.05.2050            | 2.542.856        | 0,74                         |
| 1.600.000  | BPCE SA**   | 3,12 %  | 19.10.2032            | 1.236.595        | 0,36                         |
| 2.400.000  | Broadcom Inc**  | 3,19 %  | 15.11.2036            | 1.815.155        | 0,53                         |
| 340.000  | BroadStreet Partners Inc**  | 5,88 %  | 15.04.2029            | 295.312          | 0,09                         |
| 2.250.000  | Buckeye Partners LP**   | 5,85 %  | 15.11.2043            | 1.671.863        | 0,49                         |
| 1.605.000  | Camelot Return Merger Sub Inc**   | 8,75 %  | 01.08.2028            | 1.518.843        | 0,44                         |
| 742.000  | Canacol Energy Ltd**  | 5,75 %  | 24.11.2028            | 635.344          | 0,18                         |
| 261.000  | Capital One Financial Corp**  | 3,95 %  | 29.12.2049            | 194.445          | 0,06                         |
| 65.000   | Carnival Corp**   | 5,75 %  | 01.03.2027            | 59.898           | 0,02                         |
| 345.000  | Carnival Corp**   | 9,88 %  | 01.08.2027            | 359.674          | 0,10                         |
| 535.000  | Carnival Holdings Bermuda Ltd**   | 10,38 % | 01.05.2028            | 585.650          | 0,17                         |
| 626.000  | CAS Capital No 1 Ltd*   | 4,00 %  | 29.12.2049            | 519.855          | 0,15                         |
| 2.000.000  | CDW LLC/CDW Finance Corp**  | 3,28 %  | 01.12.2028            | 1.738.608        | 0,50                         |
| 500.000  | Cemex SAB de CV**   | 5,45 %  | 19.11.2029            | 482.512          | 0,14                         |
| 445.000  | Cemex SAB de CV**   | 9,13 %  | 29.12.2049            | 451.229          | 0,13                         |
| 1.595.000  | Centene Corp*   | 2,50 %  | 01.03.2031            | 1.273.552        | 0,37                         |
| 333.000  | Central American Bottling Corp/CBC Bottling Holdco SL/Beliv Holdco SL**         | 5,25 %  | 27.04.2029            | 307.993          | 0,09                         |
| 1.745.000  | Chart Industries Inc**  | 7,50 %  | 01.01.2030            | 1.782.526        | 0,52                         |
| 870.000  | Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital** | 4,80 %  | 01.03.2050            | 657.129          | 0,19                         |
| 1.550.000  | Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital** | 5,75 %  | 01.04.2048            | 1.328.121        | 0,39                         |
| 1.685.000  | Cheniere Energy Partners LP**   | 3,25 %  | 31.01.2032            | 1.388.524        | 0,40                         |
| 625.000  | Churchill Downs Inc**   | 4,75 %  | 15.01.2028            | 580.363          | 0,17                         |
| 627.000  | CIFI Holdings Group Co Ltd*   | 5,95 %  | 20.10.2025            | 72.695           | 0,02                         |
| 515.000  | CommScope Inc**   | 7,13 %  | 01.07.2028            | 366.325          | 0,11                         |
| 1.540.000  | CommScope Technologies LLC**  | 5,00 %  | 15.03.2027            | 1.074.129        | 0,31                         |

## Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 81,02 % (31. Dezember 2022: 80,14 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |         |                       |                  |                              |
| 3.471.000  | Comstock Resources Inc**                             | 6,75 %  | 01.03.2029            | 3.179.320        | 0,92                         |
| 1.235.000  | Coty Inc**   | 5,00 %  | 15.04.2026            | 1.184.772        | 0,34                         |
| 400.000  | Country Garden Holdings Co Ltd*                      | 4,80 %  | 06.08.2030            | 115.846          | 0,03                         |
| 1.540.000  | CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC**             | 5,50 %  | 15.06.2031            | 1.376.025        | 0,40                         |
| 1.670.000  | CSC Holdings LLC**                                   | 4,13 %  | 01.12.2030            | 1.169.820        | 0,34                         |
| 2.165.000  | CSC Holdings LLC**                                   | 4,63 %  | 01.12.2030            | 965.540          | 0,28                         |
| 1.100.000  | CSN Resources SA**                                   | 4,63 %  | 10.06.2031            | 840.795          | 0,25                         |
| 1.630.000  | CVS Health Corp*                                     | 5,05 %  | 25.03.2048            | 1.503.603        | 0,44                         |
| 1.150.000  | Dell International LLC/EMC Corp*                     | 6,20 %  | 15.07.2030            | 1.195.653        | 0,35                         |
| 2.125.000  | Discovery Communications LLC**                       | 4,00 %  | 15.09.2055            | 1.414.535        | 0,41                         |
| 1.325.000  | Dominion Energy Inc*                                 | 4,85 %  | 15.08.2052            | 1.178.437        | 0,34                         |
| 350.000  | Eastern & Southern African Trade & Development Bank* | 4,13 %  | 30.06.2028            | 276.255          | 0,08                         |
| 735.000  | Ecopetrol SA*  | 4,63 %  | 02.11.2031            | 568.056          | 0,16                         |
| 200.000  | Ecopetrol SA*  | 8,88 %  | 13.01.2033            | 198.219          | 0,06                         |
| 550.000  | Edison International**                               | 5,00 %  | 29.12.2049            | 476.520          | 0,14                         |
| 400.000  | EIG Pearl Holdings Sarl*                             | 4,39 %  | 30.11.2046            | 314.792          | 0,09                         |
| 240.000  | Emerald Debt Merger Sub LLC**                        | 6,63 %  | 15.12.2030            | 238.200          | 0,07                         |
| 400.000  | Emirates NBD Bank PJSC*                              | 4,25 %  | 29.12.2049            | 357.176          | 0,10                         |
| 438.000  | Empresa Nacional del Petroleo**                      | 3,45 %  | 16.09.2031            | 367.094          | 0,11                         |
| 300.000  | Endeavour Mining Plc**                               | 5,00 %  | 14.10.2026            | 266.850          | 0,08                         |
| 341.773  | Energean Israel Finance Ltd*                         | 4,88 %  | 30.03.2026            | 318.077          | 0,09                         |
| 392.157  | Energean Israel Finance Ltd**                        | 8,50 %  | 30.09.2033            | 391.912          | 0,11                         |
| 1.890.000  | Energizer Holdings Inc**                             | 4,75 %  | 15.06.2028            | 1.687.770        | 0,49                         |
| 1.150.000  | Enterprise Products Operating LLC*                   | 4,85 %  | 15.03.2044            | 1.062.835        | 0,31                         |
| 2.400.000  | EPR Properties**                                     | 3,60 %  | 15.11.2031            | 1.874.723        | 0,54                         |
| 770.000  | EQM Midstream Partners LP*                           | 5,50 %  | 15.07.2028            | 729.280          | 0,21                         |
| 475.000  | EQM Midstream Partners LP**                          | 7,50 %  | 01.06.2030            | 481.116          | 0,14                         |
| 555.000  | EquipmentShare.com Inc**                             | 9,00 %  | 15.05.2028            | 539.445          | 0,16                         |
| 1.175.000  | Essential Utilities Inc*                             | 5,30 %  | 01.05.2052            | 1.109.453        | 0,32                         |
| 605.000  | First Quantum Minerals Ltd**                         | 6,88 %  | 01.03.2026            | 596.402          | 0,17                         |
| 300.000  | First Quantum Minerals Ltd**                         | 8,63 %  | 01.06.2031            | 307.839          | 0,09                         |
| 800.000  | First Quantum Minerals Ltd**                         | 8,63 %  | 01.06.2031            | 820.904          | 0,24                         |
| 875.000  | FMG Resources August 2006 Pty Ltd**                  | 5,88 %  | 15.04.2030            | 834.211          | 0,24                         |
| 2.070.000  | Ford Motor Credit Co LLC*                            | 4,13 %  | 17.08.2027            | 1.892.073        | 0,55                         |
| 245.000  | Ford Motor Credit Co LLC*                            | 6,80 %  | 12.05.2028            | 245.490          | 0,07                         |
| 1.250.000  | Ford Motor Credit Co LLC*                            | 6,95 %  | 06.03.2026            | 1.257.868        | 0,37                         |
| 190.000  | Ford Motor Credit Co LLC*                            | 6,95 %  | 10.06.2026            | 191.125          | 0,06                         |
| 185.000  | Ford Motor Credit Co LLC*                            | 7,20 %  | 10.06.2030            | 186.893          | 0,05                         |
| 800.000  | Franshion Brilliant Ltd*                             | 4,25 %  | 23.07.2029            | 630.759          | 0,18                         |
| 1.000.000  | FS Luxembourg Sarl**                                 | 10,00 % | 15.12.2025            | 1.025.232        | 0,30                         |

## Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 81,02 % (31. Dezember 2022: 80,14 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 403.000  | Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd*   | 2,63 % | 31.03.2036            | 325.992          | 0,09                         |
| 1.600.000  | General Motors Co*  | 5,00 % | 01.04.2035            | 1.451.531        | 0,42                         |
| 325.000  | Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp*                                | 8,00 % | 15.01.2027            | 317.236          | 0,09                         |
| 455.000  | Global Infrastructure Solutions Inc**   | 7,50 % | 15.04.2032            | 387.388          | 0,11                         |
| 80.000   | Goldman Sachs Group Inc**   | 3,65 % | 29.12.2049            | 62.040           | 0,02                         |
| 90.000   | Goldman Sachs Group Inc**   | 3,80 % | 29.12.2049            | 72.135           | 0,02                         |
| 1.205.750  | Greenko Power II Ltd*   | 4,30 % | 13.12.2028            | 1.051.008        | 0,31                         |
| 200.000  | Greensaif Pipelines Bidco Sarl*   | 6,51 % | 23.02.2042            | 207.889          | 0,06                         |
| 350.167  | Guara Norte Sarl**  | 5,20 % | 15.06.2034            | 307.018          | 0,09                         |
| 1.600.000  | HCA Inc*  | 5,25 % | 15.06.2049            | 1.445.234        | 0,42                         |
| 614.000  | HDFC Bank Ltd**   | 3,70 % | 29.12.2049            | 533.361          | 0,15                         |
| 320.000  | Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co**                                      | 6,00 % | 01.02.2031            | 286.441          | 0,08                         |
| 445.000  | Huarong Finance 2017 Co Ltd*  | 4,25 % | 07.11.2027            | 371.006          | 0,11                         |
| 600.000  | Huarong Finance 2019 Co Ltd*  | 3,38 % | 24.02.2030            | 455.040          | 0,13                         |
| 500.000  | Huarong Finance 2019 Co Ltd*  | 4,50 % | 29.05.2029            | 401.255          | 0,12                         |
| 1.200.000  | HUB International Ltd**   | 7,25 % | 15.06.2030            | 1.240.212        | 0,36                         |
| 285.000  | Hudbay Minerals Inc**   | 4,50 % | 01.04.2026            | 265.661          | 0,08                         |
| 2.074.000  | Hudbay Minerals Inc**   | 6,13 % | 01.04.2029            | 1.911.979        | 0,56                         |
| 291.200  | Hunt Oil Co of Peru LLC Sucursal Del Peru**                                   | 6,38 % | 01.06.2028            | 280.280          | 0,08                         |
| 252.000  | Huntington Bancshares Inc**   | 4,45 % | 29.12.2049            | 205.291          | 0,06                         |
| 68.000   | Huntington Bancshares Inc**   | 5,63 % | 29.12.2049            | 61.106           | 0,02                         |
| 200.000  | Hyundai Capital America**   | 5,68 % | 26.06.2028            | 198.506          | 0,06                         |
| 500.000  | IHS Holding Ltd**   | 5,63 % | 29.11.2026            | 437.600          | 0,13                         |
| 600.000  | Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT*  | 3,54 % | 27.04.2032            | 505.500          | 0,15                         |
| 250.000  | ING Groep NV**  | 3,88 % | 29.12.2049            | 179.197          | 0,05                         |
| 1.005.000  | Intelligent Packaging Ltd Finco Inc/Intelligent Packaging Ltd Co-Issuer LLC** | 6,00 % | 15.09.2028            | 855.350          | 0,25                         |
| 350.000  | Investment Energy Resources Ltd*  | 6,25 % | 26.04.2029            | 319.172          | 0,09                         |
| 3.255.000  | Iron Mountain Inc**   | 5,63 % | 15.07.2032            | 2.916.658        | 0,85                         |
| 690.000  | ITT Holdings LLC**  | 6,50 % | 01.08.2029            | 582.181          | 0,17                         |
| 1.100.000  | JELD-WEN Inc**  | 4,63 % | 15.12.2025            | 1.066.896        | 0,31                         |
| 1.230.000  | JELD-WEN Inc**  | 4,88 % | 15.12.2027            | 1.090.912        | 0,32                         |
| 500.000  | JSW Steel Ltd*  | 5,05 % | 05.04.2032            | 404.478          | 0,12                         |
| 800.000  | KazMunayGas National Co JSC*  | 6,38 % | 24.10.2048            | 687.459          | 0,20                         |
| 815.000  | KB Home*  | 6,88 % | 15.06.2027            | 827.909          | 0,24                         |
| 1.710.000  | KB Home**   | 7,25 % | 15.07.2030            | 1.733.685        | 0,50                         |
| 1.000.000  | Kinder Morgan Energy Partners LP*   | 5,50 % | 01.03.2044            | 912.772          | 0,27                         |
| 500.000  | Klabn Austria GmbH**  | 3,20 % | 12.01.2031            | 400.125          | 0,12                         |
| 500.000  | Kosmos Energy Ltd*  | 7,13 % | 04.04.2026            | 440.170          | 0,13                         |
| 2.470.000  | L Brands Inc**  | 6,63 % | 01.10.2030            | 2.387.299        | 0,69                         |
| 450.000  | Lenovo Group Ltd*   | 3,42 % | 02.11.2030            | 379.512          | 0,11                         |



## Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                     | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 81,02 % (31. Dezember 2022: 80,14 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 650.000  | Level 3 Financing Inc**                                   | 3,88 %  | 15.11.2029            | 517.947          | 0,15                         |
| 1.085.000  | Level 3 Financing Inc**                                   | 4,63 %  | 15.09.2027            | 756.231          | 0,22                         |
| 200.000  | Leviathan Bond Ltd*                                       | 6,50 %  | 30.06.2027            | 192.820          | 0,06                         |
| 250.000  | Leviathan Bond Ltd*                                       | 6,75 %  | 30.06.2030            | 233.705          | 0,07                         |
| 550.000  | Longfor Group Holdings Ltd*                               | 3,95 %  | 16.09.2029            | 409.866          | 0,12                         |
| 1.935.000  | Macy's Retail Holdings LLC**                              | 5,88 %  | 15.03.2030            | 1.726.388        | 0,50                         |
| 155.000  | Madison IAQ LLC**   | 5,88 %  | 30.06.2029            | 125.730          | 0,04                         |
| 500.000  | MARB BondCo Plc*  | 3,95 %  | 29.01.2031            | 358.340          | 0,10                         |
| 1.590.000  | Mauser Packaging Solutions Holding Co**                   | 7,88 %  | 15.08.2026            | 1.581.396        | 0,46                         |
| 676.376  | MC Brazil Downstream Trading Sarl**                       | 7,25 %  | 30.06.2031            | 457.496          | 0,13                         |
| 910.000  | McAfee Corp**   | 7,38 %  | 15.02.2030            | 792.207          | 0,23                         |
| 720.000  | McGraw-Hill Education Inc**                               | 8,00 %  | 01.08.2029            | 615.175          | 0,18                         |
| 700.000  | Medco Oak Tree Pte Ltd*                                   | 7,38 %  | 14.05.2026            | 689.253          | 0,20                         |
| 300.000  | Melco Resorts Finance Ltd**                               | 5,63 %  | 17.07.2027            | 272.078          | 0,08                         |
| 1.695.000  | Midwest Gaming Borrower LLC/Midwest Gaming Finance Corp** | 4,88 %  | 01.05.2029            | 1.498.292        | 0,44                         |
| 600.000  | Minsur SA**   | 4,50 %  | 28.10.2031            | 527.787          | 0,15                         |
| 200.000  | Mizrahi Tefahot Bank Ltd**                                | 3,08 %  | 07.04.2031            | 175.120          | 0,05                         |
| 1.350.000  | Molson Coors Beverage Co*                                 | 4,20 %  | 15.07.2046            | 1.119.117        | 0,32                         |
| 1.150.000  | MPLX LP*  | 5,50 %  | 15.02.2049            | 1.043.390        | 0,30                         |
| 1.985.000  | MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp*            | 3,50 %  | 15.03.2031            | 1.369.705        | 0,40                         |
| 330.000  | MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp*            | 5,00 %  | 15.10.2027            | 277.955          | 0,08                         |
| 1.600.000  | NatWest Group Plc*  | 3,03 %  | 28.11.2035            | 1.228.778        | 0,36                         |
| 210.000  | NCL Corp Ltd**  | 5,88 %  | 15.03.2026            | 196.657          | 0,06                         |
| 290.000  | NCL Corp Ltd**  | 5,88 %  | 15.02.2027            | 282.570          | 0,08                         |
| 3.145.000  | New Fortress Energy Inc**                                 | 6,50 %  | 30.09.2026            | 2.817.185        | 0,82                         |
| 820.000  | Newfold Digital Holdings Group Inc**                      | 6,00 %  | 15.02.2029            | 616.304          | 0,18                         |
| 800.000  | Nexa Resources SA**                                       | 5,38 %  | 04.05.2027            | 747.241          | 0,22                         |
| 670.000  | Northwest Fiber LLC/Northwest Fiber Finance Sub Inc**     | 10,75 % | 01.06.2028            | 615.610          | 0,18                         |
| 890.000  | NOVA Chemicals Corp**                                     | 4,88 %  | 01.06.2024            | 870.313          | 0,25                         |
| 845.000  | NRG Energy Inc**  | 3,88 %  | 15.02.2032            | 652.053          | 0,19                         |
| 595.000  | NRG Energy Inc**  | 10,25 % | 29.12.2049            | 561.671          | 0,16                         |
| 2.660.000  | Occidental Petroleum Corp*                                | 4,30 %  | 15.08.2039            | 2.073.483        | 0,60                         |
| 1.030.000  | Olympus Water US Holding Corp**                           | 6,25 %  | 01.10.2029            | 745.927          | 0,22                         |
| 225.000  | Olympus Water US Holding Corp**                           | 9,75 %  | 15.11.2028            | 219.724          | 0,06                         |
| 1.620.000  | OneMain Finance Corp*                                     | 3,88 %  | 15.09.2028            | 1.325.808        | 0,39                         |
| 475.000  | OneMain Finance Corp*                                     | 9,00 %  | 15.01.2029            | 479.441          | 0,14                         |
| 1.000.000  | Oracle Corp*  | 3,60 %  | 01.04.2050            | 715.141          | 0,21                         |
| 1.030.000  | Oracle Corp*  | 4,00 %  | 15.11.2047            | 793.622          | 0,23                         |
| 272.000  | Oryx Funding Ltd*   | 5,80 %  | 03.02.2031            | 262.493          | 0,08                         |
| 300.000  | Oztel Holdings SPC Ltd*                                   | 6,63 %  | 24.04.2028            | 311.839          | 0,09                         |

## Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung  | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 81,02 % (31. Dezember 2022: 80,14 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |        |                       |                  |                              |
| 500.000  | Periana Holdings LLC*  | 5,95 % | 19.04.2026            | 482.702          | 0,14                         |
| 635.000  | Petrobras Global Finance BV*                                     | 5,50 % | 10.06.2051            | 500.377          | 0,15                         |
| 429.000  | Petrobras Global Finance BV**                                    | 6,50 % | 03.07.2033            | 420.420          | 0,12                         |
| 1.800.000  | Petroleos Mexicanos*   | 5,95 % | 28.01.2031            | 1.316.341        | 0,38                         |
| 1.500.000  | Petroleos Mexicanos*   | 6,50 % | 23.01.2029            | 1.244.688        | 0,36                         |
| 1.530.000  | PetSmart Inc/PetSmart Finance Corp.**                            | 7,75 % | 15.02.2029            | 1.521.949        | 0,44                         |
| 480.000  | Pilgrim's Pride Corp**   | 6,25 % | 01.07.2033            | 465.524          | 0,14                         |
| 220.000  | PNC Financial Services Group Inc**                               | 3,40 % | 29.12.2049            | 162.800          | 0,05                         |
| 500.000  | Power Finance Corp Ltd*  | 4,50 % | 18.06.2029            | 465.990          | 0,14                         |
| 1.695.000  | Presidio Holdings Inc**  | 8,25 % | 01.02.2028            | 1.616.108        | 0,47                         |
| 1.100.000  | Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc**         | 5,75 % | 15.04.2026            | 1.080.780        | 0,31                         |
| 2.200.000  | Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc**         | 6,25 % | 15.01.2028            | 2.064.142        | 0,60                         |
| 500.000  | Prosus NV*   | 3,83 % | 08.02.2051            | 307.491          | 0,09                         |
| 1.240.000  | Rackspace Technology Global Inc**                                | 3,50 % | 15.02.2028            | 559.324          | 0,16                         |
| 1.420.000  | Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp**                       | 5,25 % | 15.04.2030            | 1.010.748        | 0,29                         |
| 610.000  | Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp**                       | 5,75 % | 15.01.2029            | 457.102          | 0,13                         |
| 409.000  | Rede D'or Finance Sarl**   | 4,50 % | 22.01.2030            | 348.979          | 0,10                         |
| 649.000  | Reliance Industries Ltd*   | 3,63 % | 12.01.2052            | 463.832          | 0,13                         |
| 450.000  | ReNew Wind Energy AP2/ReNew Power Pvt Ltd other 9 Subsidiaries** | 4,50 % | 14.07.2028            | 383.934          | 0,11                         |
| 785.000  | Ritchie Bros Holdings Inc**                                      | 7,75 % | 15.03.2031            | 815.360          | 0,24                         |
| 190.000  | Rockcliff Energy II LLC**  | 5,50 % | 15.10.2029            | 175.459          | 0,05                         |
| 700.000  | Rogers Communications Inc**                                      | 3,80 % | 15.03.2032            | 612.162          | 0,18                         |
| 995.000  | Royal Caribbean Cruises Ltd**                                    | 7,25 % | 15.01.2030            | 1.008.675        | 0,29                         |
| 1.000.000  | Sasol Financing USA LLC*   | 6,50 % | 27.09.2028            | 895.114          | 0,26                         |
| 327.000  | Sasol Financing USA LLC*   | 8,75 % | 03.05.2029            | 318.893          | 0,09                         |
| 700.000  | SEPLAT Energy Plc*   | 7,75 % | 01.04.2026            | 590.114          | 0,17                         |
| 2.000  | Service Properties Trust**                                       | 3,95 % | 15.01.2028            | 1.569            | 0,00                         |
| 500.000  | Shelf Drilling Holdings Ltd**                                    | 8,25 % | 15.02.2025            | 467.313          | 0,14                         |
| 1.600.000  | SierraCol Energy Andina LLC**                                    | 6,00 % | 15.06.2028            | 1.178.040        | 0,34                         |
| 402.000  | Sitios Latinoamerica SAB de CV**                                 | 5,38 % | 04.04.2032            | 364.448          | 0,11                         |
| 266.000  | SK Hynix Inc*  | 6,38 % | 17.01.2028            | 267.144          | 0,08                         |
| 225.000  | SK Hynix Inc*  | 6,50 % | 17.01.2033            | 227.311          | 0,07                         |
| 880.000  | SPX FLOW Inc**   | 8,75 % | 01.04.2030            | 793.010          | 0,23                         |
| 1.000.000  | SRS Distribution Inc**   | 6,00 % | 01.12.2029            | 864.495          | 0,25                         |
| 483.000  | Standard Chartered Plc*  | 6,30 % | 06.07.2034            | 483.809          | 0,14                         |
| 1.610.000  | Standard Industries Inc**  | 3,38 % | 15.01.2031            | 1.297.891        | 0,38                         |
| 600.000  | Stillwater Mining Co*  | 4,00 % | 16.11.2026            | 535.878          | 0,16                         |
| 700.000  | Studio City Finance Ltd*   | 6,50 % | 15.01.2028            | 585.256          | 0,17                         |
| 2.920.000  | Summit Midstream Holdings LLC/Summit Midstream Finance Corp**    | 9,00 % | 15.10.2026            | 2.839.189        | 0,82                         |
| 1.215.000  | Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**     | 6,00 % | 31.12.2030            | 1.071.922        | 0,31                         |

## Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                     | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|---------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 81,02 % (31. Dezember 2022: 80,14 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                    |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                    |                              |
| 750.000  | Tencent Holdings Ltd*                                     | 3,24 %  | 03.06.2050            | 492.722            | 0,14                         |
| 200.000  | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV**          | 8,13 %  | 15.09.2031            | 209.866            | 0,06                         |
| 500.000  | Thaioil Treasury Center Co Ltd*                           | 3,75 %  | 18.06.2050            | 334.706            | 0,10                         |
| 200.000  | Thaioil Treasury Center Co Ltd 144A*                      | 3,75 %  | 18.06.2050            | 133.882            | 0,04                         |
| 1.600.000  | T-Mobile USA Inc*   | 4,50 %  | 15.04.2050            | 1.373.870          | 0,40                         |
| 615.000  | TMS International Corp**                                  | 6,25 %  | 15.04.2029            | 517.233            | 0,15                         |
| 482.000  | Total Play Telecomunicaciones SA de CV*                   | 6,38 %  | 20.09.2028            | 280.495            | 0,08                         |
| 3.490.000  | TransDigm Inc**   | 6,75 %  | 15.08.2028            | 3.507.590          | 1,02                         |
| 200.000  | Transnet SOC Ltd*   | 8,25 %  | 06.02.2028            | 194.750            | 0,06                         |
| 222.000  | Transportadora de Gas del Sur SA*                         | 6,75 %  | 02.05.2025            | 210.471            | 0,06                         |
| 820.000  | Trivium Packaging Finance BV*                             | 8,50 %  | 15.08.2027            | 790.346            | 0,23                         |
| 90.000   | Truist Financial Corp**                                   | 4,95 %  | 29.12.2049            | 83.475             | 0,02                         |
| 45.000   | Truist Financial Corp**                                   | 5,10 %  | 29.12.2049            | 39.150             | 0,01                         |
| 300.000  | Turk Telekomunikasyon AS*                                 | 4,88 %  | 19.06.2024            | 286.530            | 0,08                         |
| 300.000  | Turkcell Iletisim Hizmetleri AS*                          | 5,80 %  | 11.04.2028            | 267.102            | 0,08                         |
| 200.000  | Turkiye Petrol Rafinerileri AS*                           | 4,50 %  | 18.10.2024            | 191.674            | 0,06                         |
| 1.437.367  | United Airlines 2020-1 Class A Pass Through Trust**       | 5,88 %  | 15.10.2027            | 1.426.801          | 0,41                         |
| 1.510.000  | United Rentals North America Inc*                         | 5,25 %  | 15.01.2030            | 1.442.769          | 0,42                         |
| 855.000  | Uniti Group LP/Uniti Group Finance Inc/CSL Capital LLC**  | 10,50 % | 15.02.2028            | 848.984            | 0,25                         |
| 595.000  | Valaris Ltd**   | 8,38 %  | 30.04.2030            | 597.576            | 0,17                         |
| 645.000  | Vale Overseas Ltd*  | 6,88 %  | 21.11.2036            | 675.062            | 0,20                         |
| 207.000  | Vanke Real Estate Hong Kong Co Ltd*                       | 3,98 %  | 09.11.2027            | 186.220            | 0,05                         |
| 1.000.000  | Vedanta Resources Finance II Plc*                         | 8,95 %  | 11.03.2025            | 756.030            | 0,22                         |
| 500.000  | Vedanta Resources Finance II Plc*                         | 13,88 % | 21.01.2024            | 456.658            | 0,13                         |
| 40.000   | VistaJet Malta Finance Plc/Vista Management Holding Inc** | 9,50 %  | 01.06.2028            | 36.763             | 0,01                         |
| 885.000  | VistaJet Malta Finance Plc/XO Management Holding Inc**    | 6,38 %  | 01.02.2030            | 713.427            | 0,21                         |
| 795.000  | VistaJet Malta Finance Plc/XO Management Holding Inc**    | 7,88 %  | 01.05.2027            | 715.003            | 0,21                         |
| 2.265.000  | Vistra Corp**   | 7,00 %  | 29.12.2049            | 1.978.761          | 0,57                         |
| 1.000.000  | VTR Finance NV**  | 6,38 %  | 15.07.2028            | 384.969            | 0,11                         |
| 800.000  | White Cap Buyer LLC**                                     | 6,88 %  | 15.10.2028            | 726.068            | 0,21                         |
| 365.000  | Windsor Holdings III LLC**                                | 8,50 %  | 15.06.2030            | 363.748            | 0,11                         |
| 815.000  | WR Grace Holdings LLC**                                   | 5,63 %  | 15.08.2029            | 668.504            | 0,19                         |
| 500.000  | XP Inc**  | 3,25 %  | 01.07.2026            | 443.486            | 0,13                         |
| 250.000  | YPF SA**  | 8,50 %  | 23.03.2025            | 239.649            | 0,07                         |
| 700.000  | YPF SA*   | 8,50 %  | 28.07.2025            | 643.928            | 0,19                         |
| 1.165.000  | ZF North America Capital Inc**                            | 6,88 %  | 14.04.2028            | 1.180.942          | 0,34                         |
| 1.165.000  | ZF North America Capital Inc**                            | 7,13 %  | 14.04.2030            | 1.186.132          | 0,34                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |   |         |                       | <b>209.811.262</b> | <b>60,92</b>                 |
| <b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>  |   |         |                       | <b>279.028.236</b> | <b>81,02</b>                 |

## Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag  | Wertpapierbezeichnung                      | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--|---------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 6,50 % (31. Dezember 2022: 2,49 %)</b>                        |  |         |                       |                   |                              |
| <b>Euro</b>   |  |         |                       |                   |                              |
| 1.350.000   | Ivory Coast Government International Bond* | 6,88 %  | 17.10.2040            | 1.122.251         | 0,32                         |
| 904.000   | Republic of Cameroon International Bond*   | 5,95 %  | 07.07.2032            | 712.186           | 0,21                         |
| <b>Euro insgesamt</b>   |  |         |                       | <b>1.834.437</b>  | <b>0,53</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>  |  |         |                       |                   |                              |
| 1.250.000   | Angolan Government International Bond*     | 8,25 %  | 09.05.2028            | 1.111.938         | 0,32                         |
| 1.002.000   | Angolan Government International Bond*     | 8,75 %  | 14.04.2032            | 844.761           | 0,25                         |
| 401.000   | Chile Government International Bond**      | 4,95 %  | 05.01.2036            | 396.330           | 0,11                         |
| 436.000   | Dominican Republic International Bond*     | 5,30 %  | 21.01.2041            | 342.684           | 0,10                         |
| 800.000   | Dominican Republic International Bond*     | 6,85 %  | 27.01.2045            | 728.156           | 0,21                         |
| 928.000   | Egypt Government International Bond*       | 7,50 %  | 16.02.2061            | 467.925           | 0,14                         |
| 600.000   | Egypt Government International Bond*       | 7,63 %  | 29.05.2032            | 350.152           | 0,10                         |
| 1.000.000   | Ghana Government International Bond*       | 10,75 % | 14.10.2030            | 675.463           | 0,20                         |
| 326.000   | Guatemala Government Bond*                 | 5,25 %  | 10.08.2029            | 311.022           | 0,09                         |
| 500.000   | Romanian Government International Bond*    | 7,13 %  | 17.01.2033            | 530.777           | 0,15                         |
| 312.000   | Romanian Government International Bond*    | 7,63 %  | 17.01.2053            | 343.736           | 0,10                         |
| 600.000   | Sri Lanka Government International Bond*   | 5,88 %  | 25.07.2024            | 279.084           | 0,08                         |
| 591.000   | Ukraine Government International Bond*     | 6,88 %  | 21.05.2031            | 136.551           | 0,04                         |
| 1.000.000   | Ukraine Government International Bond*     | 7,38 %  | 25.09.2034            | 233.655           | 0,07                         |
| 459.000   | Ukraine Government International Bond*     | 7,75 %  | 01.09.2028            | 111.190           | 0,03                         |
| 417.000   | Ukraine Government International Bond*     | 7,75 %  | 01.09.2029            | 101.005           | 0,03                         |
| 1.000.000   | Ukraine Government International Bond*     | 7,75 %  | 01.08.2041            | 394.780           | 0,11                         |
| 500.000   | Ukraine Government International Bond*     | 9,75 %  | 01.11.2030            | 125.031           | 0,04                         |
| 8.410.000   | United States Treasury Note/Bond*          | 3,38 %  | 15.05.2033            | 8.111.708         | 2,36                         |
| 5.080.000   | United States Treasury Note/Bond*          | 3,88 %  | 15.05.2043            | 4.957.762         | 1,44                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>  |  |         |                       | <b>20.553.710</b> | <b>5,97</b>                  |
| <b>Staatsanleihen insgesamt</b>   |  |         |                       | <b>22.388.147</b> | <b>6,50</b>                  |
| <b>Mittelfristige Schuldverschreibungen^ 3,93 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)</b> |  |         |                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar</b>  |  |         |                       |                   |                              |
| 997.462   | Alterra Mountain Co                        | 8,69 %  | 17.08.2028            | 997.153           | 0,29                         |
| 1.000.000   | AppLovin Corp                              | 0,00 %  | 15.08.2025            | 1.000.860         | 0,29                         |
| 1.000.000   | APX Group Inc                              | 0,00 %  | 10.07.2028            | 1.000.545         | 0,29                         |
| 1.000.000   | Aramark Intermediate HoldCo Corp           | 0,00 %  | 22.06.2030            | 1.001.250         | 0,29                         |
| 997.494   | Central Parent Inc                         | 9,49 %  | 06.07.2029            | 995.868           | 0,29                         |
| 997.455   | CQP Holdco LP                              | 0,00 %  | 05.06.2028            | 996.887           | 0,29                         |
| 836.785   | Dun & Bradstreet Corp                      | 0,00 %  | 06.02.2026            | 838.563           | 0,24                         |
| 997.462   | Great Outdoors Group LLC                   | 0,00 %  | 06.03.2028            | 991.228           | 0,29                         |
| 743.003   | Ingram Micro Inc                           | 0,00 %  | 30.06.2028            | 741.613           | 0,21                         |
| 997.475   | Medline Borrower LP                        | 0,00 %  | 23.10.2028            | 987.186           | 0,29                         |

## Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag  | Wertpapierbezeichnung                     | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Mittelfristige Schuldverschreibungen^ 3,93 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)</b><br><b>(Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>  |   |        |                       |                   |                              |
| 997.449   | Prime Security Services Borrower LLC      | 0,00 % | 23.09.2026            | 998.411           | 0,29                         |
| 997.184   | UFC Holdings LLC                          | 0,00 % | 29.04.2026            | 997.249           | 0,29                         |
| 996.722   | William Morris Endeavor Entertainment LLC | 0,00 % | 18.05.2025            | 996.025           | 0,29                         |
| 1.000.000   | World Wide Technology Holding Co LLC      | 0,00 % | 01.03.2030            | 1.001.875         | 0,29                         |
| <b>Mittelfristige Schuldverschreibungen insgesamt †</b>   |   |        |                       | <b>13.544.713</b> | <b>3,93</b>                  |

| Anzahl der<br>Anteile                                     | Wertpapierbezeichnung             | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-----------------------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Investmentfonds 0,05 % (31. Dezember 2022: 0,08 %)</b> |                                   |                    |                              |
| <b>Britisches Pfund</b>                                   |                                   |                    |                              |
| 171.898   | NB Global Monthly Income Fund Ltd | 163.907            | 0,05                         |
| <b>Investmentfonds insgesamt †</b>                        |                                   | <b>163.907</b>     | <b>0,05</b>                  |
| <b>Anlagen insgesamt</b>                                  |                                   | <b>335.776.704</b> | <b>97,50</b>                 |

### Devisenterminkontrakte 1,28 % (31. Dezember 2022: 7,36 %)

| Geforderter<br>Betrag  | Zu zahlender<br>Betrag | Fälligkeits-<br>datum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|------------------------|-----------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------------|------------------------------|
| 90.805 £   | 113.491 US\$           | 20.07.2023            | State Street Bank and Trust Co | 1         | 1.967                                | 0,00                         |
| 1.195.326 US\$   | 1.084.759 €            | 20.07.2023            | Goldman Sachs International    | 1         | 10.934                               | 0,00                         |
| 83.054.630 US\$  | 75.414.466 €           | 20.07.2023            | Royal Bank of Canada           | 1         | 713.460                              | 0,21                         |
| <i>Abgesicherte Klassen CAD</i>                                      |                        |                       |                                |           |                                      |                              |
| 487.949 CAD  | 363.863 US\$           | 20.07.2023            | Goldman Sachs International    | 4         | 4.975                                | 0,00                         |
| 7.188.864 CAD  | 5.346.969 US\$         | 20.07.2023            | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 87.054                               | 0,03                         |
| 7.188.864 CAD  | 5.354.798 US\$         | 20.07.2023            | Westpac Banking Corp           | 1         | 79.225                               | 0,02                         |
| 759.685 US\$   | 1.000.000 CAD          | 20.07.2023            | Westpac Banking Corp           | 1         | 3.790                                | 0,00                         |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>                                      |                        |                       |                                |           |                                      |                              |
| 22.565 €   | 24.377 US\$            | 20.07.2023            | Goldman Sachs International    | 1         | 261                                  | 0,00                         |
| 88.684 €   | 95.889 US\$            | 20.07.2023            | Westpac Banking Corp           | 14        | 940                                  | 0,00                         |
| 115.050 US\$   | 104.281 €              | 20.07.2023            | Westpac Banking Corp           | 13        | 1.192                                | 0,00                         |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>                                      |                        |                       |                                |           |                                      |                              |
| 726.214 £  | 912.545 US\$           | 20.07.2023            | Goldman Sachs International    | 1         | 10.828                               | 0,00                         |
| 75.682.970 £   | 94.386.550 US\$        | 20.07.2023            | State Street Bank and Trust Co | 2         | 1.843.450                            | 0,54                         |
| 73.518.164 £   | 91.827.642 US\$        | 20.07.2023            | Westpac Banking Corp           | 1         | 1.649.832                            | 0,48                         |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten ∞</b> |                        |                       |                                |           | <b>4.407.908</b>                     | <b>1,28</b>                  |

## Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Futures-Kontrakte 0,49 % (31. Dezember 2022: 0,12 %)

| Anzahl Kontrakte  | Beschreibung   | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|--|--------------------------------|----------------------|
| (687)   | US Treasury 10-Year Note (CBT) Future September 2023 | 1.391.380                      | 0,40                 |
| (247)   | US Treasury 10-Year Ultra Future September 2023      | 308.750                        | 0,09                 |
| (72)  | US Treasury Long Bond (CBT) Future September 2023    | 6.188                          | 0,00                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten *</b> |  | <b>1.706.318</b>               | <b>0,49</b>          |

### Total Return Swap-Kontrakte 0,01 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)

| Nominalwert  | Datum der Schließung | Variabler Zinssatz | Referenzunternehmen | Nicht realisierter Gewinn US\$                 | % des Nettovermögens |      |
|--|----------------------|--------------------|---------------------|--|----------------------|------|
| USD  | 12.499.503           | 20.09.2023         | 5,09 <sup>1</sup>   | iBoxx USD Liquid High Yield Index <sup>2</sup> | 27.731               | 0,01 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Total Return Swap-Kontrakten <sup>∞</sup></b> |                      |                    |                     | <b>27.731</b>                                  | <b>0,01</b>          |      |

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

<sup>2</sup> Die Gegenpartei für den Total Return Swap-Kontrakt ist die JPMorgan Chase Bank.

|  |  |  |  | Zeitwert US\$      | % des Nettovermögens |
|--|--|--|--|--------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> |  |  |  | <b>341.918.661</b> | <b>99,28</b>         |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (0,24 %) (31. Dezember 2022: (2,75 %))

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 17.281.633 €   | 19.032.418 US\$     | 20.07.2023       | Royal Bank of Canada           | 1         | (163.493)                       | (0,05)               |
| 2.167.653 US\$   | 1.999.999 €         | 20.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (16.043)                        | (0,00)               |
| 743 US\$   | 1.000 CAD           | 20.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (13)                            | (0,00)               |
| 13.897.828 US\$  | 11.119.828 €        | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (240.902)                       | (0,07)               |
| <i>Abgesicherte Klassen CAD</i>  |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 215.939 US\$   | 290.801 CAD         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 3         | (3.875)                         | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>  |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 95.132 €   | 104.581 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 2         | (712)                           | (0,00)               |
| 2.131.832 €  | 2.344.404 US\$      | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (16.767)                        | (0,01)               |
| 2.293.264 €  | 2.515.683 US\$      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 16        | (11.784)                        | (0,00)               |
| 23.874 US\$  | 22.006 €            | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | (153)                           | (0,00)               |
| 105.597 US\$   | 98.680 €            | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 6         | (2.147)                         | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>  |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 824.674 €  | 1.056.876 US\$      | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | (8.313)                         | (0,00)               |
| 249.300 €  | 319.511 US\$        | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 1         | (2.529)                         | (0,00)               |
| 1.991.176 US\$   | 1.584.838 €         | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 2         | (23.927)                        | (0,01)               |
| 12.339.741 US\$  | 9.965.308 €         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 5         | (331.029)                       | (0,10)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                                |           | <b>(821.687)</b>                | <b>(0,24)</b>        |

## Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

**Futures-Kontrakte (0,88 %) (31. Dezember 2022: (0,13 %))**

| Anzahl Kontrakte   | Beschreibung  | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---|---------------------------------|----------------------|
| 40   | Euro-Bund Future September 2023                     | (80.734)                        | (0,02)               |
| 217  | US Treasury 2-Year Note (CBT) Future September 2023 | (584.998)                       | (0,17)               |
| 1.064  | US Treasury 5-Year Note (CBT) Future September 2023 | (2.091.207)                     | (0,61)               |
| (167)  | US Treasury Ultra Bond (CBT) Future September 2023  | (273.242)                       | (0,08)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten *</b> |   | <b>(3.030.181)</b>              | <b>(0,88)</b>        |

  

|   | Zeitwert US\$      | % des Nettovermögens |
|---|--------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(3.851.868)</b> | <b>(1,12)</b>        |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>338.066.793</b> | <b>98,16</b>         |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>6.326.597</b>   | <b>1,84</b>          |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>344.393.390</b> | <b>100,00</b>        |

^ Schuldverschreibungen mit einem Zinssatz von 0,00 %, wurden zum 30. Juni 2023 eventuell noch nicht abgerechnet und haben somit keinen gültigen Zinssatz. Die Zinssätze werden erst bei Abrechnung gültig.

| Portfolioanalyse  | US\$               | % des Gesamtvermögens |
|---|--------------------|-----------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 143.672.192        | 39,46                 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden            | 178.395.892        | 49,00                 |
| † Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente  | 13.544.713         | 3,72                  |
| μ Investmentfonds   | 163.907            | 0,05                  |
| ± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden                          | (1.323.863)        | (0,36)                |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente   | 3.613.952          | 0,99                  |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>338.066.793</b> | <b>92,86</b>          |

## Global High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 94,72 % (31. Dezember 2022: 81,02 %)</b> |   |        |                       |                  |                              |
| <b>Euro</b>  |   |        |                       |                  |                              |
| 1.700.000  | Abertis Infraestructuras Finance BV <sup>*</sup>                  | 3,25 % | 29.12.2049            | 1.671.661        | 0,30                         |
| 1.000.000  | Accor SA <sup>*</sup>   | 4,38 % | 29.12.2049            | 1.077.768        | 0,19                         |
| 751.000  | Adevinta ASA <sup>*</sup>   | 2,63 % | 15.11.2025            | 787.410          | 0,14                         |
| 228.962  | Adient Global Holdings Ltd <sup>*</sup>                           | 3,50 % | 15.08.2024            | 245.517          | 0,05                         |
| 600.000  | Ahlstrom Holding 3 Oy <sup>*</sup>                                | 3,63 % | 04.02.2028            | 544.227          | 0,10                         |
| 1.602.000  | Altice Financing SA <sup>**</sup>                                 | 4,25 % | 15.08.2029            | 1.346.908        | 0,24                         |
| 500.000  | Altice France Holding SA <sup>*</sup>                             | 8,00 % | 15.05.2027            | 320.105          | 0,06                         |
| 800.000  | Altice France SA <sup>**</sup>                                    | 2,13 % | 15.02.2025            | 803.409          | 0,14                         |
| 1.198.000  | Altice France SA <sup>**</sup>                                    | 4,25 % | 15.10.2029            | 943.449          | 0,17                         |
| 823.000  | Apollo Swedish Bidco AB <sup>**</sup>                             | 8,59 % | 05.07.2029            | 871.019          | 0,16                         |
| 768.000  | Aramark International Finance Sarl <sup>*</sup>                   | 3,13 % | 01.04.2025            | 809.210          | 0,15                         |
| 1.499.000  | Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc <sup>*</sup> | 2,13 % | 15.08.2026            | 1.458.209        | 0,26                         |
| 1.693.000  | Ashland Services BV <sup>**</sup>                                 | 2,00 % | 30.01.2028            | 1.571.236        | 0,28                         |
| 350.000  | Assemblin Group AB <sup>**</sup>                                  | 8,53 % | 15.05.2025            | 382.408          | 0,07                         |
| 1.399.000  | Avantor Funding Inc <sup>**</sup>                                 | 2,63 % | 01.11.2025            | 1.467.105        | 0,26                         |
| 250.000  | Avantor Funding Inc <sup>*</sup>                                  | 3,88 % | 15.07.2028            | 250.584          | 0,04                         |
| 799.000  | Azelis Finance NV <sup>*</sup>                                    | 5,75 % | 15.03.2028            | 875.264          | 0,16                         |
| 1.289.000  | Banijay Entertainment SASU <sup>**</sup>                          | 3,50 % | 01.03.2025            | 1.377.179        | 0,25                         |
| 1.100.000  | Banijay Group SAS <sup>**</sup>                                   | 6,50 % | 01.03.2026            | 1.195.387        | 0,21                         |
| 1.240.000  | Benteler International AG <sup>*</sup>                            | 9,38 % | 15.05.2028            | 1.369.750        | 0,24                         |
| 1.338.000  | BK LC Lux Finco1 Sarl <sup>*</sup>                                | 5,25 % | 30.04.2029            | 1.375.572        | 0,24                         |
| 900.000  | Canpack SA/Canpack US LLC <sup>*</sup>                            | 2,38 % | 01.11.2027            | 819.985          | 0,14                         |
| 580.000  | Castle UK Finco Plc <sup>**</sup>                                 | 8,57 % | 15.05.2028            | 555.296          | 0,10                         |
| 535.000  | Castor SpA <sup>*</sup>   | 6,00 % | 15.02.2029            | 503.388          | 0,09                         |
| 600.000  | Chrome Bidco SASU <sup>*</sup>                                    | 3,50 % | 31.05.2028            | 552.578          | 0,10                         |
| 2.491.000  | Constellium SE <sup>*</sup>                                       | 3,13 % | 15.07.2029            | 2.299.528        | 0,41                         |
| 1.075.000  | Coty Inc <sup>**</sup>  | 3,88 % | 15.04.2026            | 1.139.802        | 0,20                         |
| 700.000  | Cullinan Holdco Scsp <sup>**</sup>                                | 4,63 % | 15.10.2026            | 649.279          | 0,12                         |
| 1.101.000  | Dana Financing Luxembourg Sarl <sup>*</sup>                       | 8,50 % | 15.07.2031            | 1.242.854        | 0,22                         |
| 700.000  | Deutsche Lufthansa AG <sup>*</sup>                                | 3,50 % | 14.07.2029            | 693.837          | 0,12                         |
| 1.400.000  | Deutsche Lufthansa AG <sup>*</sup>                                | 3,75 % | 11.02.2028            | 1.443.797        | 0,26                         |
| 500.000  | Dometic Group AB <sup>*</sup>                                     | 3,00 % | 08.05.2026            | 511.510          | 0,09                         |
| 700.000  | doValue SpA <sup>*</sup>  | 3,38 % | 31.07.2026            | 644.410          | 0,11                         |
| 450.000  | Dufry One BV <sup>**</sup>  | 2,00 % | 15.02.2027            | 429.460          | 0,08                         |
| 1.446.000  | Dufry One BV <sup>*</sup>   | 3,38 % | 15.04.2028            | 1.400.655        | 0,25                         |
| 538.000  | eG Global Finance Plc <sup>*</sup>                                | 6,25 % | 30.10.2025            | 559.416          | 0,10                         |
| 701.000  | Emerald Debt Merger Sub LLC <sup>**</sup>                         | 6,38 % | 15.12.2030            | 764.405          | 0,14                         |
| 1.599.000  | Emeria SASU <sup>**</sup>   | 3,38 % | 31.03.2028            | 1.407.675        | 0,25                         |
| 558.000  | Emeria SASU <sup>**</sup>   | 7,75 % | 31.03.2028            | 565.566          | 0,10                         |



## Global High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------------------|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 94,72 % (31. Dezember 2022: 81,02 %) (Fortsetzung)</b> |                                      |         |                       |                  |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |                                      |         |                       |                  |                              |
| 1.318.000  | Enel SpA*                            | 6,38 %  | 29.12.2049            | 1.451.210        | 0,26                         |
| 1.300.000  | Fiber Bidco SpA*                     | 9,60 %  | 25.10.2027            | 1.426.313        | 0,26                         |
| 250.000  | Fiber Bidco SpA*                     | 11,00 % | 25.10.2027            | 292.493          | 0,05                         |
| 980.000  | Ford Motor Credit Co LLC**           | 2,39 %  | 17.02.2026            | 1.004.727        | 0,18                         |
| 900.000  | Ford Motor Credit Co LLC*            | 3,02 %  | 06.03.2024            | 970.117          | 0,17                         |
| 1.450.000  | Ford Motor Credit Co LLC*            | 4,87 %  | 03.08.2027            | 1.554.336        | 0,28                         |
| 300.000  | Forvia*                              | 2,63 %  | 15.06.2025            | 312.820          | 0,06                         |
| 1.843.000  | Forvia*                              | 2,75 %  | 15.02.2027            | 1.824.486        | 0,33                         |
| 400.000  | Forvia*                              | 7,25 %  | 15.06.2026            | 454.612          | 0,08                         |
| 1.240.000  | Heimstaden Bostad AB*                | 3,25 %  | 29.12.2049            | 818.544          | 0,14                         |
| 600.000  | Huhtamaki OYJ*                       | 4,25 %  | 09.06.2027            | 645.854          | 0,11                         |
| 1.140.000  | Iliad Holding SASU**                 | 5,13 %  | 15.10.2026            | 1.190.833        | 0,21                         |
| 2.030.000  | Iliad Holding SASU**                 | 5,63 %  | 15.10.2028            | 2.056.443        | 0,37                         |
| 1.400.000  | Infineon Technologies AG*            | 2,88 %  | 29.12.2049            | 1.456.914        | 0,26                         |
| 500.000  | Infineon Technologies AG*            | 3,63 %  | 29.12.2049            | 499.211          | 0,09                         |
| 938.000  | Intrum AB*                           | 3,13 %  | 15.07.2024            | 952.996          | 0,17                         |
| 799.000  | IPD 3 BV*                            | 8,00 %  | 15.06.2028            | 890.881          | 0,16                         |
| 400.000  | IQVIA Inc*                           | 2,88 %  | 15.09.2025            | 423.997          | 0,07                         |
| 2.601.000  | IQVIA Inc**                          | 2,88 %  | 15.06.2028            | 2.562.422        | 0,46                         |
| 600.000  | Italmatch Chemicals SpA*             | 10,00 % | 06.02.2028            | 639.858          | 0,11                         |
| 1.300.000  | Jaguar Land Rover Automotive Plc*    | 6,88 %  | 15.11.2026            | 1.410.535        | 0,25                         |
| 1.500.000  | Koninklijke KPN NV*                  | 6,00 %  | 29.12.2049            | 1.660.164        | 0,29                         |
| 4.458.000  | Lorca Telecom Bondco SA*             | 4,00 %  | 18.09.2027            | 4.448.119        | 0,79                         |
| 200.000  | Loxam SAS*                           | 4,50 %  | 15.04.2027            | 195.496          | 0,03                         |
| 683.000  | Loxam SAS*                           | 5,75 %  | 15.07.2027            | 683.911          | 0,12                         |
| 992.000  | Loxam SAS*                           | 6,38 %  | 15.05.2028            | 1.073.709        | 0,19                         |
| 499.000  | Maxeda DIY Holding BV**              | 5,88 %  | 01.10.2026            | 392.224          | 0,07                         |
| 720.000  | Motion Bondco DAC*                   | 4,50 %  | 15.11.2027            | 688.172          | 0,12                         |
| 934.000  | Motion Finco Sarl*                   | 7,38 %  | 15.06.2030            | 1.015.708        | 0,18                         |
| 1.982.000  | Multiversity SRL*                    | 7,50 %  | 30.10.2028            | 2.140.803        | 0,38                         |
| 1.290.000  | NH Hotel Group SA*                   | 4,00 %  | 02.07.2026            | 1.345.124        | 0,24                         |
| 2.599.000  | Novelis Sheet Ingot GmbH*            | 3,38 %  | 15.04.2029            | 2.498.988        | 0,44                         |
| 1.115.000  | Olympus Water US Holding Corp*       | 9,63 %  | 15.11.2028            | 1.170.847        | 0,21                         |
| 805.000  | Paprec Holding SA*                   | 4,00 %  | 31.03.2025            | 863.439          | 0,15                         |
| 513.000  | PCF GmbH*                            | 4,75 %  | 15.04.2026            | 432.843          | 0,08                         |
| 1.170.000  | PLT VII Finance Sarl**               | 4,63 %  | 05.01.2026            | 1.241.780        | 0,22                         |
| 1.000.000  | RCS & RDS SA*                        | 3,25 %  | 05.02.2028            | 924.105          | 0,16                         |
| 600.000  | Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB* | 1,00 %  | 12.08.2027            | 426.458          | 0,08                         |
| 399.000  | SGL Carbon SE*                       | 4,63 %  | 30.09.2024            | 435.957          | 0,08                         |
| 1.090.000  | SPCM SA*                             | 2,63 %  | 01.02.2029            | 1.043.597        | 0,19                         |

## Global High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                    | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 94,72 % (31. Dezember 2022: 81,02 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                    |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |  |        |                       |                    |                              |
| 1.000.000  | Standard Industries Inc**                | 2,25 % | 21.11.2026            | 971.707            | 0,17                         |
| 1.720.000  | Summer BC Holdco B Sarl**                | 5,75 % | 31.10.2026            | 1.674.673          | 0,30                         |
| 880.000  | TDC Net A/S*                             | 5,06 % | 31.05.2028            | 943.514            | 0,17                         |
| 976.789  | Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH** | 6,00 % | 30.07.2026            | 1.047.544          | 0,19                         |
| 2.377.000  | Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH** | 2,00 % | 15.07.2025            | 2.470.083          | 0,44                         |
| 1.811.000  | Telecom Italia SpA*                      | 2,88 % | 28.01.2026            | 1.845.264          | 0,33                         |
| 1.025.000  | Telecom Italia SpA**                     | 3,00 % | 30.09.2025            | 1.057.359          | 0,19                         |
| 900.000  | Telecom Italia SpA**                     | 4,00 % | 11.04.2024            | 970.181            | 0,17                         |
| 399.000  | Telecom Italia SpA*                      | 6,88 % | 15.02.2028            | 434.608            | 0,08                         |
| 2.000.000  | Telefonica Europe BV*                    | 4,38 % | 29.12.2049            | 2.133.451          | 0,38                         |
| 1.800.000  | Telefonica Europe BV*                    | 7,13 % | 29.12.2049            | 2.008.861          | 0,36                         |
| 237.000  | Tereos Finance Groupe I SA**             | 7,25 % | 15.04.2028            | 263.881            | 0,05                         |
| 1.200.000  | TI Automotive Finance Plc**              | 3,75 % | 15.04.2029            | 1.048.845          | 0,19                         |
| 2.067.000  | TK Elevator Midco GmbH**                 | 4,38 % | 15.07.2027            | 2.022.085          | 0,36                         |
| 1.080.000  | Trivium Packaging Finance BV*            | 3,75 % | 15.08.2026            | 1.090.651          | 0,20                         |
| 900.000  | United Group BV**                        | 5,25 % | 01.02.2030            | 779.033            | 0,14                         |
| 1.600.000  | Veolia Environnement SA*                 | 2,25 % | 29.12.2049            | 1.581.927          | 0,28                         |
| 1.200.000  | Verallia SA*                             | 1,88 % | 10.11.2031            | 1.054.795          | 0,19                         |
| 2.941.000  | Verisure Holding AB*                     | 3,88 % | 15.07.2026            | 3.018.277          | 0,54                         |
| 300.000  | Verisure Midholding AB*                  | 5,25 % | 15.02.2029            | 284.682            | 0,05                         |
| 300.000  | Virgin Media Finance Plc**               | 3,75 % | 15.07.2030            | 259.133            | 0,05                         |
| 850.000  | WMG Acquisition Corp*                    | 2,25 % | 15.08.2031            | 737.468            | 0,13                         |
| 1.300.000  | ZF Europe Finance BV*                    | 3,00 % | 23.10.2029            | 1.200.120          | 0,21                         |
| 1.000.000  | ZF Finance GmbH*                         | 3,75 % | 21.09.2028            | 983.787            | 0,17                         |
| 2.020.000  | Ziggo Bond Co BV*                        | 3,38 % | 28.02.2030            | 1.630.692          | 0,29                         |
| <b>Euro insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>113.960.485</b> | <b>20,31</b>                 |
| <b>Britisches Pfund</b>  |  |        |                       |                    |                              |
| 1.101.000  | AA Bond Co Ltd*                          | 6,50 % | 31.01.2026            | 1.213.296          | 0,21                         |
| 240.000  | AA Bond Co Ltd*                          | 7,38 % | 31.07.2029            | 276.157            | 0,05                         |
| 1.000.000  | B&M European Value Retail SA*            | 3,63 % | 15.07.2025            | 1.226.419          | 0,22                         |
| 1.762.000  | Bellis Acquisition Co Plc**              | 3,25 % | 16.02.2026            | 1.881.225          | 0,33                         |
| 100.000  | Bellis Finco Plc**                       | 4,00 % | 16.02.2027            | 94.907             | 0,02                         |
| 969.000  | British Telecommunications Plc*          | 8,38 % | 20.12.2083            | 1.212.492          | 0,22                         |
| 100.000  | Castle UK Finco Plc**                    | 7,00 % | 15.05.2029            | 102.153            | 0,02                         |
| 1.418.000  | CPUK Finance Ltd**                       | 6,50 % | 28.08.2026            | 1.720.308          | 0,31                         |
| 803.000  | Maison Finco Plc**                       | 6,00 % | 31.10.2027            | 797.079            | 0,14                         |
| 1.501.000  | Marks & Spencer Plc*                     | 3,75 % | 19.05.2026            | 1.722.669          | 0,31                         |
| 590.000  | Marks & Spencer Plc*                     | 6,00 % | 12.06.2025            | 729.835            | 0,13                         |
| 1.674.000  | Mobico Group Plc*                        | 4,25 % | 29.12.2049            | 1.863.617          | 0,33                         |

## Global High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 94,72 % (31. Dezember 2022: 81,02 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                   |                              |
| <b>Britisches Pfund (Fortsetzung)</b>  |   |        |                       |                   |                              |
| 620.000  | Pinewood Finance Co Ltd**   | 3,25 % | 30.09.2025            | 726.163           | 0,13                         |
| 405.000  | Pinnacle Bidco Plc*   | 6,38 % | 15.02.2025            | 491.646           | 0,09                         |
| 660.000  | Premier Foods Finance Plc*  | 3,50 % | 15.10.2026            | 736.793           | 0,13                         |
| 960.000  | RAC Bond Co Plc**   | 5,25 % | 04.11.2027            | 973.484           | 0,17                         |
| 500.000  | Travis Perkins Plc*   | 3,75 % | 17.02.2026            | 572.059           | 0,10                         |
| 900.000  | Travis Perkins Plc*   | 4,50 % | 07.09.2023            | 1.136.164         | 0,20                         |
| 1.101.000  | Virgin Media Secured Finance Plc*                                 | 5,00 % | 15.04.2027            | 1.273.094         | 0,23                         |
| 2.044.000  | Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC**                     | 4,88 % | 15.07.2028            | 2.070.885         | 0,37                         |
| 745.000  | Zenith Finco Plc**  | 6,50 % | 30.06.2027            | 724.246           | 0,13                         |
| <b>Britisches Pfund insgesamt</b>  |   |        |                       | <b>21.544.691</b> | <b>3,84</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>   |   |        |                       |                   |                              |
| 3.960.000  | 1011778 BC ULC/New Red Finance Inc**                              | 4,00 % | 15.10.2030            | 3.393.849         | 0,61                         |
| 660.000  | 180 Medical Inc**   | 3,88 % | 15.10.2029            | 576.427           | 0,11                         |
| 490.000  | Abercrombie & Fitch Management Co**                               | 8,75 % | 15.07.2025            | 497.861           | 0,09                         |
| 1.030.000  | Acadia Healthcare Co Inc**  | 5,50 % | 01.07.2028            | 985.978           | 0,17                         |
| 692.000  | Access Bank Plc*  | 6,13 % | 21.09.2026            | 587.300           | 0,11                         |
| 1.180.000  | Adani Green Energy Ltd*   | 4,38 % | 08.09.2024            | 1.091.404         | 0,19                         |
| 165.000  | Adient Global Holdings Ltd**                                      | 8,25 % | 15.04.2031            | 167.752           | 0,03                         |
| 1.350.000  | ADT Security Corp**   | 4,88 % | 15.07.2032            | 1.156.181         | 0,21                         |
| 725.000  | AerCap Global Aviation Trust*                                     | 6,50 % | 15.06.2045            | 702.013           | 0,12                         |
| 2.087.000  | Agile Group Holdings Ltd**  | 5,75 % | 02.01.2025            | 641.502           | 0,11                         |
| 1.265.000  | Ahead DB Holdings LLC**   | 6,63 % | 01.05.2028            | 1.030.178         | 0,18                         |
| 1.295.000  | Air Canada**  | 3,88 % | 15.08.2026            | 1.201.440         | 0,21                         |
| 1.000.000  | Akbank TAS**  | 6,80 % | 06.02.2026            | 956.650           | 0,17                         |
| 730.000  | Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC** | 3,50 % | 15.03.2029            | 632.622           | 0,11                         |
| 425.000  | Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC** | 4,63 % | 15.01.2027            | 403.099           | 0,07                         |
| 385.000  | Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC** | 4,88 % | 15.02.2030            | 355.813           | 0,06                         |
| 605.000  | Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC** | 5,88 % | 15.02.2028            | 588.544           | 0,11                         |
| 845.000  | Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC** | 6,50 % | 15.02.2028            | 847.362           | 0,15                         |
| 980.000  | Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer**    | 4,25 % | 15.10.2027            | 880.866           | 0,16                         |
| 1.670.000  | Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer**    | 6,75 % | 15.10.2027            | 1.572.188         | 0,28                         |
| 250.000  | Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer**    | 6,75 % | 15.04.2028            | 248.213           | 0,04                         |
| 465.000  | Allwyn Entertainment Financing UK Plc**                           | 7,88 % | 30.04.2029            | 472.677           | 0,08                         |
| 1.883.000  | Alsea SAB de CV**   | 7,75 % | 14.12.2026            | 1.870.249         | 0,33                         |
| 1.935.000  | Altice France SA*   | 5,50 % | 15.01.2028            | 1.463.444         | 0,26                         |
| 1.030.000  | Altice France SA**  | 5,50 % | 15.10.2029            | 737.627           | 0,13                         |
| 995.000  | American Airlines Inc**   | 7,25 % | 15.02.2028            | 990.103           | 0,18                         |
| 1.625.000  | American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd**                 | 5,50 % | 20.04.2026            | 1.611.333         | 0,29                         |
| 3.285.000  | American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd**                 | 5,75 % | 20.04.2029            | 3.192.622         | 0,57                         |

## Global High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 94,72 % (31. Dezember 2022: 81,02 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 660.000  | Amkor Technology Inc**  | 6,63 %  | 15.09.2027            | 661.839          | 0,12                         |
| 885.000  | Amsted Industries Inc**   | 5,63 %  | 01.07.2027            | 856.830          | 0,15                         |
| 165.000  | AmWINS Group Inc**  | 4,88 %  | 30.06.2029            | 149.173          | 0,02                         |
| 1.160.000  | AmWINS Group Inc 144A**   | 4,88 %  | 30.06.2029            | 1.048.730        | 0,19                         |
| 1.545.000  | Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp**                | 5,38 %  | 15.06.2029            | 1.437.129        | 0,26                         |
| 730.000  | Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp**                | 5,75 %  | 01.03.2027            | 704.696          | 0,13                         |
| 1.890.000  | APX Group Inc**   | 5,75 %  | 15.07.2029            | 1.642.973        | 0,29                         |
| 616.000  | Arabian Centres Sukuk II Ltd*   | 5,63 %  | 07.10.2026            | 565.097          | 0,10                         |
| 2.680.000  | Aramark Services Inc**  | 5,00 %  | 01.02.2028            | 2.529.706        | 0,45                         |
| 425.000  | ARD Finance SA*   | 6,50 %  | 30.06.2027            | 344.941          | 0,06                         |
| 460.000  | Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc** | 4,00 %  | 01.09.2029            | 364.830          | 0,07                         |
| 705.000  | Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc** | 6,00 %  | 15.06.2027            | 693.283          | 0,12                         |
| 50.000   | Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc**                      | 5,25 %  | 15.08.2027            | 42.419           | 0,01                         |
| 1.320.000  | Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc 144A**                 | 5,25 %  | 15.08.2027            | 1.119.870        | 0,20                         |
| 3.720.000  | Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**                      | 5,88 %  | 30.06.2029            | 3.322.634        | 0,59                         |
| 410.000  | Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**                      | 7,00 %  | 01.11.2026            | 397.224          | 0,07                         |
| 2.910.000  | ASGN Inc**  | 4,63 %  | 15.05.2028            | 2.635.544        | 0,47                         |
| 1.285.000  | AssuredPartners Inc**   | 5,63 %  | 15.01.2029            | 1.113.482        | 0,20                         |
| 1.250.000  | AthenaHealth Group Inc**  | 6,50 %  | 15.02.2030            | 1.053.300        | 0,19                         |
| 395.000  | ATS Corp**  | 4,13 %  | 15.12.2028            | 353.949          | 0,06                         |
| 1.165.000  | Avantor Funding Inc**   | 3,88 %  | 01.11.2029            | 1.021.039        | 0,18                         |
| 875.000  | Avantor Funding Inc**   | 4,63 %  | 15.07.2028            | 811.845          | 0,15                         |
| 1.795.000  | Avient Corp**   | 7,13 %  | 01.08.2030            | 1.817.121        | 0,32                         |
| 845.000  | Ball Corp*  | 4,00 %  | 15.11.2023            | 839.423          | 0,15                         |
| 525.000  | Ball Corp*  | 4,88 %  | 15.03.2026            | 511.146          | 0,09                         |
| 770.000  | Ball Corp*  | 6,00 %  | 15.06.2029            | 765.187          | 0,14                         |
| 300.000  | Banco BTG Pactual SA*   | 2,75 %  | 11.01.2026            | 273.782          | 0,05                         |
| 1.216.000  | Banco Davivienda SA**   | 6,65 %  | 29.12.2049            | 896.032          | 0,16                         |
| 1.767.000  | Banco do Brasil SA**  | 9,00 %  | 29.12.2049            | 1.777.425        | 0,32                         |
| 1.800.000  | Banco Mercantil del Norte SA*   | 7,50 %  | 29.12.2049            | 1.564.508        | 0,28                         |
| 616.000  | Bancolombia SA*   | 4,63 %  | 18.12.2029            | 524.857          | 0,09                         |
| 880.000  | Bath & Body Works Inc**   | 6,63 %  | 01.10.2030            | 850.536          | 0,15                         |
| 875.000  | Bath & Body Works Inc*  | 6,75 %  | 01.07.2036            | 788.490          | 0,14                         |
| 360.000  | Bath & Body Works Inc*  | 6,88 %  | 01.11.2035            | 329.945          | 0,06                         |
| 1.843.000  | BBVA Bancomer SA**  | 5,88 %  | 13.09.2034            | 1.642.418        | 0,29                         |
| 1.695.000  | BCPE Empire Holdings Inc**  | 7,63 %  | 01.05.2027            | 1.578.196        | 0,28                         |
| 405.000  | Beacon Roofing Supply Inc**   | 4,13 %  | 15.05.2029            | 358.868          | 0,07                         |
| 1.430.000  | Beacon Roofing Supply Inc**   | 4,50 %  | 15.11.2026            | 1.358.439        | 0,24                         |
| 870.000  | Benteler International AG**   | 10,50 % | 15.05.2028            | 879.531          | 0,16                         |
| 1.420.000  | Berry Global Inc**  | 4,50 %  | 15.02.2026            | 1.353.796        | 0,24                         |

## Global High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 94,72 % (31. Dezember 2022: 81,02 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 855.000  | Berry Global Inc**  | 5,63 % | 15.07.2027            | 837.601          | 0,15                         |
| 616.000  | Bidvest Group UK Plc*   | 3,63 % | 23.09.2026            | 550.627          | 0,10                         |
| 1.025.000  | Blue Racer Midstream LLC/Blue Racer Finance Corp**                          | 6,63 % | 15.07.2026            | 1.015.854        | 0,18                         |
| 200.000  | Braskem Idesa SAPI**  | 6,99 % | 20.02.2032            | 129.725          | 0,02                         |
| 200.000  | Braskem Netherlands Finance BV*   | 7,25 % | 13.02.2033            | 196.659          | 0,03                         |
| 685.000  | BroadStreet Partners Inc**  | 5,88 % | 15.04.2029            | 594.967          | 0,11                         |
| 65.000   | Buckeye Partners LP**   | 4,13 % | 01.03.2025            | 61.893           | 0,01                         |
| 775.000  | Buckeye Partners LP 144A**  | 4,13 % | 01.03.2025            | 737.951          | 0,13                         |
| 820.000  | Buckeye Partners LP**   | 4,15 % | 01.07.2023            | 820.000          | 0,15                         |
| 640.000  | Buckeye Partners LP**   | 4,50 % | 01.03.2028            | 574.048          | 0,10                         |
| 520.000  | Buckeye Partners LP**   | 5,85 % | 15.11.2043            | 386.386          | 0,07                         |
| 435.000  | Builders FirstSource Inc**  | 4,25 % | 01.02.2032            | 379.022          | 0,07                         |
| 520.000  | Builders FirstSource Inc**  | 6,38 % | 15.06.2032            | 517.203          | 0,09                         |
| 1.465.000  | Camelot Return Merger Sub Inc**   | 8,75 % | 01.08.2028            | 1.386.358        | 0,25                         |
| 1.128.000  | Canacol Energy Ltd**  | 5,75 % | 24.11.2028            | 965.860          | 0,17                         |
| 1.290.000  | Carpenter Technology Corp*  | 6,38 % | 15.07.2028            | 1.265.497        | 0,23                         |
| 500.000  | CAS Capital No 1 Ltd*   | 4,00 % | 29.12.2049            | 415.220          | 0,07                         |
| 4.035.000  | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**                                | 4,50 % | 01.06.2033            | 3.172.923        | 0,57                         |
| 1.055.000  | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**                                | 5,13 % | 01.05.2027            | 983.545          | 0,17                         |
| 1.030.000  | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**                                | 5,50 % | 01.05.2026            | 1.005.209        | 0,18                         |
| 415.000  | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**                                | 6,38 % | 01.09.2029            | 391.446          | 0,07                         |
| 630.000  | CDW LLC/CDW Finance Corp**  | 3,57 % | 01.12.2031            | 532.514          | 0,09                         |
| 575.000  | CDW LLC/CDW Finance Corp**  | 4,25 % | 01.04.2028            | 527.891          | 0,09                         |
| 420.000  | Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co/Magnum Management Corp/Millennium Op** | 5,50 % | 01.05.2025            | 417.211          | 0,07                         |
| 1.255.000  | Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co/Magnum Management Corp/Millennium Op** | 6,50 % | 01.10.2028            | 1.225.474        | 0,22                         |
| 614.000  | Cemex SAB de CV**   | 5,13 % | 29.12.2049            | 546.966          | 0,10                         |
| 645.000  | Cemex SAB de CV**   | 9,13 % | 29.12.2049            | 654.028          | 0,12                         |
| 350.000  | Centene Corp*   | 2,50 % | 01.03.2031            | 279.463          | 0,05                         |
| 900.000  | Centene Corp*   | 3,00 % | 15.10.2030            | 750.831          | 0,13                         |
| 275.000  | Centene Corp**  | 4,63 % | 15.12.2029            | 253.368          | 0,05                         |
| 1.700.000  | Central American Bottling Corp/CBC Bottling Holdco SL/Beliv Holdco SL**     | 5,25 % | 27.04.2029            | 1.572.337        | 0,28                         |
| 810.000  | Central Parent Inc/CDK Global Inc**   | 7,25 % | 15.06.2029            | 801.747          | 0,14                         |
| 1.710.000  | Chart Industries Inc**  | 7,50 % | 01.01.2030            | 1.746.774        | 0,31                         |
| 205.000  | Chart Industries Inc**  | 9,50 % | 01.01.2031            | 217.714          | 0,04                         |
| 2.850.000  | CHS/Community Health Systems Inc**  | 6,00 % | 15.01.2029            | 2.400.626        | 0,43                         |
| 1.305.000  | Ciena Corp**  | 4,00 % | 31.01.2030            | 1.138.156        | 0,20                         |
| 200.000  | CIFI Holdings Group Co Ltd*   | 5,95 % | 20.10.2025            | 23.188           | 0,00                         |
| 455.000  | Clarios Global LP**   | 6,75 % | 15.05.2025            | 455.795          | 0,08                         |
| 1.790.000  | Clearway Energy Operating LLC**   | 4,75 % | 15.03.2028            | 1.653.191        | 0,29                         |
| 1.335.000  | CommScope Inc**   | 4,75 % | 01.09.2029            | 1.053.796        | 0,19                         |

## Global High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 94,72 % (31. Dezember 2022: 81,02 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 1.170.000  | CommScope Inc**   | 7,13 %  | 01.07.2028            | 832.233          | 0,15                         |
| 130.000  | CommScope Inc**   | 8,25 %  | 01.03.2027            | 104.179          | 0,02                         |
| 2.175.000  | Comstock Resources Inc**  | 5,88 %  | 15.01.2030            | 1.890.653        | 0,34                         |
| 1.491.000  | Comstock Resources Inc**  | 6,75 %  | 01.03.2029            | 1.365.706        | 0,24                         |
| 1.405.000  | Constellium SE**  | 5,63 %  | 15.06.2028            | 1.324.076        | 0,24                         |
| 572.880  | Continuum Energy Levanter Pte Ltd**                                     | 4,50 %  | 09.02.2027            | 534.211          | 0,10                         |
| 595.000  | Cornerstone Building Brands Inc**                                       | 6,13 %  | 15.01.2029            | 471.029          | 0,08                         |
| 610.000  | Coty Inc**  | 5,00 %  | 15.04.2026            | 585.191          | 0,10                         |
| 295.000  | Coty Inc**  | 6,50 %  | 15.04.2026            | 292.728          | 0,05                         |
| 1.738.000  | Country Garden Holdings Co Ltd*   | 2,70 %  | 12.07.2026            | 532.103          | 0,10                         |
| 400.000  | Country Garden Holdings Co Ltd*   | 3,13 %  | 22.10.2025            | 126.060          | 0,02                         |
| 4.360.000  | CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC**                                | 5,50 %  | 15.06.2031            | 3.895.759        | 0,69                         |
| 45.000   | Crestwood Midstream Partners LP/Crestwood Midstream Finance Corp**      | 5,63 %  | 01.05.2027            | 42.705           | 0,01                         |
| 955.000  | Crestwood Midstream Partners LP/Crestwood Midstream Finance Corp 144A** | 5,63 %  | 01.05.2027            | 906.295          | 0,16                         |
| 145.000  | Crestwood Midstream Partners LP/Crestwood Midstream Finance Corp**      | 6,00 %  | 01.02.2029            | 135.541          | 0,02                         |
| 1.115.000  | Crestwood Midstream Partners LP/Crestwood Midstream Finance Corp**      | 7,38 %  | 01.02.2031            | 1.100.301        | 0,20                         |
| 1.280.000  | CSC Holdings LLC**  | 4,50 %  | 15.11.2031            | 893.800          | 0,16                         |
| 885.000  | CSC Holdings LLC**  | 5,38 %  | 01.02.2028            | 712.426          | 0,13                         |
| 745.000  | CSC Holdings LLC**  | 5,50 %  | 15.04.2027            | 620.886          | 0,11                         |
| 105.000  | CSC Holdings LLC**  | 5,75 %  | 15.01.2030            | 49.726           | 0,01                         |
| 3.470.000  | CSC Holdings LLC 144A**   | 5,75 %  | 15.01.2030            | 1.643.340        | 0,29                         |
| 555.000  | CSC Holdings LLC**  | 11,25 % | 15.05.2028            | 538.858          | 0,10                         |
| 400.000  | CSN Resources SA**  | 4,63 %  | 10.06.2031            | 305.754          | 0,05                         |
| 635.000  | Dana Inc*   | 4,50 %  | 15.02.2032            | 527.761          | 0,09                         |
| 880.000  | Dana Inc*   | 5,38 %  | 15.11.2027            | 834.394          | 0,15                         |
| 1.055.000  | DaVita Inc**  | 3,75 %  | 15.02.2031            | 844.852          | 0,15                         |
| 525.000  | DaVita Inc**  | 4,63 %  | 01.06.2030            | 451.284          | 0,08                         |
| 1.000.000  | Delta Air Lines Inc*  | 7,38 %  | 15.01.2026            | 1.043.382        | 0,18                         |
| 900.000  | Ecopetrol SA*   | 5,88 %  | 28.05.2045            | 617.512          | 0,11                         |
| 1.093.000  | Ecopetrol SA*   | 6,88 %  | 29.04.2030            | 997.922          | 0,18                         |
| 709.000  | Ecopetrol SA*   | 8,88 %  | 13.01.2033            | 702.686          | 0,13                         |
| 1.100.000  | Element Solutions Inc**   | 3,88 %  | 01.09.2028            | 960.796          | 0,17                         |
| 715.000  | Emerald Debt Merger Sub LLC**   | 6,63 %  | 15.12.2030            | 709.637          | 0,13                         |
| 300.000  | Emirates NBD Bank PJSC*   | 6,13 %  | 29.12.2049            | 296.719          | 0,05                         |
| 630.000  | Encompass Health Corp*  | 4,50 %  | 01.02.2028            | 587.008          | 0,10                         |
| 605.000  | Encompass Health Corp*  | 5,75 %  | 15.09.2025            | 600.195          | 0,11                         |
| 631.000  | Endeavour Mining Plc**  | 5,00 %  | 14.10.2026            | 561.274          | 0,10                         |
| 2.000.000  | Energear Israel Finance Ltd*  | 5,38 %  | 30.03.2028            | 1.805.510        | 0,32                         |
| 3.260.000  | Energizer Holdings Inc**  | 6,50 %  | 31.12.2027            | 3.138.249        | 0,56                         |
| 910.000  | EnerSys**   | 4,38 %  | 15.12.2027            | 838.931          | 0,15                         |

## Global High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                          | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 94,72 % (31. Dezember 2022: 81,02 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |         |                       |                  |                              |
| 645.000  | EnLink Midstream LLC**                         | 6,50 %  | 01.09.2030            | 644.933          | 0,12                         |
| 825.000  | Enviri Corp**                                  | 5,75 %  | 31.07.2027            | 719.078          | 0,13                         |
| 175.000  | EPR Properties*                                | 4,50 %  | 01.04.2025            | 165.871          | 0,03                         |
| 380.000  | EPR Properties*                                | 4,50 %  | 01.06.2027            | 341.326          | 0,06                         |
| 860.000  | EQM Midstream Partners LP**                    | 6,50 %  | 01.07.2027            | 849.057          | 0,15                         |
| 205.000  | EQM Midstream Partners LP**                    | 7,50 %  | 01.06.2027            | 207.161          | 0,04                         |
| 230.000  | EQM Midstream Partners LP**                    | 7,50 %  | 01.06.2030            | 232.962          | 0,04                         |
| 425.000  | First Quantum Minerals Ltd**                   | 6,88 %  | 01.03.2026            | 418.960          | 0,08                         |
| 1.432.000  | First Quantum Minerals Ltd**                   | 6,88 %  | 15.10.2027            | 1.399.086        | 0,25                         |
| 910.000  | First Quantum Minerals Ltd**                   | 7,50 %  | 01.04.2025            | 910.146          | 0,16                         |
| 2.370.000  | First Quantum Minerals Ltd**                   | 8,63 %  | 01.06.2031            | 2.431.928        | 0,43                         |
| 890.000  | FMG Resources August 2006 Pty Ltd**            | 5,88 %  | 15.04.2030            | 848.512          | 0,15                         |
| 920.000  | FMG Resources August 2006 Pty Ltd**            | 6,13 %  | 15.04.2032            | 878.090          | 0,16                         |
| 1.440.000  | Ford Motor Co*                                 | 3,25 %  | 12.02.2032            | 1.134.151        | 0,20                         |
| 1.250.000  | Ford Motor Co*                                 | 5,29 %  | 08.12.2046            | 1.030.621        | 0,18                         |
| 2.110.000  | Ford Motor Credit Co LLC*                      | 2,90 %  | 10.02.2029            | 1.748.139        | 0,31                         |
| 875.000  | Ford Motor Credit Co LLC*                      | 4,06 %  | 01.11.2024            | 847.506          | 0,15                         |
| 920.000  | Ford Motor Credit Co LLC*                      | 4,13 %  | 17.08.2027            | 840.921          | 0,15                         |
| 2.765.000  | Ford Motor Credit Co LLC*                      | 4,69 %  | 09.06.2025            | 2.665.921        | 0,48                         |
| 600.000  | Ford Motor Credit Co LLC*                      | 6,80 %  | 12.05.2028            | 601.201          | 0,11                         |
| 1.080.000  | Ford Motor Credit Co LLC*                      | 6,95 %  | 06.03.2026            | 1.086.798        | 0,19                         |
| 565.000  | Ford Motor Credit Co LLC*                      | 6,95 %  | 10.06.2026            | 568.345          | 0,10                         |
| 545.000  | Ford Motor Credit Co LLC*                      | 7,20 %  | 10.06.2030            | 550.576          | 0,10                         |
| 555.000  | Ford Motor Credit Co LLC*                      | 7,35 %  | 04.11.2027            | 568.109          | 0,10                         |
| 505.000  | Ford Motor Credit Co LLC**                     | 8,04 %  | 06.03.2026            | 506.759          | 0,09                         |
| 195.000  | Fortrea Holdings Inc**                         | 7,50 %  | 01.07.2030            | 199.918          | 0,04                         |
| 400.000  | Franshion Brilliant Ltd*                       | 4,25 %  | 23.07.2029            | 315.380          | 0,05                         |
| 2.520.000  | Frontier Communications Holdings LLC**         | 5,88 %  | 15.10.2027            | 2.315.240        | 0,41                         |
| 1.432.000  | FS Luxembourg Sarl**                           | 10,00 % | 15.12.2025            | 1.467.790        | 0,26                         |
| 470.000  | Gen Digital Inc**                              | 6,75 %  | 30.09.2027            | 469.187          | 0,08                         |
| 600.000  | Gen Digital Inc**                              | 7,13 %  | 30.09.2030            | 601.544          | 0,11                         |
| 265.000  | Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp* | 8,00 %  | 15.01.2027            | 258.670          | 0,05                         |
| 395.000  | Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp* | 8,88 %  | 15.04.2030            | 386.278          | 0,07                         |
| 1.235.000  | GFL Environmental Inc**                        | 4,25 %  | 01.06.2025            | 1.192.894        | 0,21                         |
| 960.000  | Global Infrastructure Solutions Inc**          | 7,50 %  | 15.04.2032            | 817.346          | 0,15                         |
| 380.000  | Goodyear Tire & Rubber Co**                    | 4,88 %  | 15.03.2027            | 362.207          | 0,06                         |
| 195.000  | Goodyear Tire & Rubber Co**                    | 5,00 %  | 31.05.2026            | 190.772          | 0,03                         |
| 1.100.000  | Goodyear Tire & Rubber Co**                    | 5,00 %  | 15.07.2029            | 993.213          | 0,18                         |
| 1.090.000  | Goodyear Tire & Rubber Co**                    | 5,25 %  | 15.07.2031            | 948.109          | 0,17                         |
| 535.000  | Goodyear Tire & Rubber Co**                    | 9,50 %  | 31.05.2025            | 547.558          | 0,10                         |

## Global High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                          | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 94,72 % (31. Dezember 2022: 81,02 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |         |                       |                  |                              |
| 376.000  | Greenko Dutch BV**                             | 3,85 %  | 29.03.2026            | 338.455          | 0,06                         |
| 931.210  | Greenko Power II Ltd*                          | 4,30 %  | 13.12.2028            | 811.702          | 0,15                         |
| 3.150.000  | GTCR AP Finance Inc**                          | 8,00 %  | 15.05.2027            | 3.091.528        | 0,55                         |
| 1.230.000  | GYP Holdings III Corp**                        | 4,63 %  | 01.05.2029            | 1.084.854        | 0,19                         |
| 265.000  | Hologic Inc**                                  | 4,63 %  | 01.02.2028            | 249.948          | 0,04                         |
| 200.000  | Huarong Finance 2019 Co Ltd*                   | 3,38 %  | 24.02.2030            | 151.680          | 0,03                         |
| 200.000  | Huarong Finance II Co Ltd*                     | 5,50 %  | 16.01.2025            | 190.291          | 0,04                         |
| 1.005.000  | HUB International Ltd**                        | 5,63 %  | 01.12.2029            | 902.607          | 0,16                         |
| 2.195.000  | HUB International Ltd**                        | 7,00 %  | 01.05.2026            | 2.191.905        | 0,39                         |
| 2.135.000  | HUB International Ltd**                        | 7,25 %  | 15.06.2030            | 2.206.544        | 0,40                         |
| 1.030.000  | Hudbay Minerals Inc**                          | 4,50 %  | 01.04.2026            | 960.109          | 0,17                         |
| 1.835.000  | Hudbay Minerals Inc**                          | 6,13 %  | 01.04.2029            | 1.691.650        | 0,30                         |
| 616.000  | IHS Netherlands Holdco BV**                    | 8,00 %  | 18.09.2027            | 563.024          | 0,10                         |
| 2.615.000  | IQVIA Inc**                                    | 5,00 %  | 15.10.2026            | 2.527.326        | 0,45                         |
| 3.605.000  | Iron Mountain Inc**                            | 4,88 %  | 15.09.2027            | 3.408.853        | 0,61                         |
| 965.000  | Iron Mountain Inc**                            | 4,88 %  | 15.09.2029            | 864.675          | 0,16                         |
| 145.000  | Iron Mountain Inc**                            | 5,63 %  | 15.07.2032            | 129.928          | 0,02                         |
| 1.570.000  | Iron Mountain Inc**                            | 5,63 %  | 15.07.2032            | 1.406.805        | 0,25                         |
| 1.560.000  | ITT Holdings LLC**                             | 6,50 %  | 01.08.2029            | 1.316.234        | 0,24                         |
| 2.010.000  | JELD-WEN Inc**                                 | 4,88 %  | 15.12.2027            | 1.782.709        | 0,32                         |
| 524.000  | JSW Steel Ltd*                                 | 5,05 %  | 05.04.2032            | 423.893          | 0,08                         |
| 2.240.000  | KB Home*                                       | 4,80 %  | 15.11.2029            | 2.056.569        | 0,37                         |
| 425.000  | KB Home*                                       | 6,88 %  | 15.06.2027            | 431.732          | 0,08                         |
| 985.000  | KB Home**                                      | 7,25 %  | 15.07.2030            | 998.643          | 0,18                         |
| 520.000  | Kinetik Holdings LP**                          | 5,88 %  | 15.06.2030            | 494.777          | 0,09                         |
| 400.000  | KOC Holding AS*                                | 6,50 %  | 11.03.2025            | 395.920          | 0,07                         |
| 700.000  | Kosmos Energy Ltd*                             | 7,13 %  | 04.04.2026            | 616.238          | 0,11                         |
| 330.000  | Latam Airlines Group SA**                      | 13,38 % | 15.10.2027            | 357.273          | 0,06                         |
| 400.000  | Latam Airlines Group SA**                      | 13,38 % | 15.10.2029            | 433.179          | 0,08                         |
| 170.000  | Leeward Renewable Energy Operations LLC**      | 4,25 %  | 01.07.2029            | 151.661          | 0,03                         |
| 1.565.000  | Leeward Renewable Energy Operations LLC 144A** | 4,25 %  | 01.07.2029            | 1.396.177        | 0,25                         |
| 1.145.000  | Level 3 Financing Inc**                        | 3,88 %  | 15.11.2029            | 912.383          | 0,16                         |
| 1.170.000  | Level 3 Financing Inc**                        | 4,25 %  | 01.07.2028            | 754.610          | 0,13                         |
| 135.000  | Level 3 Financing Inc**                        | 4,63 %  | 15.09.2027            | 94.087           | 0,02                         |
| 945.000  | Level 3 Financing Inc 144A**                   | 4,63 %  | 15.09.2027            | 658.653          | 0,12                         |
| 450.000  | Leviathan Bond Ltd*                            | 6,75 %  | 30.06.2030            | 420.668          | 0,08                         |
| 680.000  | Lindblad Expeditions LLC**                     | 6,75 %  | 15.02.2027            | 648.339          | 0,12                         |
| 1.315.000  | Live Nation Entertainment Inc**                | 3,75 %  | 15.01.2028            | 1.176.925        | 0,21                         |
| 70.000   | Live Nation Entertainment Inc**                | 4,75 %  | 15.10.2027            | 65.382           | 0,01                         |
| 590.000  | Live Nation Entertainment Inc 144A**           | 4,75 %  | 15.10.2027            | 551.081          | 0,10                         |



## Global High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                   | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 94,72 % (31. Dezember 2022: 81,02 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 1.715.000  | LPL Holdings Inc**                                      | 4,00 % | 15.03.2029            | 1.506.307        | 0,27                         |
| 735.000  | LPL Holdings Inc**                                      | 4,63 % | 15.11.2027            | 689.884          | 0,12                         |
| 680.000  | Macy's Retail Holdings LLC*                             | 4,50 % | 15.12.2034            | 489.736          | 0,09                         |
| 150.000  | Macy's Retail Holdings LLC*                             | 5,13 % | 15.01.2042            | 102.271          | 0,02                         |
| 370.000  | Macy's Retail Holdings LLC**                            | 5,88 % | 01.04.2029            | 338.032          | 0,06                         |
| 1.225.000  | Macy's Retail Holdings LLC**                            | 5,88 % | 15.03.2030            | 1.092.933        | 0,19                         |
| 795.000  | Madison IAQ LLC**                                       | 4,13 % | 30.06.2028            | 700.745          | 0,13                         |
| 270.000  | Madison IAQ LLC**                                       | 5,88 % | 30.06.2029            | 219.013          | 0,04                         |
| 840.000  | Manitowoc Co Inc**                                      | 9,00 % | 01.04.2026            | 836.665          | 0,15                         |
| 1.960.000  | MARB BondCo Plc*  | 3,95 % | 29.01.2031            | 1.404.677        | 0,25                         |
| 1.175.000  | Masonite International Corp**                           | 3,50 % | 15.02.2030            | 989.776          | 0,18                         |
| 2.665.000  | Masonite International Corp**                           | 5,38 % | 01.02.2028            | 2.543.103        | 0,45                         |
| 530.000  | Mattamy Group Corp**                                    | 4,63 % | 01.03.2030            | 458.794          | 0,08                         |
| 200.000  | Mattamy Group Corp**                                    | 5,25 % | 15.12.2027            | 186.603          | 0,04                         |
| 1.120.000  | Mauser Packaging Solutions Holding Co**                 | 7,88 % | 15.08.2026            | 1.113.939        | 0,20                         |
| 2.320.000  | Mauser Packaging Solutions Holding Co**                 | 9,25 % | 15.04.2027            | 2.144.090        | 0,38                         |
| 1.623.338  | MC Brazil Downstream Trading Sarl**                     | 7,25 % | 30.06.2031            | 1.098.014        | 0,20                         |
| 120.000  | McAfee Corp**   | 7,38 % | 15.02.2030            | 104.453          | 0,02                         |
| 1.395.000  | McAfee Corp 144A**                                      | 7,38 % | 15.02.2030            | 1.214.428        | 0,21                         |
| 610.000  | McGraw-Hill Education Inc**                             | 5,75 % | 01.08.2028            | 529.248          | 0,09                         |
| 50.000   | McGraw-Hill Education Inc**                             | 8,00 % | 01.08.2029            | 42.720           | 0,01                         |
| 665.000  | McGraw-Hill Education Inc 144A**                        | 8,00 % | 01.08.2029            | 568.183          | 0,10                         |
| 3.090.000  | Medline Borrower LP**                                   | 3,88 % | 01.04.2029            | 2.688.325        | 0,48                         |
| 2.295.000  | Medline Borrower LP**                                   | 5,25 % | 01.10.2029            | 1.993.733        | 0,36                         |
| 1.120.000  | Meritage Homes Corp*                                    | 5,13 % | 06.06.2027            | 1.077.171        | 0,19                         |
| 550.000  | Midcontinent Communications/Midcontinent Finance Corp** | 5,38 % | 15.08.2027            | 515.974          | 0,09                         |
| 1.386.900  | Millicom International Cellular SA*                     | 6,25 % | 25.03.2029            | 1.244.800        | 0,22                         |
| 1.767.000  | Minerva Luxembourg SA*                                  | 4,38 % | 18.03.2031            | 1.384.787        | 0,24                         |
| 900.000  | MIWD Holdco II LLC/MIWD Finance Corp**                  | 5,50 % | 01.02.2030            | 743.661          | 0,13                         |
| 2.700.000  | Molina Healthcare Inc**                                 | 4,38 % | 15.06.2028            | 2.491.712        | 0,44                         |
| 375.000  | MPH Acquisition Holdings LLC**                          | 5,50 % | 01.09.2028            | 320.064          | 0,06                         |
| 500.000  | MPH Acquisition Holdings LLC**                          | 5,75 % | 01.11.2028            | 376.940          | 0,07                         |
| 510.000  | MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp*          | 3,50 % | 15.03.2031            | 351.914          | 0,06                         |
| 845.000  | MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp*          | 5,00 % | 15.10.2027            | 711.734          | 0,13                         |
| 1.125.000  | Mueller Water Products Inc**                            | 4,00 % | 15.06.2029            | 999.380          | 0,18                         |
| 1.060.000  | NCL Corp Ltd**  | 5,88 % | 15.02.2027            | 1.032.843        | 0,18                         |
| 355.000  | NCL Finance Ltd**                                       | 6,13 % | 15.03.2028            | 319.826          | 0,06                         |
| 2.060.000  | Nemak SAB de CV**                                       | 3,63 % | 28.06.2031            | 1.611.661        | 0,29                         |
| 1.455.000  | Neptune Bidco US Inc**                                  | 9,29 % | 15.04.2029            | 1.337.323        | 0,24                         |
| 600.000  | Network i2i Ltd*  | 5,65 % | 29.12.2049            | 584.250          | 0,10                         |

## Global High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung  | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 94,72 % (31. Dezember 2022: 81,02 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |         |                       |                  |                              |
| 905.000  | New Fortress Energy Inc**  | 6,50 %  | 30.09.2026            | 810.668          | 0,14                         |
| 2.045.000  | New Fortress Energy Inc**  | 6,75 %  | 15.09.2025            | 1.920.521        | 0,34                         |
| 780.000  | NextEra Energy Operating Partners LP**   | 3,88 %  | 15.10.2026            | 725.576          | 0,13                         |
| 75.000   | NextEra Energy Operating Partners LP**   | 4,50 %  | 15.09.2027            | 69.743           | 0,01                         |
| 1.255.000  | NextEra Energy Operating Partners LP 144A**                                    | 4,50 %  | 15.09.2027            | 1.167.025        | 0,21                         |
| 245.000  | NMG Holding Co Inc/Neiman Marcus Group LLC**                                   | 7,13 %  | 01.04.2026            | 228.307          | 0,04                         |
| 1.095.000  | Noble Finance II LLC**   | 8,00 %  | 15.04.2030            | 1.114.398        | 0,20                         |
| 580.000  | Northwest Fiber LLC/Northwest Fiber Finance Sub Inc**                          | 4,75 %  | 30.04.2027            | 512.778          | 0,09                         |
| 395.000  | Northwest Fiber LLC/Northwest Fiber Finance Sub Inc**                          | 10,75 % | 01.06.2028            | 362.934          | 0,06                         |
| 610.000  | NOVA Chemicals Corp**  | 4,88 %  | 01.06.2024            | 596.507          | 0,11                         |
| 1.560.000  | Novelis Corp**   | 4,75 %  | 30.01.2030            | 1.387.873        | 0,25                         |
| 905.000  | Occidental Petroleum Corp*   | 4,40 %  | 15.04.2046            | 700.182          | 0,13                         |
| 1.235.000  | Occidental Petroleum Corp**  | 4,50 %  | 15.07.2044            | 948.597          | 0,17                         |
| 1.150.000  | Occidental Petroleum Corp**  | 6,45 %  | 15.09.2036            | 1.181.878        | 0,21                         |
| 615.000  | Olympus Water US Holding Corp**  | 6,25 %  | 01.10.2029            | 445.384          | 0,08                         |
| 450.000  | Olympus Water US Holding Corp**  | 7,13 %  | 01.10.2027            | 406.124          | 0,07                         |
| 675.000  | Olympus Water US Holding Corp**  | 9,75 %  | 15.11.2028            | 659.171          | 0,12                         |
| 920.000  | OneMain Finance Corp*  | 3,50 %  | 15.01.2027            | 790.252          | 0,14                         |
| 720.000  | OneMain Finance Corp*  | 5,38 %  | 15.11.2029            | 612.798          | 0,11                         |
| 1.320.000  | OneMain Finance Corp*  | 6,63 %  | 15.01.2028            | 1.246.436        | 0,22                         |
| 70.000   | OneMain Finance Corp**   | 6,88 %  | 15.03.2025            | 69.373           | 0,01                         |
| 130.000  | OneMain Finance Corp**   | 7,13 %  | 15.03.2026            | 127.842          | 0,03                         |
| 1.665.000  | Open Text Holdings Inc**   | 4,13 %  | 15.02.2030            | 1.411.427        | 0,25                         |
| 1.767.000  | Oztel Holdings SPC Ltd*  | 6,63 %  | 24.04.2028            | 1.836.731        | 0,33                         |
| 780.000  | Pactiv Evergreen Group Issuer Inc/Pactiv Evergreen Group Issuer LLC**          | 4,00 %  | 15.10.2027            | 690.683          | 0,12                         |
| 1.193.000  | Pampa Energia SA*  | 7,50 %  | 24.01.2027            | 1.132.894        | 0,20                         |
| 1.045.000  | Park Intermediate Holdings LLC/PK Domestic Property LLC/PK Finance Co-Issuer** | 5,88 %  | 01.10.2028            | 959.994          | 0,17                         |
| 1.250.000  | Park Intermediate Holdings LLC/PK Domestic Property LLC/PK Finance Co-Issuer** | 7,50 %  | 01.06.2025            | 1.251.375        | 0,23                         |
| 1.740.000  | Performance Food Group Inc**   | 4,25 %  | 01.08.2029            | 1.550.924        | 0,28                         |
| 300.000  | Performance Food Group Inc**   | 5,50 %  | 15.10.2027            | 289.494          | 0,05                         |
| 400.000  | Periama Holdings LLC*  | 5,95 %  | 19.04.2026            | 386.162          | 0,07                         |
| 1.429.000  | Petrobras Global Finance BV**  | 6,50 %  | 03.07.2033            | 1.400.420        | 0,25                         |
| 1.430.000  | PetSmart Inc/PetSmart Finance Corp**   | 7,75 %  | 15.02.2029            | 1.422.476        | 0,25                         |
| 2.535.000  | Presidio Holdings Inc**  | 8,25 %  | 01.02.2028            | 2.417.011        | 0,43                         |
| 3.075.000  | Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc**                       | 5,75 %  | 15.04.2026            | 3.021.272        | 0,54                         |
| 2.485.000  | Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc**                       | 6,25 %  | 15.01.2028            | 2.331.543        | 0,42                         |
| 1.715.000  | Rackspace Technology Global Inc**  | 3,50 %  | 15.02.2028            | 773.582          | 0,14                         |
| 2.020.000  | Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp**                                     | 5,25 %  | 15.04.2030            | 1.437.825        | 0,26                         |
| 1.530.000  | Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp**                                     | 5,75 %  | 15.01.2029            | 1.146.502        | 0,20                         |
| 992.000  | Rede D'or Finance Sarl**   | 4,50 %  | 22.01.2030            | 846.424          | 0,15                         |

## Global High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung  | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 94,72 % (31. Dezember 2022: 81,02 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |        |                       |                  |                              |
| 920.000  | Regal REXNORD Corp**   | 6,05 % | 15.02.2026            | 921.697          | 0,17                         |
| 1.075.000  | Regal REXNORD Corp**   | 6,05 % | 15.04.2028            | 1.068.124        | 0,19                         |
| 692.000  | ReNew Wind Energy AP2/ReNew Power Pvt Ltd other 9 Subsidiaries** | 4,50 % | 14.07.2028            | 590.405          | 0,10                         |
| 1.370.000  | Resideo Funding Inc**  | 4,00 % | 01.09.2029            | 1.138.149        | 0,20                         |
| 585.000  | RHP Hotel Properties LP/RHP Finance Corp**                       | 4,50 % | 15.02.2029            | 518.251          | 0,09                         |
| 1.560.000  | RHP Hotel Properties LP/RHP Finance Corp**                       | 4,75 % | 15.10.2027            | 1.454.138        | 0,26                         |
| 645.000  | RHP Hotel Properties LP/RHP Finance Corp**                       | 7,25 % | 15.07.2028            | 652.179          | 0,12                         |
| 1.155.000  | Ritchie Bros Holdings Inc**                                      | 6,75 % | 15.03.2028            | 1.165.590        | 0,21                         |
| 1.120.000  | Ritchie Bros Holdings Inc**                                      | 7,75 % | 15.03.2031            | 1.163.317        | 0,21                         |
| 500.000  | RKPF Overseas 2020 A Ltd*  | 5,20 % | 12.01.2026            | 268.256          | 0,05                         |
| 555.000  | Rockcliff Energy II LLC**  | 5,50 % | 15.10.2029            | 512.526          | 0,09                         |
| 705.000  | Royal Caribbean Cruises Ltd**                                    | 5,38 % | 15.07.2027            | 659.949          | 0,12                         |
| 680.000  | Royal Caribbean Cruises Ltd**                                    | 5,50 % | 31.08.2026            | 645.352          | 0,11                         |
| 1.000.000  | Royal Caribbean Cruises Ltd**                                    | 5,50 % | 01.04.2028            | 933.535          | 0,17                         |
| 1.265.000  | Royal Caribbean Cruises Ltd**                                    | 8,25 % | 15.01.2029            | 1.329.204        | 0,24                         |
| 365.000  | Royal Caribbean Cruises Ltd*                                     | 9,25 % | 15.01.2029            | 389.213          | 0,07                         |
| 770.000  | Rumo Luxembourg Sarl**   | 5,25 % | 10.01.2028            | 716.100          | 0,13                         |
| 550.000  | Ryan Specialty LLC**   | 4,38 % | 01.02.2030            | 487.548          | 0,09                         |
| 1.750.000  | Sasol Financing USA LLC*   | 6,50 % | 27.09.2028            | 1.566.450        | 0,28                         |
| 390.000  | Sasol Financing USA LLC*   | 8,75 % | 03.05.2029            | 380.331          | 0,07                         |
| 1.675.000  | Sealed Air Corp/Sealed Air Corp US**                             | 6,13 % | 01.02.2028            | 1.664.477        | 0,30                         |
| 3.125.000  | Sensata Technologies BV**  | 4,00 % | 15.04.2029            | 2.784.952        | 0,50                         |
| 615.000  | Sensata Technologies BV**  | 5,88 % | 01.09.2030            | 598.610          | 0,11                         |
| 1.349.000  | SEPLAT Energy Plc*   | 7,75 % | 01.04.2026            | 1.137.234        | 0,20                         |
| 555.000  | Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp**                          | 4,75 % | 15.02.2028            | 493.029          | 0,09                         |
| 740.000  | Shriram Finance Ltd*   | 4,40 % | 13.03.2024            | 724.144          | 0,13                         |
| 1.432.000  | SierraCol Energy Andina LLC**                                    | 6,00 % | 15.06.2028            | 1.054.346        | 0,19                         |
| 500.000  | Sino-Ocean Land Treasure IV Ltd*                                 | 2,70 % | 13.01.2025            | 158.750          | 0,03                         |
| 785.000  | Sirius XM Radio Inc**  | 3,13 % | 01.09.2026            | 703.620          | 0,13                         |
| 415.000  | Sirius XM Radio Inc**  | 3,88 % | 01.09.2031            | 321.313          | 0,06                         |
| 2.670.000  | Solaris Midstream Holdings LLC**                                 | 7,63 % | 01.04.2026            | 2.586.547        | 0,46                         |
| 785.000  | Southwestern Energy Co*  | 4,75 % | 01.02.2032            | 692.968          | 0,12                         |
| 815.000  | SPCM SA**  | 3,13 % | 15.03.2027            | 731.628          | 0,13                         |
| 445.000  | Sprint Capital Corp**  | 8,75 % | 15.03.2032            | 538.326          | 0,09                         |
| 820.000  | Sprint LLC**   | 7,88 % | 15.09.2023            | 822.718          | 0,15                         |
| 1.685.000  | SPX FLOW Inc**   | 8,75 % | 01.04.2030            | 1.518.435        | 0,27                         |
| 1.820.000  | SRS Distribution Inc**   | 6,13 % | 01.07.2029            | 1.574.185        | 0,28                         |
| 1.260.000  | Standard Industries Inc**  | 3,38 % | 15.01.2031            | 1.015.740        | 0,18                         |
| 1.025.000  | Standard Industries Inc**  | 5,00 % | 15.02.2027            | 977.860          | 0,18                         |
| 745.000  | Starwood Property Trust Inc**                                    | 3,63 % | 15.07.2026            | 642.034          | 0,11                         |

## Global High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 94,72 % (31. Dezember 2022: 81,02 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 355.000  | Starwood Property Trust Inc**                                 | 4,38 %  | 15.01.2027            | 306.076          | 0,06                         |
| 2.660.000  | Summit Midstream Holdings LLC/Summit Midstream Finance Corp** | 9,00 %  | 15.10.2026            | 2.586.384        | 0,46                         |
| 1.855.000  | Sunnova Energy Corp**   | 5,88 %  | 01.09.2026            | 1.697.136        | 0,30                         |
| 2.020.000  | Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**  | 6,00 %  | 31.12.2030            | 1.782.125        | 0,32                         |
| 1.385.000  | Taylor Morrison Communities Inc**                             | 5,13 %  | 01.08.2030            | 1.280.019        | 0,23                         |
| 205.000  | Taylor Morrison Communities Inc**                             | 5,88 %  | 15.06.2027            | 201.535          | 0,04                         |
| 910.000  | Taylor Morrison Communities Inc**                             | 6,63 %  | 15.07.2027            | 904.185          | 0,16                         |
| 185.000  | Telecom Italia Capital SA**                                   | 7,20 %  | 18.07.2036            | 159.242          | 0,03                         |
| 616.000  | Telecomunicaciones Digitales SA**                             | 4,50 %  | 30.01.2030            | 524.411          | 0,09                         |
| 370.000  | Tenet Healthcare Corp*  | 4,25 %  | 01.06.2029            | 334.623          | 0,06                         |
| 1.740.000  | Tenet Healthcare Corp**                                       | 4,88 %  | 01.01.2026            | 1.696.490        | 0,30                         |
| 1.420.000  | Tenet Healthcare Corp**                                       | 6,13 %  | 01.10.2028            | 1.368.397        | 0,24                         |
| 1.020.000  | Tenet Healthcare Corp**                                       | 6,25 %  | 01.02.2027            | 1.010.691        | 0,18                         |
| 1.520.000  | Tenet Healthcare Corp**                                       | 6,75 %  | 15.05.2031            | 1.525.602        | 0,27                         |
| 1.420.000  | TerraForm Power Operating LLC**                               | 5,00 %  | 31.01.2028            | 1.308.729        | 0,23                         |
| 700.000  | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV*               | 4,10 %  | 01.10.2046            | 461.127          | 0,08                         |
| 1.455.000  | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV**              | 7,88 %  | 15.09.2029            | 1.501.243        | 0,27                         |
| 230.000  | TK Elevator US Newco Inc**                                    | 5,25 %  | 15.07.2027            | 212.764          | 0,04                         |
| 1.843.000  | Total Play Telecomunicaciones SA de CV*                       | 6,38 %  | 20.09.2028            | 1.072.326        | 0,19                         |
| 830.000  | TransDigm Inc*  | 4,63 %  | 15.01.2029            | 739.304          | 0,13                         |
| 150.000  | TransDigm Inc**   | 6,25 %  | 15.03.2026            | 149.393          | 0,03                         |
| 2.860.000  | TransDigm Inc 144A**  | 6,25 %  | 15.03.2026            | 2.848.596        | 0,51                         |
| 1.965.000  | TransDigm Inc**   | 6,75 %  | 15.08.2028            | 1.974.904        | 0,35                         |
| 980.000  | TransDigm Inc*  | 7,50 %  | 15.03.2027            | 982.592          | 0,18                         |
| 545.000  | TreeHouse Foods Inc*  | 4,00 %  | 01.09.2028            | 470.180          | 0,08                         |
| 710.000  | TRI Pointe Group Inc/TRI Pointe Homes Inc*                    | 5,88 %  | 15.06.2024            | 705.314          | 0,13                         |
| 1.225.000  | Tri Pointe Homes Inc*   | 5,70 %  | 15.06.2028            | 1.184.453        | 0,21                         |
| 545.000  | Trident TPI Holdings Inc**                                    | 12,75 % | 31.12.2028            | 565.846          | 0,10                         |
| 885.000  | Trivium Packaging Finance BV*                                 | 5,50 %  | 15.08.2026            | 850.887          | 0,15                         |
| 1.585.000  | Trivium Packaging Finance BV*                                 | 8,50 %  | 15.08.2027            | 1.527.681        | 0,27                         |
| 616.000  | Turk Telekomunikasyon AS*                                     | 4,88 %  | 19.06.2024            | 588.342          | 0,10                         |
| 616.000  | Turkcell Iletisim Hizmetleri AS*                              | 5,80 %  | 11.04.2028            | 548.449          | 0,10                         |
| 95.000   | United Airlines Inc**   | 4,38 %  | 15.04.2026            | 90.302           | 0,02                         |
| 1.070.000  | United Airlines Inc 144A**                                    | 4,38 %  | 15.04.2026            | 1.017.576        | 0,18                         |
| 1.510.000  | United Airlines Inc**   | 4,63 %  | 15.04.2029            | 1.377.222        | 0,24                         |
| 2.430.000  | United Rentals North America Inc*                             | 3,75 %  | 15.01.2032            | 2.060.796        | 0,37                         |
| 270.000  | United Rentals North America Inc*                             | 3,88 %  | 15.02.2031            | 234.009          | 0,04                         |
| 180.000  | United Rentals North America Inc*                             | 4,88 %  | 15.01.2028            | 171.455          | 0,03                         |
| 1.225.000  | United Rentals North America Inc*                             | 5,25 %  | 15.01.2030            | 1.170.458        | 0,21                         |
| 830.000  | United Rentals North America Inc**                            | 6,00 %  | 15.12.2029            | 828.855          | 0,15                         |

## Global High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                     | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|---------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 94,72 % (31. Dezember 2022: 81,02 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                    |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                    |                              |
| 380.000  | Uniti Group LP/Uniti Group Finance Inc/CSL Capital LLC**  | 4,75 %  | 15.04.2028            | 315.706            | 0,05                         |
| 545.000  | Uniti Group LP/Uniti Group Finance Inc/CSL Capital LLC**  | 10,50 % | 15.02.2028            | 541.165            | 0,10                         |
| 1.895.000  | Univar Solutions USA Inc**                                | 5,13 %  | 01.12.2027            | 1.938.994          | 0,34                         |
| 635.000  | US Foods Inc**  | 4,63 %  | 01.06.2030            | 569.750            | 0,10                         |
| 785.000  | US Foods Inc**  | 4,75 %  | 15.02.2029            | 719.475            | 0,13                         |
| 135.000  | US Foods Inc**  | 6,25 %  | 15.04.2025            | 135.066            | 0,03                         |
| 1.500.000  | Vedanta Resources Finance II Plc*                         | 13,88 % | 21.01.2024            | 1.369.972          | 0,25                         |
| 815.000  | Vibrant Technologies Inc**                                | 9,00 %  | 15.02.2030            | 625.488            | 0,11                         |
| 630.000  | Victoria's Secret & Co**                                  | 4,63 %  | 15.07.2029            | 461.026            | 0,08                         |
| 1.085.000  | Virgin Media Secured Finance Plc*                         | 5,50 %  | 15.05.2029            | 982.460            | 0,17                         |
| 1.720.000  | VistaJet Malta Finance Plc/Vista Management Holding Inc** | 6,38 %  | 01.02.2030            | 1.386.547          | 0,25                         |
| 1.125.000  | VistaJet Malta Finance Plc/Vista Management Holding Inc** | 7,88 %  | 01.05.2027            | 1.011.797          | 0,18                         |
| 560.000  | VistaJet Malta Finance Plc/Vista Management Holding Inc** | 9,50 %  | 01.06.2028            | 514.682            | 0,09                         |
| 1.150.000  | Vistra Operations Co LLC**                                | 4,38 %  | 01.05.2029            | 1.008.386          | 0,18                         |
| 365.000  | Vistra Operations Co LLC**                                | 5,63 %  | 15.02.2027            | 350.172            | 0,06                         |
| 1.800.000  | VM Consolidated Inc**                                     | 5,50 %  | 15.04.2029            | 1.662.066          | 0,30                         |
| 785.000  | Vmed O2 UK Financing I Plc**                              | 4,25 %  | 31.01.2031            | 635.425            | 0,11                         |
| 501.000  | VTR Finance NV**  | 6,38 %  | 15.07.2028            | 192.869            | 0,03                         |
| 1.650.000  | White Cap Parent LLC**                                    | 8,25 %  | 15.03.2026            | 1.582.292          | 0,28                         |
| 1.075.000  | Windsor Holdings III LLC**                                | 8,50 %  | 15.06.2030            | 1.071.313          | 0,19                         |
| 2.485.000  | WMG Acquisition Corp**                                    | 3,75 %  | 01.12.2029            | 2.150.668          | 0,38                         |
| 1.400.000  | WR Grace Holdings LLC**                                   | 5,63 %  | 15.08.2029            | 1.148.350          | 0,20                         |
| 1.820.000  | XPO Inc**   | 6,25 %  | 01.06.2028            | 1.792.886          | 0,32                         |
| 1.150.000  | XPO Inc**   | 7,13 %  | 01.06.2031            | 1.160.148          | 0,21                         |
| 300.000  | Yanlord Land HK Co Ltd*                                   | 5,13 %  | 20.05.2026            | 247.035            | 0,04                         |
| 800.000  | Yapi ve Kredi Bankasi AS*                                 | 5,85 %  | 21.06.2024            | 781.008            | 0,14                         |
| 500.000  | YPF SA**  | 7,00 %  | 15.12.2047            | 340.460            | 0,06                         |
| 500.000  | YPF SA*   | 8,50 %  | 27.06.2029            | 426.187            | 0,08                         |
| 3.155.000  | Yum! Brands Inc*  | 3,63 %  | 15.03.2031            | 2.728.570          | 0,49                         |
| 360.000  | ZF North America Capital Inc**                            | 6,88 %  | 14.04.2028            | 364.926            | 0,07                         |
| 2.295.000  | ZF North America Capital Inc**                            | 7,13 %  | 14.04.2030            | 2.336.629          | 0,42                         |
| 190.000  | Ziff Davis Inc**  | 4,63 %  | 15.10.2030            | 164.745            | 0,03                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |   |         |                       | <b>395.655.576</b> | <b>70,57</b>                 |
| <b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>  |   |         |                       | <b>531.160.752</b> | <b>94,72</b>                 |
| <b>Mittelfristige Schuldverschreibungen 0,21 % (31. Dezember 2022: 0,31 %)</b> |   |         |                       |                    |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |   |         |                       |                    |                              |
| 1.208.019  | Starwood Property Mortgage LLC                            | 8,45 %  | 26.07.2026            | 1.179.329          | 0,21                         |
| <b>Mittelfristige Schuldverschreibungen insgesamt †</b>                        |   |         |                       | <b>1.179.329</b>   | <b>0,21</b>                  |
| <b>Anlagen insgesamt</b>   |   |         |                       | <b>532.340.081</b> | <b>94,93</b>                 |

## Global High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 0,34 % (31. Dezember 2022: 3,82 %)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens        |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|-----------------------------|
| 85.637 €   | 93.263 US\$         | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | 239                            | 0,00                        |
| 1.126.146 €  | 964.639 £           | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | 3.055                          | 0,00                        |
| 267.965 £  | 334.838 US\$        | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | 5.876                          | 0,00                        |
| 2.286.868 US\$   | 2.075.333 €         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | 20.918                         | 0,00                        |
| 104.615.308 US\$   | 94.961.280 €        | 20.07.2023       | UBS AG                      | 3         | 931.979                        | 0,17                        |
| 15.640.812 US\$  | 14.135.718 €        | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 2         | 206.749                        | 0,04                        |
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 318 AUD  | 211 US\$            | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | 1                              | 0,00                        |
| 209 US\$   | 309 AUD             | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | 4                              | 0,00                        |
| 282 US\$   | 421 AUD             | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 2         | 2                              | 0,00                        |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 65.497.988 CHF   | 73.199.388 US\$     | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 23        | 129.789                        | 0,02                        |
| 1.345.317 US\$   | 1.191.316 CHF       | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 33        | 11.563                         | 0,00                        |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 741.935 €  | 796.851 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | 13.230                         | 0,00                        |
| 376.934 €  | 408.472 US\$        | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 21        | 3.083                          | 0,00                        |
| 26.726.550 US\$  | 24.327.262 €        | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 39        | 164.866                        | 0,03                        |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 173.149 £  | 216.756 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | 3.401                          | 0,00                        |
| 146.507 £  | 182.266 US\$        | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | 4.016                          | 0,00                        |
| 18.104.484 £   | 22.601.277 US\$     | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 60        | 418.360                        | 0,08                        |
| 221.440 US\$   | 173.978 £           | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 6         | 230                            | 0,00                        |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>o</sup></b>                        |                     |                  |                             |           | <b>1.917.361</b>               | <b>0,34</b>                 |
|  |                     |                  |                             |           | <b>Zeitwert US\$</b>           | <b>% des Nettovermögens</b> |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> |                     |                  |                             |           | <b>534.257.442</b>             | <b>95,27</b>                |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (0,27 %) (31. Dezember 2022: (2,80 %))

| Geforderter Betrag              | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 1.482.619 €                     | 1.632.197 US\$      | 20.07.2023       | UBS AG                      | 2         | (13.402)                        | (0,00)               |
| 109.506 €                       | 120.000 US\$        | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 1         | (436)                           | (0,00)               |
| 20.092.861 US\$                 | 16.084.940 £        | 20.07.2023       | UBS AG                      | 5         | (358.951)                       | (0,07)               |
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 232 AUD                         | 159 US\$            | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (5)                             | (0,00)               |
| 19.945 AUD                      | 13.442 US\$         | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | (159)                           | (0,00)               |
| 20.146 AUD                      | 13.571 US\$         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 2         | (156)                           | (0,00)               |
| 219 US\$                        | 336 AUD             | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (5)                             | (0,00)               |

## Global High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (0,27 %) (31. Dezember 2022: (2,80 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 905.544 CHF  | 1.018.224 US\$      | 20.07.2023       | UBS AG                      | 2         | (4.410)                         | (0,00)               |
| 18.226.153 CHF   | 20.630.146 US\$     | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 18        | (224.803)                       | (0,05)               |
| 497.338 US\$   | 445.154 CHF         | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | (1.041)                         | (0,00)               |
| 1.617.337 US\$   | 1.454.855 CHF       | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 32        | (11.465)                        | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 1.307.204 €  | 1.435.709 US\$      | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 2         | (8.441)                         | (0,00)               |
| 50.170.163 €   | 55.009.327 US\$     | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | (231.110)                       | (0,04)               |
| 65.945.654 €   | 72.653.033 US\$     | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 22        | (650.371)                       | (0,11)               |
| 1.237.222 US\$   | 1.136.147 €         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 2         | (3.279)                         | (0,00)               |
| 2.145.751 US\$   | 1.987.072 €         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 31        | (23.832)                        | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 106.910 £  | 137.012 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (1.078)                         | (0,00)               |
| 74.022 £   | 94.685 US\$         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 6         | (565)                           | (0,00)               |
| 130.459 US\$   | 105.119 £           | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (3.199)                         | (0,00)               |
| 472.344 US\$   | 379.057 £           | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 29        | (9.621)                         | (0,00)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                             |           | <b>(1.546.329)</b>              | <b>(0,27)</b>        |

|   | Zeitwert US\$      | % des Nettovermögens |
|---|--------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(1.546.329)</b> | <b>(0,27)</b>        |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>532.711.113</b> | <b>95,00</b>         |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>27.989.241</b>  | <b>5,00</b>          |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>560.700.354</b> | <b>100,00</b>        |

| Portfolioanalyse  | US\$               | % des Gesamtvermögens |
|---|--------------------|-----------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 170.056.339        | 29,77                 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden            | 361.104.413        | 63,21                 |
| † Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente  | 1.179.329          | 0,21                  |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente   | 371.032            | 0,06                  |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>532.711.113</b> | <b>93,25</b>          |

## Global High Yield Sustainable Action - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte 0,00 % (31. Dezember 2022: 0,05 %)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens        |
|--|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|-----------------------------|
| 4.241.292 €  | 4.613.339 US\$      | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 1         | 17.509                         | 0,00                        |
| 130.953 €  | 142.481 US\$        | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 500                            | 0,00                        |
| 8.885 £  | 10.000 €            | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | 379                            | 0,00                        |
| 4.771.490 US\$   | 4.347.239 €         | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | 24.964                         | 0,00                        |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>                        |                     |                  |                                |           | <b>43.352</b>                  | <b>0,00</b>                 |
|  |                     |                  |                                |           | <b>Zeitwert US\$</b>           | <b>% des Nettovermögens</b> |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> |                     |                  |                                |           | <b>43.352</b>                  | <b>0,00</b>                 |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,00 %) (31. Dezember 2022: (2,38 %))

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens        |
|---|---------------------|------------------|-------------|-----------|---------------------------------|-----------------------------|
| 880.506 €   | 775.730 £           | 20.07.2023       | UBS AG      | 1         | (24.953)                        | (0,00)                      |
| 41.240 £  | 48.153 €            | 20.07.2023       | Citibank NA | 1         | (139)                           | (0,00)                      |
| 725.605 £   | 847.359 €           | 20.07.2023       | UBS AG      | 1         | (2.590)                         | (0,00)                      |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>                          |                     |                  |             |           | <b>(27.682)</b>                 | <b>(0,00)</b>               |
|   |                     |                  |             |           | <b>Zeitwert US\$</b>            | <b>% des Nettovermögens</b> |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> |                     |                  |             |           | <b>(27.682)</b>                 | <b>(0,00)</b>               |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              |                     |                  |             |           | <b>15.670</b>                   | <b>0,00</b>                 |
| <b>Sonstige Nettoverbindlichkeiten</b>  |                     |                  |             |           | <b>(15.670)</b>                 | <b>(0,00)</b>               |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   |                     |                  |             |           | <b>0</b>                        | <b>0,00</b>                 |

| Portfolioanalyse   | US\$          | % des Gesamtvermögens |
|--|---------------|-----------------------|
| <sup>∞</sup> OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente | 15.670        | 9,39                  |
| <b>Anlagen insgesamt</b>                                 | <b>15.670</b> | <b>9,39</b>           |



## Global Investment Grade Credit - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                   | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 95,49 % (31. Dezember 2022: 94,02 %)</b> |   |        |                       |                  |                              |
| <b>Kanadischer Dollar</b>  |   |        |                       |                  |                              |
| 455.000  | Bell Telephone Co of Canada or Bell Canada <sup>†</sup> | 2,50 % | 14.05.2030            | 294.028          | 0,36                         |
| 195.000  | Bell Telephone Co of Canada or Bell Canada <sup>†</sup> | 4,45 % | 27.02.2047            | 131.073          | 0,16                         |
| 455.000  | Canadian Pacific Railway Co <sup>†</sup>                | 2,54 % | 28.02.2028            | 311.495          | 0,38                         |
| 455.000  | Enbridge Inc <sup>†</sup>                               | 4,24 % | 27.08.2042            | 291.637          | 0,36                         |
| 410.000  | TELUS Corp <sup>†</sup>                                 | 2,75 % | 08.07.2026            | 289.123          | 0,36                         |
| 325.000  | TELUS Corp <sup>*</sup>                                 | 4,40 % | 01.04.2043            | 214.755          | 0,26                         |
| 620.000  | Thomson Reuters Corp <sup>†</sup>                       | 2,24 % | 14.05.2025            | 442.108          | 0,54                         |
| <b>Kanadischer Dollar insgesamt</b>                              |   |        |                       | <b>1.974.219</b> | <b>2,42</b>                  |
| <b>Euro</b>  |   |        |                       |                  |                              |
| 100.000  | ABN AMRO Bank NV <sup>*</sup>                           | 0,60 % | 15.01.2027            | 95.892           | 0,12                         |
| 200.000  | ABN AMRO Bank NV <sup>*</sup>                           | 5,50 % | 21.09.2033            | 216.925          | 0,27                         |
| 100.000  | Achmea BV <sup>*</sup>                                  | 6,75 % | 26.12.2043            | 109.965          | 0,14                         |
| 200.000  | Allianz SE <sup>*</sup>                                 | 5,82 % | 25.07.2053            | 224.450          | 0,28                         |
| 439.000  | American Tower Corp <sup>*</sup>                        | 0,88 % | 21.05.2029            | 390.609          | 0,48                         |
| 150.000  | American Tower Corp <sup>*</sup>                        | 0,95 % | 05.10.2030            | 128.626          | 0,16                         |
| 200.000  | American Tower Corp <sup>*</sup>                        | 4,13 % | 16.05.2027            | 215.898          | 0,27                         |
| 250.000  | Anheuser-Busch InBev SA <sup>*</sup>                    | 2,75 % | 17.03.2036            | 246.392          | 0,30                         |
| 200.000  | Aroundtown SA <sup>*</sup>                              | 1,00 % | 07.01.2025            | 198.600          | 0,24                         |
| 400.000  | Aroundtown SA <sup>*</sup>                              | 1,45 % | 09.07.2028            | 296.886          | 0,36                         |
| 700.000  | Aroundtown SA <sup>*</sup>                              | 1,63 % | 31.01.2028            | 541.295          | 0,66                         |
| 200.000  | AstraZeneca Plc <sup>*</sup>                            | 3,75 % | 03.03.2032            | 220.319          | 0,27                         |
| 300.000  | AT&T Inc <sup>*</sup>                                   | 2,45 % | 15.03.2035            | 273.747          | 0,34                         |
| 300.000  | AT&T Inc <sup>*</sup>                                   | 4,30 % | 18.11.2034            | 328.647          | 0,40                         |
| 300.000  | ATF Netherlands BV <sup>*</sup>                         | 7,08 % | 29.12.2049            | 142.180          | 0,17                         |
| 190.000  | Athene Global Funding <sup>*</sup>                      | 0,83 % | 08.01.2027            | 177.625          | 0,22                         |
| 157.000  | AusNet Services Holdings Pty Ltd <sup>*</sup>           | 1,63 % | 11.03.2081            | 146.164          | 0,18                         |
| 100.000  | Australia & New Zealand Banking Group Ltd <sup>*</sup>  | 5,10 % | 03.02.2033            | 107.262          | 0,13                         |
| 100.000  | Banco Santander SA <sup>*</sup>                         | 5,75 % | 23.08.2033            | 108.445          | 0,13                         |
| 500.000  | Bank of America Corp <sup>*</sup>                       | 1,95 % | 27.10.2026            | 513.369          | 0,63                         |
| 133.000  | Bank of America Corp <sup>*</sup>                       | 2,82 % | 27.04.2033            | 129.395          | 0,16                         |
| 100.000  | Banque Federative du Credit Mutuel SA <sup>*</sup>      | 3,88 % | 16.06.2032            | 102.190          | 0,13                         |
| 100.000  | Banque Federative du Credit Mutuel SA <sup>*</sup>      | 4,38 % | 02.05.2030            | 108.386          | 0,13                         |
| 185.000  | Bayer AG <sup>*</sup>                                   | 4,63 % | 26.05.2033            | 205.270          | 0,25                         |
| 100.000  | BP Capital Markets Plc <sup>*</sup>                     | 1,10 % | 15.11.2034            | 79.568           | 0,10                         |
| 562.000  | BP Capital Markets Plc <sup>*</sup>                     | 3,63 % | 29.12.2049            | 535.120          | 0,66                         |
| 100.000  | BPCE SA <sup>*</sup>                                    | 4,75 % | 14.06.2034            | 109.589          | 0,13                         |
| 100.000  | BPCE SA <sup>*</sup>                                    | 5,13 % | 25.01.2035            | 105.843          | 0,13                         |
| 200.000  | BPCE SA <sup>*</sup>                                    | 5,75 % | 01.06.2033            | 218.152          | 0,27                         |

## Global Investment Grade Credit - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                           | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 95,49 % (31. Dezember 2022: 94,02 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                  |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |   |        |                       |                  |                              |
| 100.000  | Commerzbank AG <sup>*</sup>                     | 5,13 % | 18.01.2030            | 108.987          | 0,13                         |
| 136.000  | Digital Dutch Finco BV <sup>*</sup>             | 1,00 % | 15.01.2032            | 104.947          | 0,13                         |
| 310.000  | Digital Dutch Finco BV <sup>*</sup>             | 1,25 % | 01.02.2031            | 252.936          | 0,31                         |
| 322.000  | Discovery Communications LLC <sup>*</sup>       | 1,90 % | 19.03.2027            | 321.197          | 0,39                         |
| 100.000  | Duke Energy Corp <sup>*</sup>                   | 3,85 % | 15.06.2034            | 99.846           | 0,12                         |
| 100.000  | Electricite de France SA <sup>*</sup>           | 4,75 % | 12.10.2034            | 110.654          | 0,14                         |
| 100.000  | Elia Group SA <sup>*</sup>                      | 5,85 % | 29.12.2049            | 109.641          | 0,13                         |
| 100.000  | Enel SpA <sup>*</sup>                           | 6,63 % | 29.12.2049            | 110.002          | 0,14                         |
| 100.000  | Fiserv Inc <sup>*</sup>                         | 4,50 % | 24.05.2031            | 109.775          | 0,14                         |
| 453.000  | General Motors Financial Co Inc <sup>*</sup>    | 0,85 % | 26.02.2026            | 450.598          | 0,55                         |
| 165.000  | Global Payments Inc <sup>*</sup>                | 4,88 % | 17.03.2031            | 179.480          | 0,22                         |
| 45.000   | Goldman Sachs Group Inc <sup>*</sup>            | 1,25 % | 07.02.2029            | 41.676           | 0,05                         |
| 120.000  | Heimstaden Bostad Treasury BV <sup>*</sup>      | 0,63 % | 24.07.2025            | 108.716          | 0,13                         |
| 640.000  | Heimstaden Bostad Treasury BV <sup>*</sup>      | 1,38 % | 24.07.2028            | 471.631          | 0,58                         |
| 410.000  | HSBC Holdings Plc <sup>*</sup>                  | 4,79 % | 10.03.2032            | 449.321          | 0,55                         |
| 100.000  | ING Groep NV <sup>*</sup>                       | 4,13 % | 24.08.2033            | 102.993          | 0,13                         |
| 200.000  | ING Groep NV <sup>*</sup>                       | 4,75 % | 23.05.2034            | 218.747          | 0,27                         |
| 150.000  | Intesa Sanpaolo SpA <sup>**</sup>               | 5,63 % | 08.03.2033            | 163.542          | 0,20                         |
| 100.000  | Linde Plc <sup>*</sup>                          | 3,63 % | 12.06.2034            | 108.455          | 0,13                         |
| 160.000  | McDonald's Corp <sup>*</sup>                    | 4,25 % | 07.03.2035            | 179.195          | 0,22                         |
| 95.000   | Metropolitan Life Global Funding I <sup>*</sup> | 4,00 % | 05.04.2028            | 103.390          | 0,13                         |
| 100.000  | MMS USA Holdings Inc <sup>*</sup>               | 1,75 % | 13.06.2031            | 92.906           | 0,11                         |
| 265.000  | Morgan Stanley <sup>*</sup>                     | 5,15 % | 25.01.2034            | 303.471          | 0,37                         |
| 73.000   | Nasdaq Inc <sup>*</sup>                         | 0,90 % | 30.07.2033            | 57.595           | 0,07                         |
| 100.000  | National Gas Transmission Plc <sup>*</sup>      | 4,25 % | 05.04.2030            | 108.845          | 0,13                         |
| 200.000  | National Grid North America Inc <sup>*</sup>    | 1,00 % | 12.07.2024            | 211.204          | 0,26                         |
| 186.000  | National Grid Plc <sup>*</sup>                  | 2,95 % | 30.03.2030            | 188.413          | 0,23                         |
| 483.000  | Nationwide Building Society <sup>*</sup>        | 2,00 % | 25.07.2029            | 504.315          | 0,62                         |
| 249.000  | NatWest Group Plc <sup>*</sup>                  | 0,67 % | 14.09.2029            | 219.848          | 0,27                         |
| 121.000  | NatWest Group Plc <sup>*</sup>                  | 1,04 % | 14.09.2032            | 107.996          | 0,13                         |
| 125.000  | Nordea Bank Abp <sup>*</sup>                    | 1,00 % | 27.06.2029            | 130.299          | 0,16                         |
| 100.000  | Orsted A/S <sup>*</sup>                         | 4,13 % | 01.03.2035            | 111.189          | 0,14                         |
| 100.000  | Orsted A/S <sup>*</sup>                         | 5,25 % | 08.12.2022            | 108.282          | 0,13                         |
| 150.000  | PPG Industries Inc <sup>*</sup>                 | 2,75 % | 01.06.2029            | 152.738          | 0,19                         |
| 175.000  | Procter & Gamble Co <sup>*</sup>                | 3,25 % | 02.08.2031            | 189.262          | 0,23                         |
| 440.000  | Realty Income Corp <sup>*</sup>                 | 5,13 % | 06.07.2034            | 480.042          | 0,59                         |
| 185.000  | Santander UK Group Holdings Plc <sup>*</sup>    | 3,53 % | 25.08.2028            | 190.293          | 0,23                         |
| 200.000  | Societe Generale SA <sup>*</sup>                | 5,63 % | 02.06.2033            | 216.359          | 0,27                         |
| 831.000  | Southern Co <sup>*</sup>                        | 1,88 % | 15.09.2081            | 711.723          | 0,87                         |
| 200.000  | Suez SACA <sup>*</sup>                          | 2,88 % | 24.05.2034            | 193.065          | 0,24                         |

## Global Investment Grade Credit - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                    | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 95,49 % (31. Dezember 2022: 94,02 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                   |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |  |        |                       |                   |                              |
| 120.000  | Thames Water Utilities Finance Plc*                      | 4,38 % | 18.01.2031            | 116.875           | 0,14                         |
| 124.000  | TotalEnergies SE*  | 1,63 % | 29.12.2049            | 112.793           | 0,14                         |
| 723.000  | UBS Group AG*  | 3,25 % | 02.04.2026            | 760.591           | 0,93                         |
| 365.000  | UBS Group AG*  | 4,38 % | 11.01.2031            | 388.068           | 0,48                         |
| 200.000  | UBS Group AG*  | 4,75 % | 17.03.2032            | 217.644           | 0,27                         |
| 392.000  | Verizon Communications Inc*                              | 0,75 % | 22.03.2032            | 327.642           | 0,40                         |
| 116.000  | Verizon Communications Inc*                              | 4,25 % | 31.10.2030            | 128.260           | 0,16                         |
| 100.000  | Volkswagen Bank GmbH*                                    | 4,63 % | 03.05.2031            | 109.668           | 0,14                         |
| 100.000  | Volkswagen International Finance NV*                     | 4,25 % | 29.03.2029            | 108.472           | 0,13                         |
| 155.000  | Westlake Corp*   | 1,63 % | 17.07.2029            | 139.253           | 0,17                         |
| <b>Euro insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>16.869.649</b> | <b>20,70</b>                 |
| <b>Britisches Pfund</b>  |  |        |                       |                   |                              |
| 152.000  | Barclays Plc*  | 8,41 % | 14.11.2032            | 191.884           | 0,24                         |
| 200.000  | British Telecommunications Plc*                          | 5,75 % | 13.02.2041            | 235.220           | 0,29                         |
| 178.000  | Centrica Plc*  | 4,38 % | 13.03.2029            | 204.767           | 0,25                         |
| 300.000  | Credit Suisse AG**                                       | 7,75 % | 10.03.2026            | 386.221           | 0,47                         |
| 90.000   | Danske Bank A/S*   | 2,25 % | 14.01.2028            | 95.779            | 0,12                         |
| 100.000  | Electricite de France SA*                                | 6,00 % | 29.12.2049            | 116.074           | 0,14                         |
| 214.000  | GE Capital UK Funding Unlimited Co*                      | 8,00 % | 14.01.2039            | 310.811           | 0,38                         |
| 130.000  | Holcim Sterling Finance Netherlands BV*                  | 2,25 % | 04.04.2034            | 114.089           | 0,14                         |
| 100.000  | ING Groep NV*  | 6,25 % | 20.05.2033            | 117.965           | 0,15                         |
| 100.000  | Intesa Sanpaolo SpA**                                    | 6,63 % | 31.05.2033            | 122.110           | 0,15                         |
| 400.000  | Lloyds Banking Group Plc*                                | 6,63 % | 02.06.2033            | 482.718           | 0,59                         |
| 115.000  | Nationwide Building Society*                             | 6,18 % | 07.12.2027            | 141.725           | 0,17                         |
| 115.000  | NatWest Group Plc*                                       | 7,42 % | 06.06.2033            | 141.843           | 0,17                         |
| 165.000  | Phoenix Group Holdings Plc*                              | 5,63 % | 28.04.2031            | 182.812           | 0,23                         |
| 200.000  | Rothsay Life Plc*  | 7,73 % | 16.05.2033            | 246.109           | 0,30                         |
| 100.000  | Sage Group Plc*  | 2,88 % | 08.02.2034            | 95.844            | 0,12                         |
| 113.000  | Santander UK Group Holdings Plc*                         | 7,10 % | 16.11.2027            | 141.111           | 0,17                         |
| 304.000  | Scottish Hydro Electric Transmission Plc*                | 1,50 % | 24.03.2028            | 314.884           | 0,39                         |
| 244.000  | UBS Group AG*  | 2,13 % | 15.11.2029            | 242.788           | 0,30                         |
| 120.000  | Virgin Money UK Plc*                                     | 5,13 % | 11.12.2030            | 137.202           | 0,17                         |
| <b>Britisches Pfund insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>4.021.956</b>  | <b>4,94</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>   |  |        |                       |                   |                              |
| 525.000  | AbbVie Inc*  | 4,05 % | 21.11.2039            | 457.360           | 0,56                         |
| 220.000  | Adventist Health System**                                | 5,43 % | 01.03.2032            | 218.243           | 0,27                         |
| 500.000  | AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust* | 1,75 % | 30.01.2026            | 449.160           | 0,55                         |
| 235.000  | AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust* | 3,00 % | 29.10.2028            | 203.377           | 0,25                         |

## Global Investment Grade Credit - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 95,49 % (31. Dezember 2022: 94,02 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 470.000  | Air Lease Corp <sup>*</sup>   | 0,70 % | 15.02.2024            | 455.346          | 0,56                         |
| 245.000  | Air Lease Corp <sup>*</sup>   | 3,25 % | 01.10.2029            | 212.159          | 0,26                         |
| 253.029  | American Airlines 2021-1 Class A Pass Through Trust <sup>**</sup>                           | 2,88 % | 11.07.2034            | 212.040          | 0,26                         |
| 400.000  | Amgen Inc <sup>**</sup>   | 2,80 % | 15.08.2041            | 282.955          | 0,35                         |
| 110.000  | Amgen Inc <sup>**</sup>   | 4,20 % | 22.02.2052            | 91.136           | 0,11                         |
| 250.000  | Amgen Inc <sup>**</sup>   | 4,40 % | 01.05.2045            | 216.720          | 0,27                         |
| 615.000  | Amgen Inc <sup>**</sup>   | 5,15 % | 02.03.2028            | 614.886          | 0,75                         |
| 425.000  | Analog Devices Inc <sup>**</sup>  | 2,10 % | 01.10.2031            | 351.955          | 0,43                         |
| 695.000  | Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc <sup>*</sup>   | 5,45 % | 23.01.2039            | 719.720          | 0,88                         |
| 360.000  | Appalachian Power Co <sup>**</sup>  | 3,70 % | 01.05.2050            | 272.018          | 0,33                         |
| 400.000  | Apple Inc <sup>**</sup>   | 2,38 % | 08.02.2041            | 295.327          | 0,36                         |
| 500.000  | Apple Inc <sup>**</sup>   | 3,45 % | 09.02.2045            | 422.026          | 0,52                         |
| 450.000  | Ares Capital Corp <sup>**</sup>   | 2,88 % | 15.06.2028            | 372.682          | 0,46                         |
| 315.000  | AT&T Inc <sup>*</sup>   | 3,50 % | 01.06.2041            | 242.126          | 0,30                         |
| 200.000  | AT&T Inc <sup>*</sup>   | 3,65 % | 01.06.2051            | 146.937          | 0,18                         |
| 400.000  | AT&T Inc <sup>*</sup>   | 4,35 % | 01.03.2029            | 384.400          | 0,47                         |
| 1.000.000  | Athene Global Funding <sup>**</sup>   | 1,61 % | 29.06.2026            | 856.210          | 1,05                         |
| 755.000  | Baker Hughes Holdings LLC/Baker Hughes Co-Obligor Inc <sup>**</sup>                         | 2,06 % | 15.12.2026            | 680.613          | 0,83                         |
| 215.000  | Baltimore Gas & Electric Co <sup>**</sup>   | 4,55 % | 01.06.2052            | 191.575          | 0,23                         |
| 400.000  | Banco Santander SA <sup>*</sup>   | 2,75 % | 03.12.2030            | 313.877          | 0,39                         |
| 600.000  | Banco Santander SA <sup>*</sup>   | 4,25 % | 11.04.2027            | 568.439          | 0,70                         |
| 685.000  | Bank of America Corp <sup>**</sup>  | 1,90 % | 23.07.2031            | 545.797          | 0,67                         |
| 415.000  | Bank of America Corp <sup>**</sup>  | 2,59 % | 29.04.2031            | 348.615          | 0,43                         |
| 1.000.000  | Bank of Montreal <sup>**</sup>  | 4,34 % | 05.10.2028            | 988.404          | 1,21                         |
| 1.000.000  | Barclays Plc <sup>*</sup>   | 2,85 % | 07.05.2026            | 937.090          | 1,15                         |
| 225.000  | Bell Telephone Co of Canada or Bell Canada <sup>*</sup>                                     | 5,10 % | 11.05.2033            | 222.325          | 0,27                         |
| 465.000  | Berry Global Inc <sup>**</sup>  | 0,95 % | 15.02.2024            | 447.118          | 0,55                         |
| 500.000  | BNP Paribas SA <sup>**</sup>  | 2,22 % | 09.06.2026            | 462.681          | 0,57                         |
| 205.000  | Boeing Co <sup>*</sup>  | 5,81 % | 01.05.2050            | 204.426          | 0,25                         |
| 400.000  | Boeing Co <sup>*</sup>  | 5,93 % | 01.05.2060            | 396.475          | 0,49                         |
| 200.000  | Bristol-Myers Squibb Co <sup>**</sup>   | 4,35 % | 15.11.2047            | 181.024          | 0,22                         |
| 475.000  | Broadcom Inc <sup>**</sup>  | 4,15 % | 15.11.2030            | 437.250          | 0,54                         |
| 900.000  | Capital One Financial Corp <sup>*</sup>   | 4,20 % | 29.10.2025            | 860.750          | 1,06                         |
| 200.000  | Capital One Financial Corp <sup>**</sup>  | 6,31 % | 08.06.2029            | 198.815          | 0,24                         |
| 450.000  | CDW LLC/CDW Finance Corp <sup>**</sup>  | 3,57 % | 01.12.2031            | 380.367          | 0,47                         |
| 495.000  | Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital <sup>**</sup> | 4,20 % | 15.03.2028            | 464.264          | 0,57                         |
| 575.000  | Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital <sup>**</sup> | 4,80 % | 01.03.2050            | 434.309          | 0,53                         |
| 400.000  | Citigroup Inc <sup>**</sup>   | 3,35 % | 24.04.2025            | 391.152          | 0,48                         |
| 775.000  | Citigroup Inc <sup>**</sup>   | 3,89 % | 10.01.2028            | 734.903          | 0,90                         |
| 275.000  | Citigroup Inc <sup>**</sup>   | 4,41 % | 31.03.2031            | 258.708          | 0,32                         |

## Global Investment Grade Credit - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung              | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|------------------------------------|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 95,49 % (31. Dezember 2022: 94,02 %) (Fortsetzung)</b> |                                    |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |                                    |        |                       |                  |                              |
| 370.000  | Citigroup Inc**                    | 6,17 % | 25.05.2034            | 373.425          | 0,46                         |
| 210.000  | CNH Industrial Capital LLC*        | 5,45 % | 14.10.2025            | 208.683          | 0,26                         |
| 200.000  | Comcast Corp**                     | 3,40 % | 15.07.2046            | 151.973          | 0,19                         |
| 480.000  | Comcast Corp**                     | 4,80 % | 15.05.2033            | 475.187          | 0,58                         |
| 250.000  | Constellation Brands Inc*          | 3,15 % | 01.08.2029            | 225.494          | 0,28                         |
| 540.000  | Cox Communications Inc**           | 5,70 % | 15.06.2033            | 544.921          | 0,67                         |
| 500.000  | CVS Health Corp*                   | 2,70 % | 21.08.2040            | 349.399          | 0,43                         |
| 445.000  | CVS Health Corp*                   | 5,13 % | 21.02.2030            | 442.204          | 0,54                         |
| 700.000  | Dell International LLC/EMC Corp**  | 5,30 % | 01.10.2029            | 695.327          | 0,85                         |
| 680.000  | Diamondback Energy Inc**           | 6,25 % | 15.03.2033            | 703.726          | 0,86                         |
| 777.000  | Dominion Energy Inc*               | 3,07 % | 15.08.2024            | 750.748          | 0,92                         |
| 520.000  | Dominion Energy Inc*               | 5,38 % | 15.11.2032            | 522.115          | 0,64                         |
| 500.000  | DTE Energy Co**                    | 2,53 % | 01.10.2024            | 478.981          | 0,59                         |
| 250.000  | Emerson Electric Co*               | 2,80 % | 21.12.2051            | 170.637          | 0,21                         |
| 345.000  | Enbridge Inc*                      | 5,70 % | 08.03.2033            | 349.894          | 0,43                         |
| 200.000  | Entergy Corp*                      | 3,75 % | 15.06.2050            | 147.821          | 0,18                         |
| 175.000  | Enterprise Products Operating LLC* | 3,70 % | 31.01.2051            | 134.094          | 0,16                         |
| 345.000  | EPR Properties**                   | 3,60 % | 15.11.2031            | 269.491          | 0,33                         |
| 500.000  | Equinix Inc**                      | 2,50 % | 15.05.2031            | 407.593          | 0,50                         |
| 235.000  | Essential Utilities Inc*           | 5,30 % | 01.05.2052            | 221.891          | 0,27                         |
| 300.000  | Exelon Corp**                      | 4,45 % | 15.04.2046            | 255.123          | 0,31                         |
| 640.000  | F&G Global Funding**               | 5,15 % | 07.07.2025            | 619.231          | 0,76                         |
| 640.000  | GE HealthCare Technologies Inc**   | 5,60 % | 15.11.2025            | 640.574          | 0,79                         |
| 500.000  | General Motors Financial Co Inc*   | 4,35 % | 09.04.2025            | 487.230          | 0,60                         |
| 900.000  | Goldman Sachs Group Inc**          | 3,81 % | 23.04.2029            | 836.206          | 1,03                         |
| 285.000  | Halliburton Co*                    | 5,00 % | 15.11.2045            | 258.209          | 0,32                         |
| 400.000  | Home Depot Inc*                    | 4,25 % | 01.04.2046            | 354.971          | 0,44                         |
| 1.125.000  | HSBC Holdings Plc*                 | 2,01 % | 22.09.2028            | 964.913          | 1,18                         |
| 195.000  | Humana Inc**                       | 5,50 % | 15.03.2053            | 194.390          | 0,24                         |
| 610.000  | Intel Corp**                       | 4,88 % | 10.02.2028            | 608.003          | 0,75                         |
| 185.000  | Intel Corp**                       | 4,90 % | 05.08.2052            | 170.900          | 0,21                         |
| 480.000  | Interpublic Group of Cos Inc*      | 5,38 % | 15.06.2033            | 475.166          | 0,58                         |
| 285.000  | Intesa Sanpaolo SpA**              | 7,78 % | 20.06.2054            | 283.724          | 0,35                         |
| 200.000  | Intesa Sanpaolo SpA**              | 8,25 % | 21.11.2033            | 210.209          | 0,26                         |
| 220.000  | Jacobs Engineering Group Inc*      | 5,90 % | 01.03.2033            | 216.039          | 0,26                         |
| 500.000  | JPMorgan Chase & Co**              | 2,30 % | 15.10.2025            | 476.652          | 0,58                         |
| 900.000  | JPMorgan Chase & Co**              | 4,01 % | 23.04.2029            | 848.233          | 1,04                         |
| 655.000  | Kenvue Inc**                       | 5,00 % | 22.03.2030            | 661.711          | 0,81                         |
| 500.000  | Kinder Morgan Inc*                 | 5,55 % | 01.06.2045            | 461.230          | 0,57                         |
| 280.000  | KLA Corp**                         | 4,95 % | 15.07.2052            | 276.017          | 0,34                         |

## Global Investment Grade Credit - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                     | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 95,49 % (31. Dezember 2022: 94,02 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 900.000  | Lloyds Banking Group Plc*                 | 3,87 % | 09.07.2025            | 876.921          | 1,08                         |
| 300.000  | Lowe's Cos Inc*                           | 3,00 % | 15.10.2050            | 196.859          | 0,24                         |
| 200.000  | Magellan Midstream Partners LP*           | 3,95 % | 01.03.2050            | 143.139          | 0,18                         |
| 900.000  | Marathon Petroleum Corp**                 | 4,70 % | 01.05.2025            | 883.385          | 1,08                         |
| 285.000  | McDonald's Corp*                          | 3,63 % | 01.09.2049            | 225.033          | 0,28                         |
| 400.000  | Mercedes-Benz Finance North America LLC** | 5,25 % | 29.11.2027            | 402.912          | 0,49                         |
| 85.000   | Merck & Co Inc*                           | 2,90 % | 10.12.2061            | 56.370           | 0,07                         |
| 305.000  | Meta Platforms Inc**                      | 5,60 % | 15.05.2053            | 313.466          | 0,38                         |
| 240.000  | Morgan Stanley**                          | 1,93 % | 28.04.2032            | 187.465          | 0,23                         |
| 500.000  | Morgan Stanley**                          | 2,70 % | 22.01.2031            | 425.455          | 0,52                         |
| 745.000  | Morgan Stanley**                          | 5,12 % | 01.02.2029            | 735.191          | 0,90                         |
| 685.000  | MPLX LP*                                  | 4,00 % | 15.03.2028            | 646.027          | 0,79                         |
| 450.000  | MPLX LP*                                  | 5,00 % | 01.03.2033            | 431.225          | 0,53                         |
| 1.000.000  | NatWest Group Plc*                        | 3,07 % | 22.05.2028            | 900.386          | 1,10                         |
| 310.000  | NextEra Energy Capital Holdings Inc*      | 5,25 % | 28.02.2053            | 298.836          | 0,37                         |
| 435.000  | Northern Trust Corp**                     | 6,13 % | 02.11.2032            | 451.187          | 0,55                         |
| 285.000  | Occidental Petroleum Corp*                | 6,13 % | 01.01.2031            | 289.678          | 0,36                         |
| 380.000  | Occidental Petroleum Corp**               | 6,45 % | 15.09.2036            | 390.533          | 0,48                         |
| 500.000  | Oracle Corp*                              | 2,88 % | 25.03.2031            | 427.000          | 0,52                         |
| 200.000  | Oracle Corp*                              | 4,00 % | 15.07.2046            | 153.851          | 0,19                         |
| 375.000  | Oracle Corp*                              | 4,90 % | 06.02.2033            | 364.151          | 0,45                         |
| 440.000  | Oracle Corp*                              | 6,15 % | 09.11.2029            | 458.581          | 0,56                         |
| 100.000  | PepsiCo Inc**                             | 2,63 % | 21.10.2041            | 75.510           | 0,09                         |
| 320.000  | Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd*    | 5,34 % | 19.05.2063            | 324.091          | 0,40                         |
| 185.000  | Phillips 66*                              | 3,30 % | 15.03.2052            | 127.111          | 0,16                         |
| 620.000  | Piedmont Natural Gas Co Inc**             | 2,50 % | 15.03.2031            | 506.943          | 0,62                         |
| 300.000  | Pioneer Natural Resources Co*             | 1,90 % | 15.08.2030            | 243.312          | 0,30                         |
| 360.000  | Pioneer Natural Resources Co*             | 2,15 % | 15.01.2031            | 294.798          | 0,36                         |
| 310.000  | QUALCOMM Inc**                            | 6,00 % | 20.05.2053            | 347.235          | 0,43                         |
| 500.000  | Societe Generale SA**                     | 3,63 % | 01.03.2041            | 325.112          | 0,40                         |
| 155.000  | Southern California Edison Co*            | 4,88 % | 01.03.2049            | 139.502          | 0,17                         |
| 320.000  | Southern Co*                              | 4,85 % | 15.06.2028            | 313.823          | 0,38                         |
| 200.000  | Starbucks Corp**                          | 4,50 % | 15.11.2048            | 178.839          | 0,22                         |
| 250.000  | Synchrony Bank*                           | 5,40 % | 22.08.2025            | 239.380          | 0,29                         |
| 225.000  | Tapestry Inc*                             | 3,05 % | 15.03.2032            | 179.826          | 0,22                         |
| 500.000  | T-Mobile USA Inc*                         | 3,75 % | 15.04.2027            | 473.544          | 0,58                         |
| 140.000  | T-Mobile USA Inc*                         | 4,50 % | 15.04.2050            | 120.214          | 0,15                         |
| 260.000  | T-Mobile USA Inc**                        | 5,80 % | 15.09.2062            | 264.480          | 0,32                         |
| 545.000  | Toll Brothers Finance Corp*               | 3,80 % | 01.11.2029            | 488.871          | 0,60                         |
| 150.000  | Truist Financial Corp**                   | 5,87 % | 08.06.2034            | 150.130          | 0,18                         |

## Global Investment Grade Credit - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                               | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 95,49 % (31. Dezember 2022: 94,02 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |        |                       |                   |                              |
| 200.000  | Truist Financial Corp**                             | 6,05 % | 08.06.2027            | 200.173           | 0,25                         |
| 200.000  | Tucson Electric Power Co*                           | 3,25 % | 01.05.2051            | 137.725           | 0,17                         |
| 380.000  | Union Pacific Corp*                                 | 3,20 % | 20.05.2041            | 299.173           | 0,37                         |
| 1.293.630  | United Airlines 2020-1 Class A Pass Through Trust** | 5,88 % | 15.10.2027            | 1.284.121         | 1,58                         |
| 285.000  | United Airlines 2023-1 Class A Pass Through Trust** | 5,80 % | 15.01.2036            | 290.700           | 0,36                         |
| 280.000  | UnitedHealth Group Inc*                             | 5,20 % | 15.04.2063            | 280.377           | 0,34                         |
| 190.000  | UnitedHealth Group Inc*                             | 6,05 % | 15.02.2063            | 215.047           | 0,26                         |
| 450.000  | Verizon Communications Inc*                         | 2,85 % | 03.09.2041            | 320.413           | 0,39                         |
| 400.000  | Vodafone Group Plc**                                | 4,38 % | 19.02.2043            | 336.194           | 0,41                         |
| 285.000  | Walmart Inc*  | 4,50 % | 15.04.2053            | 278.177           | 0,34                         |
| 500.000  | Walt Disney Co*                                     | 3,60 % | 13.01.2051            | 398.188           | 0,49                         |
| 205.000  | Warnermedia Holdings Inc**                          | 5,05 % | 15.03.2042            | 172.901           | 0,21                         |
| 1.090.000  | WEC Energy Group Inc*                               | 4,75 % | 09.01.2026            | 1.074.068         | 1,32                         |
| 185.000  | Westlake Corp*                                      | 3,38 % | 15.08.2061            | 112.724           | 0,14                         |
| 500.000  | Westpac Banking Corp**                              | 2,89 % | 04.02.2030            | 467.418           | 0,57                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |   |        |                       | <b>54.965.866</b> | <b>67,43</b>                 |
| <b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>  |   |        |                       | <b>77.831.690</b> | <b>95,49</b>                 |
| <b>Anlagen insgesamt</b>   |   |        |                       | <b>77.831.690</b> | <b>95,49</b>                 |

Devisenterminkontrakte 0,20 % (31. Dezember 2022: 0,01 %)

| Geforderter<br>Betrag   | Zu zahlender<br>Betrag | Fälligkeits-<br>datum | Gegenpartei             | Kontrakte | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|------------------------|-----------------------|-------------------------|-----------|--------------------------------------|------------------------------|
| 861.493 €   | 932.044 US\$           | 20.07.2023            | Standard Chartered Bank | 1         | 8.576                                | 0,01                         |
| 272.334 €   | 343.590 US\$           | 20.07.2023            | Standard Chartered Bank | 1         | 2.679                                | 0,00                         |
| 410.308 US\$  | 369.801 €              | 20.07.2023            | Standard Chartered Bank | 1         | 6.541                                | 0,01                         |
| 17.964.637 US\$   | 16.321.073 €           | 20.07.2023            | Westpac Banking Corp    | 1         | 144.499                              | 0,18                         |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                        |                       |                         |           | <b>162.295</b>                       | <b>0,20</b>                  |

|  |  |  |  | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--|--|-------------------|------------------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> |  |  |  | <b>77.993.985</b> | <b>95,69</b>                 |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,15 %) (31. Dezember 2022: (1,91 %))

| Geforderter<br>Betrag | Zu zahlender<br>Betrag | Fälligkeits-<br>datum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht<br>realisierter<br>Verlust US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|-----------------------|------------------------|-----------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------------|------------------------------|
| 1.961.586 US\$        | 2.640.019 CAD          | 20.07.2023            | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (33.991)                              | (0,04)                       |
| 4.537 US\$            | 4.204 €                | 20.07.2023            | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (54)                                  | (0,00)                       |
| 468.325 US\$          | 433.397 €              | 20.07.2023            | State Street Bank and Trust Co | 2         | (4.878)                               | (0,00)                       |
| 328.297 US\$          | 261.503 £              | 20.07.2023            | UBS AG                         | 2         | (4.200)                               | (0,01)                       |

## Global Investment Grade Credit - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (0,15 %) (31. Dezember 2022: (1,91 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei          | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens         |
|---|---------------------|------------------|----------------------|-----------|---------------------------------|------------------------------|
| 4.245.675 US\$  | 3.400.090 £         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp | 1         | (77.499)                        | (0,10)                       |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>                          |                     |                  |                      |           | <b>(120.622)</b>                | <b>(0,15)</b>                |
|   |                     |                  |                      |           | <b>Zeitwert US\$</b>            | <b>% des Nettovermögens</b>  |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> |                     |                  |                      |           | <b>(120.622)</b>                | <b>(0,15)</b>                |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              |                     |                  |                      |           | <b>77.873.363</b>               | <b>95,54</b>                 |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  |                     |                  |                      |           | <b>3.637.098</b>                | <b>4,46</b>                  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   |                     |                  |                      |           | <b>81.510.461</b>               | <b>100,00</b>                |
| <b>Portfolioanalyse</b>   |                     |                  |                      |           | <b>US\$</b>                     | <b>% des Gesamtvermögens</b> |
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind   |                     |                  |                      |           | 45.477.613                      | 55,34                        |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden              |                     |                  |                      |           | 30.594.613                      | 37,23                        |
| † Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente  |                     |                  |                      |           | 1.759.464                       | 2,14                         |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente   |                     |                  |                      |           | 41.673                          | 0,05                         |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  |                     |                  |                      |           | <b>77.873.363</b>               | <b>94,76</b>                 |



## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital-<br>betrag  | Wertpapierbezeichnung  | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Agency Bonds 0,47 % (31. Dezember 2022: 0,40 %)</b>                                    |  |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar</b>  |  |        |                       |                  |                              |
| 280.000   | Federal Home Loan Banks  | 5,50 % | 15.07.2036            | 316.208          | 0,47                         |
| <b>Agency Bonds insgesamt *</b>   |  |        |                       | <b>316.208</b>   | <b>0,47</b>                  |
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 3,08 % (31. Dezember 2022: 5,64 %)</b> |  |        |                       |                  |                              |
| <b>Euro</b>   |  |        |                       |                  |                              |
| 119.314   | European Residential Loan Securitisation 2019-NPL2 DAC Class A             | 6,44 % | 24.02.2058            | 128.551          | 0,19                         |
| 210.061   | FTA Santander Consumo 4 Class C  | 2,20 % | 18.09.2032            | 214.928          | 0,32                         |
| 150.136   | Futura S.r.l. 2019-1 Class A   | 5,94 % | 31.07.2044            | 164.505          | 0,24                         |
| <b>Euro insgesamt</b>   |  |        |                       | <b>507.984</b>   | <b>0,75</b>                  |
| <b>Britisches Pfund</b>   |  |        |                       |                  |                              |
| 64.049  | Towd Point Mortgage Funding 2018 - Auburn 12 Plc Class A                   | 6,22 % | 20.02.2045            | 81.640           | 0,12                         |
| <b>Britisches Pfund insgesamt</b>   |  |        |                       | <b>81.640</b>    | <b>0,12</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>  |  |        |                       |                  |                              |
| 202.452   | Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 1M2                         | 7,80 % | 25.02.2030            | 205.644          | 0,30                         |
| 148.021   | Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 2M2                         | 7,35 % | 25.08.2030            | 149.808          | 0,22                         |
| 491.943   | Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes Class M2              | 6,95 % | 25.07.2030            | 492.336          | 0,73                         |
| 159.064   | Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes Class M2              | 7,50 % | 25.04.2030            | 161.188          | 0,24                         |
| 475.965   | Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes Class M2              | 8,40 % | 25.07.2029            | 489.388          | 0,72                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>1.498.364</b> | <b>2,21</b>                  |
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) insgesamt **</b>                       |  |        |                       | <b>2.087.988</b> | <b>3,08</b>                  |
| <b>Unternehmensanleihen 39,59 % (31. Dezember 2022: 46,55 %)</b>                          |  |        |                       |                  |                              |
| <b>Euro</b>   |  |        |                       |                  |                              |
| 100.000   | 888 Acquisitions Ltd**   | 7,56 % | 15.07.2027            | 103.072          | 0,15                         |
| 135.000   | Adevinta ASA*  | 2,63 % | 15.11.2025            | 141.545          | 0,21                         |
| 29.891  | Adient Global Holdings Ltd*  | 3,50 % | 15.08.2024            | 32.052           | 0,05                         |
| 100.000   | Air France-KLM*  | 8,13 % | 31.05.2028            | 113.138          | 0,17                         |
| 150.000   | Allwyn International AS**  | 3,88 % | 15.02.2027            | 154.089          | 0,23                         |
| 100.000   | Altice Finco SA*   | 4,75 % | 15.01.2028            | 73.097           | 0,11                         |
| 147.000   | Altice France Holding SA*  | 4,00 % | 15.02.2028            | 79.415           | 0,12                         |
| 100.000   | Altice France SA*  | 2,50 % | 15.01.2025            | 101.258          | 0,15                         |
| 200.000   | American Tower Corp*   | 0,88 % | 21.05.2029            | 177.954          | 0,26                         |
| 150.000   | Anheuser-Busch InBev SA*   | 2,00 % | 23.01.2035            | 138.806          | 0,20                         |
| 130.000   | Anheuser-Busch InBev SA*   | 2,75 % | 17.03.2036            | 128.124          | 0,19                         |
| 100.000   | Apollo Swedish Bidco AB**  | 8,59 % | 05.07.2029            | 105.835          | 0,16                         |
| 120.000   | Apple Inc*   | 0,50 % | 15.11.2031            | 105.763          | 0,16                         |
| 100.000   | Aramark International Finance Sarl*  | 3,13 % | 01.04.2025            | 105.366          | 0,15                         |
| 150.000   | Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc* | 3,00 % | 01.09.2029            | 122.291          | 0,18                         |

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 39,59 % (31. Dezember 2022: 46,55 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                  |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |   |        |                       |                  |                              |
| 139.000  | Ashland Services BV**   | 2,00 % | 30.01.2028            | 129.003          | 0,19                         |
| 100.000  | Assemblin Group AB**  | 8,53 % | 15.05.2025            | 109.259          | 0,16                         |
| 200.000  | Avantor Funding Inc*  | 3,88 % | 15.07.2028            | 200.468          | 0,30                         |
| 100.000  | Banijay Entertainment SASU**                                    | 3,50 % | 01.03.2025            | 106.841          | 0,16                         |
| 107.000  | Banijay Group SAS**   | 6,50 % | 01.03.2026            | 116.279          | 0,17                         |
| 300.000  | Banque Federative du Credit Mutuel SA*                          | 1,25 % | 03.06.2030            | 266.475          | 0,39                         |
| 270.000  | Barclays Plc*   | 0,58 % | 09.08.2029            | 236.231          | 0,35                         |
| 100.000  | Bayer AG*   | 2,38 % | 12.11.2079            | 101.603          | 0,15                         |
| 100.000  | Bayer AG*   | 5,38 % | 25.03.2082            | 101.327          | 0,15                         |
| 178.000  | BCP V Modular Services Finance Plc**                            | 6,75 % | 30.11.2029            | 148.057          | 0,22                         |
| 100.000  | Benteler International AG*                                      | 9,38 % | 15.05.2028            | 110.464          | 0,16                         |
| 100.000  | BK LC Lux Finco1 Sarl*  | 5,25 % | 30.04.2029            | 102.808          | 0,15                         |
| 171.000  | Booking Holdings Inc*   | 0,50 % | 08.03.2028            | 160.250          | 0,24                         |
| 100.000  | Cellnex Finance Co SA*  | 1,50 % | 08.06.2028            | 93.387           | 0,14                         |
| 150.000  | Cheplapharm Arzneimittel GmbH**                                 | 4,38 % | 15.01.2028            | 150.297          | 0,22                         |
| 125.000  | Clarios Global LP/Clarios US Finance Co**                       | 4,38 % | 15.05.2026            | 130.214          | 0,19                         |
| 100.000  | Constellium SE*   | 4,25 % | 15.02.2026            | 106.667          | 0,16                         |
| 100.000  | Coty Inc**  | 3,88 % | 15.04.2026            | 106.028          | 0,16                         |
| 100.000  | Ctec II GmbH**  | 5,25 % | 15.02.2030            | 90.687           | 0,13                         |
| 100.000  | Dana Financing Luxembourg Sarl*                                 | 8,50 % | 15.07.2031            | 112.884          | 0,17                         |
| 100.000  | Deutsche Lufthansa AG*  | 3,00 % | 29.05.2026            | 103.894          | 0,15                         |
| 100.000  | Deutsche Lufthansa AG*  | 3,75 % | 11.02.2028            | 103.128          | 0,15                         |
| 200.000  | Digital Intrepid Holding BV*                                    | 0,63 % | 15.07.2031            | 151.890          | 0,22                         |
| 100.000  | Douglas GmbH*   | 6,00 % | 08.04.2026            | 100.463          | 0,15                         |
| 100.000  | Dufry One BV**  | 2,50 % | 15.10.2024            | 106.780          | 0,16                         |
| 200.000  | EDP - Energias de Portugal SA*                                  | 5,94 % | 23.04.2083            | 216.670          | 0,32                         |
| 400.000  | Electricite de France SA*                                       | 7,50 % | 29.12.2049            | 444.349          | 0,66                         |
| 150.000  | Emerald Debt Merger Sub LLC*                                    | 6,38 % | 15.12.2030            | 163.567          | 0,24                         |
| 100.000  | Emeria SASU**   | 3,38 % | 31.03.2028            | 88.035           | 0,13                         |
| 100.000  | Emeria SASU**   | 7,75 % | 31.03.2028            | 101.356          | 0,15                         |
| 270.000  | EnBW International Finance BV*                                  | 0,13 % | 01.03.2028            | 255.692          | 0,38                         |
| 100.000  | Enel SpA*   | 6,38 % | 29.12.2049            | 110.107          | 0,16                         |
| 150.000  | Energia Group NI FinanceCo Plc/Energia Group ROI Holdings DAC** | 4,00 % | 15.09.2025            | 160.242          | 0,24                         |
| 83.000   | European Union*   | 0,00 % | 06.07.2026            | 82.221           | 0,12                         |
| 14.475   | European Union*   | 1,25 % | 04.02.2043            | 11.375           | 0,02                         |
| 72.590   | European Union*   | 1,63 % | 04.12.2029            | 72.614           | 0,11                         |
| 68.000   | European Union*   | 2,00 % | 04.10.2027            | 70.759           | 0,10                         |
| 32.000   | European Union*   | 2,75 % | 04.12.2037            | 33.250           | 0,05                         |
| 31.000   | European Union*   | 3,38 % | 04.10.2038            | 34.254           | 0,05                         |
| 30.000   | European Union*   | 3,38 % | 04.11.2042            | 33.220           | 0,05                         |

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                     | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 39,59 % (31. Dezember 2022: 46,55 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |   |         |                       |                  |                              |
| 100.000  | Fiber Bidco SpA <sup>*</sup>                              | 11,00 % | 25.10.2027            | 116.939          | 0,17                         |
| 100.000  | Fidelity National Information Services Inc <sup>*</sup>   | 2,00 %  | 21.05.2030            | 94.607           | 0,14                         |
| 100.000  | Fiserv Inc <sup>*</sup>                                   | 1,63 %  | 01.07.2030            | 93.027           | 0,14                         |
| 100.000  | Ford Motor Credit Co LLC <sup>*</sup>                     | 3,02 %  | 06.03.2024            | 107.791          | 0,16                         |
| 100.000  | Forvia <sup>*</sup>                                       | 2,38 %  | 15.06.2027            | 96.292           | 0,14                         |
| 100.000  | Gruenenthal GmbH <sup>**</sup>                            | 4,13 %  | 15.05.2028            | 101.530          | 0,15                         |
| 100.000  | Grupo Antolin-Irausa SA <sup>*</sup>                      | 3,50 %  | 30.04.2028            | 80.007           | 0,12                         |
| 100.000  | Guala Closures SpA <sup>*</sup>                           | 3,25 %  | 15.06.2028            | 97.492           | 0,14                         |
| 335.000  | Haleon Netherlands Capital BV <sup>*</sup>                | 1,75 %  | 29.03.2030            | 320.618          | 0,47                         |
| 150.000  | Heimstaden Bostad AB <sup>*</sup>                         | 3,25 %  | 29.12.2049            | 99.017           | 0,15                         |
| 100.000  | Heimstaden Bostad Treasury BV <sup>*</sup>                | 1,38 %  | 24.07.2028            | 73.692           | 0,11                         |
| 200.000  | IHO Verwaltungs GmbH <sup>*</sup>                         | 3,88 %  | 15.05.2027            | 197.692          | 0,29                         |
| 200.000  | Iliad Holding SASU <sup>**</sup>                          | 5,13 %  | 15.10.2026            | 208.918          | 0,31                         |
| 100.000  | iliad SA <sup>*</sup>                                     | 5,38 %  | 14.06.2027            | 107.937          | 0,16                         |
| 200.000  | INEOS Quattro Finance 1 Plc <sup>*</sup>                  | 3,75 %  | 15.07.2026            | 192.552          | 0,28                         |
| 100.000  | Infineon Technologies AG <sup>*</sup>                     | 1,63 %  | 24.06.2029            | 96.449           | 0,14                         |
| 100.000  | International Consolidated Airlines Group SA <sup>*</sup> | 3,75 %  | 25.03.2029            | 95.470           | 0,14                         |
| 150.000  | International Game Technology Plc <sup>*</sup>            | 3,50 %  | 15.06.2026            | 158.413          | 0,23                         |
| 100.000  | Intrum AB <sup>*</sup>                                    | 3,00 %  | 15.09.2027            | 75.560           | 0,11                         |
| 100.000  | IPD 3 BV <sup>*</sup>                                     | 8,00 %  | 15.06.2028            | 111.499          | 0,16                         |
| 110.000  | JPMorgan Chase & Co <sup>*</sup>                          | 1,00 %  | 25.07.2031            | 96.913           | 0,14                         |
| 100.000  | JPMorgan Chase & Co <sup>*</sup>                          | 1,81 %  | 12.06.2029            | 97.455           | 0,14                         |
| 100.000  | Kapla Holding SAS <sup>*</sup>                            | 3,38 %  | 15.12.2026            | 99.346           | 0,15                         |
| 100.000  | Kapla Holding SAS <sup>*</sup>                            | 8,68 %  | 15.07.2027            | 110.556          | 0,16                         |
| 100.000  | Koninklijke KPN NV <sup>*</sup>                           | 6,00 %  | 29.12.2049            | 110.678          | 0,16                         |
| 59.000   | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau <sup>*</sup>              | 0,00 %  | 15.06.2026            | 58.472           | 0,09                         |
| 21.000   | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau <sup>*</sup>              | 0,00 %  | 15.09.2031            | 18.069           | 0,03                         |
| 27.000   | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau <sup>*</sup>              | 0,01 %  | 05.05.2027            | 26.100           | 0,04                         |
| 18.000   | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau <sup>**</sup>             | 0,38 %  | 09.03.2026            | 18.167           | 0,03                         |
| 47.000   | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau <sup>**</sup>             | 0,75 %  | 28.06.2028            | 45.847           | 0,07                         |
| 32.000   | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau <sup>*</sup>              | 0,75 %  | 15.01.2029            | 30.841           | 0,05                         |
| 46.000   | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau <sup>*</sup>              | 1,25 %  | 30.06.2027            | 46.577           | 0,07                         |
| 370.000  | Lorca Telecom Bondco SA <sup>*</sup>                      | 4,00 %  | 18.09.2027            | 369.266          | 0,54                         |
| 100.000  | Lottomatica SpA <sup>**</sup>                             | 7,13 %  | 01.06.2028            | 111.712          | 0,16                         |
| 100.000  | Matterhorn Telecom SA <sup>**</sup>                       | 3,13 %  | 15.09.2026            | 101.848          | 0,15                         |
| 100.000  | Matterhorn Telecom SA <sup>**</sup>                       | 4,00 %  | 15.11.2027            | 102.809          | 0,15                         |
| 100.000  | Maxeda DIY Holding BV <sup>**</sup>                       | 5,88 %  | 01.10.2026            | 78.602           | 0,12                         |
| 100.000  | Medtronic Global Holdings SCA <sup>*</sup>                | 1,38 %  | 15.10.2040            | 73.373           | 0,11                         |
| 150.000  | Molson Coors Beverage Co <sup>*</sup>                     | 1,25 %  | 15.07.2024            | 158.414          | 0,23                         |
| 100.000  | Mooney Group SpA <sup>**</sup>                            | 7,42 %  | 17.12.2026            | 108.157          | 0,16                         |

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                           | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 39,59 % (31. Dezember 2022: 46,55 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |   |         |                       |                  |                              |
| 100.000  | Morgan Stanley*                                 | 0,50 %  | 26.10.2029            | 89.109           | 0,13                         |
| 100.000  | Multiversity SRL*                               | 7,50 %  | 30.10.2028            | 108.012          | 0,16                         |
| 100.000  | Nationwide Building Society*                    | 2,00 %  | 25.07.2029            | 104.413          | 0,15                         |
| 150.000  | Nidda Healthcare Holding GmbH**                 | 7,50 %  | 21.08.2026            | 163.083          | 0,24                         |
| 100.000  | Olympus Water US Holding Corp*                  | 3,88 %  | 01.10.2028            | 86.333           | 0,13                         |
| 100.000  | Organon & Co/Organon Foreign Debt Co-Issuer BV* | 2,88 %  | 30.04.2028            | 95.074           | 0,14                         |
| 100.000  | PCF GmbH*                                       | 4,75 %  | 15.04.2026            | 84.375           | 0,12                         |
| 100.000  | PEU Finance Plc*                                | 7,25 %  | 01.07.2028            | 109.344          | 0,16                         |
| 100.000  | Playtech Plc*                                   | 5,88 %  | 28.06.2028            | 108.827          | 0,16                         |
| 100.000  | PLT VII Finance Sarl**                          | 4,63 %  | 05.01.2026            | 106.135          | 0,16                         |
| 100.000  | PrestigeBidCo GmbH**                            | 9,18 %  | 15.07.2027            | 110.155          | 0,16                         |
| 100.000  | Primo Water Holdings Inc**                      | 3,88 %  | 31.10.2028            | 95.083           | 0,14                         |
| 100.000  | RCS & RDS SA*                                   | 2,50 %  | 05.02.2025            | 104.315          | 0,15                         |
| 100.000  | Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB*            | 2,62 %  | 29.12.2049            | 22.093           | 0,03                         |
| 100.000  | Sappi Papier Holding GmbH*                      | 3,63 %  | 15.03.2028            | 96.037           | 0,14                         |
| 100.000  | SES SA*   | 5,63 %  | 29.12.2049            | 108.534          | 0,16                         |
| 100.000  | SPCM SA*  | 2,63 %  | 01.02.2029            | 95.743           | 0,14                         |
| 87.920   | Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH**        | 6,00 %  | 30.07.2026            | 94.288           | 0,14                         |
| 100.000  | Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH**        | 2,00 %  | 15.07.2025            | 103.916          | 0,15                         |
| 100.000  | Telecom Italia SpA*                             | 2,38 %  | 12.10.2027            | 93.242           | 0,14                         |
| 100.000  | Telecom Italia SpA*                             | 2,88 %  | 28.01.2026            | 101.892          | 0,15                         |
| 100.000  | Telecom Italia SpA*                             | 6,88 %  | 15.02.2028            | 108.924          | 0,16                         |
| 100.000  | Telefonica Europe BV*                           | 2,88 %  | 29.12.2049            | 94.058           | 0,14                         |
| 200.000  | Telefonica Europe BV*                           | 3,88 %  | 29.12.2049            | 202.017          | 0,30                         |
| 100.000  | Tendam Brands SAU*                              | 10,75 % | 31.03.2028            | 109.250          | 0,16                         |
| 100.000  | Terna - Rete Elettrica Nazionale*               | 2,38 %  | 29.12.2049            | 93.349           | 0,14                         |
| 150.000  | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV*  | 1,63 %  | 15.10.2028            | 126.842          | 0,19                         |
| 100.000  | TI Automotive Finance Plc**                     | 3,75 %  | 15.04.2029            | 87.404           | 0,13                         |
| 100.000  | Titan Holdings II BV*                           | 5,13 %  | 15.07.2029            | 86.898           | 0,13                         |
| 92.700   | TK Elevator Holdco GmbH**                       | 6,63 %  | 15.07.2028            | 86.870           | 0,13                         |
| 100.000  | TMNL Holding BV**                               | 3,75 %  | 15.01.2029            | 95.524           | 0,14                         |
| 205.000  | Toronto-Dominion Bank*                          | 3,13 %  | 03.08.2032            | 208.109          | 0,31                         |
| 115.000  | Trivium Packaging Finance BV*                   | 3,75 %  | 15.08.2026            | 116.134          | 0,17                         |
| 150.000  | UGI International LLC**                         | 2,50 %  | 01.12.2029            | 128.962          | 0,19                         |
| 100.000  | United Group BV**                               | 5,25 %  | 01.02.2030            | 86.559           | 0,13                         |
| 270.000  | Utah Acquisition Sub Inc*                       | 3,13 %  | 22.11.2028            | 272.213          | 0,40                         |
| 200.000  | Veolia Environnement SA*                        | 2,50 %  | 29.12.2049            | 180.787          | 0,27                         |
| 200.000  | Verisure Holding AB*                            | 3,25 %  | 15.02.2027            | 194.419          | 0,29                         |
| 100.000  | Verisure Midholding AB*                         | 5,25 %  | 15.02.2029            | 94.894           | 0,14                         |
| 370.000  | Verizon Communications Inc*                     | 1,88 %  | 26.10.2029            | 356.734          | 0,53                         |

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung  | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|---------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 39,59 % (31. Dezember 2022: 46,55 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                   |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |  |         |                       |                   |                              |
| 300.000  | Vonovia SE <sup>*</sup>  | 0,25 %  | 01.09.2028            | 254.875           | 0,38                         |
| 100.000  | Vonovia SE <sup>*</sup>  | 1,00 %  | 16.06.2033            | 74.422            | 0,11                         |
| 137.000  | WEPA Hygieneprodukte GmbH <sup>**</sup>                              | 2,88 %  | 15.12.2027            | 129.640           | 0,19                         |
| 100.000  | Westlake Corp <sup>*</sup>   | 1,63 %  | 17.07.2029            | 89.841            | 0,13                         |
| 100.000  | WMG Acquisition Corp <sup>*</sup>                                    | 2,25 %  | 15.08.2031            | 86.761            | 0,13                         |
| 100.000  | ZF Finance GmbH <sup>*</sup>   | 3,75 %  | 21.09.2028            | 98.379            | 0,14                         |
| <b>Euro insgesamt</b>  |  |         |                       | <b>16.737.472</b> | <b>24,70</b>                 |
| <b>Britisches Pfund</b>  |  |         |                       |                   |                              |
| 135.000  | AA Bond Co Ltd <sup>*</sup>  | 6,50 %  | 31.01.2026            | 148.769           | 0,22                         |
| 100.000  | Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc <sup>*</sup>    | 4,75 %  | 15.07.2027            | 101.203           | 0,15                         |
| 100.000  | B&M European Value Retail SA <sup>*</sup>                            | 3,63 %  | 15.07.2025            | 122.642           | 0,18                         |
| 100.000  | British Telecommunications Plc <sup>*</sup>                          | 8,38 %  | 20.12.2083            | 125.128           | 0,19                         |
| 100.000  | Centrica Plc <sup>*</sup>  | 5,25 %  | 10.04.2075            | 120.491           | 0,18                         |
| 112.000  | CPUK Finance Ltd <sup>**</sup>                                       | 6,50 %  | 28.08.2026            | 135.878           | 0,20                         |
| 300.000  | Danske Bank A/S <sup>*</sup>   | 2,25 %  | 14.01.2028            | 319.264           | 0,47                         |
| 160.000  | Lloyds Banking Group Plc <sup>*</sup>                                | 2,71 %  | 03.12.2035            | 147.536           | 0,22                         |
| 110.000  | Marks & Spencer Plc <sup>*</sup>                                     | 3,75 %  | 19.05.2026            | 126.245           | 0,19                         |
| 120.000  | Mobico Group Plc <sup>*</sup>  | 4,25 %  | 29.12.2049            | 133.593           | 0,20                         |
| 600.000  | NGG Finance Plc <sup>*</sup>   | 5,63 %  | 18.06.2073            | 726.121           | 1,07                         |
| 100.000  | Pinewood Finance Co Ltd <sup>**</sup>                                | 3,25 %  | 30.09.2025            | 117.123           | 0,17                         |
| 100.000  | RAC Bond Co Plc <sup>**</sup>  | 5,25 %  | 04.11.2027            | 101.405           | 0,15                         |
| 100.000  | Travis Perkins Plc <sup>*</sup>                                      | 3,75 %  | 17.02.2026            | 114.412           | 0,17                         |
| 100.000  | TVL Finance Plc <sup>**</sup>  | 10,25 % | 28.04.2028            | 124.496           | 0,18                         |
| 150.000  | Virgin Media Secured Finance Plc <sup>*</sup>                        | 4,25 %  | 15.01.2030            | 150.736           | 0,22                         |
| 100.000  | Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC <sup>**</sup>            | 4,88 %  | 15.07.2028            | 101.315           | 0,15                         |
| 100.000  | Vodafone Group Plc <sup>*</sup>                                      | 5,90 %  | 26.11.2032            | 126.502           | 0,19                         |
| 300.000  | Volkswagen Financial Services NV <sup>*</sup>                        | 4,25 %  | 09.10.2025            | 359.948           | 0,53                         |
| 172.000  | Westfield America Management Ltd <sup>*</sup>                        | 2,63 %  | 30.03.2029            | 165.010           | 0,24                         |
| <b>Britisches Pfund insgesamt</b>  |  |         |                       | <b>3.567.817</b>  | <b>5,27</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>   |  |         |                       |                   |                              |
| 20.000   | AbbVie Inc <sup>*</sup>  | 4,88 %  | 14.11.2048            | 18.922            | 0,03                         |
| 200.000  | Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC <sup>*</sup>                        | 4,60 %  | 02.11.2047            | 186.021           | 0,27                         |
| 170.000  | AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust <sup>*</sup> | 1,75 %  | 30.01.2026            | 152.714           | 0,23                         |
| 70.000   | Air Lease Corp <sup>*</sup>  | 0,70 %  | 15.02.2024            | 67.817            | 0,10                         |
| 90.000   | Air Lease Corp <sup>*</sup>  | 2,30 %  | 01.02.2025            | 84.681            | 0,13                         |
| 30.000   | Ally Financial Inc <sup>*</sup>                                      | 6,70 %  | 14.02.2033            | 26.571            | 0,04                         |
| 20.000   | Amgen Inc <sup>**</sup>  | 5,65 %  | 02.03.2053            | 20.269            | 0,03                         |
| 20.000   | Amgen Inc <sup>**</sup>  | 5,75 %  | 02.03.2063            | 20.305            | 0,03                         |

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 39,59 % (31. Dezember 2022: 46,55 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 45.000   | Apple Inc**   | 4,65 % | 23.02.2046            | 44.425           | 0,07                         |
| 205.000  | AT&T Inc*   | 3,65 % | 01.06.2051            | 150.611          | 0,22                         |
| 60.000   | Bank of America Corp**  | 2,50 % | 13.02.2031            | 50.264           | 0,07                         |
| 125.000  | Bank of America Corp**  | 2,97 % | 04.02.2033            | 104.248          | 0,15                         |
| 125.000  | Ares Capital Corp**   | 2,88 % | 15.06.2028            | 103.523          | 0,15                         |
| 110.000  | Bank of America Corp**  | 3,71 % | 24.04.2028            | 103.179          | 0,15                         |
| 145.000  | Barclays Plc*   | 2,85 % | 07.05.2026            | 135.878          | 0,20                         |
| 165.000  | Boeing Co*  | 5,81 % | 01.05.2050            | 164.538          | 0,24                         |
| 100.000  | Brazil Minas SPE via State of Minas Gerais†                                     | 5,33 % | 15.02.2028            | 98.224           | 0,15                         |
| 130.000  | Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital** | 4,80 % | 01.03.2050            | 98.192           | 0,15                         |
| 15.000   | Cigna Corp*   | 3,20 % | 15.03.2040            | 11.546           | 0,02                         |
| 70.000   | Citigroup Inc**   | 2,98 % | 05.11.2030            | 60.717           | 0,09                         |
| 95.000   | Citigroup Inc**   | 3,35 % | 24.04.2025            | 92.898           | 0,14                         |
| 105.000  | Citigroup Inc**   | 3,52 % | 27.10.2028            | 97.604           | 0,14                         |
| 125.000  | Citigroup Inc**   | 3,79 % | 17.03.2033            | 110.503          | 0,16                         |
| 165.000  | Comcast Corp**  | 2,94 % | 01.11.2056            | 107.568          | 0,16                         |
| 35.000   | Corebridge Financial Inc**  | 4,35 % | 05.04.2042            | 28.294           | 0,04                         |
| 55.000   | Crown Castle Inc*   | 1,05 % | 15.07.2026            | 48.192           | 0,07                         |
| 30.000   | CVS Health Corp*  | 4,13 % | 01.04.2040            | 25.306           | 0,04                         |
| 135.000  | CVS Health Corp*  | 5,05 % | 25.03.2048            | 124.531          | 0,18                         |
| 175.000  | Dell International LLC/EMC Corp**   | 5,30 % | 01.10.2029            | 173.832          | 0,26                         |
| 80.000   | Discovery Communications LLC**  | 3,63 % | 15.05.2030            | 70.223           | 0,10                         |
| 84.000   | DTE Energy Co*  | 3,40 % | 15.06.2029            | 75.194           | 0,11                         |
| 55.000   | Duke Energy Corp*   | 2,55 % | 15.06.2031            | 45.357           | 0,07                         |
| 200.000  | Empresa de los Ferrocarriles del Estado*  | 3,83 % | 14.09.2061            | 136.463          | 0,20                         |
| 140.000  | EPR Properties**  | 3,60 % | 15.11.2031            | 109.359          | 0,16                         |
| 90.000   | Exxon Mobil Corp*   | 3,45 % | 15.04.2051            | 69.992           | 0,10                         |
| 100.000  | Fox Corp**  | 5,58 % | 25.01.2049            | 93.715           | 0,14                         |
| 130.000  | Goldman Sachs Group Inc**   | 2,62 % | 22.04.2032            | 106.652          | 0,16                         |
| 115.000  | Goldman Sachs Group Inc**   | 3,27 % | 29.09.2025            | 111.161          | 0,16                         |
| 85.000   | Goldman Sachs Group Inc**   | 3,69 % | 05.06.2028            | 79.917           | 0,12                         |
| 105.000  | Goldman Sachs Group Inc**   | 3,81 % | 23.04.2029            | 97.557           | 0,14                         |
| 95.000   | Goldman Sachs Group Inc**   | 4,02 % | 31.10.2038            | 80.509           | 0,12                         |
| 80.000   | HCA Inc*  | 5,25 % | 15.06.2049            | 72.262           | 0,11                         |
| 60.000   | JPMorgan Chase & Co**   | 2,96 % | 13.05.2031            | 51.475           | 0,08                         |
| 50.000   | JPMorgan Chase & Co**   | 3,11 % | 22.04.2041            | 37.997           | 0,06                         |
| 200.000  | KazMunayGas National Co JSC*  | 5,38 % | 24.04.2030            | 186.126          | 0,28                         |
| 130.000  | Kinder Morgan Inc*  | 5,55 % | 01.06.2045            | 119.920          | 0,18                         |
| 80.000   | Lennar Corp*  | 4,75 % | 29.11.2027            | 77.688           | 0,11                         |
| 240.000  | Lloyds Banking Group Plc*   | 3,51 % | 18.03.2026            | 228.592          | 0,34                         |

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                  | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 39,59 % (31. Dezember 2022: 46,55 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |        |                       |                   |                              |
| 55.000   | Marathon Petroleum Corp**              | 4,70 % | 01.05.2025            | 53.985            | 0,08                         |
| 100.000  | Micron Technology Inc**                | 2,70 % | 15.04.2032            | 78.950            | 0,12                         |
| 100.000  | Molson Coors Beverage Co*              | 4,20 % | 15.07.2046            | 82.898            | 0,12                         |
| 105.000  | Morgan Stanley**                       | 0,79 % | 22.01.2025            | 101.773           | 0,15                         |
| 135.000  | Morgan Stanley**                       | 2,70 % | 22.01.2031            | 114.873           | 0,17                         |
| 60.000   | Morgan Stanley*                        | 3,63 % | 20.01.2027            | 57.018            | 0,08                         |
| 55.000   | Morgan Stanley**                       | 5,25 % | 21.04.2034            | 54.336            | 0,08                         |
| 30.000   | Morgan Stanley**                       | 5,95 % | 19.01.2038            | 29.628            | 0,04                         |
| 60.000   | MPLX LP*                               | 4,70 % | 15.04.2048            | 49.329            | 0,07                         |
| 55.000   | Mylan Inc**                            | 4,55 % | 15.04.2028            | 51.850            | 0,08                         |
| 95.000   | Oracle Corp*                           | 4,00 % | 15.07.2046            | 73.079            | 0,11                         |
| 55.000   | Oracle Corp*                           | 5,55 % | 06.02.2053            | 53.299            | 0,08                         |
| 1.360.000  | Petroleos de Venezuela SA*             | 5,38 % | 12.04.2027            | 48.021            | 0,07                         |
| 200.000  | Petroleos del Peru SA*                 | 5,63 % | 19.06.2047            | 129.187           | 0,19                         |
| 21.000   | Petroleos Mexicanos**                  | 6,84 % | 23.01.2030            | 16.715            | 0,02                         |
| 179.000  | Petroleos Mexicanos*                   | 7,69 % | 23.01.2050            | 121.477           | 0,18                         |
| 35.000   | Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd* | 5,34 % | 19.05.2063            | 35.447            | 0,05                         |
| 55.000   | Rogers Communications Inc**            | 3,80 % | 15.03.2032            | 48.098            | 0,07                         |
| 115.000  | Synchrony Financial*                   | 2,88 % | 28.10.2031            | 83.724            | 0,12                         |
| 83.000   | Sysco Corp*                            | 6,60 % | 01.04.2050            | 94.678            | 0,14                         |
| 95.000   | T-Mobile USA Inc*                      | 4,50 % | 15.04.2050            | 81.574            | 0,12                         |
| 15.000   | Travelers Cos Inc*                     | 5,45 % | 25.05.2053            | 15.712            | 0,02                         |
| 120.000  | Truist Financial Corp**                | 5,87 % | 08.06.2034            | 120.104           | 0,18                         |
| 200.000  | Vedanta Resources Finance II Plc*      | 8,95 % | 11.03.2025            | 151.206           | 0,22                         |
| 350.000  | Verizon Communications Inc*            | 2,55 % | 21.03.2031            | 292.330           | 0,43                         |
| 90.000   | Warnermedia Holdings Inc**             | 5,14 % | 15.03.2052            | 73.342            | 0,11                         |
| 75.000   | Westlake Corp*                         | 3,13 % | 15.08.2051            | 47.028            | 0,07                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |  |        |                       | <b>6.521.193</b>  | <b>9,62</b>                  |
| <b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>26.826.482</b> | <b>39,59</b>                 |
| <b>Staatsanleihen 32,21 % (31. Dezember 2022: 32,47 %)</b>                     |  |        |                       |                   |                              |
| <b>Australischer Dollar</b>  |  |        |                       |                   |                              |
| 285.000  | New South Wales Treasury Corp*         | 4,25 % | 20.02.2036            | 177.839           | 0,26                         |
| 565.000  | Queensland Treasury Corp*              | 4,50 % | 09.03.2033            | 375.699           | 0,56                         |
| 210.000  | Queensland Treasury Corp*              | 4,50 % | 22.08.2035            | 136.920           | 0,20                         |
| <b>Australischer Dollar insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>690.458</b>    | <b>1,02</b>                  |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi</b>  |  |        |                       |                   |                              |
| 7.100.000  | China Government Bond**                | 2,88 % | 25.02.2033            | 994.692           | 1,47                         |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt</b>                                    |  |        |                       | <b>994.692</b>    | <b>1,47</b>                  |

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                       | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 32,21 % (31. Dezember 2022: 32,47 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                  |                              |
| <b>Tschechische Krone</b>  |   |        |                       |                  |                              |
| 12.470.000   | Czech Republic Government Bond*             | 0,95 % | 15.05.2030            | 457.373          | 0,67                         |
| <b>Tschechische Krone insgesamt</b>                                      |   |        |                       | <b>457.373</b>   | <b>0,67</b>                  |
| <b>Euro</b>  |   |        |                       |                  |                              |
| 100.000  | Andorra International Bond*                 | 1,25 % | 23.02.2027            | 98.357           | 0,14                         |
| 83.677   | Bundesobligation*                           | 2,20 % | 13.04.2028            | 89.703           | 0,13                         |
| 28.767   | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe*   | 0,00 % | 15.08.2030            | 26.573           | 0,04                         |
| 34.595   | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe*   | 0,00 % | 15.02.2031            | 31.551           | 0,05                         |
| 40.582   | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe*   | 0,00 % | 15.08.2031            | 36.654           | 0,05                         |
| 31.500   | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe*   | 0,00 % | 15.08.2052            | 17.619           | 0,03                         |
| 162.529  | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe*   | 0,50 % | 15.02.2026            | 166.478          | 0,25                         |
| 205.000  | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe*   | 0,50 % | 15.02.2028            | 203.763          | 0,30                         |
| 338.395  | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe*   | 1,70 % | 15.08.2032            | 349.219          | 0,52                         |
| 100.000  | Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale* | 1,50 % | 25.05.2032            | 95.897           | 0,14                         |
| 140.000  | Egypt Government International Bond*        | 6,38 % | 11.04.2031            | 85.238           | 0,13                         |
| 10.000   | Estonia Government International Bond*      | 4,00 % | 12.10.2032            | 11.232           | 0,02                         |
| 22.565   | French Republic Government Bond OAT*        | 0,10 % | 01.03.2036            | 23.335           | 0,03                         |
| 112.045  | French Republic Government Bond OAT**       | 0,25 % | 25.07.2024            | 121.051          | 0,18                         |
| 20.000   | French Republic Government Bond OAT*        | 0,75 % | 25.02.2028            | 19.789           | 0,03                         |
| 7.341  | French Republic Government Bond OAT*        | 0,75 % | 25.05.2052            | 4.372            | 0,01                         |
| 266.000  | French Republic Government Bond OAT*        | 0,75 % | 25.05.2053            | 154.673          | 0,23                         |
| 62.677   | French Republic Government Bond OAT*        | 1,25 % | 25.05.2038            | 53.123           | 0,08                         |
| 43.355   | French Republic Government Bond OAT*        | 1,50 % | 25.05.2031            | 42.968           | 0,06                         |
| 12.000   | French Republic Government Bond OAT*        | 1,75 % | 25.05.2066            | 8.965            | 0,01                         |
| 4.000  | Hungary Government International Bond*      | 1,75 % | 05.06.2035            | 3.070            | 0,00                         |
| 200.000  | Indonesia Government International Bond*    | 1,40 % | 30.10.2031            | 172.855          | 0,25                         |
| 21.000   | Ireland Government Bond**                   | 0,20 % | 18.10.2030            | 19.028           | 0,03                         |
| 35.000   | Ireland Government Bond*                    | 0,55 % | 22.04.2041            | 24.882           | 0,04                         |
| 23.000   | Ireland Government Bond*                    | 2,40 % | 15.05.2030            | 24.523           | 0,04                         |
| 8.400  | Ireland Government Bond*                    | 3,00 % | 18.10.2043            | 9.022            | 0,01                         |
| 18.000   | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**         | 0,00 % | 01.08.2026            | 17.526           | 0,03                         |
| 32.000   | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**         | 0,50 % | 15.07.2028            | 29.827           | 0,04                         |
| 263.000  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*          | 0,90 % | 01.04.2031            | 231.215          | 0,34                         |
| 64.000   | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*          | 0,95 % | 15.09.2027            | 62.463           | 0,09                         |
| 20.000   | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**         | 0,95 % | 01.06.2032            | 17.045           | 0,02                         |
| 31.000   | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**         | 1,20 % | 15.08.2025            | 32.062           | 0,05                         |
| 35.090   | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**         | 1,40 % | 26.05.2025            | 37.904           | 0,06                         |
| 39.000   | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**         | 1,60 % | 01.06.2026            | 40.063           | 0,06                         |
| 299.000  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**         | 1,75 % | 30.05.2024            | 320.234          | 0,47                         |
| 11.000   | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*          | 1,85 % | 01.07.2025            | 11.566           | 0,02                         |



## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                             | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 32,21 % (31. Dezember 2022: 32,47 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                  |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |   |        |                       |                  |                              |
| 19.000   | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**               | 2,05 % | 01.08.2027            | 19.453           | 0,03                         |
| 102.000  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*                | 3,40 % | 28.03.2025            | 110.462          | 0,16                         |
| 130.000  | Ivory Coast Government International Bond*        | 5,25 % | 22.03.2030            | 120.198          | 0,18                         |
| 110.000  | Ivory Coast Government International Bond*        | 5,88 % | 17.10.2031            | 100.772          | 0,15                         |
| 23.128   | Kingdom of Belgium Government Bond*               | 0,40 % | 22.06.2040            | 15.806           | 0,02                         |
| 21.000   | Kingdom of Belgium Government Bond*               | 3,00 % | 22.06.2033            | 22.802           | 0,03                         |
| 27.000   | Kingdom of Belgium Government Bond*               | 3,30 % | 22.06.2054            | 28.861           | 0,04                         |
| 18.000   | Kingdom of Belgium Government Bond*               | 3,75 % | 22.06.2045            | 20.927           | 0,03                         |
| 20.000   | Lithuania Government International Bond*          | 3,88 % | 14.06.2033            | 21.985           | 0,03                         |
| 100.000  | Philippine Government International Bond*         | 1,75 % | 28.04.2041            | 71.334           | 0,10                         |
| 615.000  | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT*                | 1,65 % | 16.07.2032            | 594.305          | 0,88                         |
| 217.000  | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT*                | 2,88 % | 15.10.2025            | 236.322          | 0,35                         |
| 35.000   | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT**               | 2,88 % | 21.07.2026            | 38.110           | 0,06                         |
| 30.000   | Republic of Poland Government International Bond* | 3,88 % | 14.02.2033            | 32.566           | 0,05                         |
| 26.000   | Romanian Government International Bond*           | 1,75 % | 13.07.2030            | 21.699           | 0,03                         |
| 123.000  | Romanian Government International Bond*           | 2,00 % | 28.01.2032            | 98.842           | 0,15                         |
| 47.000   | Romanian Government International Bond*           | 3,62 % | 26.05.2030            | 45.019           | 0,06                         |
| 37.000   | Romanian Government International Bond*           | 3,75 % | 07.02.2034            | 32.738           | 0,05                         |
| 90.000   | Romanian Government International Bond*           | 3,88 % | 29.10.2035            | 78.060           | 0,11                         |
| 23.000   | Romanian Government International Bond*           | 4,13 % | 11.03.2039            | 19.618           | 0,03                         |
| 47.000   | Romanian Government International Bond*           | 6,63 % | 27.09.2029            | 53.349           | 0,08                         |
| 100.000  | Serbia International Bond*                        | 2,05 % | 23.09.2036            | 67.193           | 0,10                         |
| 18.300   | Slovakia Government Bond*                         | 0,38 % | 21.04.2036            | 13.036           | 0,02                         |
| 31.000   | Slovenia Government Bond*                         | 1,50 % | 25.03.2035            | 27.288           | 0,04                         |
| 20.000   | Slovenia Government Bond*                         | 3,63 % | 11.03.2033            | 22.545           | 0,03                         |
| 43.000   | Spain Government Bond*                            | 0,80 % | 30.07.2027            | 42.582           | 0,07                         |
| 37.000   | Spain Government Bond*                            | 1,30 % | 31.10.2026            | 37.905           | 0,06                         |
| 14.000   | Spain Government Bond*                            | 1,40 % | 30.04.2028            | 14.047           | 0,02                         |
| 35.000   | Spain Government Bond*                            | 3,15 % | 30.04.2033            | 37.443           | 0,05                         |
| 18.000   | Spain Government Bond*                            | 3,55 % | 31.10.2033            | 19.817           | 0,03                         |
| 70.000   | State of North Rhine-Westphalia Germany*          | 1,45 % | 16.02.2043            | 56.830           | 0,08                         |
| 12.000   | State of North Rhine-Westphalia Germany*          | 1,65 % | 22.02.2038            | 10.807           | 0,02                         |
| <b>Euro insgesamt</b>  |   |        |                       | <b>4.826.566</b> | <b>7,12</b>                  |
| <b>Ungarischer Forint</b>  |   |        |                       |                  |                              |
| 126.520.000  | Hungary Government Bond*                          | 4,75 % | 24.11.2032            | 315.773          | 0,47                         |
| <b>Ungarischer Forint insgesamt</b>                                      |   |        |                       | <b>315.773</b>   | <b>0,47</b>                  |
| <b>Indonesische Rupiah</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 5.237.000.000  | Indonesia Treasury Bond*                          | 6,38 % | 15.04.2032            | 351.318          | 0,52                         |

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                             | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 32,21 % (31. Dezember 2022: 32,47 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                  |                              |
| <b>Indonesische Rupie (Fortsetzung)</b>                                  |   |        |                       |                  |                              |
| 4.200.000.000  | Indonesia Treasury Bond*                          | 7,00 % | 15.02.2033            | 295.195          | 0,43                         |
|  | <b>Indonesische Rupiah insgesamt</b>              |        |                       | <b>646.513</b>   | <b>0,95</b>                  |
| <b>Mexikanischer Peso</b>  |   |        |                       |                  |                              |
| 23.900.000   | Mexican Bonos*                                    | 7,75 % | 29.05.2031            | 1.318.837        | 1,95                         |
|  | <b>Mexikanischer Peso insgesamt</b>               |        |                       | <b>1.318.837</b> | <b>1,95</b>                  |
| <b>Neuseeländischer Dollar</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 5.441.000  | New Zealand Government Bond*                      | 3,50 % | 14.04.2033            | 3.041.114        | 4,49                         |
|  | <b>Neuseeländischer Dollar insgesamt</b>          |        |                       | <b>3.041.114</b> | <b>4,49</b>                  |
| <b>Polnischer Zloty</b>  |   |        |                       |                  |                              |
| 2.758.000  | Republic of Poland Government Bond*               | 6,00 % | 25.10.2033            | 693.378          | 1,02                         |
|  | <b>Polnischer Zloty insgesamt</b>                 |        |                       | <b>693.378</b>   | <b>1,02</b>                  |
| <b>Britisches Pfund</b>  |   |        |                       |                  |                              |
| 612.000  | United Kingdom Gilt*                              | 1,25 % | 31.07.2051            | 385.835          | 0,57                         |
| 911.000  | United Kingdom Gilt*                              | 3,25 % | 31.01.2033            | 1.056.301        | 1,56                         |
| 181.000  | United Kingdom Gilt*                              | 3,75 % | 22.10.2053            | 204.615          | 0,30                         |
| 336.000  | United Kingdom Gilt*                              | 4,25 % | 07.06.2032            | 424.962          | 0,63                         |
|  | <b>Britisches Pfund insgesamt</b>                 |        |                       | <b>2.071.713</b> | <b>3,06</b>                  |
| <b>Südkoreanischer Won</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 308.330.000  | Korea Treasury Bond*                              | 4,25 % | 10.12.2032            | 244.812          | 0,36                         |
|  | <b>Südkoreanischer Won insgesamt</b>              |        |                       | <b>244.812</b>   | <b>0,36</b>                  |
| <b>Thailändischer Baht</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 9.569.000  | Thailand Government Bond**                        | 2,00 % | 17.12.2031            | 261.116          | 0,39                         |
|  | <b>Thailändischer Baht insgesamt</b>              |        |                       | <b>261.116</b>   | <b>0,39</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 200.000  | Angolan Government International Bond*            | 8,75 % | 14.04.2032            | 168.615          | 0,25                         |
| 100.000  | Argentine Republic Government International Bond* | 0,50 % | 09.07.2030            | 33.457           | 0,05                         |
| 210.000  | Argentine Republic Government International Bond* | 1,50 % | 09.07.2035            | 63.169           | 0,09                         |
| 200.000  | Colombia Government International Bond*           | 6,13 % | 18.01.2041            | 163.444          | 0,24                         |
| 200.000  | Development Bank of Mongolia LLC*                 | 7,25 % | 23.10.2023            | 199.250          | 0,29                         |
| 160.000  | Dominican Republic International Bond*            | 4,88 % | 23.09.2032            | 136.583          | 0,20                         |
| 12.974   | Ecuador Government International Bond*            | 0,00 % | 31.07.2030            | 3.800            | 0,01                         |
| 169.060  | Ecuador Government International Bond*            | 2,50 % | 31.07.2035            | 59.091           | 0,09                         |
| 227.000  | El Salvador Government International Bond*        | 7,65 % | 15.06.2035            | 134.847          | 0,20                         |

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                   | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 32,21 % (31. Dezember 2022: 32,47 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |        |                       |                   |                              |
| 200.000  | Ghana Government International Bond*                    | 7,63 % | 16.05.2029            | 86.188            | 0,13                         |
| 112.000  | Lebanon Government International Bond*                  | 6,38 % | 09.03.2020            | 7.673             | 0,01                         |
| 220.000  | Lebanon Government International Bond*                  | 6,60 % | 27.11.2026            | 14.925            | 0,02                         |
| 108.000  | Lebanon Government International Bond*                  | 6,65 % | 26.02.2030            | 7.290             | 0,01                         |
| 62.000   | Lebanon Government International Bond*                  | 8,25 % | 17.05.2034            | 4.176             | 0,01                         |
| 80.000   | Mexico Government International Bond*                   | 5,75 % | 12.10.2110            | 71.593            | 0,11                         |
| 200.000  | Panama Government International Bond*                   | 2,25 % | 29.09.2032            | 153.333           | 0,23                         |
| 200.000  | Republic of South Africa Government International Bond* | 7,30 % | 20.04.2052            | 168.636           | 0,25                         |
| 200.000  | Sri Lanka Government International Bond*                | 6,75 % | 18.04.2028            | 92.102            | 0,14                         |
| 200.000  | Sri Lanka Government International Bond*                | 7,85 % | 14.03.2029            | 92.079            | 0,14                         |
| 150.000  | Ukraine Government International Bond*                  | 7,75 % | 01.09.2029            | 36.333            | 0,05                         |
| 525.000  | United States Treasury Note/Bond*                       | 0,25 % | 15.06.2024            | 499.901           | 0,74                         |
| 365.000  | United States Treasury Note/Bond*                       | 1,88 % | 15.02.2032            | 312.724           | 0,46                         |
| 188.000  | United States Treasury Note/Bond*                       | 2,00 % | 15.08.2051            | 128.222           | 0,19                         |
| 318.000  | United States Treasury Note/Bond*                       | 2,25 % | 15.02.2052            | 229.941           | 0,34                         |
| 108.000  | United States Treasury Note/Bond*                       | 2,38 % | 15.05.2029            | 98.493            | 0,14                         |
| 211.000  | United States Treasury Note/Bond*                       | 2,63 % | 31.07.2029            | 194.961           | 0,29                         |
| 1.088.000  | United States Treasury Note/Bond*                       | 3,25 % | 30.06.2027            | 1.046.563         | 1,54                         |
| 101.000  | United States Treasury Note/Bond*                       | 3,25 % | 15.05.2042            | 90.178            | 0,13                         |
| 60.000   | United States Treasury Note/Bond*                       | 3,50 % | 15.02.2039            | 57.547            | 0,08                         |
| 293.000  | United States Treasury Note/Bond*                       | 3,88 % | 31.03.2025            | 287.266           | 0,42                         |
| 1.528.000  | United States Treasury Note/Bond*                       | 4,13 % | 31.01.2025            | 1.504.244         | 2,22                         |
| 200.000  | Zambia Government International Bond*                   | 8,97 % | 30.07.2027            | 115.522           | 0,17                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |   |        |                       | <b>6.262.146</b>  | <b>9,24</b>                  |
| <b>Staatsanleihen insgesamt</b>  |   |        |                       | <b>21.824.491</b> | <b>32,21</b>                 |
| <b>Mortgage-Backed Securities 22,07% (31. Dezember 2022: 13,74 %)</b>    |   |        |                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |   |        |                       |                   |                              |
| 230.393  | Fannie Mae Pool   | 2,50 % | 01.09.2051            | 195.712           | 0,29                         |
| 129.827  | Fannie Mae Pool   | 2,50 % | 01.10.2051            | 110.371           | 0,16                         |
| 318.307  | Fannie Mae Pool   | 2,50 % | 01.01.2052            | 270.167           | 0,40                         |
| 504.402  | Fannie Mae Pool   | 2,50 % | 01.03.2052            | 428.315           | 0,63                         |
| 205.289  | Fannie Mae Pool   | 2,50 % | 01.04.2052            | 174.426           | 0,26                         |
| 56.872   | Fannie Mae Pool   | 3,00 % | 01.11.2045            | 51.276            | 0,08                         |
| 48.697   | Fannie Mae Pool   | 3,00 % | 01.08.2046            | 43.621            | 0,06                         |
| 74.051   | Fannie Mae Pool   | 3,00 % | 01.01.2050            | 65.698            | 0,10                         |
| 89.295   | Fannie Mae Pool   | 3,00 % | 01.03.2050            | 79.260            | 0,12                         |
| 79.441   | Fannie Mae Pool   | 3,00 % | 01.04.2050            | 70.488            | 0,10                         |
| 100.444  | Fannie Mae Pool   | 3,00 % | 01.07.2051            | 88.621            | 0,13                         |
| 119.022  | Fannie Mae Pool   | 3,00 % | 01.06.2052            | 104.942           | 0,15                         |

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung    | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Mortgage-Backed Securities 22,07 % (31. Dezember 2022: 13,74 %) (Fortsetzung)</b> |                          |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |                          |        |                       |                  |                              |
| 38.611   | Fannie Mae Pool          | 3,50 % | 01.03.2047            | 35.728           | 0,05                         |
| 61.067   | Fannie Mae Pool          | 3,50 % | 01.09.2047            | 56.398           | 0,08                         |
| 73.696   | Fannie Mae Pool          | 3,50 % | 01.02.2048            | 68.061           | 0,10                         |
| 216.307  | Fannie Mae Pool          | 3,50 % | 01.06.2052            | 197.372          | 0,29                         |
| 76.789   | Fannie Mae Pool          | 4,00 % | 01.07.2048            | 73.260           | 0,11                         |
| 23.689   | Fannie Mae Pool          | 4,00 % | 01.10.2048            | 22.579           | 0,03                         |
| 67.396   | Fannie Mae Pool          | 4,00 % | 01.07.2049            | 64.242           | 0,09                         |
| 193.255  | Fannie Mae Pool          | 4,00 % | 01.04.2052            | 181.758          | 0,27                         |
| 180.204  | Fannie Mae Pool          | 4,00 % | 01.05.2052            | 169.365          | 0,25                         |
| 112.653  | Fannie Mae Pool          | 4,00 % | 01.06.2052            | 105.849          | 0,16                         |
| 119.414  | Fannie Mae Pool          | 4,00 % | 01.07.2052            | 112.582          | 0,17                         |
| 86.368   | Fannie Mae Pool          | 4,00 % | 01.07.2052            | 81.116           | 0,12                         |
| 304.958  | Fannie Mae Pool          | 4,00 % | 01.08.2052            | 286.556          | 0,42                         |
| 407.865  | Fannie Mae Pool          | 4,00 % | 01.09.2052            | 383.274          | 0,57                         |
| 342.610  | Fannie Mae Pool          | 4,50 % | 01.09.2052            | 329.662          | 0,49                         |
| 512.082  | Fannie Mae Pool          | 4,50 % | 01.10.2052            | 492.703          | 0,73                         |
| 391.390  | Fannie Mae Pool          | 4,50 % | 01.11.2052            | 376.588          | 0,56                         |
| 141.853  | Fannie Mae Pool          | 5,00 % | 01.08.2052            | 139.220          | 0,21                         |
| 72.685   | Fannie Mae Pool          | 5,00 % | 01.11.2052            | 71.275           | 0,10                         |
| 423.449  | Fannie Mae Pool          | 5,00 % | 01.01.2053            | 415.169          | 0,61                         |
| 236.170  | Fannie Mae Pool          | 5,00 % | 01.04.2053            | 231.507          | 0,34                         |
| 545.000  | Fannie Mae Pool          | 5,00 % | 01.07.2053            | 534.057          | 0,79                         |
| 248.649  | Fannie Mae Pool          | 5,50 % | 01.01.2053            | 247.578          | 0,36                         |
| 293.803  | Fannie Mae Pool          | 5,50 % | 01.02.2053            | 292.537          | 0,43                         |
| 470.000  | Fannie Mae Pool          | 5,50 % | 01.07.2053            | 467.760          | 0,69                         |
| 76.479   | Fannie Mae Pool (BH9277) | 3,50 % | 01.02.2048            | 70.632           | 0,10                         |
| 165.959  | Fannie Mae Pool (MA4655) | 4,00 % | 01.07.2052            | 155.936          | 0,23                         |
| 84.098   | Freddie Mac Pool         | 2,50 % | 01.08.2051            | 71.584           | 0,11                         |
| 208.531  | Freddie Mac Pool         | 2,50 % | 01.01.2052            | 177.269          | 0,26                         |
| 298.252  | Freddie Mac Pool         | 2,50 % | 01.02.2052            | 253.509          | 0,37                         |
| 279.482  | Freddie Mac Pool         | 2,50 % | 01.03.2052            | 237.625          | 0,35                         |
| 426.317  | Freddie Mac Pool         | 2,50 % | 01.04.2052            | 362.007          | 0,53                         |
| 18.588   | Freddie Mac Pool         | 3,00 % | 01.03.2050            | 16.612           | 0,02                         |
| 103.817  | Freddie Mac Pool         | 3,00 % | 01.07.2050            | 92.207           | 0,14                         |
| 58.261   | Freddie Mac Pool         | 3,00 % | 01.01.2052            | 51.517           | 0,08                         |
| 208.592  | Freddie Mac Pool         | 3,00 % | 01.08.2052            | 184.226          | 0,27                         |
| 51.072   | Freddie Mac Pool         | 3,50 % | 01.04.2052            | 46.581           | 0,07                         |
| 211.047  | Freddie Mac Pool         | 3,50 % | 01.05.2052            | 192.523          | 0,28                         |
| 249.938  | Freddie Mac Pool         | 3,50 % | 01.05.2052            | 228.039          | 0,34                         |
| 198.193  | Freddie Mac Pool         | 3,50 % | 01.06.2052            | 180.793          | 0,27                         |

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung             | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|-----------------------------------|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Mortgage-Backed Securities 22,07 % (31. Dezember 2022: 13,74 %) (Fortsetzung)</b> |                                   |        |                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |                                   |        |                       |                   |                              |
| 166.670  | Freddie Mac Pool                  | 3,50 % | 01.06.2052            | 152.079           | 0,22                         |
| 213.604  | Freddie Mac Pool                  | 3,50 % | 01.11.2052            | 194.821           | 0,29                         |
| 167.500  | Freddie Mac Pool                  | 4,00 % | 01.08.2052            | 157.366           | 0,23                         |
| 408.510  | Freddie Mac Pool                  | 4,00 % | 01.09.2052            | 383.669           | 0,57                         |
| 164.183  | Freddie Mac Pool                  | 4,00 % | 01.10.2052            | 154.200           | 0,23                         |
| 278.166  | Freddie Mac Pool                  | 4,50 % | 01.08.2052            | 267.654           | 0,39                         |
| 252.388  | Freddie Mac Pool                  | 4,50 % | 01.09.2052            | 242.958           | 0,36                         |
| 268.822  | Freddie Mac Pool                  | 4,50 % | 01.10.2052            | 258.660           | 0,38                         |
| 191.364  | Freddie Mac Pool                  | 5,00 % | 01.11.2052            | 187.737           | 0,28                         |
| 150.492  | Freddie Mac Pool                  | 5,00 % | 01.01.2053            | 147.549           | 0,22                         |
| 193.510  | Freddie Mac Pool                  | 5,50 % | 01.09.2052            | 193.376           | 0,29                         |
| 203.452  | Freddie Mac Pool                  | 5,50 % | 01.10.2052            | 202.810           | 0,30                         |
| 120.813  | Freddie Mac Pool                  | 5,50 % | 01.02.2053            | 120.301           | 0,18                         |
| 300.273  | Freddie Mac Pool                  | 5,50 % | 01.05.2053            | 299.000           | 0,44                         |
| 124.230  | Freddie Mac Pool                  | 6,00 % | 01.03.2053            | 125.377           | 0,18                         |
| 339.793  | Freddie Mac Pool                  | 6,00 % | 01.04.2053            | 342.929           | 0,51                         |
| 343.375  | Freddie Mac Pool                  | 6,00 % | 01.05.2053            | 346.544           | 0,51                         |
| 226.924  | Freddie Mac Pool (QE2482)         | 3,50 % | 01.05.2052            | 207.048           | 0,31                         |
| 380.000  | Ginnie Mae                        | 5,00 % | 01.07.2053            | 373.439           | 0,55                         |
| 535.000  | Ginnie Mae                        | 5,50 % | 01.07.2038            | 532.534           | 0,79                         |
| 195.798  | Ginnie Mae II Pool                | 2,50 % | 20.05.2052            | 169.720           | 0,25                         |
| 145.713  | Ginnie Mae II Pool                | 4,50 % | 20.09.2052            | 140.780           | 0,21                         |
| 158.686  | Ginnie Mae II Pool                | 5,00 % | 20.03.2053            | 156.050           | 0,23                         |
| 158.623  | Ginnie Mae II Pool                | 5,50 % | 20.03.2053            | 158.018           | 0,23                         |
| <b>Mortgage-Backed Securities insgesamt **</b>                                       |                                   |        |                       | <b>14.954.772</b> | <b>22,07</b>                 |
| <b>Investmentfonds 0,08 % (31. Dezember 2022: 2,37 %)</b>                            |                                   |        |                       |                   |                              |
| <b>Britisches Pfund</b>  |                                   |        |                       |                   |                              |
| 54.437   | NB Global Monthly Income Fund Ltd |        |                       | 51.906            | 0,08                         |
| <b>Investmentfonds insgesamt #</b>   |                                   |        |                       | <b>51.906</b>     | <b>0,08</b>                  |
| <b>Anlagen insgesamt</b>   |                                   |        |                       | <b>66.061.847</b> | <b>97,50</b>                 |

Devisenterminkontrakte 2,43 % (31. Dezember 2022: 2,72 %)

| Geforderter<br>Betrag | Zu zahlender<br>Betrag | Fälligkeits-<br>datum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|-----------------------|------------------------|-----------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------------|------------------------------|
| 264.817 AUD           | 175.731 US\$           | 20.07.2023            | State Street Bank and Trust Co | 1         | 626                                  | 0,00                         |
| 1.863.400 BRL         | 361.762 US\$           | 20.07.2023            | BNP Paribas                    | 1         | 23.423                               | 0,04                         |
| 2.788.066 BRL         | 543.246 US\$           | 20.07.2023            | Goldman Sachs International    | 2         | 33.077                               | 0,05                         |
| 1.333.369 CAD         | 989.141 US\$           | 20.07.2023            | BNP Paribas                    | 3         | 18.745                               | 0,03                         |

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 2,43 % (31. Dezember 2022: 2,72 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 1.019.678 CAD      | 759.941 US\$        | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 3         | 10.828                         | 0,02                 |
| 59.935 CAD         | 43.998 US\$         | 20.07.2023       | Deutsche Bank AG               | 1         | 1.306                          | 0,00                 |
| 1.864.336 CAD      | 1.387.834 US\$      | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 2         | 21.408                         | 0,03                 |
| 681.149 CAD        | 506.371 US\$        | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | 8.506                          | 0,01                 |
| 1.896.086 CAD      | 1.412.179 US\$      | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 21.062                         | 0,03                 |
| 619.916 CHF        | 690.063 US\$        | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | 3.972                          | 0,01                 |
| 1.073.057 CHF      | 1.194.079 US\$      | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 3         | 7.276                          | 0,01                 |
| 868.383 CHF        | 963.377 US\$        | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 2         | 8.833                          | 0,01                 |
| 30.887.323 CLP     | 37.523 US\$         | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | 903                            | 0,00                 |
| 2.421.968 €        | 2.637.885 US\$      | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 3         | 6.537                          | 0,01                 |
| 1.103.094 €        | 1.197.018 US\$      | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 2         | 7.394                          | 0,01                 |
| 1.960.949 €        | 2.124.579 US\$      | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 6         | 16.480                         | 0,03                 |
| 88.226 €           | 94.896 US\$         | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 1.433                          | 0,00                 |
| 1.418.613 £        | 1.790.399 US\$      | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 4         | 13.351                         | 0,02                 |
| 835.508 £          | 1.043.533 US\$      | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 3         | 18.806                         | 0,03                 |
| 1.840.219 £        | 2.319.793 US\$      | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 7         | 20.024                         | 0,03                 |
| 385.469 £          | 483.952 US\$        | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 3         | 6.167                          | 0,01                 |
| 628.848 £          | 788.345 US\$        | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 4         | 11.228                         | 0,02                 |
| 39.967 £           | 49.747 US\$         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 1         | 1.071                          | 0,00                 |
| 61.959.964 HUF     | 178.250 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 2         | 2.187                          | 0,00                 |
| 120.782.487 HUF    | 349.107 US\$        | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | 2.629                          | 0,00                 |
| 147.645.352 ¥      | 1.022.301 US\$      | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | 1.677                          | 0,00                 |
| 147.705.444 ¥      | 1.023.357 US\$      | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | 1.038                          | 0,00                 |
| 22.536.289 MXN     | 1.220.244 US\$      | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | 89.706                         | 0,13                 |
| 3.296.892 NOK      | 307.870 US\$        | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 1         | 36                             | 0,00                 |
| 4.528.654 NOK      | 418.106 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 4.837                          | 0,01                 |
| 1.659.364 NZD      | 1.004.095 US\$      | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 2         | 12.438                         | 0,02                 |
| 556.098 NZD        | 337.651 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 3.017                          | 0,01                 |
| 1.200.000 NZD      | 728.956 US\$        | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | 6.168                          | 0,01                 |
| 1.682.351 PLN      | 391.433 US\$        | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | 22.299                         | 0,03                 |
| 737.181 PLN        | 176.490 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 4.801                          | 0,01                 |
| 3.627.776 SEK      | 334.194 US\$        | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | 1.909                          | 0,00                 |
| 3.612.373 SEK      | 334.140 US\$        | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 536                            | 0,00                 |
| 217.944 US\$       | 326.078 AUD         | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | 789                            | 0,00                 |
| 268.091 US\$       | 9.000.000 THB       | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | 13.851                         | 0,02                 |
| 358.537 US\$       | 3.783.234 SEK       | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | 8.031                          | 0,01                 |
| 3.127.442 US\$     | 2.845.513 €         | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 4         | 20.573                         | 0,03                 |
| 352.866 US\$       | 313.539 CHF         | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | 1.839                          | 0,00                 |
| 342.834 US\$       | 5.131.976.207 IDR   | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | 1.600                          | 0,00                 |
| 351.388 US\$       | 47.672.835 ¥        | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | 20.758                         | 0,03                 |
| 207.109 US\$       | 270.486.133 KRW     | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | 1.661                          | 0,00                 |

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 2,43 % (31. Dezember 2022: 2,72 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 346.196 US\$       | 7.479.129 CZK       | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | 3.001                          | 0,01                 |
| 1.674.188 US\$     | 17.830.745 NOK      | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 2         | 8.925                          | 0,01                 |
| 56 US\$            | 385 CNY             | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | 3                              | 0,00                 |
| 683.401 US\$       | 7.315.809 NOK       | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 1         | 157                            | 0,00                 |
| 1.556.545 US\$     | 2.493.849 NZD       | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 2         | 28.804                         | 0,04                 |
| 514.938 US\$       | 7.661.016.383 IDR   | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 2         | 5.544                          | 0,01                 |
| 53.594 US\$        | 42.081 £            | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 1         | 88                             | 0,00                 |
| 1.754.987 US\$     | 234.324.842 ¥       | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 4         | 129.853                        | 0,19                 |
| 3.100.383 US\$     | 2.819.289 €         | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 8         | 22.145                         | 0,03                 |
| 2.309.542 US\$     | 2.046.710 CHF       | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 7         | 18.120                         | 0,03                 |
| 691.763 US\$       | 1.025.584 AUD       | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 3         | 8.765                          | 0,01                 |
| 261.548 US\$       | 1.253.338 BRL       | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 2.470                          | 0,00                 |
| 348.924 US\$       | 306.561 CHF         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 5.709                          | 0,01                 |
| 1.278.623 US\$     | 2.053.818 NZD       | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 4         | 20.447                         | 0,03                 |
| 2.430.098 US\$     | 3.592.307 AUD       | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 3         | 37.767                         | 0,06                 |
| 365.414 US\$       | 3.907.639 NOK       | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 468                            | 0,00                 |
| 394 US\$           | 2.687 CNY           | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 24                             | 0,00                 |
| 364.486 US\$       | 48.509.516 ¥        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 28.054                         | 0,04                 |
| 2.665.836 US\$     | 2.432.122 €         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 8         | 10.327                         | 0,02                 |
| 176.466 US\$       | 2.593.526.180 IDR   | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 4.018                          | 0,01                 |
| 342.785 US\$       | 267.761 £           | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 2.330                          | 0,00                 |
| 1.036.527 US\$     | 1.366.127 CAD       | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 3.879                          | 0,01                 |
| 175.675 US\$       | 59.397.478 HUF      | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 2.701                          | 0,00                 |
| 1.019.870 US\$     | 909.163 CHF         | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | 2.004                          | 0,00                 |
| 932.471 US\$       | 134.300.096 ¥       | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | 1.047                          | 0,00                 |
| 344.535 US\$       | 315.427 €           | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | 137                            | 0,00                 |
| 1.453 US\$         | 33.551 TRY          | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | 171                            | 0,00                 |
| 168.232 US\$       | 2.515.574.873 IDR   | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | 967                            | 0,00                 |
| 1.045.621 US\$     | 7.300.000 CNY       | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | 36.959                         | 0,06                 |
| 169.452 US\$       | 275.204 NZD         | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | 862                            | 0,00                 |
| 314.667 US\$       | 4.655.332.604 IDR   | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 5.126                          | 0,01                 |
| 354.557 US\$       | 321.744 €           | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 2         | 3.262                          | 0,01                 |
| 1.716.032 US\$     | 2.725.091 NZD       | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 4         | 46.631                         | 0,07                 |
| 528.064 US\$       | 465.076 CHF         | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 2         | 7.382                          | 0,01                 |
| 164.421 US\$       | 242.633 AUD         | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 2.837                          | 0,01                 |
| 2.319 US\$         | 15.853 CNY          | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 129                            | 0,00                 |
| 50.725 US\$        | 6.845.951 ¥         | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 3.246                          | 0,01                 |
| 331.481 US\$       | 3.570.535 SEK       | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 2         | 681                            | 0,00                 |
| 2.347.512 US\$     | 304.311.147 ¥       | 20.07.2023       | UBS AG                         | 2         | 236.994                        | 0,35                 |
| 497.662 US\$       | 652.000.000 KRW     | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | 2.437                          | 0,00                 |
| 28.585.444 US\$    | 25.980.485 €        | 20.07.2023       | UBS AG                         | 2         | 218.691                        | 0,32                 |

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 2,43 % (31. Dezember 2022: 2,72 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 1.935.942 US\$  | 19.792.100 SEK      | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | 102.259                        | 0,15                 |
| 39.293 US\$   | 708.353 ZAR         | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | 1.856                          | 0,00                 |
| 465.258 US\$  | 10.011.367 CZK      | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | 5.867                          | 0,01                 |
| 858.962 US\$  | 1.277.622 AUD       | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 2         | 8.117                          | 0,01                 |
| 44.282 US\$   | 34.734 £            | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 1         | 118                            | 0,00                 |
| 4.491.046 US\$  | 7.116.693 NZD       | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 1         | 131.334                        | 0,19                 |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>   |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 84 €  | 92 US\$             | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 0                              | 0,00                 |
| 94 €  | 100 US\$            | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 1         | 2                              | 0,00                 |
| 95 US\$   | 87 €                | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 1         | 0                              | 0,00                 |
| 193 US\$  | 175 €               | 20.07.2023       | UBS AG                         | 2         | 2                              | 0,00                 |
| 190 US\$  | 173 €               | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 2         | 2                              | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>   |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 339 £   | 424 US\$            | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 7                              | 0,00                 |
| 10.991 £  | 13.706 US\$         | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 269                            | 0,00                 |
| 11.133 £  | 13.905 US\$         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 2         | 251                            | 0,00                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                                |           | <b>1.648.082</b>               | <b>2,43</b>          |

### Futures-Kontrakte 0,21 % (31. Dezember 2022: 0,75 %)

| Anzahl Kontrakte   | Beschreibung  | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---|--------------------------------|----------------------|
| 52   | 10-Year Mini Japanese Government Bond Future September 2023 | 19.718                         | 0,03                 |
| (3)  | Australian Government Bond 10-Year Future September 2023    | 914                            | 0,00                 |
| (20)   | Euro-BOBL Future September 2023                             | 37.421                         | 0,05                 |
| (4)  | Euro-Bund Future September 2023                             | 1.757                          | 0,00                 |
| 6  | Euro-Buxl 30-Year Bond Future September 2023                | 7.444                          | 0,01                 |
| (11)   | Euro-OAT Future September 2023                              | 15.885                         | 0,02                 |
| (41)   | US Treasury 10-Year Ultra Future September 2023             | 51.250                         | 0,08                 |
| 9  | US Treasury Ultra Bond (CBT) Future September 2023          | 12.933                         | 0,02                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten <sup>*</sup></b> |   | <b>147.322</b>                 | <b>0,21</b>          |

### Zinsswap-Kontrakte 0,04 % (31. Dezember 2022: 0,02 %)

| Nominalwert  | Fälligkeit | Gegenpartei                              | Erhalt/(Zahlung) <sup>#</sup> | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|------------|--|-------------------------------|-----------------|--------------------|--------------------------------|----------------------|
| USD 250.000  | 07.12.2027 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | Erhalt                        | 2,43 %          | 1D SOFR            | 17.060                         | 0,03                 |
| AUD 8.052.000  | 28.06.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 4,59 %          | 6M BBSW            | 7.565                          | 0,01                 |
| USD 250.000  | 07.09.2023 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | Erhalt                        | 2,43 %          | 1D SOFR            | 1.488                          | 0,00                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Zinsswapkontrakten <sup>∞</sup></b> |            |  |                               |                 |                    | <b>26.113</b>                  | <b>0,04</b>          |

<sup>#</sup>Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.



## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Credit-Default-Swap-Kontrakten 0,42 % (31. Dezember 2022: 0,60 %)

| Nominalwert  | Fälligkeit | Gegenpartei                 | Referenzverbindlichkeit                | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|------------|-----------------------------|--|------------------|------------------------------|
| USD 6.763.000  | 20.12.2027 | ICE Clear U.S. <sup>1</sup> | Buying default protection on CDX.EM.38 | 283.005          | 0,42                         |
| <b>Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten insgesamt *</b> |            |                             |  | <b>283.005</b>   | <b>0,42</b>                  |

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

|  | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|-------------------|------------------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> | <b>68.166.369</b> | <b>100,60</b>                |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (2,30 %) (31. Dezember 2022: (6,38 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 573.857 AUD        | 385.737 US\$        | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (3.572)                         | (0,01)               |
| 4.233.683 AUD      | 2.831.069 US\$      | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 6         | (11.608)                        | (0,02)               |
| 1.616.146 AUD      | 1.094.125 US\$      | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (17.838)                        | (0,03)               |
| 1.087.329 CHF      | 1.228.669 US\$      | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 2         | (11.335)                        | (0,02)               |
| 462.106 CHF        | 522.371 US\$        | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 2         | (5.013)                         | (0,01)               |
| 948.414 CHF        | 1.071.249 US\$      | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 3         | (9.440)                         | (0,01)               |
| 628.516 CHF        | 704.850 US\$        | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (1.186)                         | (0,00)               |
| 8.069.210 CZK      | 374.773 US\$        | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (4.501)                         | (0,01)               |
| 3.799.992 CZK      | 177.412 US\$        | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 1         | (3.041)                         | (0,00)               |
| 325.992 €          | 360.372 US\$        | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (4.438)                         | (0,01)               |
| 684.688 €          | 750.659 US\$        | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 2         | (3.083)                         | (0,00)               |
| 825.342 €          | 909.364 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 5         | (8.215)                         | (0,01)               |
| 200.000 €          | 219.367 US\$        | 20.07.2023       | Royal Bank of Canada           | 1         | (997)                           | (0,00)               |
| 2.736.114 €        | 3.008.789 US\$      | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 5         | (21.367)                        | (0,03)               |
| 1.955.132 €        | 2.153.730 US\$      | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 3         | (19.022)                        | (0,03)               |
| 1.400.491 €        | 1.540.913 US\$      | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | (11.789)                        | (0,02)               |
| 268.109 £          | 342.723 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | (1.826)                         | (0,00)               |
| 12.816.883.405 IDR | 857.669 US\$        | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 2         | (5.452)                         | (0,01)               |
| 191.441.246 ¥      | 1.420.697 US\$      | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 5         | (92.977)                        | (0,14)               |
| 356.437.400 ¥      | 2.674.785 US\$      | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 7         | (202.751)                       | (0,30)               |
| 229.876.430 ¥      | 1.669.219 US\$      | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 3         | (74.936)                        | (0,11)               |
| 7.000.000 ¥        | 52.302 US\$         | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | (3.755)                         | (0,01)               |
| 242.727.094 ¥      | 1.744.822 US\$      | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 2         | (61.414)                        | (0,09)               |
| 152.825.240 ¥      | 1.180.918 US\$      | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | (121.015)                       | (0,18)               |
| 270.463.656 KRW    | 208.688 US\$        | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 1         | (3.258)                         | (0,00)               |
| 440.019.449 KRW    | 335.861 US\$        | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | (1.644)                         | (0,00)               |
| 21.532.922 NOK     | 2.083.056 US\$      | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 2         | (72.037)                        | (0,11)               |

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (2,30 %) (31. Dezember 2022: (6,38 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 2.154.989 NZD      | 1.346.232 US\$      | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 5         | (26.078)                        | (0,04)               |
| 2.801.169 NZD      | 1.723.623 US\$      | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 2         | (7.616)                         | (0,01)               |
| 176.323 NZD        | 110.083 US\$        | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 2         | (2.067)                         | (0,00)               |
| 737.479 NZD        | 458.761 US\$        | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 6         | (6.979)                         | (0,01)               |
| 496.178 NZD        | 313.117 US\$        | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 1         | (9.157)                         | (0,01)               |
| 7.303.027 SEK      | 711.071 US\$        | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (34.466)                        | (0,05)               |
| 6.362.779 SEK      | 619.779 US\$        | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 3         | (30.284)                        | (0,04)               |
| 1.368.437 SEK      | 133.489 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | (6.707)                         | (0,01)               |
| 4.256.386 SEK      | 399.840 US\$        | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 2         | (5.498)                         | (0,01)               |
| 342.465 US\$       | 317.722 €           | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (4.439)                         | (0,01)               |
| 526.097 US\$       | 702.113 CAD         | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (4.626)                         | (0,01)               |
| 352.186 US\$       | 6.452.621 MXN       | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (22.881)                        | (0,03)               |
| 166.185 US\$       | 1.806.980 SEK       | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (1.227)                         | (0,00)               |
| 677.716 US\$       | 606.359 CHF         | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (1.142)                         | (0,00)               |
| 337.641 US\$       | 551.191 NZD         | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (21)                            | (0,00)               |
| 346.661 US\$       | 3.781.475 NOK       | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (6.501)                         | (0,01)               |
| 761.242 US\$       | 611.842 €           | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 3         | (16.708)                        | (0,02)               |
| 347.762 US\$       | 123.379.034 HUF     | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (11.536)                        | (0,02)               |
| 388.515 US\$       | 1.682.517 PLN       | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (25.257)                        | (0,04)               |
| 2.600.230 US\$     | 2.074.891 €         | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 5         | (37.970)                        | (0,06)               |
| 1.348.453 US\$     | 2.041.236 AUD       | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 3         | (10.928)                        | (0,02)               |
| 1.544.102 US\$     | 2.065.275 CAD       | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 3         | (17.027)                        | (0,03)               |
| 345.388 US\$       | 310.176 CHF         | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 1         | (1.873)                         | (0,00)               |
| 178.085 US\$       | 736.929 PLN         | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 1         | (3.144)                         | (0,00)               |
| 55.750 US\$        | 51.705 €            | 20.07.2023       | Deutsche Bank AG               | 1         | (704)                           | (0,00)               |
| 1.216.338 US\$     | 1.621.320 CAD       | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 4         | (9.208)                         | (0,01)               |
| 341.848 US\$       | 3.662.472 NOK       | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | (201)                           | (0,00)               |
| 486.750 US\$       | 731.609 AUD         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | (472)                           | (0,00)               |
| 1.705.752 US\$     | 1.527.909 CHF       | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 3         | (4.839)                         | (0,01)               |
| 1.649.168 US\$     | 1.320.737 €         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 3         | (30.134)                        | (0,04)               |
| 2.042.602 US\$     | 1.883.630 €         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 4         | (14.037)                        | (0,02)               |
| 171.227 US\$       | 3.778.381 CZK       | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | (2.152)                         | (0,00)               |
| 45.075 US\$        | 188.165 PLN         | 20.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (1.199)                         | (0,00)               |
| 1.126.773 US\$     | 900.000 €           | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 2         | (17.566)                        | (0,03)               |
| 1.599.023 US\$     | 29.618.200 MXN      | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 2         | (122.572)                       | (0,18)               |
| 302.037 US\$       | 406.288 CAD         | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | (5.073)                         | (0,01)               |
| 263.282 US\$       | 1.120.000 PLN       | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | (12.154)                        | (0,02)               |
| 356.933 US\$       | 3.881.357 NOK       | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (5.558)                         | (0,01)               |
| 14.610 US\$        | 75.411 BRL          | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (978)                           | (0,00)               |
| 859.366 US\$       | 770.625 CHF         | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 2         | (3.398)                         | (0,00)               |

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (2,30 %) (31. Dezember 2022: (6,38 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 411.495 US\$       | 380.214 €           | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 2         | (3.642)                         | (0,01)               |
| 1.027.167 US\$     | 1.369.593 CAD       | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (8.101)                         | (0,01)               |
| 4.256.386 SEK      | 399.840 US\$        | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 2         | (5.498)                         | (0,01)               |
| 342.465 US\$       | 317.722 €           | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (4.439)                         | (0,01)               |
| 526.097 US\$       | 702.113 CAD         | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (4.626)                         | (0,01)               |
| 352.186 US\$       | 6.452.621 MXN       | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (22.881)                        | (0,03)               |
| 166.185 US\$       | 1.806.980 SEK       | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (1.227)                         | (0,00)               |
| 677.716 US\$       | 606.359 CHF         | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (1.142)                         | (0,00)               |
| 337.641 US\$       | 551.191 NZD         | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (21)                            | (0,00)               |
| 346.661 US\$       | 3.781.475 NOK       | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (6.501)                         | (0,01)               |
| 761.242 US\$       | 611.842 £           | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 3         | (16.708)                        | (0,02)               |
| 347.762 US\$       | 123.379.034 HUF     | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (11.536)                        | (0,02)               |
| 388.515 US\$       | 1.682.517 PLN       | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (25.257)                        | (0,04)               |
| 2.600.230 US\$     | 2.074.891 £         | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 5         | (37.970)                        | (0,06)               |
| 1.348.453 US\$     | 2.041.236 AUD       | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 3         | (10.928)                        | (0,02)               |
| 1.544.102 US\$     | 2.065.275 CAD       | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 3         | (17.027)                        | (0,03)               |
| 345.388 US\$       | 310.176 CHF         | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 1         | (1.873)                         | (0,00)               |
| 178.085 US\$       | 736.929 PLN         | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 1         | (3.144)                         | (0,00)               |
| 55.750 US\$        | 51.705 €            | 20.07.2023       | Deutsche Bank AG               | 1         | (704)                           | (0,00)               |
| 1.216.338 US\$     | 1.621.320 CAD       | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 4         | (9.208)                         | (0,01)               |
| 341.848 US\$       | 3.662.472 NOK       | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | (201)                           | (0,00)               |
| 486.750 US\$       | 731.609 AUD         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | (472)                           | (0,00)               |
| 1.705.752 US\$     | 1.527.909 CHF       | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 3         | (4.839)                         | (0,01)               |
| 1.649.168 US\$     | 1.320.737 £         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 3         | (30.134)                        | (0,04)               |
| 2.042.602 US\$     | 1.883.630 €         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 4         | (14.037)                        | (0,02)               |
| 171.227 US\$       | 3.778.381 CZK       | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | (2.152)                         | (0,00)               |
| 45.075 US\$        | 188.165 PLN         | 20.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (1.199)                         | (0,00)               |
| 1.126.773 US\$     | 900.000 £           | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 2         | (17.566)                        | (0,03)               |
| 1.599.023 US\$     | 29.618.200 MXN      | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 2         | (122.572)                       | (0,18)               |
| 302.037 US\$       | 406.288 CAD         | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | (5.073)                         | (0,01)               |
| 263.282 US\$       | 1.120.000 PLN       | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | (12.154)                        | (0,02)               |
| 356.933 US\$       | 3.881.357 NOK       | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (5.558)                         | (0,01)               |
| 14.610 US\$        | 75.411 BRL          | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (978)                           | (0,00)               |
| 859.366 US\$       | 770.625 CHF         | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 2         | (3.398)                         | (0,00)               |
| 411.495 US\$       | 380.214 €           | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 2         | (3.642)                         | (0,01)               |
| 1.027.167 US\$     | 1.369.593 CAD       | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (8.101)                         | (0,01)               |
| 5.527.557 US\$     | 4.421.248 £         | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 5         | (94.008)                        | (0,14)               |
| 1.035.125 US\$     | 19.362.933 MXN      | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 2         | (90.370)                        | (0,13)               |
| 318.027 US\$       | 1.368.633 PLN       | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | (18.554)                        | (0,03)               |
| 349.495 US\$       | 323.040 €           | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | (3.216)                         | (0,00)               |

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (2,30 %) (31. Dezember 2022: (6,38 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 2.318.848 US\$  | 1.851.642 £         | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | (35.493)                        | (0,05)               |
| 300.423 US\$  | 104.500.000 HUF     | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 1         | (3.896)                         | (0,01)               |
| 49.498 ZAR  | 2.738 US\$          | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | (122)                           | (0,00)               |
| 569.437 ZAR   | 31.587 US\$         | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | (1.492)                         | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>   |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 7.298 €   | 8.026 US\$          | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (57)                            | (0,00)               |
| 127 €   | 141 US\$            | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | (2)                             | (0,00)               |
| 7.570 €   | 8.302 US\$          | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 3         | (37)                            | (0,00)               |
| 302 US\$  | 279 €               | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 3         | (2)                             | (0,00)               |
| 81 US\$   | 75 €                | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 1         | (1)                             | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>   |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 311 US\$  | 251 £               | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 2         | (8)                             | (0,00)               |
| 138 US\$  | 111 £               | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (3)                             | (0,00)               |
| 447 US\$  | 358 £               | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 3         | (8)                             | (0,00)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>oo</sup></b> |                     |                  |                                |           | <b>(1.560.899)</b>              | <b>(2,30)</b>        |

### Futures-Kontrakte (0,51 %) (31. Dezember 2022: (0,80 %))

| Anzahl Kontrakte   | Beschreibung  | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---|---------------------------------|----------------------|
| 16   | Canadian 10-Year Bond Future September 2023                       | (13.180)                        | (0,02)               |
| 6  | Canadian 5-Year Bond Future September 2023                        | (6.484)                         | (0,01)               |
| 1  | Euro-BOBL Call Option on Future August 2023, Strike Price EUR 116 | (61)                            | (0,00)               |
| (4)  | Euro-BTP Future September 2023                                    | (2.182)                         | (0,00)               |
| 6  | Euro-Bund Future September 2023                                   | (12.110)                        | (0,02)               |
| 55   | Euro-Schatz Future September 2023                                 | (42.882)                        | (0,06)               |
| 27   | US Treasury 10-Year Note (CBT) Future September 2023              | (51.771)                        | (0,08)               |
| 55   | US Treasury 2-Year Note (CBT) Future September 2023               | (130.054)                       | (0,19)               |
| 45   | US Treasury 5-Year Note (CBT) Future September 2023               | (84.008)                        | (0,13)               |
| 9  | US Treasury Long Bond (CBT) Future September 2023                 | (1.595)                         | (0,00)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten *</b> |   | <b>(344.327)</b>                | <b>(0,51)</b>        |

### Credit-Default-Swap-Kontrakte (0,73 %) (31. Dezember 2022: (0,09 %))

| Nominalwert   | Fälligkeit | Gegenpartei                 | Referenzverbindlichkeit                                  | Zeitwert US\$    | % des Nettovermögens |
|---|------------|-----------------------------|--|------------------|----------------------|
| EUR 1.200.000   | 20.06.2028 | ICE Clear U.S. <sup>1</sup> | Buying default protection on iTRAXX Europe Crossover S39 | (52.029)         | (0,07)               |
| EUR 8.358.000   | 20.12.2027 | ICE Clear U.S. <sup>1</sup> | Buying default protection on iTRAXX Europe Crossover S38 | (445.871)        | (0,66)               |
| <b>Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten insgesamt <sup>±</sup></b> |            |                             |  | <b>(497.900)</b> | <b>(0,73)</b>        |

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Zinsswap-Kontrakte (0,01 %) (31. Dezember 2022: (0,00 %))

|  | Nominalwert   | Fälligkeit | Gegenpartei                   | Erhalt/(Zahlung) <sup>#</sup> | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------|------------|-------------------------------|-------------------------------|-----------------|--------------------|---------------------------------|----------------------|
| KRW  | 1.267.973.000 | 11.08.2032 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 2,88 %          | 3M KORIBOR         | (32)                            | (0,00)               |
| KRW  | 730.294.000   | 18.02.2032 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 2,37 %          | 3M KORIBOR         | (34)                            | (0,00)               |
| AUD  | 1.879.000     | 28.06.2033 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 4,35 %          | 6M BBSW            | (4.627)                         | (0,01)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Zinsswapkontrakten<sup>∞</sup></b> |               |            |                               |                               |                 |                    | <b>(4.693)</b>                  | <b>(0,01)</b>        |

<sup>#</sup>Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

|   | Zeitwert US\$      | % des Nettovermögens |
|---|--------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(2.407.819)</b> | <b>(3,55)</b>        |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>65.758.550</b>  | <b>97,05</b>         |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>1.998.438</b>   | <b>2,95</b>          |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>67.756.988</b>  | <b>100,00</b>        |

| Portfolioanalyse  | US\$              | % des Gesamtvermögens |
|---|-------------------|-----------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 39.405.963        | 54,38                 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden            | 26.440.411        | 36,49                 |
| † Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente  | 163.567           | 0,23                  |
| µ Investmentfonds   | 51.906            | 0,07                  |
| ± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden                          | (197.005)         | (0,27)                |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap                            | (106.292)         | (0,15)                |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>65.758.550</b> | <b>90,75</b>          |

## Global Real Estate Securities - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der<br>Anteile  | Wertpapierbezeichnung               | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|-------------------------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Aktien 16,32 % (31. Dezember 2022: 17,55 %)</b>                         |                                     |                  |                              |
| <b>Kanadischer Dollar</b>  |                                     |                  |                              |
| 22.695   | Tricon Residential Inc              | 200.323          | 0,60                         |
| <b>Kanadischer Dollar insgesamt</b>  |                                     | <b>200.323</b>   | <b>0,60</b>                  |
| <b>Euro</b>  |                                     |                  |                              |
| 20.667   | Cellnex Telecom SA                  | 834.039          | 2,50                         |
| <b>Euro insgesamt</b>  |                                     | <b>834.039</b>   | <b>2,50</b>                  |
| <b>Hongkong-Dollar</b>   |                                     |                  |                              |
| 129.000  | CK Asset Holdings Ltd               | 716.767          | 2,15                         |
| 68.383   | Sun Hung Kai Properties Ltd         | 863.927          | 2,59                         |
| <b>Hongkong-Dollar insgesamt</b>   |                                     | <b>1.580.694</b> | <b>4,74</b>                  |
| <b>Japanischer Yen</b>   |                                     |                  |                              |
| 53.400   | Mitsui Fudosan Co Ltd               | 1.062.570        | 3,18                         |
| 15.700   | Nomura Real Estate Holdings Inc     | 372.642          | 1,12                         |
| <b>Japanischer Yen insgesamt</b>   |                                     | <b>1.435.212</b> | <b>4,30</b>                  |
| <b>Britisches Pfund</b>  |                                     |                  |                              |
| 155.306  | Grainger Plc                        | 448.603          | 1,34                         |
| <b>Britisches Pfund insgesamt</b>  |                                     | <b>448.603</b>   | <b>1,34</b>                  |
| <b>Singapur-Dollar</b>   |                                     |                  |                              |
| 199.300  | UOL Group Ltd                       | 949.256          | 2,84                         |
| <b>Singapur-Dollar insgesamt</b>   |                                     | <b>949.256</b>   | <b>2,84</b>                  |
| <b>Aktien insgesamt *</b>  |                                     | <b>5.448.127</b> | <b>16,32</b>                 |
| <b>Immobilienaktiengesellschaften 81,13 % (31. Dezember 2022: 77,80 %)</b> |                                     |                  |                              |
| <b>Australischer Dollar</b>  |                                     |                  |                              |
| 211.803  | Charter Hall Retail REIT            | 510.561          | 1,53                         |
| 122.975  | GPT Group                           | 340.027          | 1,02                         |
| 602.917  | Region RE Ltd                       | 913.710          | 2,74                         |
| <b>Australischer Dollar insgesamt</b>                                      |                                     | <b>1.764.298</b> | <b>5,29</b>                  |
| <b>Kanadischer Dollar</b>  |                                     |                  |                              |
| 15.292   | Canadian Apartment Properties REIT  | 587.758          | 1,76                         |
| 49.057   | RioCan Real Estate Investment Trust | 714.770          | 2,14                         |
| <b>Kanadischer Dollar insgesamt</b>  |                                     | <b>1.302.528</b> | <b>3,90</b>                  |
| <b>Euro</b>  |                                     |                  |                              |
| 3.563  | ARGAN SA                            | 264.332          | 0,79                         |

## Global Real Estate Securities - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile   | Wertpapierbezeichnung               | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|-------------------------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Immobilienaktiengesellschaften 81,13 % (31. Dezember 2022: 77,80 %) (Fortsetzung)</b> |                                     |                  |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |                                     |                  |                              |
| 5.819  | Gecina SA                           | 619.299          | 1,86                         |
| <b>Euro insgesamt</b>  |                                     | <b>883.631</b>   | <b>2,65</b>                  |
| <b>Hongkong-Dollar</b>   |                                     |                  |                              |
| 51.060   | Link REIT                           | 284.235          | 0,85                         |
| <b>Hongkong-Dollar insgesamt</b>   |                                     | <b>284.235</b>   | <b>0,85</b>                  |
| <b>Japanischer Yen</b>   |                                     |                  |                              |
| 635  | LaSalle Logiport REIT               | 665.141          | 1,99                         |
| 360  | Nippon Prologis REIT Inc            | 722.327          | 2,16                         |
| <b>Japanischer Yen insgesamt</b>   |                                     | <b>1.387.468</b> | <b>4,15</b>                  |
| <b>Britisches Pfund</b>  |                                     |                  |                              |
| 59.577   | Great Portland Estates Plc          | 314.334          | 0,94                         |
| 51.507   | Safestore Holdings Plc              | 555.954          | 1,67                         |
| 81.698   | Segro Plc                           | 744.517          | 2,23                         |
| 58.266   | UNITE Group Plc                     | 644.465          | 1,93                         |
| <b>Britisches Pfund insgesamt</b>  |                                     | <b>2.259.270</b> | <b>6,77</b>                  |
| <b>Singapur-Dollar</b>   |                                     |                  |                              |
| 296.300  | Mapletree Pan Asia Commercial Trust | 356.206          | 1,07                         |
| <b>Singapur-Dollar insgesamt</b>   |                                     | <b>356.206</b>   | <b>1,07</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>   |                                     |                  |                              |
| 7.616  | American Homes 4 Rent Class A       | 269.987          | 0,81                         |
| 8.213  | American Tower Corp                 | 1.592.829        | 4,77                         |
| 17.113   | Apartment Income REIT Corp          | 617.608          | 1,85                         |
| 3.710  | Boston Properties Inc               | 213.659          | 0,64                         |
| 9.516  | Crown Castle Inc                    | 1.084.253        | 3,25                         |
| 1.993  | EastGroup Properties Inc            | 345.985          | 1,04                         |
| 1.175  | Equinix Inc                         | 921.129          | 2,76                         |
| 8.425  | Equity LifeStyle Properties Inc     | 563.548          | 1,69                         |
| 7.925  | Equity Residential                  | 522.812          | 1,56                         |
| 2.687  | Essex Property Trust Inc            | 629.564          | 1,89                         |
| 3.365  | Extra Space Storage Inc             | 500.880          | 1,50                         |
| 14.406   | Healthpeak Properties Inc           | 289.561          | 0,87                         |
| 12.974   | Invitation Homes Inc                | 446.306          | 1,33                         |
| 11.595   | Iron Mountain Inc                   | 658.828          | 1,97                         |
| 38.274   | Kimco Realty Corp                   | 754.763          | 2,26                         |
| 1.566  | Life Storage Inc                    | 208.215          | 0,62                         |

## Global Real Estate Securities - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile   | Wertpapierbezeichnung               | Zeitwert US\$     | % des Nettovermögens |
|--|-------------------------------------|-------------------|----------------------|
| <b>Immobilienaktiengesellschaften 81,13 % (31. Dezember 2022: 77,80 %) (Fortsetzung)</b> |                                     |                   |                      |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |                                     |                   |                      |
| 6.273  | Omega Healthcare Investors Inc      | 192.519           | 0,58                 |
| 12.658   | Prologis Inc                        | 1.552.251         | 4,65                 |
| 4.889  | Public Storage                      | 1.427.001         | 4,27                 |
| 16.461   | Realty Income Corp                  | 984.203           | 2,95                 |
| 11.958   | Retail Opportunity Investments Corp | 161.553           | 0,48                 |
| 4.482  | Rexford Industrial Realty Inc       | 234.050           | 0,70                 |
| 1.993  | SBA Communications Corp Class A     | 461.898           | 1,38                 |
| 5.400  | Simon Property Group Inc            | 623.592           | 1,87                 |
| 2.716  | Sun Communities Inc                 | 354.329           | 1,06                 |
| 9.141  | UDR Inc                             | 392.698           | 1,18                 |
| 13.306   | Urban Edge Properties               | 205.312           | 0,62                 |
| 11.854   | Ventas Inc                          | 560.339           | 1,68                 |
| 21.563   | VICI Properties Inc Class A         | 677.725           | 2,03                 |
| 9.706  | Welltower Inc                       | 785.118           | 2,35                 |
| 18.314   | Weyerhaeuser Co                     | 613.702           | 1,84                 |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |                                     | <b>18.846.217</b> | <b>56,45</b>         |
| <b>Immobilienaktiengesellschaften insgesamt *</b>  |                                     | <b>27.083.853</b> | <b>81,13</b>         |
| <b>Anlagen insgesamt</b>   |                                     | <b>32.531.980</b> | <b>97,45</b>         |

Devisenterminkontrakte 0,06 % (31. Dezember 2022: 2,22 %)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens        |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|-----------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 315.605 €  | 339.570 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 2         | 5.023                          | 0,01                        |
| 243.208 €  | 263.087 US\$        | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 14        | 2.456                          | 0,01                        |
| 134.330 US\$   | 121.056 €           | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | 2.156                          | 0,01                        |
| 339.201 US\$   | 308.210 €           | 20.07.2023       | UBS AG                      | 4         | 2.683                          | 0,01                        |
| 595.486 US\$   | 540.135 €           | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 10        | 5.741                          | 0,02                        |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 3.632 £  | 4.563 US\$          | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 4         | 55                             | 0,00                        |
| 2.608 £  | 3.260 US\$          | 20.07.2023       | UBS AG                      | 2         | 56                             | 0,00                        |
| 88.223 £   | 110.118 US\$        | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 8         | 2.054                          | 0,00                        |
| 2.033 US\$   | 1.595 £             | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 2         | 5                              | 0,00                        |
| 3.101 US\$   | 2.438 £             | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 2         | 1                              | 0,00                        |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>                        |                     |                  |                             |           | <b>20.230</b>                  | <b>0,06</b>                 |
|  |                     |                  |                             |           | <b>Zeitwert US\$</b>           | <b>% des Nettovermögens</b> |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> |                     |                  |                             |           | <b>32.552.210</b>              | <b>97,51</b>                |



## Global Real Estate Securities - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (0,24 %) (31. Dezember 2022: (0,38 %))

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 462.291 €  | 507.860 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 5         | (3.109)                         | (0,01)               |
| 5.545.900 €  | 6.083.364 US\$      | 20.07.2023       | UBS AG                      | 6         | (28.081)                        | (0,09)               |
| 5.253.583 €  | 5.777.851 US\$      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 9         | (41.733)                        | (0,13)               |
| 572.892 US\$   | 527.109 €           | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 5         | (2.632)                         | (0,00)               |
| 170.735 US\$   | 156.376 €           | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | (4)                             | (0,00)               |
| 426.566 US\$   | 395.547 €           | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 13        | (5.311)                         | (0,01)               |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 492 £  | 631 US\$            | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (5)                             | (0,00)               |
| 988 £  | 1.260 US\$          | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 1         | (3)                             | (0,00)               |
| 4.257 US\$   | 3.408 £             | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 3         | (77)                            | (0,00)               |
| 7.683 US\$   | 6.169 £             | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 9         | (163)                           | (0,00)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                             |           | <b>(81.118)</b>                 | <b>(0,24)</b>        |

|   | Zeitwert US\$     | % des Nettovermögens |
|---|-------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(81.118)</b>   | <b>(0,24)</b>        |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>32.471.092</b> | <b>97,27</b>         |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>912.400</b>    | <b>2,73</b>          |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>33.383.492</b> | <b>100,00</b>        |

| Portfolioanalyse  | US\$              | % des Gesamtvermögens |
|---|-------------------|-----------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 32.531.980        | 96,66                 |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente   | (60.888)          | (0,18)                |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>32.471.092</b> | <b>96,48</b>          |

## Global Sustainable Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der Anteile                                 | Wertpapierbezeichnung     | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---------------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Aktien 99,12 % (31. Dezember 2022: 99,20 %)</b> |                           |                   |                              |
| <b>Dänische Krone</b>                              |                           |                   |                              |
| 15.026   | Novo Nordisk A/S Class B  | 2.420.505         | 1,61                         |
| <b>Dänische Krone insgesamt</b>                    |                           | <b>2.420.505</b>  | <b>1,61</b>                  |
| <b>Euro</b>  |                           |                   |                              |
| 2.413  | Adyen NV                  | 4.174.750         | 2,78                         |
| 58.216   | Alfen NV                  | 3.911.171         | 2,60                         |
| 5.314  | ASML Holding NV           | 3.843.791         | 2,56                         |
| 102.088  | HelloFresh SE             | 2.517.143         | 1,67                         |
| 5.225  | L'Oreal SA                | 2.434.673         | 1,62                         |
| 92.444   | TeamViewer SE             | 1.483.598         | 0,99                         |
| <b>Euro insgesamt</b>                              |                           | <b>18.365.126</b> | <b>12,22</b>                 |
| <b>Japanischer Yen</b>                             |                           |                   |                              |
| 55.300   | Recruit Holdings Co Ltd   | 1.761.988         | 1,17                         |
| <b>Japanischer Yen insgesamt</b>                   |                           | <b>1.761.988</b>  | <b>1,17</b>                  |
| <b>Norwegische Krone</b>                           |                           |                   |                              |
| 70.096   | Bakkafrost P/F            | 4.200.441         | 2,80                         |
| <b>Norwegische Krone insgesamt</b>                 |                           | <b>4.200.441</b>  | <b>2,80</b>                  |
| <b>Britisches Pfund</b>                            |                           |                   |                              |
| 169.274  | 3i Group Plc              | 4.193.298         | 2,79                         |
| <b>Britisches Pfund insgesamt</b>                  |                           | <b>4.193.298</b>  | <b>2,79</b>                  |
| <b>Schwedische Krone</b>                           |                           |                   |                              |
| 92.360   | Assa Abloy AB Class B     | 2.214.663         | 1,47                         |
| 161.363  | Atlas Copco AB Class A    | 2.321.555         | 1,55                         |
| <b>Schwedische Krone insgesamt</b>                 |                           | <b>4.536.218</b>  | <b>3,02</b>                  |
| <b>Schweizer Franken</b>                           |                           |                   |                              |
| 18.932   | Nestle SA                 | 2.276.961         | 1,51                         |
| 2.600  | Partners Group Holding AG | 2.445.828         | 1,63                         |
| 10.372   | Straumann Holding AG      | 1.682.777         | 1,12                         |
| 2.871  | VAT Group AG              | 1.187.358         | 0,79                         |
| <b>Schweizer Franken insgesamt</b>                 |                           | <b>7.592.924</b>  | <b>5,05</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>                                   |                           |                   |                              |
| 20.671   | Abbott Laboratories       | 2.253.552         | 1,50                         |
| 10.058   | Adobe Inc                 | 4.918.261         | 3,27                         |
| 74.645   | Alphabet Inc Class A      | 8.935.006         | 5,95                         |

## Global Sustainable Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile  | Wertpapierbezeichnung        | Zeitwert US\$      | % des Nettovermögens         |
|---|------------------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Aktien 99,12% (31. Dezember 2022: 99,20 %) (Fortsetzung)</b>   |                              |                    |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>  |                              |                    |                              |
| 65.470  | Amazon.com Inc               | 8.534.669          | 5,68                         |
| 19.067  | Applied Materials Inc        | 2.755.944          | 1,83                         |
| 46.164  | Brown & Brown Inc            | 3.177.930          | 2,12                         |
| 11.682  | Danaher Corp                 | 2.803.680          | 1,87                         |
| 7.296   | Elevance Health Inc          | 3.241.540          | 2,16                         |
| 21.663  | Estee Lauder Cos Inc Class A | 4.254.180          | 2,83                         |
| 7.884   | Intuit Inc                   | 3.612.370          | 2,40                         |
| 7.610   | Mastercard Inc Class A       | 2.993.013          | 1,99                         |
| 44.222  | Match Group Inc              | 1.850.691          | 1,23                         |
| 36.842  | Microsoft Corp               | 12.546.175         | 8,35                         |
| 9.943   | Moody's Corp                 | 3.457.380          | 2,30                         |
| 43.963  | Nasdaq Inc                   | 2.191.556          | 1,46                         |
| 10.507  | Netflix Inc                  | 4.628.228          | 3,08                         |
| 37.952  | NIKE Inc Class B             | 4.188.762          | 2,79                         |
| 8.628   | Nordson Corp                 | 2.141.297          | 1,43                         |
| 9.199   | S&P Global Inc               | 3.687.787          | 2,45                         |
| 7.593   | SolarEdge Technologies Inc   | 2.042.897          | 1,36                         |
| 9.092   | Synopsys Inc                 | 3.958.748          | 2,64                         |
| 9.138   | Thermo Fisher Scientific Inc | 4.767.751          | 3,17                         |
| 6.220   | Ulta Beauty Inc              | 2.927.101          | 1,95                         |
| 11.425  | UnitedHealth Group Inc       | 5.491.312          | 3,66                         |
| 12.172  | Visa Inc Class A             | 2.890.607          | 1,92                         |
| 9.357   | Zoetis Inc Class A           | 1.611.369          | 1,07                         |
|   | <b>US-Dollar insgesamt</b>   | <b>105.861.806</b> | <b>70,46</b>                 |
|   | <b>Aktien insgesamt *</b>    | <b>148.932.306</b> | <b>99,12</b>                 |
|   | <b>Anlagen insgesamt</b>     | <b>148.932.306</b> | <b>99,12</b>                 |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>  |                              | <b>148.932.306</b> | <b>99,12</b>                 |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>            |                              | <b>148.932.306</b> | <b>99,12</b>                 |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  |                              | <b>1.316.921</b>   | <b>0,88</b>                  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                 |                              | <b>150.249.227</b> | <b>100,00</b>                |
| <b>Portfolioanalyse</b>   |                              | <b>US\$</b>        | <b>% des Gesamtvermögens</b> |
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind |                              | 148.932.306        | 99,05                        |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  |                              | <b>148.932.306</b> | <b>99,05</b>                 |

## High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital-<br>betrag  | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---|---------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 1,77 % (31. Dezember 2022: 0,95 %)</b> |   |         |                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar</b>  |   |         |                       |                   |                              |
| 2.375.000   | 37 Capital CLO II Series 2022-1X Class E                          | 13,63 % | 15.07.2034            | 2.349.564         | 0,11                         |
| 1.000.000   | AB BSL CLO 3 Ltd Series 2021-3X Class E                           | 12,54 % | 20.10.2034            | 913.034           | 0,04                         |
| 4.000.000   | AB BSL CLO 4 Ltd Series 2023-4X Class D                           | 10,46 % | 20.04.2036            | 4.011.282         | 0,18                         |
| 2.000.000   | AGL CLO 14 Ltd Series 2021-14X Class E                            | 12,25 % | 02.12.2034            | 1.792.887         | 0,08                         |
| 1.000.000   | AGL CLO 23 Ltd Series 2022-23X Class D                            | 10,70 % | 20.01.2036            | 1.004.712         | 0,05                         |
| 1.400.000   | Aimco CDO Series 2020-12X Class ER                                | 11,41 % | 17.01.2032            | 1.300.847         | 0,06                         |
| 1.000.000   | Benefit Street Partners CLO XII Ltd Series 2017-12X Class D       | 11,98 % | 15.10.2030            | 843.044           | 0,04                         |
| 1.500.000   | Benefit Street Partners CLO XXXI Ltd Series 2023-31X Class D      | 9,87 %  | 25.04.2036            | 1.507.583         | 0,07                         |
| 4.500.000   | Clover CLO 2021-3 LLC Series 2021-3X Class E                      | 12,07 % | 25.01.2035            | 4.254.353         | 0,19                         |
| 1.350.000   | Galaxy XIX CLO Ltd Series 2015-19X Class D1R                      | 12,14 % | 24.07.2030            | 1.137.990         | 0,05                         |
| 1.250.000   | Grippen Park CLO Ltd Series 2017-1X Class E                       | 11,29 % | 20.01.2030            | 1.090.048         | 0,05                         |
| 2.750.000   | Invesco US CLO 2023-1 Ltd Series 2023-1X Class D                  | 10,37 % | 22.04.2035            | 2.762.672         | 0,12                         |
| 2.500.000   | Invesco US CLO 2023-2 Ltd Series 2023-2X Class D                  | 9,81 %  | 21.04.2036            | 2.497.832         | 0,11                         |
| 2.000.000   | Oaktree CLO 2023-1 Ltd Series 2023-1X Class D                     | 10,11 % | 15.04.2036            | 2.010.446         | 0,09                         |
| 2.000.000   | Ocean Trails CLO XIV Ltd Series 2023-14X Class D                  | 10,60 % | 20.01.2035            | 2.010.093         | 0,09                         |
| 3.250.000   | OCP CLO 2023-26 Ltd Series 2023-26X Class D                       | 10,08 % | 17.04.2036            | 3.268.340         | 0,15                         |
| 2.000.000   | Symphony CLO 38 Ltd Series 2023-38X Class D                       | 10,02 % | 24.04.2036            | 1.975.882         | 0,09                         |
| 2.250.000   | Symphony CLO XXIV Ltd Series 2020-24X Class E                     | 12,61 % | 23.01.2032            | 2.105.313         | 0,09                         |
| 2.500.000   | Trinitas CLO XXI Ltd Series 2022-21X Class D                      | 11,65 % | 20.01.2036            | 2.513.587         | 0,11                         |
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) insgesamt **</b>                       |   |         |                       | <b>39.349.509</b> | <b>1,77</b>                  |
| <b>Unternehmensanleihen 88,05 % (31. Dezember 2022: 86,24 %)</b>                          |   |         |                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar</b>  |   |         |                       |                   |                              |
| 1.995.000   | 1011778 BC ULC/New Red Finance Inc**                              | 3,50 %  | 15.02.2029            | 1.751.463         | 0,08                         |
| 4.915.000   | 1011778 BC ULC/New Red Finance Inc**                              | 3,88 %  | 15.01.2028            | 4.497.759         | 0,20                         |
| 6.520.000   | 1011778 BC ULC/New Red Finance Inc**                              | 4,00 %  | 15.10.2030            | 5.587.853         | 0,25                         |
| 8.815.000   | 180 Medical Inc**   | 3,88 %  | 15.10.2029            | 7.698.789         | 0,35                         |
| 2.265.000   | Abercrombie & Fitch Management Co**                               | 8,75 %  | 15.07.2025            | 2.301.336         | 0,10                         |
| 3.160.000   | Adient Global Holdings Ltd**                                      | 4,88 %  | 15.08.2026            | 3.005.510         | 0,14                         |
| 1.025.000   | Adient Global Holdings Ltd**                                      | 8,25 %  | 15.04.2031            | 1.042.096         | 0,05                         |
| 6.155.000   | Advanced Drainage Systems Inc**                                   | 6,38 %  | 15.06.2030            | 6.096.035         | 0,27                         |
| 3.444.000   | AerCap Global Aviation Trust*                                     | 6,50 %  | 15.06.2045            | 3.334.803         | 0,15                         |
| 6.630.000   | Ahead DB Holdings LLC**   | 6,63 %  | 01.05.2028            | 5.399.273         | 0,24                         |
| 6.355.000   | Ahlstrom Holding 3 Oy*  | 4,88 %  | 04.02.2028            | 5.283.525         | 0,24                         |
| 2.820.000   | Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC** | 3,50 %  | 15.03.2029            | 2.443.827         | 0,11                         |
| 2.640.000   | Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC** | 4,88 %  | 15.02.2030            | 2.439.862         | 0,11                         |
| 990.000   | Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC** | 5,88 %  | 15.02.2028            | 963.072           | 0,04                         |
| 7.245.000   | Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC** | 6,50 %  | 15.02.2028            | 7.265.250         | 0,33                         |
| 16.903.000  | Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer**    | 6,75 %  | 15.10.2027            | 15.912.991        | 0,72                         |

## High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 88,05 % (31. Dezember 2022: 86,24 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 4.560.000  | Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer**              | 6,75 % | 15.04.2028            | 4.527.411        | 0,20                         |
| 2.780.000  | Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp**                 | 6,00 % | 01.06.2029            | 2.054.977        | 0,09                         |
| 3.480.000  | Allwyn Entertainment Financing UK Plc**                                     | 7,88 % | 30.04.2029            | 3.537.455        | 0,16                         |
| 8.810.000  | Altice France Holding SA**  | 6,00 % | 15.02.2028            | 4.305.676        | 0,19                         |
| 8.280.000  | Altice France SA <sup>†</sup>   | 5,50 % | 15.01.2028            | 6.262.179        | 0,28                         |
| 4.570.000  | Altice France SA**  | 5,50 % | 15.10.2029            | 3.272.770        | 0,15                         |
| 4.985.000  | American Airlines Inc**   | 7,25 % | 15.02.2028            | 4.960.467        | 0,22                         |
| 19.675.000   | American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd**                           | 5,50 % | 20.04.2026            | 19.509.527       | 0,88                         |
| 23.040.000   | American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd**                           | 5,75 % | 20.04.2029            | 22.392.088       | 1,01                         |
| 3.770.000  | American Tower Corp <sup>†</sup>  | 2,95 % | 15.01.2051            | 2.382.069        | 0,11                         |
| 3.465.000  | Amgen Inc**   | 3,38 % | 21.02.2050            | 2.541.665        | 0,11                         |
| 2.470.000  | Amkor Technology Inc**  | 6,63 % | 15.09.2027            | 2.476.881        | 0,11                         |
| 1.091.000  | Amsted Industries Inc**   | 5,63 % | 01.07.2027            | 1.056.273        | 0,05                         |
| 1.270.000  | AmWINS Group Inc**  | 4,88 % | 30.06.2029            | 1.148.179        | 0,05                         |
| 2.385.000  | Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp**                | 5,38 % | 15.06.2029            | 2.218.480        | 0,10                         |
| 3.675.000  | Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp**                | 5,75 % | 01.03.2027            | 3.547.612        | 0,16                         |
| 2.410.000  | Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp**                | 7,88 % | 15.05.2026            | 2.446.490        | 0,11                         |
| 3.000.000  | APi Group DE Inc**  | 4,13 % | 15.07.2029            | 2.593.351        | 0,12                         |
| 1.135.000  | APi Group DE Inc**  | 4,75 % | 15.10.2029            | 1.023.560        | 0,05                         |
| 11.810.000   | APX Group Inc**   | 5,75 % | 15.07.2029            | 10.266.407       | 0,46                         |
| 920.000  | Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc** | 4,00 % | 01.09.2029            | 729.660          | 0,03                         |
| 5.370.000  | Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc** | 6,00 % | 15.06.2027            | 5.280.748        | 0,24                         |
| 8.375.000  | Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc**                      | 4,13 % | 15.08.2026            | 7.810.957        | 0,35                         |
| 1.575.000  | Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc <sup>†</sup>           | 5,25 % | 15.08.2027            | 1.336.209        | 0,06                         |
| 8.045.000  | Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc**                      | 5,25 % | 15.08.2027            | 6.825.269        | 0,31                         |
| 575.000  | Asbury Automotive Group Inc**   | 4,63 % | 15.11.2029            | 511.022          | 0,02                         |
| 9.705.000  | Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**                      | 5,88 % | 30.06.2029            | 8.668.323        | 0,39                         |
| 4.880.000  | Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**                      | 7,00 % | 01.11.2026            | 4.727.938        | 0,21                         |
| 5.185.000  | Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**                      | 8,25 % | 31.12.2028            | 5.103.617        | 0,23                         |
| 1.758.000  | Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**                      | 9,00 % | 01.11.2027            | 2.187.734        | 0,10                         |
| 8.544.000  | ASGN Inc**  | 4,63 % | 15.05.2028            | 7.738.173        | 0,35                         |
| 5.949.000  | AssuredPartners Inc**   | 5,63 % | 15.01.2029            | 5.154.948        | 0,23                         |
| 7.035.000  | AssuredPartners Inc**   | 7,00 % | 15.08.2025            | 6.956.520        | 0,31                         |
| 4.435.000  | AthenaHealth Group Inc**  | 6,50 % | 15.02.2030            | 3.737.109        | 0,17                         |
| 2.384.000  | ATI Inc <sup>†</sup>  | 4,88 % | 01.10.2029            | 2.151.092        | 0,10                         |
| 3.325.000  | ATI Inc <sup>†</sup>  | 5,88 % | 01.12.2027            | 3.222.780        | 0,15                         |
| 2.520.000  | ATS Corp**  | 4,13 % | 15.12.2028            | 2.258.101        | 0,10                         |
| 7.575.000  | Avient Corp**   | 7,13 % | 01.08.2030            | 7.668.354        | 0,35                         |
| 4.380.000  | Avolon Holdings Funding Ltd**   | 5,25 % | 15.05.2024            | 4.304.570        | 0,19                         |
| 2.655.000  | Ball Corp <sup>†</sup>  | 6,00 % | 15.06.2029            | 2.638.406        | 0,12                         |

## High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 88,05 % (31. Dezember 2022: 86,24 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 7.120.000  | Bank of America Corp**  | 6,13 %  | 29.12.2049            | 6.975.108        | 0,31                         |
| 3.470.000  | Bank of New York Mellon Corp**  | 3,70 %  | 29.12.2049            | 3.076.155        | 0,14                         |
| 3.040.000  | Bath & Body Works Inc**   | 6,63 %  | 01.10.2030            | 2.938.214        | 0,13                         |
| 2.490.000  | Bath & Body Works Inc*  | 6,88 %  | 01.11.2035            | 2.282.119        | 0,10                         |
| 5.010.000  | BCPE Empire Holdings Inc**  | 7,63 %  | 01.05.2027            | 4.664.757        | 0,21                         |
| 5.630.000  | Benteler International AG**   | 10,50 % | 15.05.2028            | 5.691.677        | 0,26                         |
| 5.700.000  | Berry Global Inc**  | 5,63 %  | 15.07.2027            | 5.584.005        | 0,25                         |
| 3.115.000  | BroadStreet Partners Inc**  | 5,88 %  | 15.04.2029            | 2.705.578        | 0,12                         |
| 2.115.000  | Buckeye Partners LP**   | 4,35 %  | 15.10.2024            | 2.066.989        | 0,09                         |
| 3.860.000  | Buckeye Partners LP**   | 4,50 %  | 01.03.2028            | 3.462.224        | 0,16                         |
| 7.967.000  | Buckeye Partners LP**   | 5,60 %  | 15.10.2044            | 5.749.186        | 0,26                         |
| 10.052.000   | Buckeye Partners LP**   | 5,85 %  | 15.11.2043            | 7.469.139        | 0,34                         |
| 1.760.000  | Builders FirstSource Inc**  | 5,00 %  | 01.03.2030            | 1.647.403        | 0,07                         |
| 5.350.000  | Builders FirstSource Inc**  | 6,38 %  | 15.06.2032            | 5.321.224        | 0,24                         |
| 11.150.000   | Caesars Entertainment Inc**   | 4,63 %  | 15.10.2029            | 9.746.333        | 0,44                         |
| 2.475.000  | Caesars Entertainment Inc**   | 6,25 %  | 01.07.2025            | 2.465.766        | 0,11                         |
| 1.545.000  | Caesars Entertainment Inc**   | 8,13 %  | 01.07.2027            | 1.582.998        | 0,07                         |
| 6.640.000  | Calderys Financing LLC**  | 11,25 % | 01.06.2028            | 6.812.906        | 0,31                         |
| 1.820.000  | Callon Petroleum Co**   | 7,50 %  | 15.06.2030            | 1.719.594        | 0,08                         |
| 2.319.000  | Calpine Corp**  | 4,63 %  | 01.02.2029            | 1.959.223        | 0,09                         |
| 4.447.000  | Calpine Corp**  | 5,00 %  | 01.02.2031            | 3.683.685        | 0,17                         |
| 85.000   | Calpine Corp**  | 5,13 %  | 15.03.2028            | 75.971           | 0,00                         |
| 8.865.000  | Camelot Return Merger Sub Inc**   | 8,75 %  | 01.08.2028            | 8.389.121        | 0,38                         |
| 3.805.000  | Carnival Corp**   | 5,75 %  | 01.03.2027            | 3.506.365        | 0,16                         |
| 2.520.000  | Carnival Corp**   | 7,63 %  | 01.03.2026            | 2.470.416        | 0,11                         |
| 6.860.000  | Carnival Corp**   | 9,88 %  | 01.08.2027            | 7.151.783        | 0,32                         |
| 7.455.000  | Carnival Holdings Bermuda Ltd**   | 10,38 % | 01.05.2028            | 8.160.792        | 0,37                         |
| 2.180.000  | Carnival Plc*   | 7,88 %  | 01.06.2027            | 2.210.504        | 0,10                         |
| 278.000  | Carpenter Technology Corp*  | 6,38 %  | 15.07.2028            | 272.719          | 0,01                         |
| 5.205.000  | Carpenter Technology Corp*  | 7,63 %  | 15.03.2030            | 5.270.122        | 0,24                         |
| 3.290.000  | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**                                | 4,25 %  | 01.02.2031            | 2.664.471        | 0,12                         |
| 3.160.000  | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**                                | 4,25 %  | 15.01.2034            | 2.391.481        | 0,11                         |
| 2.015.000  | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**                                | 4,50 %  | 15.08.2030            | 1.679.686        | 0,08                         |
| 5.000.000  | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**                                | 4,50 %  | 01.05.2032            | 3.997.158        | 0,18                         |
| 5.800.000  | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**                                | 4,75 %  | 01.03.2030            | 4.964.705        | 0,22                         |
| 13.595.000   | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**                                | 5,00 %  | 01.02.2028            | 12.400.543       | 0,56                         |
| 4.375.000  | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**                                | 6,38 %  | 01.09.2029            | 4.126.691        | 0,19                         |
| 4.030.000  | CDW LLC/CDW Finance Corp**  | 3,57 %  | 01.12.2031            | 3.406.398        | 0,15                         |
| 3.675.000  | CDW LLC/CDW Finance Corp**  | 4,25 %  | 01.04.2028            | 3.373.911        | 0,15                         |
| 945.000  | Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co/Magnum Management Corp/Millennium Op** | 5,50 %  | 01.05.2025            | 938.724          | 0,04                         |

## High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 88,05 % (31. Dezember 2022: 86,24 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 935.000  | Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co/Magnum Management Corp/Millennium Op** | 6,50 %  | 01.10.2028            | 913.002          | 0,04                         |
| 5.895.000  | Central Parent Inc/CDK Global Inc**   | 7,25 %  | 15.06.2029            | 5.834.933        | 0,26                         |
| 10.010.000   | Chart Industries Inc**  | 7,50 %  | 01.01.2030            | 10.225.265       | 0,46                         |
| 9.220.000  | Chesapeake Energy Corp**  | 6,75 %  | 15.04.2029            | 9.156.711        | 0,41                         |
| 5.330.000  | CHS/Community Health Systems Inc**  | 5,25 %  | 15.05.2030            | 4.204.103        | 0,19                         |
| 2.210.000  | CHS/Community Health Systems Inc**  | 5,63 %  | 15.03.2027            | 1.949.668        | 0,09                         |
| 1.495.000  | CHS/Community Health Systems Inc**  | 6,00 %  | 15.01.2029            | 1.259.276        | 0,06                         |
| 2.425.000  | Churchill Downs Inc**   | 4,75 %  | 15.01.2028            | 2.251.809        | 0,10                         |
| 1.215.000  | Churchill Downs Inc**   | 5,50 %  | 01.04.2027            | 1.169.512        | 0,05                         |
| 9.655.000  | Churchill Downs Inc**   | 6,75 %  | 01.05.2031            | 9.558.450        | 0,43                         |
| 5.960.000  | Ciena Corp**  | 4,00 %  | 31.01.2030            | 5.198.014        | 0,23                         |
| 5.520.000  | Civitas Resources Inc**   | 8,38 %  | 01.07.2028            | 5.589.276        | 0,25                         |
| 5.360.000  | Civitas Resources Inc**   | 8,75 %  | 01.07.2031            | 5.440.668        | 0,25                         |
| 1.230.000  | Clarios Global LP**   | 6,75 %  | 15.05.2025            | 1.232.149        | 0,06                         |
| 1.280.000  | Clean Harbors Inc**   | 5,13 %  | 15.07.2029            | 1.213.137        | 0,05                         |
| 1.365.000  | Clearway Energy Operating LLC**   | 3,75 %  | 15.01.2032            | 1.113.243        | 0,05                         |
| 3.865.000  | CommScope Inc**   | 4,75 %  | 01.09.2029            | 3.050.879        | 0,14                         |
| 3.465.000  | CommScope Inc**   | 8,25 %  | 01.03.2027            | 2.776.774        | 0,13                         |
| 12.552.000   | CommScope Technologies LLC**  | 5,00 %  | 15.03.2027            | 8.754.847        | 0,39                         |
| 12.430.000   | Comstock Resources Inc**  | 5,88 %  | 15.01.2030            | 10.804.971       | 0,49                         |
| 10.699.000   | Comstock Resources Inc**  | 6,75 %  | 01.03.2029            | 9.799.928        | 0,44                         |
| 4.765.000  | Consensus Cloud Solutions Inc**   | 6,50 %  | 15.10.2028            | 4.078.363        | 0,18                         |
| 4.070.000  | Cornerstone Building Brands Inc**   | 6,13 %  | 15.01.2029            | 3.221.995        | 0,15                         |
| 6.045.000  | Coty Inc**  | 5,00 %  | 15.04.2026            | 5.799.145        | 0,26                         |
| 14.680.000   | CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC**                                    | 5,50 %  | 15.06.2031            | 13.116.912       | 0,59                         |
| 2.830.000  | Crestwood Midstream Partners LP/Crestwood Midstream Finance Corp**          | 5,63 %  | 01.05.2027            | 2.685.670        | 0,12                         |
| 515.000  | Crestwood Midstream Partners LP/Crestwood Midstream Finance Corp*           | 5,75 %  | 01.04.2025            | 506.454          | 0,02                         |
| 4.974.000  | Crestwood Midstream Partners LP/Crestwood Midstream Finance Corp**          | 6,00 %  | 01.02.2029            | 4.649.521        | 0,21                         |
| 4.275.000  | Crestwood Midstream Partners LP/Crestwood Midstream Finance Corp**          | 7,38 %  | 01.02.2031            | 4.218.641        | 0,19                         |
| 3.751.000  | Crestwood Midstream Partners LP/Crestwood Midstream Finance Corp**          | 8,00 %  | 01.04.2029            | 3.805.564        | 0,17                         |
| 1.165.000  | Crown Americas LLC/Crown Americas Capital Corp VI**                         | 4,75 %  | 01.02.2026            | 1.130.127        | 0,05                         |
| 4.805.000  | CSC Holdings LLC**  | 4,13 %  | 01.12.2030            | 3.365.859        | 0,15                         |
| 6.600.000  | CSC Holdings LLC**  | 4,63 %  | 01.12.2030            | 2.943.449        | 0,13                         |
| 4.305.000  | CSC Holdings LLC**  | 5,00 %  | 15.11.2031            | 2.009.156        | 0,09                         |
| 1.200.000  | CSC Holdings LLC**  | 5,25 %  | 01.06.2024            | 1.117.449        | 0,05                         |
| 4.155.000  | CSC Holdings LLC**  | 5,38 %  | 01.02.2028            | 3.344.778        | 0,15                         |
| 19.205.000   | CSC Holdings LLC**  | 5,75 %  | 15.01.2030            | 9.095.200        | 0,41                         |
| 2.760.000  | CSC Holdings LLC**  | 6,50 %  | 01.02.2029            | 2.233.905        | 0,10                         |
| 2.525.000  | CSC Holdings LLC**  | 11,25 % | 15.05.2028            | 2.451.560        | 0,11                         |
| 2.365.000  | Dana Inc*   | 4,50 %  | 15.02.2032            | 1.965.599        | 0,09                         |

## High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung  | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 88,05 % (31. Dezember 2022: 86,24 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |         |                       |                  |                              |
| 3.615.000  | Dana Inc <sup>*</sup>  | 5,38 %  | 15.11.2027            | 3.427.654        | 0,15                         |
| 1.130.000  | Darling Ingredients Inc <sup>**</sup>                            | 6,00 %  | 15.06.2030            | 1.104.766        | 0,05                         |
| 2.785.000  | DaVita Inc <sup>**</sup>   | 3,75 %  | 15.02.2031            | 2.230.248        | 0,10                         |
| 3.020.000  | DaVita Inc <sup>**</sup>   | 4,63 %  | 01.06.2030            | 2.595.955        | 0,12                         |
| 6.175.000  | Diamond Sports Group LLC/Diamond Sports Finance Co <sup>**</sup> | 5,38 %  | 15.08.2026            | 212.266          | 0,01                         |
| 7.170.000  | DISH DBS Corp <sup>**</sup>                                      | 5,13 %  | 01.06.2029            | 3.336.496        | 0,15                         |
| 4.400.000  | DISH DBS Corp <sup>**</sup>                                      | 5,25 %  | 01.12.2026            | 3.537.809        | 0,16                         |
| 1.865.000  | DISH DBS Corp <sup>**</sup>                                      | 7,75 %  | 01.07.2026            | 1.145.809        | 0,05                         |
| 7.305.000  | DISH Network Corp <sup>**</sup>                                  | 3,38 %  | 15.08.2026            | 3.743.813        | 0,17                         |
| 3.520.000  | DISH Network Corp <sup>**</sup>                                  | 11,75 % | 15.11.2027            | 3.439.185        | 0,16                         |
| 7.125.000  | DT Midstream Inc <sup>**</sup>                                   | 4,13 %  | 15.06.2029            | 6.259.635        | 0,28                         |
| 4.610.000  | Emerald Debt Merger Sub LLC <sup>**</sup>                        | 6,63 %  | 15.12.2030            | 4.575.425        | 0,21                         |
| 2.088.000  | Encompass Health Corp <sup>*</sup>                               | 4,50 %  | 01.02.2028            | 1.945.512        | 0,09                         |
| 10.230.000   | Energizer Holdings Inc <sup>**</sup>                             | 6,50 %  | 31.12.2027            | 9.847.941        | 0,44                         |
| 2.910.000  | EnLink Midstream LLC <sup>**</sup>                               | 6,50 %  | 01.09.2030            | 2.909.699        | 0,13                         |
| 6.655.000  | Envision Healthcare Corp <sup>**</sup>                           | 8,75 %  | 15.10.2026            | 109.042          | 0,01                         |
| 2.640.000  | EPR Properties <sup>*</sup>                                      | 3,75 %  | 15.08.2029            | 2.149.489        | 0,10                         |
| 3.660.000  | EPR Properties <sup>*</sup>                                      | 4,50 %  | 01.04.2025            | 3.469.062        | 0,16                         |
| 3.590.000  | EQM Midstream Partners LP <sup>*</sup>                           | 4,13 %  | 01.12.2026            | 3.342.251        | 0,15                         |
| 2.570.000  | EQM Midstream Partners LP <sup>**</sup>                          | 4,50 %  | 15.01.2029            | 2.294.915        | 0,10                         |
| 3.782.000  | EQM Midstream Partners LP <sup>**</sup>                          | 6,00 %  | 01.07.2025            | 3.743.645        | 0,17                         |
| 3.580.000  | EQM Midstream Partners LP <sup>**</sup>                          | 6,50 %  | 01.07.2027            | 3.534.448        | 0,16                         |
| 1.880.000  | EQM Midstream Partners LP <sup>**</sup>                          | 7,50 %  | 01.06.2027            | 1.899.815        | 0,09                         |
| 2.110.000  | EQM Midstream Partners LP <sup>**</sup>                          | 7,50 %  | 01.06.2030            | 2.137.168        | 0,10                         |
| 6.045.000  | EquipmentShare.com Inc <sup>**</sup>                             | 9,00 %  | 15.05.2028            | 5.875.574        | 0,26                         |
| 6.774.000  | Everi Holdings Inc <sup>**</sup>                                 | 5,00 %  | 15.07.2029            | 5.938.498        | 0,27                         |
| 2.635.000  | Fair Isaac Corp <sup>**</sup>                                    | 5,25 %  | 15.05.2026            | 2.573.736        | 0,12                         |
| 5.500.000  | First Quantum Minerals Ltd <sup>**</sup>                         | 6,88 %  | 15.10.2027            | 5.373.583        | 0,24                         |
| 2.988.000  | First Quantum Minerals Ltd <sup>**</sup>                         | 7,50 %  | 01.04.2025            | 2.988.480        | 0,13                         |
| 13.990.000   | First Quantum Minerals Ltd <sup>**</sup>                         | 8,63 %  | 01.06.2031            | 14.355.559       | 0,65                         |
| 2.780.000  | FMG Resources August 2006 Pty Ltd <sup>**</sup>                  | 4,38 %  | 01.04.2031            | 2.377.531        | 0,11                         |
| 1.145.000  | FMG Resources August 2006 Pty Ltd <sup>**</sup>                  | 6,13 %  | 15.04.2032            | 1.092.840        | 0,05                         |
| 4.650.000  | Foot Locker Inc <sup>**</sup>                                    | 4,00 %  | 01.10.2029            | 3.505.870        | 0,16                         |
| 3.005.000  | Ford Motor Co <sup>*</sup>                                       | 4,75 %  | 15.01.2043            | 2.313.441        | 0,10                         |
| 1.550.000  | Ford Motor Co <sup>*</sup>                                       | 5,29 %  | 08.12.2046            | 1.277.970        | 0,06                         |
| 2.380.000  | Ford Motor Co <sup>*</sup>                                       | 6,10 %  | 19.08.2032            | 2.308.912        | 0,10                         |
| 6.915.000  | Ford Motor Co <sup>*</sup>                                       | 7,45 %  | 16.07.2031            | 7.375.663        | 0,33                         |
| 1.975.000  | Ford Motor Co <sup>*</sup>                                       | 9,63 %  | 22.04.2030            | 2.299.281        | 0,10                         |
| 1.370.000  | Ford Motor Credit Co LLC <sup>*</sup>                            | 3,63 %  | 17.06.2031            | 1.124.352        | 0,05                         |
| 5.320.000  | Ford Motor Credit Co LLC <sup>*</sup>                            | 4,06 %  | 01.11.2024            | 5.152.838        | 0,23                         |



## High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                          | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 88,05 % (31. Dezember 2022: 86,24 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |        |                       |                  |                              |
| 2.480.000  | Ford Motor Credit Co LLC*                      | 4,13 % | 17.08.2027            | 2.266.831        | 0,10                         |
| 6.160.000  | Ford Motor Credit Co LLC*                      | 4,39 % | 08.01.2026            | 5.835.447        | 0,26                         |
| 2.765.000  | Ford Motor Credit Co LLC*                      | 4,69 % | 09.06.2025            | 2.665.921        | 0,12                         |
| 2.635.000  | Ford Motor Credit Co LLC*                      | 5,11 % | 03.05.2029            | 2.446.266        | 0,11                         |
| 1.685.000  | Ford Motor Credit Co LLC*                      | 6,80 % | 12.05.2028            | 1.688.373        | 0,08                         |
| 6.905.000  | Ford Motor Credit Co LLC*                      | 6,95 % | 06.03.2026            | 6.948.460        | 0,31                         |
| 3.590.000  | Ford Motor Credit Co LLC*                      | 6,95 % | 10.06.2026            | 3.611.253        | 0,16                         |
| 3.455.000  | Ford Motor Credit Co LLC*                      | 7,20 % | 10.06.2030            | 3.490.345        | 0,16                         |
| 6.480.000  | Ford Motor Credit Co LLC*                      | 7,35 % | 04.11.2027            | 6.633.058        | 0,30                         |
| 2.215.000  | Ford Motor Credit Co LLC*                      | 7,35 % | 06.03.2030            | 2.264.543        | 0,10                         |
| 4.055.000  | Ford Motor Credit Co LLC**                     | 8,04 % | 06.03.2026            | 4.069.127        | 0,18                         |
| 1.210.000  | Fortrea Holdings Inc**                         | 7,50 % | 01.07.2030            | 1.240.516        | 0,06                         |
| 2.925.000  | Frontier Communications Holdings LLC**         | 5,00 % | 01.05.2028            | 2.526.542        | 0,11                         |
| 6.500.000  | Frontier Communications Holdings LLC**         | 5,88 % | 01.11.2029            | 4.751.565        | 0,21                         |
| 2.500.000  | Frontier Communications Holdings LLC**         | 8,75 % | 15.05.2030            | 2.445.685        | 0,11                         |
| 2.730.000  | Garda World Security Corp**                    | 6,00 % | 01.06.2029            | 2.239.849        | 0,10                         |
| 2.895.000  | Gen Digital Inc**                              | 6,75 % | 30.09.2027            | 2.889.990        | 0,13                         |
| 3.910.000  | Gen Digital Inc**                              | 7,13 % | 30.09.2030            | 3.920.064        | 0,18                         |
| 1.050.000  | Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp* | 6,25 % | 15.05.2026            | 998.544          | 0,05                         |
| 3.885.000  | Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp* | 6,50 % | 01.10.2025            | 3.830.568        | 0,17                         |
| 2.890.000  | Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp* | 7,75 % | 01.02.2028            | 2.752.173        | 0,12                         |
| 2.445.000  | Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp* | 8,88 % | 15.04.2030            | 2.391.013        | 0,11                         |
| 2.085.000  | Glatfelter Corp**                              | 4,75 % | 15.11.2029            | 1.366.147        | 0,06                         |
| 6.351.232  | Global Aircraft Leasing Co Ltd**               | 6,50 % | 15.09.2024            | 5.821.158        | 0,26                         |
| 13.645.000   | Global Infrastructure Solutions Inc**          | 5,63 % | 01.06.2029            | 11.136.475       | 0,50                         |
| 1.425.000  | Global Infrastructure Solutions Inc**          | 7,50 % | 15.04.2032            | 1.213.248        | 0,05                         |
| 2.210.000  | Golden Entertainment Inc**                     | 7,63 % | 15.04.2026            | 2.222.022        | 0,10                         |
| 4.215.000  | Goodyear Tire & Rubber Co**                    | 5,00 % | 31.05.2026            | 4.123.602        | 0,19                         |
| 1.425.000  | Goodyear Tire & Rubber Co**                    | 5,25 % | 30.04.2031            | 1.253.219        | 0,06                         |
| 4.640.000  | GTCR AP Finance Inc**                          | 8,00 % | 15.05.2027            | 4.553.870        | 0,21                         |
| 6.700.000  | GYP Holdings III Corp**                        | 4,63 % | 01.05.2029            | 5.909.367        | 0,27                         |
| 6.515.000  | Harvest Midstream I LP**                       | 7,50 % | 01.09.2028            | 6.465.294        | 0,29                         |
| 1.867.000  | HealthEquity Inc**                             | 4,50 % | 01.10.2029            | 1.647.780        | 0,07                         |
| 1.543.000  | Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co**       | 5,75 % | 01.02.2029            | 1.398.696        | 0,06                         |
| 3.310.000  | Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co**       | 6,00 % | 15.04.2030            | 3.017.426        | 0,14                         |
| 2.680.000  | Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co**       | 6,00 % | 01.02.2031            | 2.398.940        | 0,11                         |
| 1.985.000  | Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co**       | 6,25 % | 01.11.2028            | 1.870.276        | 0,08                         |
| 2.330.000  | Hologic Inc**                                  | 4,63 % | 01.02.2028            | 2.197.654        | 0,10                         |
| 5.930.000  | Howard Midstream Energy Partners LLC**         | 6,75 % | 15.01.2027            | 5.653.959        | 0,25                         |
| 5.065.000  | Howard Midstream Energy Partners LLC**         | 8,88 % | 15.07.2028            | 5.096.656        | 0,23                         |

## High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 88,05 % (31. Dezember 2022: 86,24 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 4.010.000  | HUB International Ltd**   | 5,63 %  | 01.12.2029            | 3.601.448        | 0,16                         |
| 2.725.000  | HUB International Ltd**   | 7,00 %  | 01.05.2026            | 2.721.158        | 0,12                         |
| 13.525.000   | HUB International Ltd**   | 7,25 %  | 15.06.2030            | 13.978.223       | 0,63                         |
| 9.485.000  | Hudbay Minerals Inc**   | 4,50 %  | 01.04.2026            | 8.841.390        | 0,40                         |
| 7.485.000  | Hudbay Minerals Inc**   | 6,13 %  | 01.04.2029            | 6.900.272        | 0,31                         |
| 2.365.000  | IHO Verwaltungs GmbH*   | 6,38 %  | 15.05.2029            | 2.196.194        | 0,10                         |
| 3.060.000  | Iliad Holding SASU**  | 6,50 %  | 15.10.2026            | 2.890.852        | 0,13                         |
| 2.745.000  | Iliad Holding SASU**  | 7,00 %  | 15.10.2028            | 2.532.700        | 0,11                         |
| 11.295.000   | Imola Merger Corp**   | 4,75 %  | 15.05.2029            | 9.834.788        | 0,44                         |
| 4.530.000  | INEOS Finance Plc*  | 6,75 %  | 15.05.2028            | 4.355.512        | 0,20                         |
| 3.675.000  | INEOS Quattro Finance 2 Plc*  | 3,38 %  | 15.01.2026            | 3.357.225        | 0,15                         |
| 3.475.000  | Intelligent Packaging Ltd Finco Inc/Intelligent Packaging Ltd Co-Issuer LLC** | 6,00 %  | 15.09.2028            | 2.957.554        | 0,13                         |
| 5.760.000  | IQVIA Inc**   | 5,00 %  | 15.05.2027            | 5.545.611        | 0,25                         |
| 6.854.000  | Iron Mountain Inc**   | 4,88 %  | 15.09.2027            | 6.481.076        | 0,29                         |
| 2.460.000  | Iron Mountain Inc**   | 4,88 %  | 15.09.2029            | 2.204.249        | 0,10                         |
| 2.390.000  | Iron Mountain Inc**   | 5,00 %  | 15.07.2028            | 2.216.675        | 0,10                         |
| 6.671.000  | Iron Mountain Inc**   | 5,25 %  | 15.03.2028            | 6.244.074        | 0,28                         |
| 3.960.000  | Iron Mountain Inc**   | 5,25 %  | 15.07.2030            | 3.571.880        | 0,16                         |
| 6.985.000  | Iron Mountain Inc**   | 5,63 %  | 15.07.2032            | 6.258.941        | 0,28                         |
| 10.465.000   | ITT Holdings LLC**  | 6,50 %  | 01.08.2029            | 8.829.739        | 0,40                         |
| 4.810.000  | Jaguar Land Rover Automotive Plc*   | 5,50 %  | 15.07.2029            | 4.109.341        | 0,19                         |
| 3.980.000  | Jaguar Land Rover Automotive Plc*   | 5,88 %  | 15.01.2028            | 3.677.294        | 0,17                         |
| 5.745.000  | JELD-WEN Inc**  | 4,63 %  | 15.12.2025            | 5.572.104        | 0,25                         |
| 6.570.000  | JELD-WEN Inc**  | 4,88 %  | 15.12.2027            | 5.827.064        | 0,26                         |
| 8.305.000  | JPMorgan Chase & Co**   | 4,60 %  | 29.12.2049            | 7.765.175        | 0,35                         |
| 7.255.000  | KB Home**   | 7,25 %  | 15.07.2030            | 7.355.489        | 0,33                         |
| 3.055.000  | Kinetik Holdings LP**   | 5,88 %  | 15.06.2030            | 2.906.817        | 0,13                         |
| 6.240.000  | Knife River Corp**  | 7,75 %  | 01.05.2031            | 6.326.177        | 0,29                         |
| 3.375.000  | Latam Airlines Group SA**   | 13,38 % | 15.10.2027            | 3.653.927        | 0,16                         |
| 2.725.000  | Latam Airlines Group SA**   | 13,38 % | 15.10.2029            | 2.951.031        | 0,13                         |
| 5.845.000  | Leeward Renewable Energy Operations LLC**                                     | 4,25 %  | 01.07.2029            | 5.214.477        | 0,24                         |
| 3.510.000  | Legends Hospitality Holding Co LLC/Legends Hospitality Co-Issuer Inc**        | 5,00 %  | 01.02.2026            | 3.163.861        | 0,14                         |
| 8.510.000  | Level 3 Financing Inc**   | 3,75 %  | 15.07.2029            | 5.134.354        | 0,23                         |
| 8.130.000  | Level 3 Financing Inc**   | 3,88 %  | 15.11.2029            | 6.478.321        | 0,29                         |
| 8.056.000  | Level 3 Financing Inc**   | 4,63 %  | 15.09.2027            | 5.614.927        | 0,25                         |
| 2.469.000  | Level 3 Financing Inc**   | 10,50 % | 15.05.2030            | 2.507.400        | 0,11                         |
| 1.835.000  | Lindblad Expeditions Holdings Inc**   | 9,00 %  | 15.05.2028            | 1.863.494        | 0,08                         |
| 350.000  | Lindblad Expeditions LLC**  | 6,75 %  | 15.02.2027            | 333.704          | 0,02                         |
| 1.660.000  | Lions Gate Capital Holdings LLC**   | 5,50 %  | 15.04.2029            | 1.204.081        | 0,05                         |
| 1.275.000  | Live Nation Entertainment Inc**   | 3,75 %  | 15.01.2028            | 1.141.125        | 0,05                         |

## High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 88,05 % (31. Dezember 2022: 86,24 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 3.645.000  | Live Nation Entertainment Inc**                                   | 6,50 % | 15.05.2027            | 3.667.683        | 0,17                         |
| 1.280.000  | LPL Holdings Inc**  | 4,00 % | 15.03.2029            | 1.124.241        | 0,05                         |
| 1.245.000  | LPL Holdings Inc**  | 4,63 % | 15.11.2027            | 1.168.579        | 0,05                         |
| 2.040.000  | Lumen Technologies Inc**  | 4,00 % | 15.02.2027            | 1.522.564        | 0,07                         |
| 4.670.000  | Macy's Retail Holdings LLC*                                       | 4,50 % | 15.12.2034            | 3.363.334        | 0,15                         |
| 2.755.000  | Macy's Retail Holdings LLC*                                       | 5,13 % | 15.01.2042            | 1.878.369        | 0,08                         |
| 2.770.000  | Macy's Retail Holdings LLC**                                      | 5,88 % | 01.04.2029            | 2.530.672        | 0,11                         |
| 3.455.000  | Macy's Retail Holdings LLC**                                      | 5,88 % | 15.03.2030            | 3.082.516        | 0,14                         |
| 1.165.000  | Madison IAQ LLC**   | 5,88 % | 30.06.2029            | 945.000          | 0,04                         |
| 4.075.000  | Manitowoc Co Inc**  | 9,00 % | 01.04.2026            | 4.058.822        | 0,18                         |
| 1.360.000  | Masonite International Corp**                                     | 3,50 % | 15.02.2030            | 1.145.613        | 0,05                         |
| 2.725.000  | Masonite International Corp**                                     | 5,38 % | 01.02.2028            | 2.600.359        | 0,12                         |
| 4.624.000  | Match Group Holdings II LLC**                                     | 5,63 % | 15.02.2029            | 4.339.898        | 0,20                         |
| 2.625.000  | Mattamy Group Corp**  | 4,63 % | 01.03.2030            | 2.272.330        | 0,10                         |
| 1.210.000  | Mattamy Group Corp**  | 5,25 % | 15.12.2027            | 1.128.950        | 0,05                         |
| 5.770.000  | Mauser Packaging Solutions Holding Co**                           | 7,88 % | 15.08.2026            | 5.738.775        | 0,26                         |
| 13.745.000   | Mauser Packaging Solutions Holding Co**                           | 9,25 % | 15.04.2027            | 12.702.811       | 0,57                         |
| 8.565.000  | McAfee Corp**   | 7,38 % | 15.02.2030            | 7.456.324        | 0,34                         |
| 2.939.000  | McGraw-Hill Education Inc**                                       | 5,75 % | 01.08.2028            | 2.549.935        | 0,12                         |
| 4.855.000  | McGraw-Hill Education Inc**                                       | 8,00 % | 01.08.2029            | 4.148.161        | 0,19                         |
| 3.085.000  | MDC Holdings Inc*   | 2,50 % | 15.01.2031            | 2.427.019        | 0,11                         |
| 11.415.000   | Medline Borrower LP**   | 3,88 % | 01.04.2029            | 9.931.143        | 0,45                         |
| 5.400.000  | Medline Borrower LP**   | 5,25 % | 01.10.2029            | 4.691.137        | 0,21                         |
| 1.160.000  | Meritage Homes Corp*  | 5,13 % | 06.06.2027            | 1.115.642        | 0,05                         |
| 3.500.000  | Midcontinent Communications/Midcontinent Finance Corp**           | 5,38 % | 15.08.2027            | 3.283.473        | 0,15                         |
| 6.775.000  | Midwest Gaming Borrower LLC/Midwest Gaming Finance Corp**         | 4,88 % | 01.05.2029            | 5.988.748        | 0,27                         |
| 4.985.000  | MIWD Holdco II LLC/MIWD Finance Corp**                            | 5,50 % | 01.02.2030            | 4.119.056        | 0,19                         |
| 7.975.000  | Molina Healthcare Inc**   | 3,88 % | 15.05.2032            | 6.696.203        | 0,30                         |
| 4.885.000  | Molina Healthcare Inc**   | 4,38 % | 15.06.2028            | 4.508.153        | 0,20                         |
| 3.395.000  | MPH Acquisition Holdings LLC**                                    | 5,50 % | 01.09.2028            | 2.897.645        | 0,13                         |
| 3.175.000  | MPH Acquisition Holdings LLC**                                    | 5,75 % | 01.11.2028            | 2.393.569        | 0,11                         |
| 4.400.000  | MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp*                    | 5,00 % | 15.10.2027            | 3.706.072        | 0,17                         |
| 1.505.000  | MSCI Inc**  | 3,25 % | 15.08.2033            | 1.213.600        | 0,05                         |
| 4.030.000  | MSCI Inc**  | 4,00 % | 15.11.2029            | 3.650.860        | 0,16                         |
| 5.590.000  | Nabors Industries Inc**   | 7,38 % | 15.05.2027            | 5.324.363        | 0,24                         |
| 1.695.000  | Nabors Industries Ltd**   | 7,25 % | 15.01.2026            | 1.584.342        | 0,07                         |
| 1.505.000  | Nabors Industries Ltd**   | 7,50 % | 15.01.2028            | 1.318.801        | 0,06                         |
| 1.625.000  | NCL Corp Ltd**  | 5,88 % | 15.03.2026            | 1.521.754        | 0,07                         |
| 5.394.000  | NCL Corp Ltd**  | 5,88 % | 15.02.2027            | 5.255.804        | 0,24                         |
| 5.145.000  | Necessity Retail REIT Inc/American Finance Operating Partner LP** | 4,50 % | 30.09.2028            | 3.962.920        | 0,18                         |

## High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung  | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 88,05 % (31. Dezember 2022: 86,24 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |         |                       |                  |                              |
| 3.600.000  | Neptune Bidco US Inc**   | 9,29 %  | 15.04.2029            | 3.308.840        | 0,15                         |
| 20.235.000   | New Fortress Energy Inc**  | 6,50 %  | 30.09.2026            | 18.125.831       | 0,82                         |
| 5.875.000  | New Fortress Energy Inc**  | 6,75 %  | 15.09.2025            | 5.517.389        | 0,25                         |
| 8.285.000  | Newfold Digital Holdings Group Inc**   | 6,00 %  | 15.02.2029            | 6.226.923        | 0,28                         |
| 5.460.000  | NMG Holding Co Inc/Neiman Marcus Group LLC**                                   | 7,13 %  | 01.04.2026            | 5.087.988        | 0,23                         |
| 6.855.000  | Noble Finance II LLC**   | 8,00 %  | 15.04.2030            | 6.976.436        | 0,31                         |
| 6.185.000  | Northern Oil & Gas Inc**   | 8,13 %  | 01.03.2028            | 6.067.516        | 0,27                         |
| 7.000.000  | Northwest Fiber LLC/Northwest Fiber Finance Sub Inc**                          | 4,75 %  | 30.04.2027            | 6.188.700        | 0,28                         |
| 2.562.000  | Northwest Fiber LLC/Northwest Fiber Finance Sub Inc**                          | 6,00 %  | 15.02.2028            | 2.048.443        | 0,09                         |
| 115.000  | Northwest Fiber LLC/Northwest Fiber Finance Sub Inc**                          | 10,75 % | 01.06.2028            | 105.664          | 0,00                         |
| 4.305.000  | NOVA Chemicals Corp**  | 4,88 %  | 01.06.2024            | 4.209.773        | 0,19                         |
| 3.210.000  | NOVA Chemicals Corp**  | 5,25 %  | 01.06.2027            | 2.857.804        | 0,13                         |
| 8.415.000  | NRG Energy Inc**   | 5,25 %  | 15.06.2029            | 7.532.518        | 0,34                         |
| 8.720.000  | NRG Energy Inc**   | 10,25 % | 29.12.2049            | 8.231.549        | 0,37                         |
| 2.445.000  | Occidental Petroleum Corp*   | 4,63 %  | 15.06.2045            | 1.895.376        | 0,09                         |
| 1.655.000  | Occidental Petroleum Corp*   | 7,50 %  | 01.05.2031            | 1.809.403        | 0,08                         |
| 3.355.000  | Olympus Water US Holding Corp**  | 4,25 %  | 01.10.2028            | 2.655.303        | 0,12                         |
| 4.310.000  | Olympus Water US Holding Corp**  | 9,75 %  | 15.11.2028            | 4.208.931        | 0,19                         |
| 1.985.000  | ON Semiconductor Corp**  | 3,88 %  | 01.09.2028            | 1.808.782        | 0,08                         |
| 9.195.000  | OneMain Finance Corp*  | 3,50 %  | 15.01.2027            | 7.898.229        | 0,36                         |
| 1.960.000  | OneMain Finance Corp*  | 3,88 %  | 15.09.2028            | 1.604.064        | 0,07                         |
| 2.515.000  | OneMain Finance Corp*  | 5,38 %  | 15.11.2029            | 2.140.536        | 0,10                         |
| 915.000  | OneMain Finance Corp**   | 6,88 %  | 15.03.2025            | 906.808          | 0,04                         |
| 2.260.000  | OneMain Finance Corp**   | 7,13 %  | 15.03.2026            | 2.222.478        | 0,10                         |
| 5.200.000  | OneMain Finance Corp*  | 9,00 %  | 15.01.2029            | 5.248.620        | 0,24                         |
| 20.000   | Open Text Corp**   | 3,88 %  | 01.12.2029            | 16.736           | 0,00                         |
| 4.180.000  | Open Text Holdings Inc**   | 4,13 %  | 01.12.2031            | 3.432.394        | 0,15                         |
| 3.400.000  | Oracle Corp*   | 3,60 %  | 01.04.2050            | 2.431.479        | 0,11                         |
| 610.000  | Organon & Co/Organon Foreign Debt Co-Issuer BV**                               | 5,13 %  | 30.04.2031            | 504.082          | 0,02                         |
| 360.000  | Pactiv Evergreen Group Issuer Inc/Pactiv Evergreen Group Issuer LLC**          | 4,00 %  | 15.10.2027            | 318.777          | 0,01                         |
| 7.980.000  | Pactiv Evergreen Group Issuer LLC/Pactiv Evergreen Group Issuer Inc**          | 4,38 %  | 15.10.2028            | 6.918.812        | 0,31                         |
| 3.840.000  | Park Intermediate Holdings LLC/PK Domestic Property LLC/PK Finance Co-Issuer** | 4,88 %  | 15.05.2029            | 3.313.056        | 0,15                         |
| 4.830.000  | Park Intermediate Holdings LLC/PK Domestic Property LLC/PK Finance Co-Issuer** | 5,88 %  | 01.10.2028            | 4.437.104        | 0,20                         |
| 3.615.000  | Penn Entertainment Inc**   | 5,63 %  | 15.01.2027            | 3.384.551        | 0,15                         |
| 1.265.000  | Performance Food Group Inc**   | 4,25 %  | 01.08.2029            | 1.127.540        | 0,05                         |
| 6.756.000  | Performance Food Group Inc**   | 5,50 %  | 15.10.2027            | 6.519.393        | 0,29                         |
| 2.048.000  | Permian Resources Operating LLC**  | 5,38 %  | 15.01.2026            | 1.953.149        | 0,09                         |
| 5.180.000  | Permian Resources Operating LLC**  | 5,88 %  | 01.07.2029            | 4.884.926        | 0,22                         |
| 5.355.000  | PetSmart Inc/PetSmart Finance Corp**   | 7,75 %  | 15.02.2029            | 5.326.823        | 0,24                         |
| 3.925.000  | Pilgrim's Pride Corp**   | 3,50 %  | 01.03.2032            | 3.106.638        | 0,14                         |

## High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung  | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 88,05 % (31. Dezember 2022: 86,24 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |        |                       |                  |                              |
| 9.690.000  | Pilgrim's Pride Corp**                                       | 4,25 % | 15.04.2031            | 8.318.717        | 0,37                         |
| 10.220.000   | Pilgrim's Pride Corp**                                       | 6,25 % | 01.07.2033            | 9.911.785        | 0,45                         |
| 3.050.000  | PNC Financial Services Group Inc**                           | 3,40 % | 29.12.2049            | 2.257.000        | 0,10                         |
| 14.270.000   | Presidio Holdings Inc**                                      | 8,25 % | 01.02.2028            | 13.605.819       | 0,61                         |
| 9.275.000  | Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc**     | 5,75 % | 15.04.2026            | 9.112.943        | 0,41                         |
| 9.496.000  | Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc**     | 6,25 % | 15.01.2028            | 8.909.589        | 0,40                         |
| 14.365.000   | Rackspace Technology Global Inc**                            | 3,50 % | 15.02.2028            | 6.479.592        | 0,29                         |
| 10.565.000   | Rackspace Technology Global Inc**                            | 5,38 % | 01.12.2028            | 3.289.283        | 0,15                         |
| 3.420.000  | Radiate Holdco LLC/Radiate Finance Inc**                     | 6,50 % | 15.09.2028            | 2.000.700        | 0,09                         |
| 6.442.000  | Raptor Acquisition Corp/Raptor Co-Issuer LLC**               | 4,88 % | 01.11.2026            | 6.077.383        | 0,27                         |
| 15.865.000   | Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp**                   | 5,25 % | 15.04.2030            | 11.292.621       | 0,51                         |
| 9.571.000  | Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp**                   | 5,75 % | 15.01.2029            | 7.172.005        | 0,32                         |
| 9.655.000  | Regal Rexnord Corp**   | 6,40 % | 15.04.2033            | 9.653.381        | 0,43                         |
| 8.170.000  | Resideo Funding Inc**  | 4,00 % | 01.09.2029            | 6.787.357        | 0,31                         |
| 3.348.000  | RHP Hotel Properties LP/RHP Finance Corp**                   | 4,50 % | 15.02.2029            | 2.965.993        | 0,13                         |
| 4.095.000  | RHP Hotel Properties LP/RHP Finance Corp**                   | 7,25 % | 15.07.2028            | 4.140.577        | 0,19                         |
| 2.115.000  | Ritchie Bros Holdings Inc**                                  | 6,75 % | 15.03.2028            | 2.134.393        | 0,10                         |
| 6.810.000  | Ritchie Bros Holdings Inc**                                  | 7,75 % | 15.03.2031            | 7.073.380        | 0,32                         |
| 6.665.000  | RLJ Lodging Trust LP**                                       | 4,00 % | 15.09.2029            | 5.587.844        | 0,25                         |
| 7.390.000  | Rockcliff Energy II LLC**                                    | 5,50 % | 15.10.2029            | 6.824.443        | 0,31                         |
| 12.775.000   | Royal Caribbean Cruises Ltd**                                | 5,50 % | 01.04.2028            | 11.925.906       | 0,54                         |
| 6.995.000  | Royal Caribbean Cruises Ltd**                                | 7,25 % | 15.01.2030            | 7.091.139        | 0,32                         |
| 1.965.000  | Ryan Specialty LLC**   | 4,38 % | 01.02.2030            | 1.741.874        | 0,08                         |
| 2.665.000  | SBA Communications Corp**                                    | 3,88 % | 15.02.2027            | 2.457.413        | 0,11                         |
| 8.445.000  | Scientific Games Holdings LP/Scientific Games US FinCo Inc** | 6,63 % | 01.03.2030            | 7.439.412        | 0,34                         |
| 3.380.000  | Scientific Games International Inc**                         | 7,00 % | 15.05.2028            | 3.364.996        | 0,15                         |
| 2.580.000  | SCIL IV LLC/SCIL USA Holdings LLC**                          | 5,38 % | 01.11.2026            | 2.354.563        | 0,11                         |
| 2.425.000  | Sealed Air Corp**  | 4,00 % | 01.12.2027            | 2.215.723        | 0,10                         |
| 4.425.000  | Sealed Air Corp/Sealed Air Corp US**                         | 6,13 % | 01.02.2028            | 4.397.202        | 0,20                         |
| 3.700.000  | SeaWorld Parks & Entertainment Inc**                         | 5,25 % | 15.08.2029            | 3.315.336        | 0,15                         |
| 7.960.000  | Sensata Technologies BV**                                    | 4,00 % | 15.04.2029            | 7.093.829        | 0,32                         |
| 4.180.000  | Sensata Technologies BV**                                    | 5,88 % | 01.09.2030            | 4.068.603        | 0,18                         |
| 2.195.000  | Service Properties Trust**                                   | 3,95 % | 15.01.2028            | 1.721.935        | 0,08                         |
| 4.503.000  | Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp**                      | 4,75 % | 15.02.2028            | 4.000.198        | 0,18                         |
| 3.595.000  | Sirius XM Radio Inc**  | 3,88 % | 01.09.2031            | 2.783.419        | 0,13                         |
| 5.260.000  | Sirius XM Radio Inc**  | 4,13 % | 01.07.2030            | 4.299.811        | 0,19                         |
| 7.465.000  | Solaris Midstream Holdings LLC**                             | 7,63 % | 01.04.2026            | 7.231.675        | 0,33                         |
| 1.285.000  | SPCM SA**  | 3,13 % | 15.03.2027            | 1.153.549        | 0,05                         |
| 495.000  | SPCM SA**  | 3,38 % | 15.03.2030            | 412.214          | 0,02                         |
| 3.300.000  | Sprint Capital Corp**  | 6,88 % | 15.11.2028            | 3.500.948        | 0,16                         |

## High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 88,05 % (31. Dezember 2022: 86,24 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 2.090.000  | Sprint Capital Corp**   | 8,75 %  | 15.03.2032            | 2.528.319        | 0,11                         |
| 3.595.000  | Sprint LLC**  | 7,13 %  | 15.06.2024            | 3.630.386        | 0,16                         |
| 795.000  | Sprint LLC**  | 7,63 %  | 15.02.2025            | 812.781          | 0,04                         |
| 5.285.000  | SPX FLOW Inc**  | 8,75 %  | 01.04.2030            | 4.762.568        | 0,21                         |
| 3.090.000  | SRS Distribution Inc**  | 6,13 %  | 01.07.2029            | 2.672.656        | 0,12                         |
| 6.540.000  | Standard Industries Inc**                                     | 4,38 %  | 15.07.2030            | 5.670.160        | 0,26                         |
| 4.770.000  | Summer BC Bidco B LLC**                                       | 5,50 %  | 31.10.2026            | 4.019.417        | 0,18                         |
| 14.015.000   | Summit Midstream Holdings LLC/Summit Midstream Finance Corp** | 9,00 %  | 15.10.2026            | 13.627.135       | 0,61                         |
| 6.215.000  | Sunnova Energy Corp**   | 5,88 %  | 01.09.2026            | 5.686.091        | 0,26                         |
| 4.695.000  | Talen Energy Supply LLC**                                     | 8,63 %  | 01.06.2030            | 4.863.691        | 0,22                         |
| 3.380.000  | Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**  | 5,50 %  | 15.01.2028            | 3.094.162        | 0,14                         |
| 1.720.000  | Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**  | 6,00 %  | 01.03.2027            | 1.619.129        | 0,07                         |
| 1.095.000  | Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**  | 6,00 %  | 31.12.2030            | 966.053          | 0,04                         |
| 1.860.000  | Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**  | 6,00 %  | 01.09.2031            | 1.604.814        | 0,07                         |
| 4.680.000  | Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**  | 7,50 %  | 01.10.2025            | 4.675.577        | 0,21                         |
| 2.510.000  | Telecom Italia Capital SA**                                   | 6,38 %  | 15.11.2033            | 2.131.844        | 0,10                         |
| 1.250.000  | Telecom Italia Capital SA**                                   | 7,20 %  | 18.07.2036            | 1.075.962        | 0,05                         |
| 2.360.000  | Tenet Healthcare Corp**                                       | 4,88 %  | 01.01.2026            | 2.300.987        | 0,10                         |
| 3.465.000  | Tenet Healthcare Corp**                                       | 5,13 %  | 01.11.2027            | 3.311.800        | 0,15                         |
| 5.910.000  | Tenet Healthcare Corp**                                       | 6,13 %  | 01.10.2028            | 5.695.231        | 0,26                         |
| 4.525.000  | Tenet Healthcare Corp**                                       | 6,13 %  | 15.06.2030            | 4.465.949        | 0,20                         |
| 9.840.000  | Tenet Healthcare Corp**                                       | 6,75 %  | 15.05.2031            | 9.876.268        | 0,45                         |
| 4.205.000  | Terex Corp**  | 5,00 %  | 15.05.2029            | 3.913.738        | 0,18                         |
| 8.225.000  | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV**              | 7,88 %  | 15.09.2029            | 8.486.407        | 0,38                         |
| 4.723.000  | TMS International Corp**                                      | 6,25 %  | 15.04.2029            | 3.972.185        | 0,18                         |
| 5.305.000  | TransAlta Corp*   | 7,75 %  | 15.11.2029            | 5.466.829        | 0,25                         |
| 3.510.000  | TransDigm Inc*  | 5,50 %  | 15.11.2027            | 3.314.703        | 0,15                         |
| 8.190.000  | TransDigm Inc**   | 6,25 %  | 15.03.2026            | 8.157.344        | 0,37                         |
| 3.300.000  | TransDigm Inc*  | 6,38 %  | 15.06.2026            | 3.261.182        | 0,15                         |
| 16.610.000   | TransDigm Inc**   | 6,75 %  | 15.08.2028            | 16.693.714       | 0,75                         |
| 4.375.000  | TransDigm Inc*  | 7,50 %  | 15.03.2027            | 4.386.572        | 0,20                         |
| 1.650.000  | TreeHouse Foods Inc*  | 4,00 %  | 01.09.2028            | 1.423.480        | 0,06                         |
| 1.865.000  | Tri Pointe Homes Inc*   | 5,25 %  | 01.06.2027            | 1.765.968        | 0,08                         |
| 4.265.000  | Trident TPI Holdings Inc**                                    | 12,75 % | 31.12.2028            | 4.428.136        | 0,20                         |
| 3.815.000  | Trivium Packaging Finance BV*                                 | 5,50 %  | 15.08.2026            | 3.667.948        | 0,17                         |
| 7.190.000  | Trivium Packaging Finance BV*                                 | 8,50 %  | 15.08.2027            | 6.929.986        | 0,31                         |
| 4.390.000  | Tronox Inc**  | 4,63 %  | 15.03.2029            | 3.652.187        | 0,16                         |
| 7.025.000  | United Airlines Inc**   | 4,38 %  | 15.04.2026            | 6.680.815        | 0,30                         |
| 4.560.000  | United Airlines Inc**   | 4,63 %  | 15.04.2029            | 4.159.029        | 0,19                         |
| 7.925.000  | United Rentals North America Inc*                             | 3,75 %  | 15.01.2032            | 6.720.908        | 0,30                         |

## High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                     | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 88,05 % (31. Dezember 2022: 86,24 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 2.450.000  | United Rentals North America Inc*                         | 4,00 %  | 15.07.2030            | 2.172.015        | 0,10                         |
| 1.195.000  | United Rentals North America Inc*                         | 4,88 %  | 15.01.2028            | 1.138.274        | 0,05                         |
| 5.865.000  | United Rentals North America Inc*                         | 5,25 %  | 15.01.2030            | 5.603.866        | 0,25                         |
| 9.525.000  | Uniti Group LP/Uniti Group Finance Inc/CSL Capital LLC**  | 10,50 % | 15.02.2028            | 9.457.979        | 0,43                         |
| 3.430.000  | Univar Solutions USA Inc**                                | 5,13 %  | 01.12.2027            | 3.509.631        | 0,16                         |
| 1.235.000  | US Acute Care Solutions LLC**                             | 6,38 %  | 01.03.2026            | 1.058.741        | 0,05                         |
| 3.205.000  | US Foods Inc**  | 4,63 %  | 01.06.2030            | 2.875.668        | 0,13                         |
| 3.620.000  | US Foods Inc**  | 4,75 %  | 15.02.2029            | 3.317.836        | 0,15                         |
| 5.410.000  | Valaris Ltd**   | 8,38 %  | 30.04.2030            | 5.433.425        | 0,24                         |
| 2.960.000  | Venture Global LNG Inc**                                  | 8,13 %  | 01.06.2028            | 3.009.594        | 0,14                         |
| 2.950.000  | Venture Global LNG Inc**                                  | 8,38 %  | 01.06.2031            | 2.978.047        | 0,13                         |
| 65.000   | Verscend Escrow Corp**                                    | 9,75 %  | 15.08.2026            | 65.287           | 0,00                         |
| 5.240.000  | Vibrant Technologies Inc**                                | 9,00 %  | 15.02.2030            | 4.021.543        | 0,18                         |
| 2.505.000  | VICI Properties LP/VICI Note Co Inc**                     | 4,13 %  | 15.08.2030            | 2.207.732        | 0,10                         |
| 4.240.000  | Victoria's Secret & Co**                                  | 4,63 %  | 15.07.2029            | 3.102.779        | 0,14                         |
| 7.690.000  | VistaJet Malta Finance Plc/Vista Management Holding Inc** | 6,38 %  | 01.02.2030            | 6.199.155        | 0,28                         |
| 8.560.000  | VistaJet Malta Finance Plc/Vista Management Holding Inc** | 7,88 %  | 01.05.2027            | 7.698.650        | 0,35                         |
| 5.200.000  | VistaJet Malta Finance Plc/Vista Management Holding Inc** | 9,50 %  | 01.06.2028            | 4.779.190        | 0,22                         |
| 11.005.000   | Vistra Corp**   | 7,00 %  | 29.12.2049            | 9.614.243        | 0,43                         |
| 7.775.000  | Vistra Operations Co LLC**                                | 4,38 %  | 01.05.2029            | 6.817.565        | 0,31                         |
| 7.350.000  | Vistra Operations Co LLC**                                | 5,50 %  | 01.09.2026            | 7.079.113        | 0,32                         |
| 2.165.000  | Vistra Operations Co LLC**                                | 5,63 %  | 15.02.2027            | 2.077.052        | 0,09                         |
| 8.656.000  | VM Consolidated Inc**                                     | 5,50 %  | 15.04.2029            | 7.992.693        | 0,36                         |
| 6.930.000  | Vmed O2 UK Financing I Plc**                              | 4,75 %  | 15.07.2031            | 5.769.665        | 0,26                         |
| 2.880.000  | Warnermedia Holdings Inc**                                | 5,14 %  | 15.03.2052            | 2.346.943        | 0,11                         |
| 3.615.000  | White Cap Parent LLC**                                    | 8,25 %  | 15.03.2026            | 3.466.658        | 0,16                         |
| 6.790.000  | Windsor Holdings III LLC**                                | 8,50 %  | 15.06.2030            | 6.766.710        | 0,30                         |
| 2.430.000  | WMG Acquisition Corp**                                    | 3,75 %  | 01.12.2029            | 2.103.067        | 0,09                         |
| 2.790.000  | WMG Acquisition Corp**                                    | 3,88 %  | 15.07.2030            | 2.409.202        | 0,11                         |
| 2.750.000  | Wolverine World Wide Inc**                                | 4,00 %  | 15.08.2029            | 2.192.493        | 0,10                         |
| 2.960.000  | WR Grace Holdings LLC**                                   | 5,63 %  | 15.08.2029            | 2.427.940        | 0,11                         |
| 2.455.000  | Wyndham Hotels & Resorts Inc**                            | 4,38 %  | 15.08.2028            | 2.244.116        | 0,10                         |
| 4.005.000  | XHR LP**  | 4,88 %  | 01.06.2029            | 3.437.892        | 0,16                         |
| 5.445.000  | XHR LP**  | 6,38 %  | 15.08.2025            | 5.350.611        | 0,24                         |
| 6.995.000  | XPO Inc**   | 6,25 %  | 01.06.2028            | 6.890.790        | 0,31                         |
| 2.790.000  | XPO Inc**   | 7,13 %  | 01.06.2031            | 2.814.619        | 0,13                         |
| 1.310.000  | Yum! Brands Inc*  | 3,63 %  | 15.03.2031            | 1.132.940        | 0,05                         |
| 3.710.000  | Yum! Brands Inc*  | 4,63 %  | 31.01.2032            | 3.356.283        | 0,15                         |
| 4.740.000  | Yum! Brands Inc**   | 4,75 %  | 15.01.2030            | 4.443.205        | 0,20                         |
| 3.120.000  | ZF North America Capital Inc**                            | 6,88 %  | 14.04.2028            | 3.162.694        | 0,14                         |

## High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag  | Wertpapierbezeichnung               | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$         | % des<br>Netto-<br>vermögens          |
|---|-------------------------------------|---------|-----------------------|--------------------------|---------------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 88,05 % (31. Dezember 2022: 86,24 %) (Fortsetzung)</b>  |                                     |         |                       |                          |                                       |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>  |                                     |         |                       |                          |                                       |
| 5.785.000   | ZF North America Capital Inc**      | 7,13 %  | 14.04.2030            | 5.889.934                | 0,27                                  |
| 8.435.000   | Ziff Davis Inc**                    | 4,63 %  | 15.10.2030            | 7.313.799                | 0,33                                  |
| <b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>   |                                     |         |                       | <b>1.954.989.023</b>     | <b>88,05</b>                          |
| <b>Mittelfristige Schuldverschreibungen^ 4,96 % (31. Dezember 2022: 3,99 %)</b> |                                     |         |                       |                          |                                       |
| <b>US-Dollar</b>  |                                     |         |                       |                          |                                       |
| 2.835.642   | AppLovin Corp                       | 0,00 %  | 25.10.2028            | 2.831.843                | 0,13                                  |
| 1.475.496   | Aramark Intermediate HoldCo Corp    | 7,72 %  | 06.04.2028            | 1.476.234                | 0,07                                  |
| 4.484.000   | Crocs Inc                           | 8,86 %  | 20.02.2029            | 4.499.537                | 0,20                                  |
| 3.020.961   | Cytera DC Holdings Inc              | 8,07 %  | 01.05.2024            | 1.537.155                | 0,07                                  |
| 2.865.455   | Diamond (BC) BV                     | 8,06 %  | 29.09.2028            | 2.865.841                | 0,13                                  |
| 2.709.376   | Engineered Machinery Holdings Inc   | 0,00 %  | 21.05.2029            | 2.540.040                | 0,11                                  |
| 5.835.675   | Entain Plc                          | 8,44 %  | 31.10.2029            | 5.834.216                | 0,26                                  |
| 7.441.507   | Gainwell Acquisition Corp           | 9,34 %  | 01.10.2027            | 7.339.187                | 0,33                                  |
| 2.825.510   | Gates Global LLC                    | 7,70 %  | 31.03.2027            | 2.814.915                | 0,13                                  |
| 2.850.000   | Ineos US Finance LLC                | 8,70 %  | 18.02.2030            | 2.837.531                | 0,13                                  |
| 2.794.557   | Lightstone Holdco LLC B Term Loan   | 0,00 %  | 29.01.2027            | 2.538.156                | 0,11                                  |
| 158.033   | Lightstone Holdco LLC C Term Loan   | 0,00 %  | 29.01.2027            | 143.534                  | 0,01                                  |
| 2.788.806   | Nouryon Finance BV                  | 8,07 %  | 01.10.2025            | 2.791.944                | 0,13                                  |
| 14.575.000  | Parexel International Inc           | 11,72 % | 15.11.2029            | 13.627.625               | 0,61                                  |
| 2.830.253   | Peraton Corp                        | 8,95 %  | 01.02.2028            | 2.786.285                | 0,13                                  |
| 7.300.137   | Petco Health and Wellness Co Inc    | 8,75 %  | 03.03.2028            | 7.258.636                | 0,33                                  |
| 5.173.869   | Raptor Acquisition Corp             | 9,52 %  | 01.11.2026            | 5.163.082                | 0,23                                  |
| 3.221.888   | Standard Building Solutions Inc     | 7,69 %  | 22.09.2028            | 3.224.127                | 0,15                                  |
| 6.767.172   | Starwood Property Mortgage LLC      | 8,45 %  | 26.07.2026            | 6.606.452                | 0,30                                  |
| 8.599.315   | Team Health Holdings Inc            | 10,35 % | 02.03.2027            | 5.946.426                | 0,27                                  |
| 2.815.707   | Tempo Acquisition LLC               | 8,10 %  | 31.08.2028            | 2.819.987                | 0,13                                  |
| 6.633.375   | TransDigm Inc                       | 8,49 %  | 24.08.2028            | 6.637.222                | 0,30                                  |
| 3.020.000   | Trident TPI Holdings Inc            | 9,74 %  | 15.09.2028            | 2.985.074                | 0,13                                  |
| 5.453.199   | US Silica Co                        | 9,95 %  | 25.03.2030            | 5.422.525                | 0,24                                  |
| 1.887.118   | Verscend Holding Corp               | 9,22 %  | 27.08.2025            | 1.888.882                | 0,08                                  |
| 5.676.919   | WaterBridge Midstream Operating LLC | 11,01 % | 22.06.2026            | 5.651.657                | 0,25                                  |
| <b>Mittelfristige Schuldverschreibungen insgesamt †</b>                         |                                     |         |                       | <b>110.068.113</b>       | <b>4,96</b>                           |
| <b>Anzahl der<br/>Anteile</b>   | <b>Wertpapierbezeichnung</b>        |         |                       | <b>Zeitwert<br/>US\$</b> | <b>% des<br/>Nettover-<br/>mögens</b> |
| <b>Investmentfonds 0,40 % (31. Dezember 2022: 0,80 %)</b>                       |                                     |         |                       |                          |                                       |
| <b>Britisches Pfund</b>   |                                     |         |                       |                          |                                       |
| 9.288.723   | NB Global Monthly Income Fund Ltd   |         |                       | 8.856.913                | 0,40                                  |
| <b>Investmentfonds insgesamt †</b>  |                                     |         |                       | <b>8.856.913</b>         | <b>0,40</b>                           |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  |                                     |         |                       | <b>2.113.263.558</b>     | <b>95,18</b>                          |



## High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 0,42 % (31. Dezember 2022: 2,42 %)

| Geforderter Betrag              | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 2.978.964 €                     | 3.698.178 US\$      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 1         | 89.539                         | 0,01                 |
| 3.965.725 US\$                  | 3.602.175 €         | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | 32.695                         | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 783.363 AUD                     | 519.109 US\$        | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 14        | 2.579                          | 0,00                 |
| 538.051 US\$                    | 803.098 AUD         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | 3.220                          | 0,00                 |
| 11.078.783 US\$                 | 16.442.050 AUD      | 20.07.2023       | UBS AG                      | 3         | 129.044                        | 0,01                 |
| 3.524.436 US\$                  | 5.248.104 AUD       | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 47        | 29.411                         | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen CAD</i> |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 111.735 CAD                     | 83.223 US\$         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 3         | 1.237                          | 0,00                 |
| 5.713.952 CAD                   | 4.249.698 US\$      | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | 69.447                         | 0,00                 |
| 5.748.020 CAD                   | 4.281.482 US\$      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 4         | 63.414                         | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i> |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 60.175 CHF                      | 66.564 US\$         | 20.07.2023       | UBS AG                      | 2         | 805                            | 0,00                 |
| 9.189.390 CHF                   | 10.270.845 US\$     | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 4         | 17.265                         | 0,00                 |
| 53.916 US\$                     | 47.682 CHF          | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | 533                            | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen CNY</i> |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 13.009 US\$                     | 90.750 CNY          | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | 519                            | 0,00                 |
| 1.777.079 US\$                  | 12.138.339 CNY      | 20.07.2023       | UBS AG                      | 3         | 106.476                        | 0,01                 |
| 1.773.283 US\$                  | 12.095.350 CNY      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 2         | 108.595                        | 0,01                 |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 1.221.893 €                     | 1.312.334 US\$      | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | 21.788                         | 0,00                 |
| 1.171.412 €                     | 1.268.173 US\$      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 19        | 10.829                         | 0,00                 |
| 1.038.656 US\$                  | 941.912 €           | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | 10.231                         | 0,00                 |
| 185.092.436 US\$                | 168.506.797 €       | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 37        | 1.108.549                      | 0,05                 |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 1.128.478 €                     | 1.425.792 US\$      | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | 9.054                          | 0,00                 |
| 1.773.046 €                     | 2.205.809 US\$      | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | 48.598                         | 0,00                 |
| 282.748.613 €                   | 352.887.117 US\$    | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 40        | 6.624.394                      | 0,30                 |
| 2.155.901 US\$                  | 1.694.190 €         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 9         | 1.757                          | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen HKD</i> |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 1.160.001 US\$                  | 9.062.140 HKD       | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | 3.307                          | 0,00                 |
| 115.996 US\$                    | 907.414 HKD         | 20.07.2023       | UBS AG                      | 4         | 173                            | 0,00                 |
| 1.330.764 US\$                  | 10.395.843 HKD      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 2         | 3.835                          | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen SEK</i> |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 1.207.226 SEK                   | 111.547 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | 300                            | 0,00                 |
| 90.458 SEK                      | 8.344 US\$          | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 9         | 37                             | 0,00                 |
| 231.743 US\$                    | 2.418.103 SEK       | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 3         | 7.713                          | 0,00                 |
| 2.424.061 US\$                  | 25.092.812 SEK      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 39        | 99.284                         | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i> |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 1.248.586 US\$                  | 1.653.333 SGD       | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 3         | 26.220                         | 0,00                 |
| 1.027.076 US\$                  | 1.359.321 SGD       | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | 22.083                         | 0,00                 |

## High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 0,42 % (31. Dezember 2022: 2,42 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens        |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|-----------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen SGD (Fortsetzung)</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 528.602 US\$   | 709.205 SGD         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 9         | 4.262                          | 0,00                        |
| <i>Abgesicherte Klassen ZAR</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 13.803.652 US\$  | 250.637.507 ZAR     | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 4         | 557.138                        | 0,03                        |
| 1.583.805 US\$   | 29.735.356 ZAR      | 20.07.2023       | UBS AG                      | 2         | 12.254                         | 0,00                        |
| 2.329.433 US\$   | 43.035.672 ZAR      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 47        | 54.943                         | 0,00                        |
| 10.822.419 ZAR   | 560.318 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | 11.661                         | 0,00                        |
| 12.949.399 ZAR   | 671.801 US\$        | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | 12.592                         | 0,00                        |
| 43.728 ZAR   | 2.249 US\$          | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 14        | 60                             | 0,00                        |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>20</sup></b>                       |                     |                  |                             |           | <b>9.305.841</b>               | <b>0,42</b>                 |
|  |                     |                  |                             |           | <b>Zeitwert US\$</b>           | <b>% des Nettovermögens</b> |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> |                     |                  |                             |           | <b>2.122.569.399</b>           | <b>95,60</b>                |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (0,60 %) (31. Dezember 2022: (1,09 %))

| Geforderter Betrag              | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 31.387.783 US\$                 | 25.119.069 €        | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | (550.815)                       | (0,03)               |
| 4.512.794 US\$                  | 3.632.030 €         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 1         | (105.289)                       | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 2.736.049 AUD                   | 1.841.422 US\$      | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 3         | (19.324)                        | (0,00)               |
| 155.470.376 AUD                 | 104.714.740 US\$    | 20.07.2023       | UBS AG                      | 2         | (1.177.779)                     | (0,05)               |
| 85.390 AUD                      | 57.252 US\$         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 16        | (385)                           | (0,00)               |
| 520.094 US\$                    | 797.392 AUD         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (10.937)                        | (0,00)               |
| 519.462 US\$                    | 784.304 AUD         | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | (2.853)                         | (0,00)               |
| 913.577 US\$                    | 1.379.485 AUD       | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 18        | (5.106)                         | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen CAD</i> |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 126.632 US\$                    | 171.248 CAD         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 5         | (2.814)                         | (0,00)               |
| 1.895.999 US\$                  | 2.549.275 CAD       | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | (30.984)                        | (0,00)               |
| 2.245.366 US\$                  | 3.014.075 CAD       | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 2         | (32.957)                        | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i> |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 31.552 CHF                      | 35.383 US\$         | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | (59)                            | (0,00)               |
| 50 CHF                          | 56 US\$             | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 1         | (0)                             | (0,00)               |
| 36.162 US\$                     | 32.368 CHF          | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | (76)                            | (0,00)               |
| 4.082.784 US\$                  | 3.655.095 CHF       | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 8         | (9.327)                         | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen CNY</i> |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 86.561 CNY                      | 12.136 US\$         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (223)                           | (0,00)               |
| 18.805.668 CNY                  | 2.754.867 US\$      | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | (166.636)                       | (0,01)               |
| 18.805.668 CNY                  | 2.757.293 US\$      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 1         | (169.062)                       | (0,01)               |

## High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Devisenterminkontrakte (0,60 %) (31. Dezember 2022: (1,09 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens        |
|---|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|-----------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>   |                     |                  |                             |           |                                 |                             |
| 1.670.485 €   | 1.835.646 US\$      | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 2         | (11.730)                        | (0,00)                      |
| 308.102.052 €   | 338.407.165 US\$    | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 19        | (2.006.410)                     | (0,09)                      |
| 1.976.353 US\$  | 1.814.869 €         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 2         | (5.209)                         | (0,00)                      |
| 4.891.200 US\$  | 4.508.154 €         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 22        | (31.023)                        | (0,00)                      |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>   |                     |                  |                             |           |                                 |                             |
| 1.219.837 £   | 1.563.304 US\$      | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (12.296)                        | (0,00)                      |
| 25.749 £  | 32.996 US\$         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 4         | (257)                           | (0,00)                      |
| 114.369.048 US\$  | 91.596.304 £        | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 57        | (2.094.566)                     | (0,10)                      |
| <i>Abgesicherte Klassen HKD</i>   |                     |                  |                             |           |                                 |                             |
| 28.484.293 HKD  | 3.646.137 US\$      | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (10.394)                        | (0,00)                      |
| 193.733 HKD   | 24.753 US\$         | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | (25)                            | (0,00)                      |
| 28.696.490 HKD  | 3.673.543 US\$      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 3         | (10.715)                        | (0,00)                      |
| <i>Abgesicherte Klassen SEK</i>   |                     |                  |                             |           |                                 |                             |
| 2.244.928 SEK   | 217.435 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 2         | (9.448)                         | (0,00)                      |
| 177.111.945 SEK   | 17.133.323 US\$     | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 27        | (724.395)                       | (0,03)                      |
| 96.936 US\$   | 1.046.968 SEK       | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (63)                            | (0,00)                      |
| 4.775.581 US\$  | 51.827.239 SEK      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 9         | (26.069)                        | (0,00)                      |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>   |                     |                  |                             |           |                                 |                             |
| 13.811.324 SGD  | 10.449.999 US\$     | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (238.819)                       | (0,01)                      |
| 13.956.459 SGD  | 10.543.672 US\$     | 20.07.2023       | UBS AG                      | 2         | (225.190)                       | (0,01)                      |
| 203.015 SGD   | 153.233 US\$        | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 7         | (3.137)                         | (0,00)                      |
| 199.874 US\$  | 270.397 SGD         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 1         | (40)                            | (0,00)                      |
| <i>Abgesicherte Klassen ZAR</i>   |                     |                  |                             |           |                                 |                             |
| 1.177.975 US\$  | 23.024.186 ZAR      | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 2         | (38.883)                        | (0,00)                      |
| 602.012 US\$  | 11.955.960 ZAR      | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | (29.875)                        | (0,00)                      |
| 1.897.493 US\$  | 36.836.881 ZAR      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 29        | (49.383)                        | (0,00)                      |
| 2.380.844.300 ZAR   | 131.322.777 US\$    | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 2         | (5.492.091)                     | (0,25)                      |
| 11.921.128 ZAR  | 652.818 US\$        | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | (22.771)                        | (0,00)                      |
| 32.276.391 ZAR  | 1.783.754 US\$      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 16        | (77.906)                        | (0,01)                      |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>o</sup></b>                          |                     |                  |                             |           | <b>(13.405.321)</b>             | <b>(0,60)</b>               |
|   |                     |                  |                             |           | <b>Zeitwert US\$</b>            | <b>% des Nettovermögens</b> |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> |                     |                  |                             |           | <b>(13.405.321)</b>             | <b>(0,60)</b>               |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              |                     |                  |                             |           | <b>2.109.164.078</b>            | <b>95,00</b>                |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  |                     |                  |                             |           | <b>111.066.330</b>              | <b>5,00</b>                 |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   |                     |                  |                             |           | <b>2.220.230.408</b>            | <b>100,00</b>               |

^ Schuldverschreibungen mit einem Zinssatz von 0,00 %, wurden zum 30. Juni 2023 eventuell noch nicht abgerechnet und haben somit keinen gültigen Zinssatz. Die Zinssätze werden erst bei Abrechnung gültig.

## High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

| Portfolioanalyse  | US\$                 | % des<br>Gesamtver-<br>mögens |
|---|----------------------|-------------------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 226.682.463          | 10,02                         |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden            | 1.767.656.069        | 78,12                         |
| † Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente  | 110.068.113          | 4,86                          |
| μ Investmentfonds   | 8.856.913            | 0,39                          |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente   | (4.099.480)          | (0,18)                        |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>2.109.164.078</b> | <b>93,21</b>                  |

## InnovAsia 5G - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der Anteile                                 | Wertpapierbezeichnung                                      | Zeitwert US\$    | % des Nettovermögens |
|--|--|------------------|----------------------|
| <b>Aktien 96,83 % (31. Dezember 2022: 94,06 %)</b> |  |                  |                      |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi</b>                  |  |                  |                      |
| 12.447   | Beijing Huafeng Test & Control Technology Co Ltd Class A*  | 261.779          | 1,25                 |
| 186.500  | Longshine Technology Group Co Ltd Class A*                 | 596.817          | 2,84                 |
| 80.073   | Shenzhen Sinexcel Electric Co Ltd Class A*                 | 406.375          | 1,93                 |
| 57.150   | Zhejiang Jingsheng Mechanical & Electrical Co Ltd Class A* | 556.982          | 2,65                 |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt</b>        |  | <b>1.821.953</b> | <b>8,67</b>          |
| <b>Hongkong-Dollar</b>                             |  |                  |                      |
| 18.950   | Baidu Inc Class A*   | 321.129          | 1,53                 |
| 12.700   | Meituan Class B*   | 198.199          | 0,94                 |
| <b>Hongkong-Dollar insgesamt</b>                   |  | <b>519.328</b>   | <b>2,47</b>          |
| <b>Indische Rupie</b>                              |  |                  |                      |
| 26.215   | Bharti Airtel Ltd*   | 281.207          | 1,34                 |
| 35.163   | One 97 Communications Ltd*                                 | 371.063          | 1,76                 |
| 20.982   | Tech Mahindra Ltd*   | 289.258          | 1,38                 |
| 432.952  | Zomato Ltd*  | 395.290          | 1,88                 |
| <b>Indische Rupie insgesamt</b>                    |  | <b>1.336.818</b> | <b>6,36</b>          |
| <b>Japanischer Yen</b>                             |  |                  |                      |
| 2.500  | Disco Corp*  | 391.082          | 1,86                 |
| 5.700  | Hamamatsu Photonics KK*                                    | 277.083          | 1,32                 |
| 25.200   | Harmonic Drive Systems Inc*                                | 803.764          | 3,83                 |
| 17.100   | JMDC Inc*  | 674.843          | 3,21                 |
| 29.400   | Mercari Inc*   | 683.257          | 3,25                 |
| 7.500  | Rohm Co Ltd*   | 701.560          | 3,34                 |
| 48.900   | Sansan Inc*  | 568.388          | 2,71                 |
| 3.400  | Shibaura Mechatronics Corp*                                | 522.932          | 2,49                 |
| 1.100  | SMC Corp*  | 604.891          | 2,88                 |
| 400  | Socionext Inc*   | 57.758           | 0,27                 |
| 9.000  | Square Enix Holdings Co Ltd*                               | 416.453          | 1,98                 |
| <b>Japanischer Yen insgesamt</b>                   |  | <b>5.702.011</b> | <b>27,14</b>         |
| <b>Malaysischer Ringgit</b>                        |  |                  |                      |
| 658.800  | Inari Amertron Bhd*  | 386.741          | 1,84                 |
| <b>Malaysischer Ringgit insgesamt</b>              |  | <b>386.741</b>   | <b>1,84</b>          |
| <b>Neuer taiwanesischer Dollar</b>                 |  |                  |                      |
| 46.000   | Accton Technology Corp*                                    | 515.468          | 2,45                 |
| 102.000  | E Ink Holdings Inc*  | 736.888          | 3,51                 |
| 7.000  | eMemory Technology Inc*                                    | 496.717          | 2,36                 |

## InnovAsia 5G - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile  | Wertpapierbezeichnung                              | Zeitwert US\$     | % des Nettovermögens |
|---|--|-------------------|----------------------|
| <b>Aktien 96,83% (31. Dezember 2022: 94,06 %) (Fortsetzung)</b> |  |                   |                      |
| <b>Neuer taiwanesischer Dollar (Fortsetzung)</b>                |  |                   |                      |
| 148.000   | Gold Circuit Electronics Ltd*                      | 693.798           | 3,30                 |
| 269.000   | Inventec Corp*                                     | 373.125           | 1,78                 |
| 37.499  | Jentech Precision Industrial Co Ltd*               | 776.601           | 3,70                 |
| 142.000   | Lite-On Technology Corp*                           | 471.897           | 2,25                 |
| 8.000   | Novatek Microelectronics Corp*                     | 109.554           | 0,52                 |
| 5.000   | Silergy Corp*                                      | 61.809            | 0,29                 |
| 28.000  | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd*         | 517.844           | 2,47                 |
| 75.000  | Tripod Technology Corp*                            | 297.404           | 1,42                 |
| 9.000   | Unimicron Technology Corp*                         | 50.860            | 0,24                 |
| 56.000  | Vanguard International Semiconductor Corp*         | 158.230           | 0,75                 |
| 10.000  | Yageo Corp*  | 157.813           | 0,75                 |
|   | <b>Neuer taiwanesischer Dollar insgesamt</b>       | <b>5.418.008</b>  | <b>25,79</b>         |
| <b>Singapur-Dollar</b>  |  |                   |                      |
| 243.300   | AEM Holdings Ltd**                                 | 666.969           | 3,18                 |
|   | <b>Singapur-Dollar insgesamt</b>                   | <b>666.969</b>    | <b>3,18</b>          |
| <b>Südkoreanischer Won</b>                                      |  |                   |                      |
| 11.302  | Hanmi Semiconductor Co Ltd*                        | 258.608           | 1,23                 |
| 9.816   | HPSP Co Ltd*                                       | 212.314           | 1,01                 |
| 1.327   | LG Innotek Co Ltd*                                 | 311.696           | 1,49                 |
| 10.835  | SK Hynix Inc*                                      | 947.287           | 4,51                 |
|   | <b>Südkoreanischer Won insgesamt</b>               | <b>1.729.905</b>  | <b>8,24</b>          |
| <b>Thailändischer Baht</b>                                      |  |                   |                      |
| 105.500   | Hana Microelectronics PCL*                         | 140.597           | 0,67                 |
| 251.400   | KCE Electronics PCL*                               | 276.537           | 1,32                 |
|   | <b>Thailändischer Baht insgesamt</b>               | <b>417.134</b>    | <b>1,99</b>          |
| <b>US-Dollar</b>  |  |                   |                      |
| 5.602   | Fabrinet*  | 727.588           | 3,46                 |
| 22.298  | Kanzhun Ltd ADR*                                   | 335.585           | 1,60                 |
| 9.307   | New Oriental Education & Technology Group Inc ADR* | 367.534           | 1,75                 |
| 3.579   | Rambus Inc*  | 229.664           | 1,09                 |
| 4.180   | Sea Ltd ADR*                                       | 242.607           | 1,16                 |
|   | <b>US-Dollar insgesamt</b>                         | <b>1.902.978</b>  | <b>9,06</b>          |
| <b>Vietnamesischer Dong</b>                                     |  |                   |                      |
| 120.480   | FPT Corp*  | 439.317           | 2,09                 |
|   | <b>Vietnamesischer Dong insgesamt</b>              | <b>439.317</b>    | <b>2,09</b>          |
|   | <b>Aktien insgesamt</b>                            | <b>20.341.162</b> | <b>96,83</b>         |
|   | <b>Anlagen insgesamt</b>                           | <b>20.341.162</b> | <b>96,83</b>         |

## InnovAsia 5G - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Devisenterminkontrakte 0,09 % (31. Dezember 2022: 3,07 %)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens        |
|--|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|-----------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i>  |                     |                  |                                |           |                                |                             |
| 509.879 CHF  | 570.374 US\$        | 20.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 468                            | 0,00                        |
| 17.189 CHF   | 19.034 US\$         | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 2         | 210                            | 0,00                        |
| 33.676 CHF   | 37.236 US\$         | 20.07.2023       | UBS AG                         | 5         | 466                            | 0,00                        |
| 29.456 CHF   | 32.834 US\$         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 5         | 146                            | 0,00                        |
| 15.689 US\$  | 13.879 CHF          | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 2         | 151                            | 0,00                        |
| 17.346 US\$  | 15.391 CHF          | 20.07.2023       | UBS AG                         | 3         | 115                            | 0,00                        |
| 69.185 US\$  | 61.230 CHF          | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 7         | 635                            | 0,01                        |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>  |                     |                  |                                |           |                                |                             |
| 26.389 €   | 28.502 US\$         | 20.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 312                            | 0,00                        |
| 145.917 €  | 157.452 US\$        | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 2         | 1.868                          | 0,01                        |
| 245.256 €  | 265.475 US\$        | 20.07.2023       | UBS AG                         | 4         | 2.308                          | 0,01                        |
| 314.535 €  | 337.622 US\$        | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 4         | 5.804                          | 0,03                        |
| 156.992 US\$   | 143.781 €           | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 1         | 5                              | 0,00                        |
| 35.572 US\$  | 32.289 €            | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | 317                            | 0,00                        |
| 283.538 US\$   | 257.479 €           | 20.07.2023       | UBS AG                         | 6         | 2.411                          | 0,01                        |
| 253.536 US\$   | 230.014 €           | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 5         | 2.395                          | 0,01                        |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>  |                     |                  |                                |           |                                |                             |
| 45.497 SGD   | 33.606 US\$         | 20.07.2023       | UBS AG                         | 2         | 31                             | 0,00                        |
| 20.491 US\$  | 27.287 SGD          | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | 317                            | 0,00                        |
| 6.373 US\$   | 8.472 SGD           | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 109                            | 0,00                        |
| 113.005 US\$   | 151.631 SGD         | 20.07.2023       | UBS AG                         | 10        | 898                            | 0,01                        |
| 13.577 US\$  | 18.276 SGD          | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 2         | 66                             | 0,00                        |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>~</sup></b>                        |                     |                  |                                |           | <b>19.032</b>                  | <b>0,09</b>                 |
|  |                     |                  |                                |           | <b>Zeitwert US\$</b>           | <b>% des Nettovermögens</b> |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> |                     |                  |                                |           | <b>20.360.194</b>              | <b>96,92</b>                |

## InnovAsia 5G - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (0,34 %) (31. Dezember 2022: (0,53 %))

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i>  |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 7.394 CHF  | 8.282 US\$          | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (4)                             | (0,00)               |
| 18.253 CHF   | 20.605 US\$         | 20.07.2023       | UBS AG                         | 3         | (170)                           | (0,00)               |
| 37.921 CHF   | 42.764 US\$         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 5         | (309)                           | (0,00)               |
| 4.915 US\$   | 4.407 CHF           | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (19)                            | (0,00)               |
| 15.040 US\$  | 13.531 CHF          | 20.07.2023       | UBS AG                         | 4         | (108)                           | (0,00)               |
| 8.868 US\$   | 7.934 CHF           | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 1         | (15)                            | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>  |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 53.739 €   | 58.702 US\$         | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 1         | (27)                            | (0,00)               |
| 58.419 €   | 63.916 US\$         | 20.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (131)                           | (0,00)               |
| 152.722 €  | 168.802 US\$        | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 2         | (2.053)                         | (0,01)               |
| 65.242 €   | 71.879 US\$         | 20.07.2023       | UBS AG                         | 2         | (644)                           | (0,00)               |
| 4.632.415 €  | 5.101.560 US\$      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 3         | (43.665)                        | (0,21)               |
| 40.034 US\$  | 37.123 €            | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | (499)                           | (0,00)               |
| 67.703 US\$  | 62.823 €            | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 2         | (891)                           | (0,01)               |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>  |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 35.432 SGD   | 26.508 US\$         | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 1         | (312)                           | (0,00)               |
| 85.361 SGD   | 63.794 US\$         | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 5         | (684)                           | (0,01)               |
| 1.268.427 SGD  | 959.333 US\$        | 20.07.2023       | UBS AG                         | 5         | (21.542)                        | (0,10)               |
| 76.734 SGD   | 57.360 US\$         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 6         | (628)                           | (0,00)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                                |           | <b>(71.701)</b>                 | <b>(0,34)</b>        |

|   | Zeitwert US\$     | % des Nettovermögens |
|---|-------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(71.701)</b>   | <b>(0,34)</b>        |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>20.288.493</b> | <b>96,58</b>         |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>718.262</b>    | <b>3,42</b>          |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>21.006.755</b> | <b>100,00</b>        |

| Portfolioanalyse  | US\$              | % des Gesamtvermögens |
|---|-------------------|-----------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 19.674.193        | 92,74                 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden            | 666.969           | 3,14                  |
| <sup>∞</sup> OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente  | (52.669)          | (0,25)                |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>20.288.493</b> | <b>95,63</b>          |



## Japan Equity Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der<br>Anteile                              | Wertpapierbezeichnung                  | Zeitwert<br>JPY | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|-----------------|------------------------------|
| <b>Aktien 92,45 % (31. Dezember 2022: 98,37 %)</b> |  |                 |                              |
| <b>Japanischer Yen</b>                             |  |                 |                              |
| 30.000   | ABC-Mart Inc                           | 234.210.000     | 0,97                         |
| 507.000  | Amada Co Ltd                           | 716.391.000     | 2,97                         |
| 110.000  | Appier Group Inc                       | 192.390.000     | 0,80                         |
| 77.000   | As One Corp                            | 437.514.000     | 1,82                         |
| 91.000   | Asahi Intecc Co Ltd                    | 255.801.000     | 1,06                         |
| 91.000   | Asics Corp                             | 402.311.000     | 1,67                         |
| 26.000   | BayCurrent Consulting Inc              | 139.568.000     | 0,58                         |
| 61.400   | BML Inc                                | 177.753.000     | 0,74                         |
| 40.000   | Comture Corp                           | 82.800.000      | 0,34                         |
| 82.000   | Cover Corp                             | 228.534.000     | 0,95                         |
| 170.000  | Daiei Kankyo Co Ltd                    | 430.270.000     | 1,79                         |
| 577.000  | Daiwa Industries Ltd                   | 796.260.000     | 3,30                         |
| 100.000  | Direct Marketing MiX Inc               | 85.700.000      | 0,36                         |
| 127.000  | eGuarantee Inc                         | 243.205.000     | 1,01                         |
| 35.000   | eWeLL Co Ltd                           | 174.125.000     | 0,72                         |
| 194.000  | FP Partner Inc                         | 859.420.000     | 3,57                         |
| 72.300   | Fujimi Inc                             | 255.580.500     | 1,06                         |
| 6.000  | GMO Financial Gate Inc                 | 69.420.000      | 0,29                         |
| 91.500   | Hokkoku Financial Holdings Inc         | 379.725.000     | 1,58                         |
| 80.000   | Japan Elevator Service Holdings Co Ltd | 150.480.000     | 0,62                         |
| 12.000   | JMDC Inc                               | 68.448.000      | 0,28                         |
| 152.000  | JSB Co Ltd                             | 766.080.000     | 3,18                         |
| 34.000   | JSR Corp                               | 139.740.000     | 0,58                         |
| 80.000   | Justsystems Corp                       | 320.640.000     | 1,33                         |
| 160.000  | Kansai Paint Co Ltd                    | 338.320.000     | 1,40                         |
| 20.000   | KeePer Technical Laboratory Co Ltd     | 97.600.000      | 0,41                         |
| 40.000   | Keisei Electric Railway Co Ltd         | 238.240.000     | 0,99                         |
| 158.000  | Kosaido Holdings Co Ltd                | 331.800.000     | 1,38                         |
| 18.700   | M&A Research Institute Holdings Inc    | 211.684.000     | 0,88                         |
| 68.000   | MEC Co Ltd                             | 239.700.000     | 0,99                         |
| 70.000   | Menicon Co Ltd                         | 175.595.000     | 0,73                         |
| 150.000  | MISUMI Group Inc                       | 430.350.000     | 1,79                         |
| 260.000  | Musashi Seimitsu Industry Co Ltd       | 458.380.000     | 1,90                         |
| 40.000   | Nakanishi Inc                          | 127.200.000     | 0,53                         |
| 154.000  | Nifco Inc                              | 655.886.000     | 2,72                         |
| 75.000   | Niterra Co Ltd                         | 216.225.000     | 0,90                         |
| 352.000  | Okinawa Cellular Telephone Co          | 1.056.000.000   | 4,38                         |
| 340.000  | Open Up Group Inc                      | 712.980.000     | 2,96                         |
| 127.000  | Pilot Corp                             | 578.485.000     | 2,40                         |
| 147.000  | Resorttrust Inc                        | 313.624.500     | 1,30                         |

## Japan Equity Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile  | Wertpapierbezeichnung       | Zeitwert JPY          | % des Nettovermögens |
|---|-----------------------------|-----------------------|----------------------|
| <b>Aktien 92,45% (31. Dezember 2022: 98,37 %) (Fortsetzung)</b> |                             |                       |                      |
| <b>Japanischer Yen (Fortsetzung)</b>                            |                             |                       |                      |
| 565.000   | Ricoh Co Ltd                | 690.712.500           | 2,87                 |
| 42.000  | Sakai Moving Service Co Ltd | 209.790.000           | 0,87                 |
| 44.000  | San-A Co Ltd                | 200.200.000           | 0,83                 |
| 25.000  | SHO-BOND Holdings Co Ltd    | 142.900.000           | 0,59                 |
| 346.000   | Shoei Co Ltd                | 919.668.000           | 3,82                 |
| 95.000  | Skymark Airlines Inc        | 119.225.000           | 0,49                 |
| 60.000  | Snow Peak Inc               | 112.320.000           | 0,47                 |
| 53.000  | St Cousair Co Ltd           | 170.395.000           | 0,71                 |
| 95.000  | TBS Holdings Inc            | 249.090.000           | 1,03                 |
| 120.000   | TKC Corp                    | 466.200.000           | 1,93                 |
| 74.000  | TKP Corp                    | 202.612.000           | 0,84                 |
| 45.000  | Tokyo Century Corp          | 232.920.000           | 0,97                 |
| 34.000  | Tokyo Seimitsu Co Ltd       | 269.620.000           | 1,12                 |
| 32.000  | Tokyotokeiba Co Ltd         | 125.440.000           | 0,52                 |
| 1.160.000   | Tokyu Fudosan Holdings Corp | 954.912.000           | 3,96                 |
| 230.000   | Transaction Co Ltd          | 439.300.000           | 1,82                 |
| 285.000   | USS Co Ltd                  | 677.730.000           | 2,81                 |
| 14.000  | Visional Inc                | 111.160.000           | 0,46                 |
| 68.000  | WingArc1st Inc              | 160.820.000           | 0,67                 |
| 105.000   | Yamaha Corp                 | 578.130.000           | 2,40                 |
| 286.000   | Yamanashi Chuo Bank Ltd     | 354.926.000           | 1,47                 |
| 128.000   | Yokogawa Electric Corp      | 339.264.000           | 1,41                 |
| 87.000  | Zenkoku Hoshu Co Ltd        | 434.826.000           | 1,80                 |
| 84.000  | Zuken Inc                   | 327.180.000           | 1,36                 |
|   | <b>Aktien insgesamt *</b>   | <b>22.277.775.500</b> | <b>92,45</b>         |
|   | <b>Anlagen insgesamt</b>    | <b>22.277.775.500</b> | <b>92,45</b>         |

## Devisenterminkontrakte 4,67 % (31. Dezember 2022: 0,22 %)

| Geforderter Betrag              | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn JPY | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|-------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> |                     |                  |                                |           |                               |                      |
| 496.018 €                       | 74.817.008 ¥        | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 1         | 3.271.468                     | 0,02                 |
| 31.946.526 €                    | 4.521.030.146 ¥     | 20.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 508.334.730                   | 2,11                 |
| 1.155.749 €                     | 164.945.492 ¥       | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | 17.004.917                    | 0,07                 |
| 9.656.653 €                     | 1.437.499.754 ¥     | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 14        | 82.754.180                    | 0,34                 |
| 2.151.063 €                     | 331.280.441 ¥       | 20.07.2023       | UBS AG                         | 3         | 7.362.979                     | 0,03                 |
| 31.946.526 €                    | 4.532.291.935 ¥     | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 1         | 497.072.941                   | 2,06                 |
| 70.729.490 ¥                    | 449.084 €           | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 29.868                        | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> |                     |                  |                                |           |                               |                      |
| 208.226 £                       | 33.914.989 ¥        | 20.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 6         | 4.256.667                     | 0,02                 |

## Japan Equity Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 4,67 % (31. Dezember 2022: 0,22 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn JPY | % des Nettovermögens        |
|--|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|-------------------------------|-----------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen GBP (Fortsetzung)</i>  |                     |                  |                                |           |                               |                             |
| 53.208 £   | 9.054.921 ¥         | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 12        | 699.066                       | 0,00                        |
| 239.776 £  | 39.702.396 ¥        | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 4         | 4.252.787                     | 0,02                        |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>                        |                     |                  |                                |           | <b>1.125.039.603</b>          | <b>4,67</b>                 |
|  |                     |                  |                                |           | <b>Zeitwert JPY</b>           | <b>% des Nettovermögens</b> |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> |                     |                  |                                |           | <b>23.402.815.103</b>         | <b>97,12</b>                |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (0,36 %) (31. Dezember 2022: (0,69 %))

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust JPY | % des Nettovermögens        |
|---|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|-----------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>   |                     |                  |                                |           |                                |                             |
| 135.709.757 ¥   | 926.376 €           | 20.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (10.130.293)                   | (0,04)                      |
| 647.509.339 ¥   | 4.393.159 €         | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 6         | (44.108.892)                   | (0,18)                      |
| 609.045.824 ¥   | 4.076.515 €         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 5         | (32.722.911)                   | (0,14)                      |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>   |                     |                  |                                |           |                                |                             |
| 7.495.749 ¥   | 43.656 £            | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 10        | (507.184)                      | (0,00)                      |
| 421.431 ¥   | 2.523 £             | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 2         | (41.099)                       | (0,00)                      |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>                          |                     |                  |                                |           | <b>(87.510.379)</b>            | <b>(0,36)</b>               |
|   |                     |                  |                                |           | <b>Zeitwert JPY</b>            | <b>% des Nettovermögens</b> |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> |                     |                  |                                |           | <b>(87.510.379)</b>            | <b>(0,36)</b>               |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              |                     |                  |                                |           | <b>23.315.304.724</b>          | <b>96,76</b>                |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  |                     |                  |                                |           | <b>782.421.360</b>             | <b>3,24</b>                 |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   |                     |                  |                                |           | <b>24.097.726.084</b>          | <b>100,00</b>               |

| Portfolioanalyse  | JPY                   | % des Gesamtvermögens |
|---|-----------------------|-----------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 22.277.775.500        | 92,06                 |
| <sup>∞</sup> OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente  | 1.037.529.224         | 4,29                  |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>23.315.304.724</b> | <b>96,35</b>          |

## Macro Opportunities FX - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                             | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Schatzwechsel 21,04 % (31. Dezember 2022: 13,93 %)</b>        |   |        |                       |                   |                              |
| <b>Euro</b>  |   |        |                       |                   |                              |
| 1.300.000  | European Stability Mechanism Treasury Bill        | 0,00 % | 23.11.2023            | 1.281.863         | 4,29                         |
| 800.000  | European Union Bill                               | 0,00 % | 10.11.2023            | 789.980           | 2,64                         |
| 1.000.000  | Finland T-Bill                                    | 0,00 % | 13.11.2023            | 987.901           | 3,30                         |
| 3.300.000  | Finland T-Bill                                    | 0,00 % | 13.02.2024            | 3.231.830         | 10,81                        |
| <b>Schatzwechsel insgesamt **</b>                                |   |        |                       | <b>6.291.574</b>  | <b>21,04</b>                 |
| <b>Unternehmensanleihen 82,06 % (31. Dezember 2022: 79,24 %)</b> |   |        |                       |                   |                              |
| <b>Euro</b>  |   |        |                       |                   |                              |
| 600.000  | ANZ New Zealand Int'l Ltd                         | 0,13 % | 22.09.2023            | 595.590           | 1,99                         |
| 200.000  | Arkea Home Loans SFH SA                           | 0,38 % | 04.03.2024            | 195.433           | 0,65                         |
| 1.000.000  | Bank of Montreal                                  | 0,25 % | 10.01.2024            | 982.265           | 3,28                         |
| 1.500.000  | Bank of Nova Scotia                               | 0,38 % | 23.10.2023            | 1.485.571         | 4,97                         |
| 1.200.000  | Belfius Bank SA                                   | 0,38 % | 24.10.2023            | 1.188.134         | 3,97                         |
| 1.400.000  | BPCE SFH SA                                       | 0,38 % | 21.02.2024            | 1.370.513         | 4,58                         |
| 500.000  | Caisse Centrale du Credit Immobilier de France SA | 0,00 % | 17.01.2024            | 489.810           | 1,64                         |
| 500.000  | Caisse de Refinancement de l'Habitat SA           | 3,60 % | 08.03.2024            | 499.514           | 1,67                         |
| 1.000.000  | Caisse de Refinancement de l'Habitat SA           | 3,90 % | 20.10.2023            | 1.000.592         | 3,35                         |
| 1.500.000  | Cie de Financement Foncier SA                     | 0,33 % | 12.09.2023            | 1.491.041         | 4,99                         |
| 1.500.000  | Commerzbank AG                                    | 0,25 % | 13.09.2023            | 1.490.719         | 4,98                         |
| 1.000.000  | Credit Mutuel Home Loan SFH SA                    | 0,25 % | 30.04.2024            | 970.879           | 3,25                         |
| 1.000.000  | Dexia Credit Local SA                             | 0,63 % | 03.02.2024            | 981.808           | 3,28                         |
| 1.100.000  | DNB Boligkreditt AS                               | 0,38 % | 14.11.2023            | 1.087.272         | 3,64                         |
| 300.000  | Federation des Caisses Desjardins du Quebec       | 0,35 % | 30.01.2024            | 294.192           | 0,98                         |
| 500.000  | ING-DiBa AG                                       | 0,25 % | 09.10.2023            | 495.678           | 1,66                         |
| 500.000  | Jyske Realkredit A/S                              | 0,25 % | 01.07.2023            | 500.000           | 1,67                         |
| 1.000.000  | La Banque Postale Home Loan SFH SA                | 2,38 % | 15.01.2024            | 992.219           | 3,32                         |
| 200.000  | Landesbank Baden-Wuerttemberg                     | 0,20 % | 10.01.2024            | 196.465           | 0,66                         |
| 300.000  | Landesbank Hessen-Thueringen Girozentrale         | 0,38 % | 08.02.2024            | 293.946           | 0,98                         |
| 1.000.000  | National Bank of Canada                           | 0,00 % | 29.09.2023            | 991.580           | 3,32                         |
| 1.500.000  | Royal Bank of Canada                              | 0,25 % | 29.01.2024            | 1.470.805         | 4,92                         |
| 1.500.000  | Santander UK Plc                                  | 0,10 % | 12.05.2024            | 1.451.015         | 4,85                         |
| 900.000  | Societe Generale SFH SA                           | 0,25 % | 11.09.2023            | 894.516           | 2,99                         |
| 600.000  | Societe Generale SFH SA                           | 2,00 % | 29.04.2024            | 591.184           | 1,98                         |
| 250.000  | Toronto-Dominion Bank                             | 0,25 % | 26.03.2024            | 243.737           | 0,81                         |
| 1.350.000  | Toronto-Dominion Bank                             | 0,50 % | 03.04.2024            | 1.317.381         | 4,40                         |
| 1.000.000  | Westpac Securities NZ Ltd                         | 0,50 % | 17.01.2024            | 982.364           | 3,28                         |
| <b>Unternehmensanleihen insgesamt *</b>                          |   |        |                       | <b>24.544.223</b> | <b>82,06</b>                 |
| <b>Anlagen insgesamt</b>   |   |        |                       | <b>30.835.797</b> | <b>103,10</b>                |

## Macro Opportunities FX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 10,95 % (31. Dezember 2022: 11,48 %)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn EUR | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|-------------------------------|----------------------|
| 953.915 AUD        | 633.012 US\$        | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 2.067                         | 0,01                 |
| 6.476.585 BRL      | 1.257.370 US\$      | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | 74.560                        | 0,25                 |
| 9.975.146 BRL      | 1.943.915 US\$      | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 2         | 108.121                       | 0,36                 |
| 4.952.566 CAD      | 3.674.783 US\$      | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 3         | 63.044                        | 0,21                 |
| 3.666.533 CAD      | 2.732.567 US\$      | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 3         | 35.670                        | 0,12                 |
| 6.691.710 CAD      | 4.981.461 US\$      | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 2         | 70.309                        | 0,24                 |
| 6.761.092 CAD      | 5.035.570 US\$      | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 68.785                        | 0,23                 |
| 2.221.641 CHF      | 2.473.033 US\$      | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | 13.041                        | 0,04                 |
| 4.160.502 CHF      | 4.629.808 US\$      | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 3         | 25.776                        | 0,09                 |
| 3.159.627 CHF      | 3.505.113 US\$      | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 2         | 29.578                        | 0,10                 |
| 114.660.520 CLP    | 139.295 US\$        | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | 3.069                         | 0,01                 |
| 9.073.915 €        | 9.879.762 US\$      | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 3         | 25.263                        | 0,08                 |
| 6.186.897 €        | 6.715.853 US\$      | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 3         | 35.998                        | 0,12                 |
| 4.634.580 €        | 5.022.567 US\$      | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 2         | 34.523                        | 0,12                 |
| 5.175.684 €        | 6.531.615 US\$      | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 4         | 45.069                        | 0,15                 |
| 2.877.280 €        | 3.593.363 US\$      | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 3         | 59.592                        | 0,20                 |
| 6.431.655 €        | 8.109.689 US\$      | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 5         | 62.360                        | 0,21                 |
| 1.068.304 €        | 1.343.984 US\$      | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 2         | 13.145                        | 0,04                 |
| 1.982.390 €        | 2.491.368 US\$      | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 2         | 26.761                        | 0,09                 |
| 221.695.680 HUF    | 637.785 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 2         | 7.166                         | 0,02                 |
| 437.625.141 HUF    | 1.264.903 US\$      | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | 8.722                         | 0,03                 |
| 510.075.440 ¥      | 3.531.779 US\$      | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | 5.311                         | 0,02                 |
| 512.450.683 ¥      | 3.550.445 US\$      | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | 3.303                         | 0,01                 |
| 13.343.725 MXN     | 722.506 US\$        | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | 48.646                        | 0,16                 |
| 27.370.365 NOK     | 2.555.893 US\$      | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 1         | 277                           | 0,00                 |
| 5.848.107 NZD      | 3.538.738 US\$      | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 2         | 40.147                        | 0,13                 |
| 1.995.824 NZD      | 1.211.822 US\$      | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 9.916                         | 0,03                 |
| 598 PLN            | 139 US\$            | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | 7                             | 0,00                 |
| 2.640.085 PLN      | 632.066 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 15.749                        | 0,05                 |
| 13.119.071 SEK     | 1.208.541 US\$      | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | 6.324                         | 0,02                 |
| 13.576.225 SEK     | 1.255.785 US\$      | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 1.846                         | 0,01                 |
| 1.260.147 US\$     | 1.119.704 CHF       | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | 6.014                         | 0,02                 |
| 6.068.335 US\$     | 64.637.124 NOK      | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 2         | 29.026                        | 0,10                 |
| 619.277 US\$       | 808.781.692 KRW     | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | 4.550                         | 0,02                 |
| 1.289.794 US\$     | 13.609.727 SEK      | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | 26.460                        | 0,09                 |
| 11.391.714 US\$    | 10.365.405 €        | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 4         | 68.010                        | 0,23                 |
| 2.403.251 US\$     | 322.297.120 ¥       | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 2         | 153.859                       | 0,51                 |
| 78 US\$            | 534 CNY             | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | 4                             | 0,00                 |
| 1.265.133 US\$     | 1.892.833 AUD       | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | 4.198                         | 0,01                 |
| 5.611.099 US\$     | 8.989.727 NZD       | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 2         | 95.214                        | 0,32                 |

## Macro Opportunities FX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 10,95 % (31. Dezember 2022: 11,48 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag              | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn EUR | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|-------------------------------|----------------------|
| 2.373.755 US\$                  | 25.411.049 NOK      | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 1         | 500                           | 0,00                 |
| 8.218.416 US\$                  | 7.283.340 CHF       | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 7         | 58.840                        | 0,20                 |
| 635.032 US\$                    | 9.366.722.331 IDR   | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 1         | 11.194                        | 0,04                 |
| 6.328.379 US\$                  | 845.121.213 ¥       | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 4         | 427.828                       | 1,43                 |
| 10.637.377 US\$                 | 9.670.295 €         | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 7         | 72.240                        | 0,24                 |
| 1.918.044 US\$                  | 2.844.979 AUD       | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 2         | 21.435                        | 0,07                 |
| 359.396 US\$                    | 282.191 £           | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 1         | 543                           | 0,00                 |
| 882.109 US\$                    | 4.227.066 BRL       | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 7.629                         | 0,03                 |
| 3.790.353 US\$                  | 4.995.628 CAD       | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 12.991                        | 0,04                 |
| 1.261.935 US\$                  | 167.951.079 ¥       | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 88.956                        | 0,30                 |
| 646.191 US\$                    | 218.483.692 HUF     | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 9.100                         | 0,03                 |
| 8.844.742 US\$                  | 13.073.863 AUD      | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 3         | 126.466                       | 0,42                 |
| 1.237.283 US\$                  | 966.484 £           | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 7.702                         | 0,03                 |
| 1.240.491 US\$                  | 1.089.883 CHF       | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 18.589                        | 0,06                 |
| 4.317.540 US\$                  | 6.929.348 NZD       | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 3         | 66.489                        | 0,22                 |
| 627.446 US\$                    | 9.221.567.783 IDR   | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 13.085                        | 0,04                 |
| 9.046.689 US\$                  | 8.254.385 €         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 5         | 31.274                        | 0,11                 |
| 1.280.798 US\$                  | 13.696.522 NOK      | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 1.503                         | 0,01                 |
| 614.235 US\$                    | 997.565 NZD         | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | 2.860                         | 0,01                 |
| 665.235 US\$                    | 9.947.259.910 IDR   | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | 3.502                         | 0,01                 |
| 3.692.138 US\$                  | 3.291.356 CHF       | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | 6.641                         | 0,02                 |
| 3.354 US\$                      | 77.464 TRY          | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | 361                           | 0,00                 |
| 1.229.976 US\$                  | 1.126.060 €         | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | 447                           | 0,00                 |
| 3.757.972 US\$                  | 541.245.655 ¥       | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | 3.861                         | 0,01                 |
| 5.442.446 US\$                  | 8.633.842 NZD       | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 140.425                       | 0,47                 |
| 442.639 US\$                    | 653.196 AUD         | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 6.995                         | 0,02                 |
| 1.909.152 US\$                  | 1.681.385 CHF       | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 2         | 24.484                        | 0,08                 |
| 1.185.737 US\$                  | 12.772.997 SEK      | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 2.156                         | 0,01                 |
| 3.972.121 US\$                  | 515.856.202 ¥       | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | 361.269                       | 1,21                 |
| 6.932.212 US\$                  | 70.871.468 SEK      | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | 335.363                       | 1,12                 |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> |                     |                  |                                |           |                               |                      |
| 1.479 €                         | 1.268 £             | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 2                             | 0,00                 |
| 1.449 €                         | 1.239 £             | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 6                             | 0,00                 |
| 165.135 £                       | 187.540 €           | 20.07.2023       | Deutsche Bank AG               | 1         | 4.765                         | 0,02                 |
| 3.273 £                         | 3.741 €             | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 2         | 69                            | 0,00                 |
| 970 £                           | 1.115 €             | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 15                            | 0,00                 |
| 983 £                           | 1.143 €             | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | 3                             | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen SEK</i> |                     |                  |                                |           |                               |                      |
| 174.191 €                       | 1.973.258 SEK       | 20.07.2023       | Deutsche Bank AG               | 1         | 6.752                         | 0,02                 |
| 181.826 €                       | 2.116.529 SEK       | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 2.231                         | 0,01                 |

## Macro Opportunities FX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 10,95 % (31. Dezember 2022: 11,48 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn EUR | % des Nettovermögens        |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|-------------------------------|-----------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen SEK (Fortsetzung)</i>  |                     |                  |                             |           |                               |                             |
| 404.621 €  | 4.671.627 SEK       | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 35        | 8.218                         | 0,03                        |
| 720.756 SEK  | 61.048 €            | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 5         | 111                           | 0,00                        |
| <i>Abgesicherte Klassen USD</i>  |                     |                  |                             |           |                               |                             |
| 1.402.206 €  | 1.530.000 US\$      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 1         | 913                           | 0,00                        |
| 112.851 US\$   | 102.504 €           | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | 853                           | 0,00                        |
| 7.121.558 US\$   | 6.466.642 €         | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | 55.833                        | 0,19                        |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>~</sup></b>                        |                     |                  |                             |           | <b>3.275.979</b>              | <b>10,95</b>                |
|  |                     |                  |                             |           | <b>Zeitwert EUR</b>           | <b>% des Nettovermögens</b> |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> |                     |                  |                             |           | <b>34.111.776</b>             | <b>114,05</b>               |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (14,20 %) (31. Dezember 2022: (14,06 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust EUR | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 1.856.626 AUD      | 1.247.994 US\$      | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (10.584)                       | (0,04)               |
| 14.481.153 AUD     | 9.684.675 US\$      | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 7         | (37.382)                       | (0,13)               |
| 5.786.933 AUD      | 3.917.734 US\$      | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (58.499)                       | (0,20)               |
| 3.941.373 CHF      | 4.453.838 US\$      | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 2         | (37.748)                       | (0,13)               |
| 1.639.052 CHF      | 1.852.805 US\$      | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 2         | (16.285)                       | (0,05)               |
| 3.361.318 CHF      | 3.796.695 US\$      | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 3         | (30.664)                       | (0,10)               |
| 2.374.818 CHF      | 2.663.244 US\$      | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (4.104)                        | (0,01)               |
| 2.138.040 CZK      | 99.301 US\$         | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (1.092)                        | (0,00)               |
| 13.582.310 CZK     | 634.122 US\$        | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 1         | (9.956)                        | (0,03)               |
| 1.157.779 €        | 1.279.881 US\$      | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (14.435)                       | (0,05)               |
| 2.697.990 €        | 2.959.533 US\$      | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 2         | (12.580)                       | (0,04)               |
| 2.252.707 €        | 2.482.634 US\$      | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 2         | (21.082)                       | (0,07)               |
| 562.097 €          | 616.300 US\$        | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | (2.359)                        | (0,01)               |
| 8.706.618 €        | 9.592.821 US\$      | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (79.232)                       | (0,26)               |
| 945.361 £          | 1.208.453 US\$      | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | (5.896)                        | (0,02)               |
| 28.553.626.157 IDR | 1.910.647 US\$      | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 2         | (11.051)                       | (0,04)               |
| 844.673.979 ¥      | 6.256.617 US\$      | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 4         | (364.943)                      | (1,22)               |
| 1.204.105.454 ¥    | 9.057.136 US\$      | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 7         | (646.775)                      | (2,16)               |
| 866.774.434 ¥      | 6.294.362 US\$      | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 3         | (259.132)                      | (0,87)               |
| 870.921.462 ¥      | 6.252.687 US\$      | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (194.621)                      | (0,65)               |
| 808.788.624 KRW    | 624.056 US\$        | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 1         | (8.922)                        | (0,03)               |
| 77.212.665 NOK     | 7.467.553 US\$      | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 2         | (234.872)                      | (0,79)               |

## Macro Opportunities FX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (14,20 %) (31. Dezember 2022: (14,06 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag              | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust EUR | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 7.742.600 NZD                   | 4.835.598 US\$      | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 5         | (84.675)                       | (0,28)               |
| 10.178.799 NZD                  | 6.263.344 US\$      | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 2         | (25.438)                       | (0,09)               |
| 904.884 NZD                     | 559.735 US\$        | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (4.945)                        | (0,02)               |
| 26.551.395 SEK                  | 2.585.221 US\$      | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (114.766)                      | (0,38)               |
| 19.053.172 SEK                  | 1.854.106 US\$      | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 2         | (81.405)                       | (0,27)               |
| 8.227.677 SEK                   | 802.598 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | (36.934)                       | (0,12)               |
| 13.554.963 SEK                  | 1.266.421 US\$      | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (9.700)                        | (0,03)               |
| 1.202.495 US\$                  | 1.963.048 NZD       | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (69)                           | (0,00)               |
| 1.885.070 US\$                  | 2.515.758 CAD       | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (15.183)                       | (0,05)               |
| 2.486.875 US\$                  | 2.225.032 CHF       | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (3.840)                        | (0,01)               |
| 1.259.635 US\$                  | 1.168.627 €         | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (14.956)                       | (0,05)               |
| 1.242.974 US\$                  | 440.982.431 HUF     | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (37.760)                       | (0,13)               |
| 660.356 US\$                    | 7.180.271 SEK       | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (4.466)                        | (0,02)               |
| 2.515.294 US\$                  | 2.025.721 £         | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 2         | (55.308)                       | (0,19)               |
| 1.199.050 US\$                  | 21.968.539 MXN      | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (71.344)                       | (0,24)               |
| 1.238.788 US\$                  | 13.513.044 NOK      | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (21.278)                       | (0,07)               |
| 5.456.321 US\$                  | 7.298.500 CAD       | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 3         | (55.481)                       | (0,19)               |
| 637.998 US\$                    | 2.640.088 PLN       | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 1         | (10.316)                       | (0,03)               |
| 1.255.219 US\$                  | 1.127.249 CHF       | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 1         | (6.237)                        | (0,02)               |
| 4.832.651 US\$                  | 7.315.613 AUD       | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 3         | (35.948)                       | (0,12)               |
| 9.206.986 US\$                  | 7.347.544 £         | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 5         | (123.949)                      | (0,41)               |
| 5.642.634 US\$                  | 4.519.529 £         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 2         | (95.156)                       | (0,32)               |
| 1.186.367 US\$                  | 12.710.441 NOK      | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | (638)                          | (0,00)               |
| 6.345.773 US\$                  | 5.685.462 CHF       | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 3         | (17.833)                       | (0,06)               |
| 1.241.612 US\$                  | 1.866.205 AUD       | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | (1.103)                        | (0,00)               |
| 7.862.767 US\$                  | 7.241.399 €         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 3         | (40.066)                       | (0,13)               |
| 612.980 US\$                    | 13.526.325 CZK      | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | (7.055)                        | (0,02)               |
| 4.302.815 US\$                  | 5.735.562 CAD       | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 4         | (29.918)                       | (0,10)               |
| 3.118.334 US\$                  | 2.796.336 CHF       | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 2         | (11.308)                       | (0,04)               |
| 1.185.558 US\$                  | 12.891.991 NOK      | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (16.909)                       | (0,06)               |
| 1.274.474 US\$                  | 1.176.572 €         | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (9.310)                        | (0,03)               |
| 1.430.815 US\$                  | 1.142.921 £         | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (20.513)                       | (0,07)               |
| 3.777.660 US\$                  | 5.037.018 CAD       | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (27.289)                       | (0,09)               |
| 1.254.350 US\$                  | 1.159.402 €         | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | (10.571)                       | (0,04)               |
| 8.268.136 US\$                  | 6.602.255 £         | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | (115.911)                      | (0,39)               |
| 172.819 ZAR                     | 9.560 US\$          | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | (390)                          | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 2.309 €                         | 2.019 £             | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 2         | (42)                           | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen SEK</i> |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 37 €                            | 435 SEK             | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 2         | (0)                            | (0,00)               |



## Macro Opportunities FX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (14,20 %) (31. Dezember 2022: (14,06 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust EUR | % des Nettovermögens         |
|---|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|------------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen SEK (Fortsetzung)</i>   |                     |                  |                                |           |                                |                              |
| 271.827.442 SEK   | 23.957.477 €        | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (891.960)                      | (2,98)                       |
| 3.203.228 SEK   | 284.368 €           | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | (12.563)                       | (0,04)                       |
| 1.616.316 SEK   | 143.549 €           | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (6.399)                        | (0,02)                       |
| 17.044.104 SEK  | 1.499.156 €         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 63        | (52.904)                       | (0,18)                       |
| <i>Abgesicherte Klassen USD</i>   |                     |                  |                                |           |                                |                              |
| 74.928 €  | 82.034 US\$         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 2         | (205)                          | (0,00)                       |
| 77.594 €  | 85.614 US\$         | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 2         | (819)                          | (0,00)                       |
| 913.870 €   | 1.000.000 US\$      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 1         | (2.007)                        | (0,01)                       |
| 28.626 US\$   | 26.302 €            | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (84)                           | (0,00)                       |
| 82.604 US\$   | 76.345 €            | 20.07.2023       | UBS AG                         | 2         | (690)                          | (0,00)                       |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>                          |                     |                  |                                |           | <b>(4.247.855)</b>             | <b>(14,20)</b>               |
|   |                     |                  |                                |           | <b>Zeitwert</b>                | <b>% des Nettovermögens</b>  |
|   |                     |                  |                                |           | <b>EUR</b>                     |                              |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> |                     |                  |                                |           | <b>(4.247.855)</b>             | <b>(14,20)</b>               |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              |                     |                  |                                |           | <b>29.863.921</b>              | <b>99,85</b>                 |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  |                     |                  |                                |           | <b>45.572</b>                  | <b>0,15</b>                  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   |                     |                  |                                |           | <b>29.909.493</b>              | <b>100,00</b>                |
| <b>Portfolioanalyse</b>   |                     |                  |                                |           | <b>EUR</b>                     | <b>% des Gesamtvermögens</b> |
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind   |                     |                  |                                |           | 24.544.223                     | 68,84                        |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden              |                     |                  |                                |           | 6.291.574                      | 17,65                        |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente   |                     |                  |                                |           | (971.876)                      | (2,73)                       |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  |                     |                  |                                |           | <b>29.863.921</b>              | <b>83,76</b>                 |

## Multi-Asset Income - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der<br>Anteile                             | Wertpapierbezeichnung            | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|----------------------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Aktien 3,37 % (31. Dezember 2022: 25,06 %)</b> |                                  |                  |                              |
| <b>US-Dollar</b>                                  |                                  |                  |                              |
| 42  | AbbVie Inc                       | 5.659            | 0,08                         |
| 70  | Aflac Inc                        | 4.886            | 0,07                         |
| 2   | Allstate Corp                    | 218              | 0,00                         |
| 16  | American International Group Inc | 921              | 0,01                         |
| 19  | Amgen Inc                        | 4.218            | 0,06                         |
| 337   | AT&T Inc                         | 5.375            | 0,07                         |
| 2   | Automatic Data Processing Inc    | 440              | 0,01                         |
| 1   | BlackRock Inc Class A            | 691              | 0,01                         |
| 94  | Bristol-Myers Squibb Co          | 6.011            | 0,08                         |
| 9   | Broadcom Inc                     | 7.807            | 0,11                         |
| 11  | Cardinal Health Inc              | 1.040            | 0,01                         |
| 21  | Caterpillar Inc                  | 5.167            | 0,07                         |
| 12  | CH Robinson Worldwide Inc        | 1.132            | 0,02                         |
| 40  | Chevron Corp                     | 6.294            | 0,09                         |
| 2   | Chubb Ltd                        | 385              | 0,00                         |
| 2   | Cigna Corp                       | 561              | 0,01                         |
| 143   | Cisco Systems Inc                | 7.399            | 0,10                         |
| 135   | Citigroup Inc                    | 6.215            | 0,08                         |
| 112   | Coca-Cola Co                     | 6.745            | 0,09                         |
| 113   | Comcast Corp Class A             | 4.695            | 0,06                         |
| 11  | ConocoPhillips                   | 1.140            | 0,02                         |
| 40  | Consolidated Edison Inc          | 3.616            | 0,05                         |
| 65  | CVS Health Corp                  | 4.493            | 0,06                         |
| 18  | Darden Restaurants Inc           | 3.007            | 0,04                         |
| 25  | Devon Energy Corp                | 1.208            | 0,02                         |
| 11  | Dominion Energy Inc              | 570              | 0,01                         |
| 42  | Dow Inc                          | 2.237            | 0,03                         |
| 16  | Duke Energy Corp                 | 1.436            | 0,02                         |
| 20  | Edison International             | 1.389            | 0,02                         |
| 7   | Emerson Electric Co              | 633              | 0,01                         |
| 9   | Entergy Corp                     | 876              | 0,01                         |
| 5   | Everest Re Group Ltd             | 1.709            | 0,02                         |
| 47  | Exelon Corp                      | 1.915            | 0,03                         |
| 63  | Exxon Mobil Corp                 | 6.757            | 0,09                         |
| 48  | FirstEnergy Corp                 | 1.866            | 0,03                         |
| 78  | General Mills Inc                | 5.983            | 0,08                         |
| 30  | Genuine Parts Co                 | 5.077            | 0,07                         |
| 75  | Gilead Sciences Inc              | 5.780            | 0,08                         |

## Multi-Asset Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile   | Wertpapierbezeichnung                 | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------------------------|---------------|----------------------|
| <b>Aktien 3,37% (31. Dezember 2022: 25,06 %) (Fortsetzung)</b> |                                       |               |                      |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>                                 |                                       |               |                      |
| 59   | Hartford Financial Services Group Inc | 4.249         | 0,06                 |
| 11   | Honeywell International Inc           | 2.283         | 0,03                 |
| 27   | Illinois Tool Works Inc               | 6.754         | 0,09                 |
| 38   | International Business Machines Corp  | 5.085         | 0,07                 |
| 6  | Interpublic Group of Cos Inc          | 231           | 0,00                 |
| 7  | JM Smucker Co                         | 1.034         | 0,01                 |
| 39   | Johnson & Johnson                     | 6.455         | 0,09                 |
| 19   | JPMorgan Chase & Co                   | 2.763         | 0,04                 |
| 34   | Kellogg Co                            | 2.292         | 0,03                 |
| 15   | Lockheed Martin Corp                  | 6.906         | 0,09                 |
| 39   | LyondellBasell Industries NV Class A  | 3.581         | 0,05                 |
| 48   | Marathon Petroleum Corp               | 5.597         | 0,08                 |
| 7  | McDonald's Corp                       | 2.089         | 0,03                 |
| 57   | Merck & Co Inc                        | 6.577         | 0,09                 |
| 25   | MetLife Inc                           | 1.413         | 0,02                 |
| 42   | Morgan Stanley                        | 3.587         | 0,05                 |
| 1  | NetApp Inc                            | 76            | 0,00                 |
| 1  | Norfolk Southern Corp                 | 227           | 0,00                 |
| 48   | PACCAR Inc                            | 4.015         | 0,05                 |
| 19   | Packaging Corp of America             | 2.511         | 0,03                 |
| 3  | Paychex Inc                           | 336           | 0,00                 |
| 29   | PepsiCo Inc                           | 5.371         | 0,07                 |
| 28   | Pfizer Inc                            | 1.027         | 0,01                 |
| 15   | Pioneer Natural Resources Co          | 3.108         | 0,04                 |
| 27   | PNC Financial Services Group Inc      | 3.401         | 0,05                 |
| 27   | Principal Financial Group Inc         | 2.048         | 0,03                 |
| 39   | Procter & Gamble Co                   | 5.918         | 0,08                 |
| 2  | Progressive Corp                      | 265           | 0,00                 |
| 38   | Public Service Enterprise Group Inc   | 2.379         | 0,03                 |
| 11   | Sempra Energy                         | 1.601         | 0,02                 |
| 16   | Snap-on Inc                           | 4.611         | 0,06                 |
| 50   | Southern Co                           | 3.513         | 0,05                 |
| 39   | Texas Instruments Inc                 | 7.021         | 0,09                 |
| 17   | Travelers Cos Inc                     | 2.952         | 0,04                 |
| 47   | Truist Financial Corp                 | 1.426         | 0,02                 |
| 13   | Union Pacific Corp                    | 2.660         | 0,04                 |
| 16   | United Parcel Service Inc Class B     | 2.868         | 0,04                 |
| 16   | US Bancorp                            | 529           | 0,01                 |
| 21   | Valero Energy Corp                    | 2.463         | 0,03                 |
| 15   | Verizon Communications Inc            | 558           | 0,01                 |

## Multi-Asset Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile   | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$  | % des Nettovermögens |
|--|-----------------------|----------------|----------------------|
| <b>Aktien 3,37% (31. Dezember 2022: 25,06 %) (Fortsetzung)</b> |                       |                |                      |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>                                 |                       |                |                      |
| 12   | Yum! Brands Inc       | 1.663          | 0,02                 |
| <b>Aktien insgesamt *</b>                                      |                       | <b>248.994</b> | <b>3,37</b>          |
| <b>Anlagen insgesamt</b>                                       |                       | <b>248.994</b> | <b>3,37</b>          |

## Devisenterminkontrakte 1,58 % (31. Dezember 2022: 1,41 %)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 20.304 AUD         | 13.474 US\$         | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 48                             | 0,00                 |
| 144.950 BRL        | 28.141 US\$         | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | 1.822                          | 0,03                 |
| 219.083 BRL        | 42.605 US\$         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 2         | 2.681                          | 0,04                 |
| 110.422 CAD        | 81.935 US\$         | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 3         | 1.532                          | 0,02                 |
| 78.233 CAD         | 58.304 US\$         | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 3         | 832                            | 0,01                 |
| 142.571 CAD        | 106.135 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 2         | 1.634                          | 0,02                 |
| 151.815 CAD        | 113.070 US\$        | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 1.686                          | 0,02                 |
| 47.310 CHF         | 52.663 US\$         | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | 303                            | 0,01                 |
| 103.602 CHF        | 115.277 US\$        | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 3         | 712                            | 0,01                 |
| 70.584 CHF         | 78.312 US\$         | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 2         | 711                            | 0,01                 |
| 3.519.939 CLP      | 4.276 US\$          | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | 103                            | 0,00                 |
| 193.468 €          | 210.650 US\$        | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 3         | 589                            | 0,01                 |
| 128.393 €          | 139.371 US\$        | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 3         | 815                            | 0,01                 |
| 98.442 €           | 106.683 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 2         | 801                            | 0,01                 |
| 111.612 £          | 140.874 US\$        | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 4         | 1.040                          | 0,02                 |
| 64.009 £           | 79.941 US\$         | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 3         | 1.445                          | 0,02                 |
| 139.543 £          | 175.946 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 5         | 1.481                          | 0,02                 |
| 24.000 £           | 30.193 US\$         | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 2         | 322                            | 0,01                 |
| 48.520 £           | 61.023 US\$         | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 3         | 669                            | 0,01                 |
| 4.868.844 HUF      | 14.007 US\$         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 2         | 172                            | 0,00                 |
| 9.324.643 HUF      | 26.952 US\$         | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | 203                            | 0,00                 |
| 10.182.094 ¥       | 70.501 US\$         | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | 116                            | 0,00                 |
| 6.407.498 ¥        | 44.393 US\$         | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | 45                             | 0,00                 |
| 332.966 MXN        | 18.029 US\$         | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | 1.325                          | 0,02                 |
| 593.825 NOK        | 55.452 US\$         | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 1         | 7                              | 0,00                 |
| 123.064 NZD        | 74.468 US\$         | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 2         | 922                            | 0,01                 |
| 95.905 NZD         | 8.447.815 ¥         | 24.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 122                            | 0,00                 |
| 42.602 NZD         | 25.867 US\$         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 231                            | 0,00                 |
| 19 PLN             | 4 US\$              | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | 0                              | 0,00                 |
| 55.854 PLN         | 13.372 US\$         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 364                            | 0,01                 |
| 279.965 SEK        | 25.791 US\$         | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | 147                            | 0,00                 |
| 302.175 SEK        | 27.951 US\$         | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 45                             | 0,00                 |
| 139.920 US\$       | 1.489.530 NOK       | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 2         | 809                            | 0,01                 |

## Multi-Asset Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Devisenterminkontrakte 1,58 % (31. Dezember 2022: 1,41 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 14.801 US\$        | 19.330.510 KRW      | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | 119                            | 0,00                 |
| 53.259 US\$        | 7.138.108 ¥         | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 2         | 3.753                          | 0,05                 |
| 7 US\$             | 46 CNY              | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | 0                              | 0,00                 |
| 27.512 US\$        | 290.301 SEK         | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | 616                            | 0,01                 |
| 244.963 US\$       | 222.877 €           | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 4         | 1.615                          | 0,02                 |
| 27.661 US\$        | 24.578 CHF          | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | 144                            | 0,00                 |
| 26.658 US\$        | 39.884 AUD          | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | 97                             | 0,00                 |
| 38.093 US\$        | 407.785 NOK         | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 1         | 9                              | 0,00                 |
| 119.218 US\$       | 191.011 NZD         | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 2         | 2.204                          | 0,03                 |
| 14.156 US\$        | 208.797.573 IDR     | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 1         | 272                            | 0,00                 |
| 134.928 US\$       | 18.015.899 ¥        | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 4         | 9.980                          | 0,14                 |
| 177.611 US\$       | 157.393 CHF         | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 7         | 1.399                          | 0,02                 |
| 41.340 US\$        | 61.296 AUD          | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 2         | 520                            | 0,01                 |
| 229.948 US\$       | 209.031 €           | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 7         | 1.717                          | 0,02                 |
| 10.596 US\$        | 8.320 £             | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 1         | 17                             | 0,00                 |
| 178.291 US\$       | 162.571 €           | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 5         | 790                            | 0,01                 |
| 81.059 US\$        | 106.834 CAD         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 303                            | 0,01                 |
| 13.851 US\$        | 4.683.198 HUF       | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 213                            | 0,00                 |
| 26.927 US\$        | 23.658 CHF          | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 441                            | 0,01                 |
| 13.688 US\$        | 201.169.973 IDR     | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 312                            | 0,01                 |
| 26.363 US\$        | 20.593 £            | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 179                            | 0,00                 |
| 190.056 US\$       | 280.931 AUD         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 3         | 2.968                          | 0,04                 |
| 26.991 US\$        | 288.634 NOK         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 35                             | 0,00                 |
| 90.336 US\$        | 144.999 NZD         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 3         | 1.509                          | 0,02                 |
| 29.059 US\$        | 3.867.430 ¥         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 2.237                          | 0,03                 |
| 21.347 US\$        | 102.294 BRL         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 202                            | 0,00                 |
| 152.523 US\$       | 1.069.598 CNH       | 24.07.2023       | Goldman Sachs International    | 2         | 5.263                          | 0,07                 |
| 8.805 US\$         | 42.499 BRL          | 20.07.2023       | Royal Bank of Canada           | 1         | 20                             | 0,00                 |
| 94.406 US\$        | 13.596.968 ¥        | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | 106                            | 0,00                 |
| 26.432 US\$        | 24.199 €            | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | 11                             | 0,00                 |
| 13.166 US\$        | 21.383 NZD          | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | 67                             | 0,00                 |
| 18.230 US\$        | 272.586.405 IDR     | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | 105                            | 0,00                 |
| 140 US\$           | 3.226 TRY           | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | 16                             | 0,00                 |
| 78.331 US\$        | 69.828 CHF          | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | 154                            | 0,00                 |
| 24.910 US\$        | 268.338 SEK         | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 49                             | 0,00                 |
| 41.670 US\$        | 36.697 CHF          | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 2         | 585                            | 0,01                 |
| 122.236 US\$       | 193.914 NZD         | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 3.444                          | 0,05                 |
| 9.727 US\$         | 14.354 AUD          | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 168                            | 0,00                 |
| 3.891.045 US\$     | 3.533.146 €         | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 3         | 33.384                         | 0,45                 |
| 155.689 US\$       | 1.591.683 SEK       | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | 8.224                          | 0,11                 |
| 90.242 US\$        | 11.719.665 ¥        | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | 8.962                          | 0,12                 |

## Multi-Asset Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 1,58 % (31. Dezember 2022: 1,41 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens        |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|-----------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 136 £  | 171 US\$            | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | 2                              | 0,00                        |
| 159 £  | 198 US\$            | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | 4                              | 0,00                        |
| 19.320 £   | 24.103 US\$         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 3         | 462                            | 0,01                        |
| 135 US\$   | 106 £               | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | 0                              | 0,00                        |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>                        |                     |                  |                             |           | <b>116.411</b>                 | <b>1,58</b>                 |
|  |                     |                  |                             |           | <b>Zeitwert US\$</b>           | <b>% des Nettovermögens</b> |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> |                     |                  |                             |           | <b>365.405</b>                 | <b>4,95</b>                 |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (1,49 %) (31. Dezember 2022: (5,14 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 39.432 AUD         | 26.506 US\$         | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (245)                           | (0,00)               |
| 324.999 AUD        | 217.308 US\$        | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 8         | (872)                           | (0,01)               |
| 129.974 AUD        | 87.992 US\$         | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (1.435)                         | (0,02)               |
| 85.380 CHF         | 96.482 US\$         | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 2         | (894)                           | (0,01)               |
| 36.940 CHF         | 41.758 US\$         | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 2         | (401)                           | (0,01)               |
| 73.371 CHF         | 82.879 US\$         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 3         | (735)                           | (0,01)               |
| 50.663 CHF         | 56.816 US\$         | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (96)                            | (0,00)               |
| 1.069.598 CNH      | 149.009 US\$        | 24.07.2023       | Goldman Sachs International    | 2         | (1.749)                         | (0,02)               |
| 54.980 CZK         | 2.554 US\$          | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (31)                            | (0,00)               |
| 277.642 CZK        | 12.962 US\$         | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 1         | (222)                           | (0,00)               |
| 25.592 €           | 28.291 US\$         | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (348)                           | (0,01)               |
| 55.487 €           | 60.857 US\$         | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 2         | (273)                           | (0,00)               |
| 144.542 €          | 160.000 US\$        | 20.07.2023       | Deutsche Bank AG               | 1         | (2.182)                         | (0,03)               |
| 166.407 €          | 183.343 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 3         | (1.652)                         | (0,02)               |
| 265.989 €          | 291.464 US\$        | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 2         | (1.045)                         | (0,02)               |
| 197.789 €          | 217.921 US\$        | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (1.965)                         | (0,03)               |
| 2.250.193 €        | 2.474.555 US\$      | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | (17.685)                        | (0,24)               |
| 187.253 £          | 238.379 US\$        | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 1         | (289)                           | (0,00)               |
| 20.844 £           | 26.645 US\$         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | (142)                           | (0,00)               |
| 682.929.762 IDR    | 45.698 US\$         | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 2         | (289)                           | (0,00)               |
| 18.400.015 ¥       | 136.316 US\$        | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 4         | (8.706)                         | (0,12)               |
| 26.997.688 ¥       | 202.860 US\$        | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 7         | (15.621)                        | (0,21)               |
| 8.447.814 ¥        | 100.790 NZD         | 24.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | (3.114)                         | (0,04)               |
| 18.116.728 ¥       | 131.697 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 3         | (6.050)                         | (0,08)               |

## Multi-Asset Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Devisenterminkontrakte (1,49 %) (31. Dezember 2022: (5,14 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 18.659.640 ¥       | 133.965 US\$        | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (4.553)                         | (0,06)               |
| 19.328.904 KRW     | 14.914 US\$         | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 1         | (233)                           | (0,00)               |
| 1.778.110 NOK      | 172.093 US\$        | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 2         | (6.030)                         | (0,08)               |
| 171.348 NZD        | 107.048 US\$        | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 5         | (2.079)                         | (0,03)               |
| 220.086 NZD        | 135.424 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 2         | (598)                           | (0,01)               |
| 19.502 NZD         | 12.063 US\$         | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (116)                           | (0,00)               |
| 577.109 SEK        | 56.191 US\$         | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (2.724)                         | (0,04)               |
| 494.739 SEK        | 48.187 US\$         | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 3         | (2.351)                         | (0,03)               |
| 159.785 SEK        | 15.587 US\$         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | (783)                           | (0,01)               |
| 289.744 SEK        | 27.070 US\$         | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (226)                           | (0,00)               |
| 26.814 US\$        | 9.512.975 HUF       | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (889)                           | (0,01)               |
| 53.755 US\$        | 43.292 £            | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 2         | (1.290)                         | (0,02)               |
| 28.587 US\$        | 523.765 MXN         | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (1.857)                         | (0,03)               |
| 14.668 US\$        | 159.491 SEK         | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (108)                           | (0,00)               |
| 26.259 US\$        | 286.443 NOK         | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (493)                           | (0,01)               |
| 27.160 US\$        | 25.196 €            | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 2         | (350)                           | (0,01)               |
| 26.467 US\$        | 43.206 NZD          | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (2)                             | (0,00)               |
| 52.504 US\$        | 46.976 CHF          | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (88)                            | (0,00)               |
| 40.585 US\$        | 54.164 CAD          | 20.07.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (357)                           | (0,01)               |
| 182.652 US\$       | 145.854 £           | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 5         | (2.800)                         | (0,04)               |
| 105.419 US\$       | 159.564 AUD         | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 3         | (845)                           | (0,01)               |
| 116.046 US\$       | 155.294 CAD         | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 3         | (1.339)                         | (0,02)               |
| 13.501 US\$        | 55.867 PLN          | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 1         | (238)                           | (0,00)               |
| 28.098 US\$        | 25.233 CHF          | 20.07.2023       | Citibank NA                    | 1         | (152)                           | (0,00)               |
| 241.489 US\$       | 193.148 £           | 20.07.2023       | Deutsche Bank AG               | 1         | (4.096)                         | (0,06)               |
| 12.963 US\$        | 286.045 CZK         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | (163)                           | (0,00)               |
| 136.489 US\$       | 122.300 CHF         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 3         | (433)                           | (0,01)               |
| 26.560 US\$        | 39.921 AUD          | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | (26)                            | (0,00)               |
| 21.778 US\$        | 233.323 NOK         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | (13)                            | (0,00)               |
| 160.744 US\$       | 148.051 €           | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 3         | (905)                           | (0,01)               |
| 121.534 US\$       | 97.335 £            | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 2         | (2.227)                         | (0,03)               |
| 92.760 US\$        | 123.689 CAD         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 4         | (735)                           | (0,01)               |
| 68.441 US\$        | 61.376 CHF          | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 2         | (274)                           | (0,00)               |
| 28.569 US\$        | 310.664 NOK         | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (445)                           | (0,01)               |
| 80.722 US\$        | 107.632 CAD         | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (637)                           | (0,01)               |
| 27.665 US\$        | 25.540 €            | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (221)                           | (0,00)               |
| 27.507 US\$        | 21.972 £            | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (431)                           | (0,01)               |
| 185.659 US\$       | 148.252 £           | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | (2.842)                         | (0,04)               |
| 26.636 US\$        | 24.620 €            | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | (245)                           | (0,00)               |
| 4.373 ZAR          | 242 US\$            | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | (11)                            | (0,00)               |

## Multi-Asset Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (1,49 %) (31. Dezember 2022: (5,14 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens         |
|---|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|------------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>   |                     |                  |                             |           |                                 |                              |
| 181 US\$  | 145 £               | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (3)                             | (0,00)                       |
| 139 US\$  | 111 £               | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank     | 1         | (3)                             | (0,00)                       |
| 175 US\$  | 142 £               | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 1         | (5)                             | (0,00)                       |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>                          |                     |                  |                             |           | <b>(110.257)</b>                | <b>(1,49)</b>                |
|   |                     |                  |                             |           | <b>Zeitwert US\$</b>            | <b>% des Nettovermögens</b>  |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> |                     |                  |                             |           | <b>(110.257)</b>                | <b>(1,49)</b>                |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              |                     |                  |                             |           | <b>255.148</b>                  | <b>3,46</b>                  |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  |                     |                  |                             |           | <b>7.127.436</b>                | <b>96,54</b>                 |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   |                     |                  |                             |           | <b>7.382.584</b>                | <b>100,00</b>                |
| <b>Portfolioanalyse</b>   |                     |                  |                             |           | <b>US\$</b>                     | <b>% des Gesamtvermögens</b> |
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind   |                     |                  |                             |           | 248.994                         | 2,49                         |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente   |                     |                  |                             |           | 6.154                           | 0,06                         |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  |                     |                  |                             |           | <b>255.148</b>                  | <b>2,55</b>                  |



## Next Generation Mobility - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der<br>Anteile                              | Wertpapierbezeichnung                        | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|------------------|------------------------------|
| <b>Aktien 92,31 % (31. Dezember 2022: 92,48 %)</b> |  |                  |                              |
| <b>Kanadischer Dollar</b>                          |  |                  |                              |
| 27.962   | First Quantum Minerals Ltd                   | 662.255          | 0,39                         |
| 12.556   | Magna International Inc                      | 709.664          | 0,41                         |
|  | <b>Kanadischer Dollar insgesamt</b>          | <b>1.371.919</b> | <b>0,80</b>                  |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi</b>                  |  |                  |                              |
| 32.300   | StarPower Semiconductor Ltd Class A          | 958.230          | 0,56                         |
|  | <b>Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt</b>  | <b>958.230</b>   | <b>0,56</b>                  |
| <b>Euro</b>  |  |                  |                              |
| 22.654   | BE Semiconductor Industries NV               | 2.454.251        | 1,43                         |
| 17.763   | Infineon Technologies AG                     | 732.252          | 0,43                         |
| 24.060   | Schneider Electric SE                        | 4.369.485        | 2,56                         |
|  | <b>Euro insgesamt</b>                        | <b>7.555.988</b> | <b>4,42</b>                  |
| <b>Hongkong-Dollar</b>                             |  |                  |                              |
| 48.200   | Baidu Inc Class A                            | 822.026          | 0,48                         |
| 26.000   | BYD Co Ltd - H Shares                        | 833.617          | 0,49                         |
| 69.572   | JD.com Inc Class A                           | 1.186.429        | 0,69                         |
| 103.236  | Sunny Optical Technology Group Co Ltd        | 1.035.029        | 0,61                         |
|  | <b>Hongkong-Dollar insgesamt</b>             | <b>3.877.101</b> | <b>2,27</b>                  |
| <b>Japanischer Yen</b>                             |  |                  |                              |
| 35.614   | Murata Manufacturing Co Ltd                  | 2.042.304        | 1,19                         |
| 37.541   | Taiyo Yuden Co Ltd                           | 1.072.874        | 0,63                         |
|  | <b>Japanischer Yen insgesamt</b>             | <b>3.115.178</b> | <b>1,82</b>                  |
| <b>Neuer taiwanesischer Dollar</b>                 |  |                  |                              |
| 50.000   | MediaTek Inc                                 | 1.106.793        | 0,65                         |
|  | <b>Neuer taiwanesischer Dollar insgesamt</b> | <b>1.106.793</b> | <b>0,65</b>                  |
| <b>Südkoreanischer Won</b>                         |  |                  |                              |
| 2.068  | LG Energy Solution Ltd                       | 871.853          | 0,51                         |
|  | <b>Südkoreanischer Won insgesamt</b>         | <b>871.853</b>   | <b>0,51</b>                  |
| <b>Schwedische Krone</b>                           |  |                  |                              |
| 101.682  | Epiroc AB Class A                            | 1.919.487        | 1,13                         |
|  | <b>Schwedische Krone insgesamt</b>           | <b>1.919.487</b> | <b>1,13</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>                                   |  |                  |                              |
| 21.208   | Advanced Micro Devices Inc                   | 2.415.803        | 1,41                         |

## Next Generation Mobility - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile  | Wertpapierbezeichnung                         | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---|---------------|----------------------|
| <b>Aktien 92,31% (31. Dezember 2022: 92,48 %) (Fortsetzung)</b> |   |               |                      |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>                                  |   |               |                      |
| 7.063   | Air Products & Chemicals Inc                  | 2.115.580     | 1,24                 |
| 4.135   | Albemarle Corp                                | 922.477       | 0,54                 |
| 9.658   | Alphabet Inc Class A                          | 1.156.063     | 0,68                 |
| 28.438  | Altair Engineering Inc Class A                | 2.156.738     | 1,26                 |
| 25.004  | Amazon.com Inc                                | 3.259.521     | 1,91                 |
| 30.982  | Ambarella Inc                                 | 2.592.264     | 1,52                 |
| 78.678  | Amphenol Corp Class A                         | 6.683.696     | 3,91                 |
| 27.708  | Analog Devices Inc                            | 5.397.796     | 3,16                 |
| 18.245  | ANSYS Inc                                     | 6.025.776     | 3,53                 |
| 27.560  | Applied Materials Inc                         | 3.983.522     | 2,33                 |
| 31.730  | Aptiv Plc                                     | 3.239.316     | 1,90                 |
| 6.284   | ASML Holding NV                               | 4.554.329     | 2,66                 |
| 11.648  | Autodesk Inc                                  | 2.383.297     | 1,39                 |
| 118.338   | Ballard Power Systems Inc                     | 515.954       | 0,30                 |
| 20.734  | Cadence Design Systems Inc                    | 4.862.538     | 2,85                 |
| 17.369  | Caterpillar Inc                               | 4.273.643     | 2,50                 |
| 55.243  | ChargePoint Holdings Inc                      | 485.586       | 0,28                 |
| 9.098   | Deere & Co                                    | 3.686.419     | 2,16                 |
| 82.126  | General Motors Co                             | 3.166.779     | 1,85                 |
| 115.612   | Gentex Corp                                   | 3.382.807     | 1,98                 |
| 13.861  | Globalfoundries Inc                           | 895.143       | 0,52                 |
| 15.881  | Keysight Technologies Inc                     | 2.659.274     | 1,56                 |
| 4.340   | Lam Research Corp                             | 2.790.012     | 1,63                 |
| 42.016  | Lattice Semiconductor Corp                    | 4.036.477     | 2,36                 |
| 13.095  | Linde Plc                                     | 4.990.243     | 2,92                 |
| 15.884  | Micron Technology Inc                         | 1.002.439     | 0,59                 |
| 17.735  | Mobileye Global Inc Class A                   | 681.379       | 0,40                 |
| 7.545   | Monolithic Power Systems Inc                  | 4.076.035     | 2,38                 |
| 143.886   | MP Materials Corp                             | 3.292.112     | 1,93                 |
| 45.139  | NIO Inc ADR                                   | 437.397       | 0,26                 |
| 13.960  | NVIDIA Corp                                   | 5.905.359     | 3,46                 |
| 14.176  | NXP Semiconductors NV                         | 2.901.544     | 1,70                 |
| 29.446  | ON Semiconductor Corp                         | 2.785.003     | 1,63                 |
| 9.271   | Qorvo Inc                                     | 945.920       | 0,55                 |
| 56.756  | Rambus Inc                                    | 3.642.033     | 2,13                 |
| 2.509   | S&P Global Inc                                | 1.005.833     | 0,59                 |
| 42.075  | Sensata Technologies Holding Plc              | 1.892.954     | 1,11                 |
| 14.810  | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR | 1.494.625     | 0,87                 |
| 35.027  | TE Connectivity Ltd                           | 4.909.384     | 2,87                 |
| 15.460  | Tesla Inc                                     | 4.046.964     | 2,37                 |

## Next Generation Mobility - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile   | Wertpapierbezeichnung        | Zeitwert US\$      | % des Nettovermögens |
|--|------------------------------|--------------------|----------------------|
| <b>Aktien 92,31% (31. Dezember 2022: 92,48 %) (Fortsetzung)</b>          |                              |                    |                      |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |                              |                    |                      |
| 12.855   | Texas Instruments Inc        | 2.314.157          | 1,35                 |
| 28.181   | T-Mobile US Inc              | 3.914.341          | 2,29                 |
| 86.499   | Trimble Inc                  | 4.579.257          | 2,68                 |
| 53.773   | Uber Technologies Inc        | 2.321.380          | 1,36                 |
| 5.576  | Verisk Analytics Inc Class A | 1.260.343          | 0,74                 |
| 6.314  | Zscaler Inc                  | 923.738            | 0,54                 |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |                              | <b>136.963.250</b> | <b>80,15</b>         |
| <b>Aktien insgesamt *</b>  |                              | <b>157.739.799</b> | <b>92,31</b>         |
| <b>Immobilienaktiengesellschaften 0,97 % (31. Dezember 2022: 1,03 %)</b> |                              |                    |                      |
| <b>US-Dollar</b>   |                              |                    |                      |
| 13.506   | Prologis Inc                 | 1.656.241          | 0,97                 |
| <b>Immobilienaktiengesellschaften insgesamt *</b>                        |                              | <b>1.656.241</b>   | <b>0,97</b>          |
| <b>Anlagen insgesamt</b>   |                              | <b>159.396.040</b> | <b>93,28</b>         |

Devisenterminkontrakte 0,00 % (31. Dezember 2022: 0,20 %)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 31.211 €   | 33.714 US\$         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 5         | 364                            | 0,00                 |
| 17.103 €   | 18.419 US\$         | 20.07.2023       | UBS AG                      | 3         | 256                            | 0,00                 |
| 29.733 €   | 32.105 US\$         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 7         | 359                            | 0,00                 |
| 14.216 US\$  | 12.885 €            | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 2         | 147                            | 0,00                 |
| 37.805 US\$  | 34.291 €            | 20.07.2023       | UBS AG                      | 6         | 365                            | 0,00                 |
| 5.939 US\$   | 5.392 €             | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 1         | 52                             | 0,00                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>sm</sup></b> |                     |                  |                             |           | <b>1.543</b>                   | <b>0,00</b>          |

|  | Zeitwert US\$      | % des Nettovermögens |
|--|--------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> | <b>159.397.583</b> | <b>93,28</b>         |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,00 %) (31. Dezember 2022: (0,14 %))

| Geforderter Betrag              | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 12.854 €                        | 14.201 US\$         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 3         | (167)                           | (0,00)               |
| 245.986 €                       | 269.701 US\$        | 20.07.2023       | UBS AG                      | 4         | (1.121)                         | (0,00)               |
| 233.267 €                       | 256.554 US\$        | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 4         | (1.861)                         | (0,00)               |

## Next Generation Mobility - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (0,00 %) (31. Dezember 2022: (0,14 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR (Fortsetzung)</i>                                    |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 9.387 US\$   | 8.668 €             | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 3         | (78)                            | (0,00)               |
| 13.683 US\$  | 12.617 €            | 20.07.2023       | UBS AG                      | 2         | (93)                            | (0,00)               |
| 58.540 US\$  | 54.478 €            | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 4         | (941)                           | (0,00)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                             |           | <b>(4.261)</b>                  | <b>(0,00)</b>        |

|   | Zeitwert US\$      | % des Nettovermögens |
|---|--------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(4.261)</b>     | <b>(0,00)</b>        |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>159.393.322</b> | <b>93,28</b>         |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>11.492.698</b>  | <b>6,72</b>          |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>170.886.020</b> | <b>100,00</b>        |

| Portfolioanalyse  | US\$               | % des Gesamtvermögens |
|---|--------------------|-----------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 159.396.040        | 92,94                 |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente   | (2.718)            | 0,00                  |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>159.393.322</b> | <b>92,94</b>          |

## Next Generation Space Economy - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der Anteile                                 | Wertpapierbezeichnung                            | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|------------------|------------------------------|
| <b>Aktien 96,91 % (31. Dezember 2022: 94,00 %)</b> |  |                  |                              |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi</b>                  |  |                  |                              |
| 43.220   | Shanghai Huace Navigation Technology Ltd Class A | 193.054          | 1,41                         |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt</b>        |  | <b>193.054</b>   | <b>1,41</b>                  |
| <b>Euro</b>  |  |                  |                              |
| 3.381  | Airbus SE  | 488.233          | 3,56                         |
| 10.615   | Avio SpA   | 108.050          | 0,79                         |
| 8.257  | AXA SA   | 243.452          | 1,77                         |
| 39.419   | Eutelsat Communications SA                       | 256.962          | 1,87                         |
| 2.085  | Safran SA  | 326.333          | 2,38                         |
| 1.743  | Thales SA  | 260.901          | 1,90                         |
| <b>Euro insgesamt</b>                              |  | <b>1.683.931</b> | <b>12,27</b>                 |
| <b>Japanischer Yen</b>                             |  |                  |                              |
| 6.800  | Mitsubishi Heavy Industries Ltd                  | 317.068          | 2,31                         |
| 4.600  | NEC Corp   | 222.787          | 1,62                         |
| 89.100   | SKY Perfect JSAT Holdings Inc                    | 353.435          | 2,58                         |
| <b>Japanischer Yen insgesamt</b>                   |  | <b>893.290</b>   | <b>6,51</b>                  |
| <b>Britisches Pfund</b>                            |  |                  |                              |
| 21.798   | BAE Systems Plc                                  | 256.898          | 1,87                         |
| 143.035  | Spirent Communications Plc                       | 297.503          | 2,17                         |
| <b>Britisches Pfund insgesamt</b>                  |  | <b>554.401</b>   | <b>4,04</b>                  |
| <b>Singapur-Dollar</b>                             |  |                  |                              |
| 150.700  | Singapore Technologies Engineering Ltd           | 410.922          | 3,00                         |
| <b>Singapur-Dollar insgesamt</b>                   |  | <b>410.922</b>   | <b>3,00</b>                  |
| <b>Südkoreanischer Won</b>                         |  |                  |                              |
| 1.063  | Hanwha Aerospace Co Ltd                          | 102.951          | 0,75                         |
| 7.062  | Intellian Technologies Inc                       | 395.929          | 2,88                         |
| 1.177  | Intellian Technologies Inc (Right, 31/12/2049)   | 13.488           | 0,10                         |
| <b>Südkoreanischer Won insgesamt</b>               |  | <b>512.368</b>   | <b>3,73</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>                                   |  |                  |                              |
| 3.028  | Advanced Micro Devices Inc                       | 344.919          | 2,51                         |
| 2.553  | Amazon.com Inc                                   | 332.809          | 2,43                         |
| 675  | ANSYS Inc  | 222.932          | 1,62                         |
| 283  | ASML Holding NV                                  | 205.104          | 1,50                         |
| 2.330  | Ball Corp  | 135.629          | 0,99                         |
| 1.796  | Boeing Co  | 379.243          | 2,76                         |
| 901  | CACI International Inc Class A                   | 307.097          | 2,24                         |

## Next Generation Space Economy - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile  | Wertpapierbezeichnung                   | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---|-------------------|------------------------------|
| <b>Aktien 96,91% (31. Dezember 2022: 94,00 %) (Fortsetzung)</b> |   |                   |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>                                  |   |                   |                              |
| 683   | CrowdStrike Holdings Inc Class A        | 100.312           | 0,73                         |
| 879   | Deere & Co                              | 356.162           | 2,60                         |
| 3.014   | Iridium Communications Inc              | 187.230           | 1,36                         |
| 1.673   | Jacobs Solutions Inc                    | 198.903           | 1,45                         |
| 1.782   | Keysight Technologies Inc               | 298.396           | 2,17                         |
| 20.138  | Kratos Defense & Security Solutions Inc | 288.779           | 2,10                         |
| 2.242   | Leidos Holdings Inc                     | 198.372           | 1,45                         |
| 394   | Lockheed Martin Corp                    | 181.390           | 1,32                         |
| 2.600   | MACOM Technology Solutions Holdings Inc | 170.378           | 1,24                         |
| 800   | Microsoft Corp                          | 272.432           | 1,99                         |
| 1.177   | Motorola Solutions Inc                  | 345.191           | 2,52                         |
| 2.727   | NV5 Global Inc                          | 302.070           | 2,20                         |
| 828   | NVIDIA Corp                             | 350.261           | 2,55                         |
| 3.350   | Okta Inc Class A                        | 232.322           | 1,69                         |
| 1.118   | Palo Alto Networks Inc                  | 285.660           | 2,08                         |
| 117.136   | Planet Labs PBC                         | 377.178           | 2,75                         |
| 3.776   | QUALCOMM Inc                            | 449.495           | 3,28                         |
| 2.026   | Raytheon Technologies Corp              | 198.467           | 1,45                         |
| 77.612  | Rocket Lab USA Inc                      | 465.672           | 3,39                         |
| 1.355   | Teledyne Technologies Inc               | 557.054           | 4,06                         |
| 369   | TransDigm Group Inc                     | 329.949           | 2,40                         |
| 7.729   | Trimble Inc                             | 409.173           | 2,98                         |
| 6.182   | Uber Technologies Inc                   | 266.877           | 1,95                         |
| 41.187  | Virgin Galactic Holdings Inc            | 159.806           | 1,16                         |
| 966   | Zscaler Inc                             | 141.326           | 1,03                         |
|   | <b>US-Dollar insgesamt</b>              | <b>9.050.588</b>  | <b>65,95</b>                 |
|   | <b>Aktien insgesamt *</b>               | <b>13.298.554</b> | <b>96,91</b>                 |
|   | <b>Anlagen insgesamt</b>                | <b>13.298.554</b> | <b>96,91</b>                 |

|  | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|-------------------|------------------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> | <b>13.298.554</b> | <b>96,91</b>                 |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>           | <b>13.298.554</b> | <b>96,91</b>                 |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>   | <b>424.516</b>    | <b>3,09</b>                  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                | <b>13.723.070</b> | <b>100,00</b>                |

| Portfolioanalyse  | US\$              | % des<br>Gesamtver-<br>mögens |
|---|-------------------|-------------------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 13.298.554        | 96,01                         |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>13.298.554</b> | <b>96,01</b>                  |

## Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung  | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Schatzwechsel 3,15 % (31. Dezember 2022: 1,00 %)</b>          |  |        |                       |                    |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |  |        |                       |                    |                              |
| 25.000.000   | United States Treasury Bill  | 0,00 % | 11.07.2023            | 24.972.403         | 0,52                         |
| 26.610.000   | United States Treasury Bill  | 0,00 % | 27.07.2023            | 26.521.101         | 0,56                         |
| 25.000.000   | United States Treasury Bill  | 0,00 % | 05.09.2023            | 24.772.333         | 0,52                         |
| 25.000.000   | United States Treasury Bill  | 0,00 % | 26.09.2023            | 24.697.178         | 0,52                         |
| 50.000.000   | United States Treasury Bill  | 0,00 % | 24.11.2023            | 48.964.633         | 1,03                         |
| <b>Schatzwechsel insgesamt **</b>                                |  |        |                       | <b>149.927.648</b> | <b>3,15</b>                  |
| <b>Unternehmensanleihen 65,89 % (31. Dezember 2022: 68,84 %)</b> |  |        |                       |                    |                              |
| <b>Euro</b>  |  |        |                       |                    |                              |
| 15.300.000   | NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance Plc*                                   | 7,13 % | 19.07.2026            | 6.217.381          | 0,13                         |
| 2.000.000  | Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara*                     | 2,88 % | 25.10.2025            | 2.102.418          | 0,04                         |
| <b>Euro insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>8.319.799</b>   | <b>0,17</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>   |  |        |                       |                    |                              |
| 4.317.000  | ABJA Investment Co Pte Ltd**   | 5,95 % | 31.07.2024            | 4.306.471          | 0,09                         |
| 21.380.000   | ABQ Finance Ltd*   | 1,88 % | 08.09.2025            | 19.739.620         | 0,41                         |
| 12.477.000   | ABQ Finance Ltd*   | 2,00 % | 06.07.2026            | 11.312.147         | 0,24                         |
| 14.283.000   | ABQ Finance Ltd*   | 3,13 % | 24.09.2024            | 13.815.289         | 0,29                         |
| 12.926.000   | Abu Dhabi Commercial Bank PJSC*  | 3,50 % | 31.03.2027            | 12.236.139         | 0,26                         |
| 5.370.000  | Abu Dhabi Commercial Bank PJSC*  | 4,50 % | 14.09.2027            | 5.293.048          | 0,11                         |
| 6.713.000  | Abu Dhabi National Energy Co PJSC*   | 4,38 % | 24.01.2029            | 6.640.768          | 0,14                         |
| 4.324.000  | Access Bank Plc*   | 6,13 % | 21.09.2026            | 3.669.779          | 0,08                         |
| 6.409.000  | Adani Green Energy Ltd*  | 4,38 % | 08.09.2024            | 5.927.802          | 0,12                         |
| 23.357.000   | Adani Green Energy UP Ltd/Prayatna Developers Pvt Ltd/Parampujya Solar Energy* | 6,25 % | 10.12.2024            | 22.417.968         | 0,47                         |
| 3.484.000  | Adani Ports & Special Economic Zone Ltd**                                      | 3,38 % | 24.07.2024            | 3.329.976          | 0,07                         |
| 7.758.000  | Africa Finance Corp*   | 3,88 % | 13.04.2024            | 7.588.876          | 0,16                         |
| 8.509.000  | African Export-Import Bank*  | 2,63 % | 17.05.2026            | 7.680.691          | 0,16                         |
| 7.500.000  | African Export-Import Bank*  | 4,13 % | 20.06.2024            | 7.331.250          | 0,15                         |
| 300.000  | African Export-Import Bank*  | 5,25 % | 11.10.2023            | 298.875            | 0,01                         |
| 5.589.000  | AIA Group Ltd*   | 5,63 % | 25.10.2027            | 5.732.086          | 0,12                         |
| 2.000.000  | Alibaba Group Holding Ltd*   | 3,40 % | 06.12.2027            | 1.860.839          | 0,04                         |
| 11.941.000   | Alsea SAB de CV**  | 7,75 % | 14.12.2026            | 11.860.143         | 0,25                         |
| 2.000.000  | Altice Financing SA*   | 5,00 % | 15.01.2028            | 1.600.499          | 0,03                         |
| 26.613.000   | Arab Petroleum Investments Corp*   | 4,13 % | 18.09.2023            | 26.537.016         | 0,56                         |
| 4.000.000  | Arabian Centres Sukuk II Ltd*  | 5,63 % | 07.10.2026            | 3.669.460          | 0,08                         |
| 6.540.000  | AUB Sukuk Ltd*   | 2,62 % | 09.09.2026            | 5.906.679          | 0,12                         |
| 2.552.000  | Baidu Inc**  | 1,72 % | 09.04.2026            | 2.289.677          | 0,05                         |
| 18.828.000   | Banco Bradesco SA*   | 3,20 % | 27.01.2025            | 17.934.800         | 0,38                         |
| 10.992.000   | Banco Bradesco SA**  | 4,38 % | 18.03.2027            | 10.424.006         | 0,22                         |
| 18.882.000   | Banco BTG Pactual SA*  | 2,75 % | 11.01.2026            | 17.231.796         | 0,36                         |

## Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung  | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 65,89 % (31. Dezember 2022: 68,84 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |        |                       |                  |                              |
| 14.781.000   | Banco BTG Pactual SA <sup>+</sup>  | 4,50 % | 10.01.2025            | 14.290.113       | 0,30                         |
| 7.800.000  | Banco BTG Pactual SA Series JUL <sup>+</sup>   | 4,50 % | 10.01.2025            | 7.540.957        | 0,16                         |
| 13.000.000   | Banco de Bogota SA <sup>+</sup>  | 6,25 % | 12.05.2026            | 12.565.929       | 0,26                         |
| 13.400.000   | Banco de Credito del Peru SA <sup>**</sup>   | 2,70 % | 11.01.2025            | 12.812.657       | 0,27                         |
| 8.861.000  | Banco del Estado de Chile <sup>+</sup>   | 2,70 % | 09.01.2025            | 8.482.339        | 0,18                         |
| 10.245.000   | Banco do Brasil SA <sup>+</sup>  | 3,25 % | 30.09.2026            | 9.456.787        | 0,19                         |
| 15.000.000   | Banco Inbursa SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Inbursa <sup>+</sup>           | 4,13 % | 06.06.2024            | 14.719.491       | 0,31                         |
| 9.000.000  | Banco Nacional de Comercio Exterior SNC <sup>+</sup>   | 2,72 % | 11.08.2031            | 7.582.500        | 0,16                         |
| 6.297.000  | Banco Santander Chile <sup>**</sup>  | 2,70 % | 10.01.2025            | 6.026.495        | 0,13                         |
| 29.442.000   | Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand <sup>**</sup> | 5,38 % | 17.04.2025            | 29.149.500       | 0,61                         |
| 8.824.000  | Banco Votorantim SA <sup>**</sup>  | 4,50 % | 24.09.2024            | 8.598.988        | 0,18                         |
| 19.200.000   | Bancolombia SA <sup>+</sup>  | 3,00 % | 29.01.2025            | 18.253.891       | 0,38                         |
| 10.200.000   | Bancolombia SA <sup>+</sup>  | 6,91 % | 18.10.2027            | 9.676.823        | 0,20                         |
| 7.431.000  | Bangkok Bank PCL <sup>+</sup>  | 4,30 % | 15.06.2027            | 7.227.578        | 0,15                         |
| 5.241.000  | Bank Mandiri Persero Tbk PT <sup>+</sup>   | 4,75 % | 13.05.2025            | 5.142.299        | 0,11                         |
| 15.789.000   | Bank Muscat SAOG <sup>+</sup>  | 4,75 % | 17.03.2026            | 15.307.309       | 0,32                         |
| 3.332.000  | Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT <sup>**</sup>   | 3,75 % | 30.03.2026            | 3.085.726        | 0,06                         |
| 2.800.000  | Banque Ouest Africaine de Developpement <sup>+</sup>   | 5,00 % | 27.07.2027            | 2.563.210        | 0,05                         |
| 10.833.000   | BBK BSC <sup>+</sup>   | 5,50 % | 09.07.2024            | 10.719.145       | 0,22                         |
| 5.338.000  | Beijing Gas Singapore Capital Corp <sup>+</sup>  | 1,88 % | 18.01.2025            | 5.037.337        | 0,11                         |
| 5.677.000  | Bidvest Group UK Plc <sup>+</sup>  | 3,63 % | 23.09.2026            | 5.074.528        | 0,11                         |
| 21.862.854   | Bioceanico Sovereign Certificate Ltd <sup>**</sup>   | 0,00 % | 05.06.2034            | 15.299.175       | 0,32                         |
| 17.184.000   | Black Sea Trade & Development Bank <sup>+</sup>  | 3,50 % | 25.06.2024            | 16.189.287       | 0,34                         |
| 6.988.000  | Blossom Joy Ltd <sup>+</sup>   | 3,10 % | 29.12.2049            | 6.625.809        | 0,14                         |
| 8.457.000  | BOC Aviation Ltd <sup>+</sup>  | 1,75 % | 21.01.2026            | 7.645.608        | 0,16                         |
| 3.487.000  | BOC Aviation Ltd <sup>+</sup>  | 3,25 % | 29.04.2025            | 3.318.248        | 0,07                         |
| 200.000  | BOC Aviation Ltd <sup>**</sup>   | 3,50 % | 18.09.2027            | 187.022          | 0,00                         |
| 5.399.000  | BOC Aviation Ltd <sup>+</sup>  | 4,00 % | 25.01.2024            | 5.336.841        | 0,11                         |
| 5.432.000  | BOCOM International Blossom Ltd <sup>+</sup>   | 1,75 % | 28.06.2026            | 4.826.347        | 0,10                         |
| 5.399.000  | Boubyan Sukuk Ltd <sup>**</sup>  | 2,59 % | 18.02.2025            | 5.184.244        | 0,11                         |
| 9.625.000  | Boubyan Sukuk Ltd <sup>+</sup>   | 3,39 % | 29.03.2027            | 9.215.966        | 0,19                         |
| 9.349.371  | Brazil Loan Trust 1 <sup>+</sup>   | 5,48 % | 24.07.2023            | 9.311.974        | 0,20                         |
| 54.556.000   | Brazil Minas SPE via State of Minas Gerais <sup>+</sup>  | 5,33 % | 15.02.2028            | 53.587.085       | 1,12                         |
| 19.430.000   | BSF Finance <sup>+</sup>   | 5,50 % | 23.11.2027            | 19.776.903       | 0,41                         |
| 27.742.000   | CBQ Finance Ltd <sup>+</sup>   | 2,00 % | 15.09.2025            | 25.776.507       | 0,54                         |
| 24.369.000   | CBQ Finance Ltd <sup>+</sup>   | 2,00 % | 12.05.2026            | 22.262.920       | 0,47                         |
| 4.800.000  | CCBL Cayman 1 Corp Ltd <sup>+</sup>  | 1,60 % | 15.09.2026            | 4.231.614        | 0,09                         |
| 8.549.000  | CCBL Cayman 1 Corp Ltd <sup>+</sup>  | 1,99 % | 21.07.2025            | 7.895.356        | 0,17                         |
| 14.000.000   | CCBL Cayman 1 Corp Ltd <sup>+</sup>  | 3,50 % | 16.05.2024            | 13.713.098       | 0,29                         |
| 7.821.000  | CDBL Funding 1 <sup>+</sup>  | 1,50 % | 04.11.2023            | 7.705.914        | 0,16                         |



## Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 65,89 % (31. Dezember 2022: 68,84 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 12.000.000   | CDBL Funding 2 <sup>*</sup>                                       | 2,00 % | 04.03.2026            | 10.922.154       | 0,23                         |
| 8.200.000  | Cencosud SA <sup>*</sup>  | 4,38 % | 17.07.2027            | 7.790.781        | 0,16                         |
| 3.439.000  | Centrais Eletricas Brasileiras SA <sup>**</sup>                   | 3,63 % | 04.02.2025            | 3.298.345        | 0,07                         |
| 7.800.000  | Central American Bank for Economic Integration <sup>*</sup>       | 1,14 % | 09.02.2026            | 6.997.969        | 0,15                         |
| 12.476.000   | Central American Bank for Economic Integration <sup>*</sup>       | 5,00 % | 09.02.2026            | 12.338.168       | 0,26                         |
| 4.926.000  | Chalco Hong Kong Investment Co Ltd <sup>*</sup>                   | 1,55 % | 28.07.2024            | 4.705.504        | 0,10                         |
| 5.399.000  | China Cinda Finance 2015 I Ltd <sup>*</sup>                       | 4,25 % | 23.04.2025            | 5.200.311        | 0,11                         |
| 10.036.000   | China Construction Bank Corp <sup>*</sup>                         | 1,25 % | 04.08.2025            | 9.194.435        | 0,19                         |
| 2.709.000  | China Hongqiao Group Ltd <sup>*</sup>                             | 6,25 % | 08.06.2024            | 2.663.489        | 0,06                         |
| 24.471.000   | China Huadian Overseas Development 2018 Ltd <sup>*</sup>          | 3,38 % | 29.12.2049            | 23.413.853       | 0,49                         |
| 27.908.000   | China Huadian Overseas Development Management Co Ltd <sup>*</sup> | 4,00 % | 29.12.2049            | 27.391.259       | 0,57                         |
| 4.090.000  | China Overseas Grand Oceans Finance IV Cayman Ltd <sup>*</sup>    | 2,45 % | 09.02.2026            | 3.611.266        | 0,08                         |
| 18.174.000   | Chinalco Capital Holdings Ltd <sup>*</sup>                        | 2,13 % | 03.06.2026            | 16.436.666       | 0,34                         |
| 14.756.000   | Chinalco Capital Holdings Ltd <sup>*</sup>                        | 2,95 % | 24.02.2027            | 13.708.885       | 0,29                         |
| 8.442.000  | Chinalco Capital Holdings Ltd <sup>*</sup>                        | 4,10 % | 29.12.2049            | 8.251.823        | 0,17                         |
| 4.683.000  | CICC Hong Kong Finance 2016 MTN Ltd <sup>*</sup>                  | 1,75 % | 10.08.2023            | 4.663.355        | 0,10                         |
| 6.237.000  | CICC Hong Kong Finance 2016 MTN Ltd <sup>*</sup>                  | 2,00 % | 26.01.2026            | 5.683.656        | 0,12                         |
| 3.316.000  | CIFI Holdings Group Co Ltd <sup>*</sup>                           | 5,95 % | 20.10.2025            | 384.459          | 0,01                         |
| 4.600.000  | CITIC Ltd <sup>*</sup>  | 2,88 % | 17.02.2027            | 4.259.928        | 0,09                         |
| 4.303.000  | CITIC Securities Finance MTN Co Ltd <sup>*</sup>                  | 2,00 % | 03.06.2025            | 4.011.684        | 0,08                         |
| 11.695.000   | CK Hutchison International 23 Ltd <sup>**</sup>                   | 4,75 % | 21.04.2028            | 11.570.799       | 0,24                         |
| 9.192.000  | CMB International Leasing Management Ltd <sup>*</sup>             | 1,25 % | 16.09.2024            | 8.681.610        | 0,18                         |
| 12.236.000   | CMB International Leasing Management Ltd <sup>*</sup>             | 1,88 % | 12.08.2025            | 11.304.480       | 0,24                         |
| 2.500.000  | CMB International Leasing Management Ltd <sup>*</sup>             | 2,00 % | 04.02.2026            | 2.269.312        | 0,05                         |
| 14.815.000   | CMHI Finance BVI Co Ltd <sup>*</sup>                              | 4,00 % | 01.06.2027            | 14.300.608       | 0,30                         |
| 9.392.000  | CNCBINV 1 BVI Ltd <sup>*</sup>                                    | 1,75 % | 17.11.2024            | 8.866.405        | 0,19                         |
| 13.330.000   | Comision Federal de Electricidad <sup>*</sup>                     | 4,69 % | 15.05.2029            | 12.012.055       | 0,25                         |
| 14.320.000   | Comision Federal de Electricidad <sup>*</sup>                     | 4,75 % | 23.02.2027            | 13.699.729       | 0,29                         |
| 44.043.000   | Comision Federal de Electricidad <sup>*</sup>                     | 4,88 % | 15.01.2024            | 43.751.656       | 0,92                         |
| 14.467.000   | Commercial Bank of Dubai PSC <sup>*</sup>                         | 5,32 % | 14.06.2028            | 14.407.685       | 0,30                         |
| 6.871.000  | Compania de Minas Buenaventura SAA <sup>**</sup>                  | 5,50 % | 23.07.2026            | 5.970.266        | 0,13                         |
| 23.570.000   | Corp Andina de Fomento <sup>*</sup>                               | 1,25 % | 26.10.2024            | 22.132.731       | 0,46                         |
| 27.333.000   | Corp Andina de Fomento <sup>*</sup>                               | 2,25 % | 08.02.2027            | 24.543.041       | 0,51                         |
| 6.000.000  | Corp Nacional del Cobre de Chile <sup>*</sup>                     | 4,50 % | 13.08.2023            | 5.983.961        | 0,13                         |
| 628.000  | Country Garden Holdings Co Ltd <sup>*</sup>                       | 6,15 % | 17.09.2025            | 207.527          | 0,00                         |
| 3.000.000  | Country Garden Holdings Co Ltd <sup>*</sup>                       | 8,00 % | 27.01.2024            | 1.971.351        | 0,04                         |
| 3.528.000  | Credicorp Ltd <sup>**</sup>                                       | 2,75 % | 17.06.2025            | 3.335.085        | 0,07                         |
| 3.800.000  | CSCIF Asia Ltd <sup>*</sup>                                       | 1,75 % | 04.08.2025            | 3.502.670        | 0,07                         |
| 16.200.000   | CSN Inova Ventures <sup>**</sup>                                  | 6,75 % | 28.01.2028            | 15.044.635       | 0,32                         |
| 10.825.000   | Development Bank of Kazakhstan JSC <sup>*</sup>                   | 5,75 % | 12.05.2025            | 10.931.929       | 0,23                         |

## Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 65,89 % (31. Dezember 2022: 68,84 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |         |                       |                  |                              |
| 13.401.000   | Dianjian Haiyu Ltd*                                  | 4,30 %  | 29.12.2049            | 13.203.675       | 0,28                         |
| 15.584.000   | DIB Sukuk Ltd*                                       | 1,96 %  | 22.06.2026            | 14.266.616       | 0,30                         |
| 14.741.000   | DIB Sukuk Ltd*                                       | 2,74 %  | 16.02.2027            | 13.642.132       | 0,29                         |
| 4.758.000  | DIB Sukuk Ltd*                                       | 2,95 %  | 20.02.2025            | 4.567.985        | 0,10                         |
| 26.946.000   | DIB Sukuk Ltd*                                       | 2,95 %  | 16.01.2026            | 25.497.922       | 0,53                         |
| 12.489.000   | DIB Sukuk Ltd*                                       | 4,80 %  | 16.08.2028            | 12.478.509       | 0,26                         |
| 15.584.000   | DIB Sukuk Ltd*                                       | 5,49 %  | 30.11.2027            | 15.962.442       | 0,33                         |
| 42.143.000   | Eastern & Southern African Trade & Development Bank* | 4,88 %  | 23.05.2024            | 40.591.716       | 0,85                         |
| 9.286.000  | Eastern Creation II Investment Holdings Ltd*         | 1,00 %  | 10.09.2023            | 9.207.440        | 0,19                         |
| 21.950.000   | Ecopetrol SA*  | 4,13 %  | 16.01.2025            | 21.101.494       | 0,44                         |
| 26.300.000   | Ecopetrol SA*  | 5,38 %  | 26.06.2026            | 25.189.085       | 0,53                         |
| 18.300.000   | EI Sukuk Co Ltd*                                     | 1,83 %  | 23.09.2025            | 16.973.415       | 0,36                         |
| 5.800.000  | EI Sukuk Co Ltd*                                     | 2,08 %  | 02.11.2026            | 5.299.112        | 0,11                         |
| 32.420.000   | Emirates Development Bank PJSC*                      | 1,64 %  | 15.06.2026            | 29.455.288       | 0,62                         |
| 28.200.000   | Emirates Development Bank PJSC*                      | 3,52 %  | 06.03.2024            | 27.759.375       | 0,58                         |
| 9.165.000  | Emirates NBD Bank PJSC*                              | 1,64 %  | 13.01.2026            | 8.402.600        | 0,18                         |
| 12.376.000   | Emirates NBD Bank PJSC*                              | 2,63 %  | 18.02.2025            | 11.825.701       | 0,25                         |
| 20.828.000   | Emirates NBD Bank PJSC*                              | 5,63 %  | 21.10.2027            | 21.419.828       | 0,45                         |
| 4.145.000  | Endeavour Mining Plc**                               | 5,00 %  | 14.10.2026            | 3.686.978        | 0,08                         |
| 12.757.988   | Energean Israel Finance Ltd*                         | 4,50 %  | 30.03.2024            | 12.634.350       | 0,27                         |
| 2.800.000  | ENN Clean Energy International Investment Ltd*       | 3,38 %  | 12.05.2026            | 2.594.246        | 0,05                         |
| 11.568.000   | Fab Sukuk Co Ltd*                                    | 1,41 %  | 14.01.2026            | 10.606.584       | 0,22                         |
| 22.088.000   | Fab Sukuk Co Ltd*                                    | 3,88 %  | 22.01.2024            | 21.849.538       | 0,46                         |
| 16.000.000   | First Abu Dhabi Bank PJSC*                           | 4,38 %  | 24.04.2028            | 15.632.000       | 0,33                         |
| 30.439.000   | First Abu Dhabi Bank PJSC*                           | 5,13 %  | 13.10.2027            | 30.869.154       | 0,65                         |
| 11.633.000   | Franshion Brilliant Ltd*                             | 3,20 %  | 09.04.2026            | 10.388.578       | 0,22                         |
| 14.143.000   | FS Luxembourg Sarl**                                 | 10,00 % | 15.12.2025            | 14.501.255       | 0,31                         |
| 454.473  | Genneia SA**   | 8,75 %  | 02.09.2027            | 443.373          | 0,01                         |
| 14.000.000   | Geopark Ltd**  | 5,50 %  | 17.01.2027            | 11.376.898       | 0,24                         |
| 2.500.000  | Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd*                 | 5,13 %  | 15.05.2024            | 2.476.133        | 0,05                         |
| 9.099.200  | Greenko Dutch BV**                                   | 3,85 %  | 29.03.2026            | 8.190.599        | 0,18                         |
| 10.790.000   | Greenko Wind Projects Mauritius Ltd**                | 5,50 %  | 06.04.2025            | 10.367.908       | 0,22                         |
| 20.370.000   | Grupo de Inversiones Suramericana SA*                | 5,50 %  | 29.04.2026            | 19.314.011       | 0,41                         |
| 35.576.000   | Gulf International Bank BSC*                         | 2,38 %  | 23.09.2025            | 33.131.537       | 0,70                         |
| 5.200.000  | Haitong International Securities Group Ltd*          | 3,13 %  | 18.05.2025            | 4.850.794        | 0,10                         |
| 9.395.000  | Hana Bank*   | 3,25 %  | 30.03.2027            | 8.801.577        | 0,18                         |
| 1.551.000  | Hengjian International Investment Ltd*               | 1,88 %  | 23.06.2025            | 1.434.838        | 0,03                         |
| 18.193.000   | Hikma Finance USA LLC*                               | 3,25 %  | 09.07.2025            | 17.265.787       | 0,36                         |
| 4.995.000  | Horse Gallop Finance Ltd*                            | 1,70 %  | 28.07.2025            | 4.590.720        | 0,10                         |
| 16.769.000   | HPHT Finance 19 Ltd*                                 | 2,88 %  | 05.11.2024            | 16.116.442       | 0,34                         |

## Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 65,89 % (31. Dezember 2022: 68,84 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |        |                       |                  |                              |
| 8.250.000  | HPHT Finance 21 II Ltd**                             | 1,50 % | 17.09.2026            | 7.215.119        | 0,15                         |
| 3.023.000  | Huarong Finance 2019 Co Ltd*                         | 2,13 % | 30.09.2023            | 2.987.988        | 0,06                         |
| 10.365.000   | Huarong Finance 2019 Co Ltd*                         | 3,25 % | 13.11.2024            | 9.729.930        | 0,20                         |
| 9.858.000  | Huarong Finance 2019 Co Ltd*                         | 3,75 % | 29.05.2024            | 9.477.971        | 0,20                         |
| 400.000  | Huarong Finance II Co Ltd*                           | 5,50 % | 16.01.2025            | 380.581          | 0,01                         |
| 10.816.000   | Hunt Oil Co of Peru LLC Sucursal Del Peru**          | 6,38 % | 01.06.2028            | 10.410.400       | 0,22                         |
| 1.000.000  | Hyundai Capital America**                            | 1,65 % | 17.09.2026            | 881.606          | 0,02                         |
| 8.100.000  | Hyundai Capital America**                            | 2,65 % | 10.02.2025            | 7.680.996        | 0,16                         |
| 14.000.000   | Hyundai Capital America**                            | 3,40 % | 20.06.2024            | 13.654.297       | 0,29                         |
| 6.097.000  | Hyundai Capital America**                            | 5,50 % | 30.03.2026            | 6.044.916        | 0,13                         |
| 11.805.000   | Hyundai Capital America**                            | 5,68 % | 26.06.2028            | 11.716.818       | 0,25                         |
| 5.400.000  | IHS Holding Ltd**                                    | 5,63 % | 29.11.2026            | 4.726.080        | 0,10                         |
| 6.200.000  | IHS Netherlands Holdco BV**                          | 8,00 % | 18.09.2027            | 5.666.800        | 0,12                         |
| 9.000.000  | Industrial & Commercial Bank of China Ltd*           | 1,00 % | 09.09.2023            | 8.925.525        | 0,19                         |
| 5.200.000  | Inventive Global Investments Ltd*                    | 1,10 % | 01.09.2024            | 4.917.904        | 0,10                         |
| 7.150.000  | Inventive Global Investments Ltd*                    | 1,50 % | 15.07.2023            | 7.141.277        | 0,15                         |
| 7.967.000  | Israel Discount Bank Ltd**                           | 5,38 % | 26.01.2028            | 7.880.829        | 0,17                         |
| 2.031.000  | Itau Unibanco Holding SA**                           | 3,25 % | 24.01.2025            | 1.958.172        | 0,04                         |
| 10.411.000   | JBS USA LUX SA/JBS USA Food Co/JBS USA Finance Inc** | 2,50 % | 15.01.2027            | 9.128.885        | 0,19                         |
| 4.996.000  | JBS USA LUX SA/JBS USA Food Co/JBS USA Finance Inc** | 5,13 % | 01.02.2028            | 4.801.518        | 0,10                         |
| 11.877.000   | JSW Steel Ltd*                                       | 5,95 % | 18.04.2024            | 11.810.489       | 0,25                         |
| 8.439.000  | Kallpa Generacion SA*                                | 4,13 % | 16.08.2027            | 7.889.226        | 0,17                         |
| 4.081.000  | Kasikornbank PCL*                                    | 5,46 % | 07.03.2028            | 4.085.387        | 0,09                         |
| 11.632.000   | KazMunayGas National Co JSC*                         | 4,75 % | 19.04.2027            | 11.066.917       | 0,23                         |
| 7.000.000  | KOC Holding AS*                                      | 6,50 % | 11.03.2025            | 6.928.600        | 0,15                         |
| 6.079.000  | Kookmin Bank*  | 1,38 % | 06.05.2026            | 5.431.438        | 0,11                         |
| 6.000.000  | Kosmos Energy Ltd*                                   | 7,13 % | 04.04.2026            | 5.282.040        | 0,11                         |
| 3.775.000  | KT Corp*   | 4,00 % | 08.08.2025            | 3.661.269        | 0,08                         |
| 7.651.000  | Legend Fortune Ltd*                                  | 1,38 % | 02.06.2024            | 7.337.468        | 0,15                         |
| 3.000.000  | Levc Finance Ltd*                                    | 1,38 % | 25.03.2024            | 2.902.055        | 0,06                         |
| 27.134.226   | Leviathan Bond Ltd*                                  | 6,13 % | 30.06.2025            | 26.591.541       | 0,56                         |
| 7.800.000  | Longfor Group Holdings Ltd*                          | 4,50 % | 16.01.2028            | 6.278.206        | 0,13                         |
| 31.718.000   | Mashreqbank PSC*                                     | 4,25 % | 26.02.2024            | 31.354.163       | 0,66                         |
| 20.500.000   | MDGH GMTN RSC Ltd*                                   | 2,50 % | 07.11.2024            | 19.713.620       | 0,41                         |
| 6.800.000  | MDGH GMTN RSC Ltd*                                   | 3,00 % | 19.04.2024            | 6.650.216        | 0,14                         |
| 14.708.000   | MDGH GMTN RSC Ltd*                                   | 3,00 % | 28.03.2027            | 13.832.389       | 0,29                         |
| 6.939.000  | Medco Bell Pte Ltd*                                  | 6,38 % | 30.01.2027            | 6.502.092        | 0,14                         |
| 11.200.000   | MEGlobal Canada ULC*                                 | 5,00 % | 18.05.2025            | 10.985.106       | 0,23                         |
| 4.265.000  | Meituan*   | 2,13 % | 28.10.2025            | 3.897.920        | 0,08                         |
| 7.638.000  | Melco Resorts Finance Ltd**                          | 4,88 % | 06.06.2025            | 7.284.361        | 0,15                         |

## Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                    | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 65,89 % (31. Dezember 2022: 68,84 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |         |                       |                  |                              |
| 10.678.000   | Melco Resorts Finance Ltd*                               | 5,25 %  | 26.04.2026            | 9.894.689        | 0,21                         |
| 2.322.000  | MercadoLibre Inc**                                       | 2,38 %  | 14.01.2026            | 2.104.755        | 0,04                         |
| 3.200.000  | MGM China Holdings Ltd*                                  | 5,25 %  | 18.06.2025            | 3.071.187        | 0,06                         |
| 11.983.000   | Minera y Metalurgica del Boleo SAPI de CV*               | 3,25 %  | 17.04.2024            | 11.725.065       | 0,25                         |
| 25.648.000   | Minmetals Bounteous Finance BVI Ltd*                     | 3,38 %  | 29.12.2049            | 24.867.531       | 0,52                         |
| 8.054.000  | MTN Mauritius Investments Ltd*                           | 4,76 %  | 11.11.2024            | 7.860.704        | 0,16                         |
| 2.792.000  | Muthoot Finance Ltd*                                     | 4,40 %  | 02.09.2023            | 2.773.852        | 0,06                         |
| 17.721.000   | NBK SPC Ltd*   | 1,63 %  | 15.09.2027            | 15.817.765       | 0,33                         |
| 12.700.000   | Nexa Resources SA**                                      | 5,38 %  | 04.05.2027            | 11.862.455       | 0,25                         |
| 12.646.000   | NPC Ukrenergo*   | 6,88 %  | 09.11.2028            | 2.813.735        | 0,06                         |
| 7.274.000  | Orazul Energy Peru SA*                                   | 5,63 %  | 28.04.2027            | 6.552.747        | 0,14                         |
| 9.038.000  | Periama Holdings LLC*                                    | 5,95 %  | 19.04.2026            | 8.725.325        | 0,18                         |
| 8.100.000  | Petrobras Global Finance BV*                             | 6,00 %  | 27.01.2028            | 8.092.671        | 0,17                         |
| 52.992.000   | Petroleos Mexicanos**                                    | 6,50 %  | 13.03.2027            | 47.188.162       | 0,99                         |
| 9.920.000  | Philippine National Bank*                                | 3,28 %  | 27.09.2024            | 9.616.607        | 0,20                         |
| 10.864.000   | POSCO*   | 4,38 %  | 04.08.2025            | 10.549.153       | 0,22                         |
| 3.931.000  | POSCO**  | 5,75 %  | 17.01.2028            | 3.989.515        | 0,08                         |
| 5.571.000  | Powerchina Roadbridge Group British Virgin Islands Ltd** | 3,08 %  | 29.12.2049            | 5.208.885        | 0,11                         |
| 29.141.000   | QatarEnergy*   | 1,38 %  | 12.09.2026            | 26.241.791       | 0,55                         |
| 8.561.000  | QIB Sukuk Ltd*   | 1,95 %  | 27.10.2025            | 7.944.831        | 0,17                         |
| 35.321.000   | QIB Sukuk Ltd*   | 3,98 %  | 26.03.2024            | 34.909.687       | 0,73                         |
| 6.495.000  | QIIB Senior Sukuk Ltd*                                   | 4,26 %  | 05.03.2024            | 6.427.673        | 0,13                         |
| 49.347.000   | QNB Finance Ltd*   | 2,63 %  | 12.05.2025            | 46.882.463       | 0,98                         |
| 37.190.000   | QNB Finance Ltd*   | 3,50 %  | 28.03.2024            | 36.578.596       | 0,77                         |
| 8.700.000  | Rakfunding Cayman Ltd*                                   | 4,13 %  | 09.04.2024            | 8.590.832        | 0,18                         |
| 9.291.420  | Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co Ltd 3**              | 5,84 %  | 30.09.2027            | 9.413.323        | 0,20                         |
| 19.317.350   | Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co Ltd 3**              | 6,33 %  | 30.09.2027            | 19.732.673       | 0,41                         |
| 14.385.000   | REC Ltd*   | 3,38 %  | 25.07.2024            | 13.979.628       | 0,29                         |
| 18.625.000   | REC Ltd*   | 3,50 %  | 12.12.2024            | 17.924.272       | 0,38                         |
| 5.000.000  | REC Ltd*   | 5,25 %  | 13.11.2023            | 4.980.924        | 0,10                         |
| 2.000.000  | Republic of Angola Via Avenir II BV*                     | 10,16 % | 07.12.2023            | 1.990.000        | 0,04                         |
| 5.714.286  | Republic of Angola Via Avenir Issuer II Ireland DAC*     | 6,93 %  | 19.02.2027            | 5.371.429        | 0,11                         |
| 779.000  | RKPF Overseas 2019 A Ltd*                                | 6,70 %  | 30.09.2024            | 573.998          | 0,01                         |
| 2.000.000  | RKPF Overseas 2020 A Ltd*                                | 5,20 %  | 12.01.2026            | 1.073.025        | 0,02                         |
| 25.000.000   | Rongshi International Finance Ltd*                       | 3,25 %  | 21.05.2024            | 24.477.635       | 0,51                         |
| 20.000.000   | SA Global Sukuk Ltd*                                     | 1,60 %  | 17.06.2026            | 18.130.840       | 0,38                         |
| 7.000.000  | Sands China Ltd**  | 4,30 %  | 08.01.2026            | 6.586.951        | 0,14                         |
| 5.799.000  | Sands China Ltd*   | 5,63 %  | 08.08.2025            | 5.661.230        | 0,12                         |
| 1.000.000  | Sands China Ltd*   | 5,90 %  | 08.08.2028            | 954.150          | 0,02                         |
| 40.650.000   | Sasol Financing USA LLC*                                 | 5,88 %  | 27.03.2024            | 40.161.298       | 0,84                         |

## Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                           | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 65,89 % (31. Dezember 2022: 68,84 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 5.000.000  | Sasol Financing USA LLC*                        | 6,50 %  | 27.09.2028            | 4.475.570        | 0,09                         |
| 3.239.000  | Saudi Arabian Oil Co*                           | 1,25 %  | 24.11.2023            | 3.179.846        | 0,07                         |
| 4.319.000  | Saudi Arabian Oil Co*                           | 1,63 %  | 24.11.2025            | 3.954.062        | 0,08                         |
| 45.986.000   | Saudi Arabian Oil Co*                           | 2,88 %  | 16.04.2024            | 44.907.444       | 0,94                         |
| 26.331.000   | Saudi Electricity Global Sukuk Co 4*            | 4,22 %  | 27.01.2024            | 26.089.597       | 0,55                         |
| 26.370.000   | Saudi Electricity Global Sukuk Co 5*            | 1,74 %  | 17.09.2025            | 24.588.891       | 0,52                         |
| 5.000.000  | Severstal OAO Via Steel Capital SA*             | 5,90 %  | 17.12.2023            | 500.000          | 0,01                         |
| 4.507.000  | SF Holding Investment 2021 Ltd*                 | 2,38 %  | 17.11.2026            | 4.057.909        | 0,09                         |
| 5.100.000  | Shinhan Bank Co Ltd**                           | 3,88 %  | 24.03.2026            | 4.796.578        | 0,10                         |
| 10.581.000   | Shinhan Financial Group Co Ltd*                 | 1,35 %  | 10.01.2026            | 9.537.455        | 0,20                         |
| 4.400.000  | Sinopec Group Overseas Development 2014 Ltd**   | 4,38 %  | 10.04.2024            | 4.356.561        | 0,09                         |
| 5.000.000  | Sinopec Group Overseas Development 2015 Ltd*    | 3,25 %  | 28.04.2025            | 4.798.824        | 0,10                         |
| 21.866.000   | Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd**   | 1,45 %  | 08.01.2026            | 19.824.447       | 0,42                         |
| 23.800.000   | Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd*    | 2,15 %  | 13.05.2025            | 22.439.494       | 0,47                         |
| 27.104.000   | Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd*    | 2,50 %  | 08.08.2024            | 26.183.071       | 0,55                         |
| 7.000.000  | Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd*    | 2,50 %  | 12.11.2024            | 6.698.371        | 0,14                         |
| 7.078.000  | SK Hynix Inc*                                   | 6,25 %  | 17.01.2026            | 7.083.305        | 0,15                         |
| 5.594.000  | SK Hynix Inc*                                   | 6,38 %  | 17.01.2028            | 5.618.065        | 0,12                         |
| 1.500.000  | SK On Co Ltd**                                  | 5,38 %  | 11.05.2026            | 1.488.077        | 0,03                         |
| 25.418.000   | SNB Funding Ltd*                                | 2,75 %  | 02.10.2024            | 24.517.440       | 0,51                         |
| 17.918.000   | SNB Sukuk Ltd*                                  | 2,34 %  | 19.01.2027            | 16.491.154       | 0,35                         |
| 53.000.000   | Southern Gas Corridor CJSC*                     | 6,88 %  | 24.03.2026            | 53.938.100       | 1,13                         |
| 7.600.000  | Standard Chartered Plc*                         | 6,19 %  | 06.07.2027            | 7.604.926        | 0,16                         |
| 10.717.000   | State Agency of Roads of Ukraine*               | 6,25 %  | 24.06.2030            | 2.347.023        | 0,05                         |
| 5.353.000  | State Grid Europe Development (2014) Plc*       | 3,13 %  | 07.04.2025            | 5.138.227        | 0,11                         |
| 10.925.000   | Stillwater Mining Co*                           | 4,00 %  | 16.11.2026            | 9.757.445        | 0,20                         |
| 12.200.000   | Studio City Finance Ltd*                        | 6,00 %  | 15.07.2025            | 11.339.690       | 0,24                         |
| 2.500.000  | Studio City Finance Ltd*                        | 6,50 %  | 15.01.2028            | 2.090.200        | 0,04                         |
| 16.062.000   | SURA Asset Management SA**                      | 4,88 %  | 17.04.2024            | 15.875.061       | 0,33                         |
| 3.000.000  | Suzano Austria GmbH*                            | 2,50 %  | 15.09.2028            | 2.557.236        | 0,05                         |
| 2.000.000  | Tencent Holdings Ltd*                           | 1,81 %  | 26.01.2026            | 1.821.948        | 0,04                         |
| 26.847.000   | Tengizchevroil Finance Co International Ltd**   | 2,63 %  | 15.08.2025            | 24.469.027       | 0,51                         |
| 6.587.000  | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV* | 4,75 %  | 09.05.2027            | 6.101.686        | 0,13                         |
| 3.835.000  | Transnet SOC Ltd*                               | 8,25 %  | 06.02.2028            | 3.734.331        | 0,08                         |
| 14.200.000   | Trust Fibra Uno**                               | 5,25 %  | 15.12.2024            | 13.889.730       | 0,29                         |
| 8.235.000  | Trust Fibra Uno*                                | 5,25 %  | 30.01.2026            | 8.031.794        | 0,17                         |
| 9.021.000  | TSMC Arizona Corp*                              | 3,88 %  | 22.04.2027            | 8.689.919        | 0,18                         |
| 1.659.000  | Tullow Oil Plc*                                 | 10,25 % | 15.05.2026            | 1.262.499        | 0,02                         |
| 1.000.000  | Turk Telekomunikasyon AS*                       | 4,88 %  | 19.06.2024            | 955.100          | 0,02                         |
| 7.400.000  | Turkiye Petrol Rafinerileri AS*                 | 4,50 %  | 18.10.2024            | 7.091.938        | 0,15                         |

## Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                      | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$     | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|---------|-----------------------|----------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 65,89 % (31. Dezember 2022: 68,84 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                      |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |         |                       |                      |                              |
| 4.145.000  | Turkiye Sinai Kalkinma Bankasi AS*         | 6,00 %  | 23.01.2025            | 3.929.460            | 0,08                         |
| 9.530.000  | Turkiye Sise ve Cam Fabrikalari AS*        | 6,95 %  | 14.03.2026            | 9.291.750            | 0,19                         |
| 12.723.000   | Turkiye Vakiflar Bankasi TAO*              | 5,50 %  | 01.10.2026            | 11.245.605           | 0,24                         |
| 12.453.000   | Turkiye Vakiflar Bankasi TAO*              | 6,50 %  | 08.01.2026            | 11.604.639           | 0,24                         |
| 2.283.000  | Unigel Luxembourg SA*                      | 8,75 %  | 01.10.2026            | 750.536              | 0,02                         |
| 20.200.000   | Vedanta Resources Finance II Plc*          | 13,88 % | 21.01.2024            | 18.448.963           | 0,39                         |
| 5.000.000  | VTR Finance NV**                           | 6,38 %  | 15.07.2028            | 1.924.844            | 0,04                         |
| 3.239.000  | Weibo Corp*                                | 3,50 %  | 05.07.2024            | 3.161.717            | 0,07                         |
| 8.638.000  | Wynn Macau Ltd*                            | 4,88 %  | 01.10.2024            | 8.431.897            | 0,18                         |
| 2.000.000  | Wynn Macau Ltd*                            | 5,50 %  | 15.01.2026            | 1.859.900            | 0,04                         |
| 2.500.000  | Wynn Macau Ltd*                            | 5,50 %  | 01.10.2027            | 2.228.063            | 0,05                         |
| 8.889.000  | Xingsheng BVI Co Ltd*                      | 1,38 %  | 25.08.2024            | 8.421.439            | 0,18                         |
| 29.418.000   | XP Inc**                                   | 3,25 %  | 01.07.2026            | 26.092.945           | 0,55                         |
| 14.261.500   | YPF SA**                                   | 8,50 %  | 23.03.2025            | 13.671.003           | 0,29                         |
| 6.494.000  | Yunda Holding Investment Ltd*              | 2,25 %  | 19.08.2025            | 5.847.875            | 0,12                         |
| 12.868.000   | Zhejiang Seaport International Co Ltd*     | 1,98 %  | 17.03.2026            | 11.661.767           | 0,24                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |  |         |                       | <b>3.132.390.991</b> | <b>65,72</b>                 |
| <b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>  |  |         |                       | <b>3.140.710.790</b> | <b>65,89</b>                 |
| <b>Staatsanleihen 27,83 % (31. Dezember 2022: 23,53 %)</b>                     |  |         |                       |                      |                              |
| <b>Euro</b>  |  |         |                       |                      |                              |
| 5.000.000  | Colombia Government International Bond*    | 3,88 %  | 22.03.2026            | 5.241.109            | 0,11                         |
| 46.440.000   | Egypt Government International Bond*       | 4,75 %  | 11.04.2025            | 40.429.689           | 0,85                         |
| 41.167.000   | Egypt Government International Bond*       | 4,75 %  | 16.04.2026            | 31.714.707           | 0,66                         |
| 4.819.000  | Hungary Government International Bond*     | 5,00 %  | 22.02.2027            | 5.297.549            | 0,11                         |
| 17.240.000   | Indonesia Government International Bond*   | 1,75 %  | 24.04.2025            | 18.045.765           | 0,38                         |
| 30.745.000   | Ivory Coast Government International Bond* | 5,13 %  | 15.06.2025            | 33.209.826           | 0,70                         |
| 34.305.000   | Ivory Coast Government International Bond* | 5,25 %  | 22.03.2030            | 31.718.340           | 0,66                         |
| 11.000.000   | Kazakhstan Government International Bond*  | 0,60 %  | 30.09.2026            | 10.614.284           | 0,22                         |
| 10.000.000   | Peruvian Government International Bond*    | 2,75 %  | 30.01.2026            | 10.571.335           | 0,22                         |
| 2.376.000  | Romanian Government International Bond*    | 2,75 %  | 26.02.2026            | 2.468.618            | 0,05                         |
| 32.930.000   | Romanian Government International Bond**   | 2,88 %  | 26.05.2028            | 32.314.818           | 0,68                         |
| 2.624.000  | Romanian Government International Bond*    | 5,00 %  | 27.09.2026            | 2.879.704            | 0,06                         |
| 18.500.000   | Senegal Government International Bond*     | 4,75 %  | 13.03.2028            | 17.433.616           | 0,37                         |
| 37.000.000   | Serbia International Bond*                 | 1,00 %  | 23.09.2028            | 31.325.599           | 0,66                         |
| 65.046.000   | Serbia International Bond*                 | 3,13 %  | 15.05.2027            | 63.915.504           | 1,34                         |
| 6.000.000  | Ukraine Government International Bond**    | 6,75 %  | 20.06.2028            | 1.415.082            | 0,03                         |
| <b>Euro insgesamt</b>  |  |         |                       | <b>338.595.545</b>   | <b>7,10</b>                  |

## Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                             | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 27,83 % (31. Dezember 2022: 23,53 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 21.984.000   | Airport Authority*                                | 1,75 %  | 12.01.2027            | 19.911.940       | 0,42                         |
| 7.396.000  | Airport Authority*                                | 2,10 %  | 29.12.2049            | 6.754.283        | 0,14                         |
| 8.898.000  | Airport Authority*                                | 4,75 %  | 12.01.2028            | 8.895.269        | 0,19                         |
| 53.460.000   | Angolan Government International Bond*            | 8,25 %  | 09.05.2028            | 47.555.343       | 1,00                         |
| 71.573.310   | Argentine Republic Government International Bond* | 0,50 %  | 09.07.2030            | 23.946.012       | 0,50                         |
| 30.845.329   | Argentine Republic Government International Bond* | 1,00 %  | 09.07.2029            | 10.061.856       | 0,21                         |
| 2.600.000  | Bahamas Government International Bond*            | 5,75 %  | 16.01.2024            | 2.547.792        | 0,05                         |
| 18.190.000   | Bahamas Government International Bond*            | 6,00 %  | 21.11.2028            | 14.688.425       | 0,31                         |
| 5.000.000  | Bermuda Government International Bond*            | 3,72 %  | 25.01.2027            | 4.775.000        | 0,10                         |
| 67.662.000   | Colombia Government International Bond*           | 3,88 %  | 25.04.2027            | 61.499.216       | 1,29                         |
| 24.500.000   | Colombia Government International Bond*           | 4,50 %  | 28.01.2026            | 23.383.478       | 0,49                         |
| 15.000.000   | Colombia Government International Bond*           | 4,50 %  | 15.03.2029            | 13.174.744       | 0,28                         |
| 30.500.000   | Development Bank of Mongolia LLC*                 | 7,25 %  | 23.10.2023            | 30.385.624       | 0,64                         |
| 21.000.000   | Dominican Republic International Bond*            | 5,50 %  | 27.01.2025            | 20.695.899       | 0,43                         |
| 9.680.000  | Dominican Republic International Bond*            | 5,50 %  | 22.02.2029            | 9.081.509        | 0,19                         |
| 8.500.000  | Dominican Republic International Bond*            | 5,95 %  | 25.01.2027            | 8.352.102        | 0,18                         |
| 21.000.000   | Dominican Republic International Bond*            | 6,88 %  | 29.01.2026            | 21.202.114       | 0,44                         |
| 31.050.000   | Dominican Republic International Bond*            | 8,63 %  | 20.04.2027            | 32.447.213       | 0,68                         |
| 27.098.882   | Ecuador Government International Bond*            | 5,50 %  | 31.07.2030            | 13.165.414       | 0,28                         |
| 20.779.000   | Egypt Government International Bond*              | 5,80 %  | 30.09.2027            | 13.868.736       | 0,29                         |
| 13.860.000   | El Salvador Government International Bond*        | 7,65 %  | 15.06.2035            | 8.233.369        | 0,17                         |
| 24.616.000   | El Salvador Government International Bond*        | 8,63 %  | 28.02.2029            | 16.533.887       | 0,35                         |
| 4.443.000  | Export-Import Bank of Korea*                      | 5,00 %  | 11.01.2028            | 4.458.372        | 0,09                         |
| 10.909.000   | Fondo MIVIVIENDA SA*                              | 4,63 %  | 12.04.2027            | 10.549.401       | 0,22                         |
| 18.600.000   | Ghana Government International Bond*              | 6,38 %  | 11.02.2027            | 8.072.028        | 0,17                         |
| 24.934.000   | Ghana Government International Bond*              | 10,75 % | 14.10.2030            | 16.841.994       | 0,35                         |
| 9.800.000  | Guatemala Government Bond*                        | 5,25 %  | 10.08.2029            | 9.349.748        | 0,20                         |
| 7.585.333  | Honduras Government International Bond*           | 7,50 %  | 15.03.2024            | 7.548.466        | 0,16                         |
| 13.464.000   | Hong Kong Government International Bond*          | 4,50 %  | 11.01.2028            | 13.510.969       | 0,28                         |
| 7.864.000  | Hungary Government International Bond*            | 6,13 %  | 22.05.2028            | 7.994.283        | 0,17                         |
| 13.755.000   | Istanbul Metropolitan Municipality*               | 6,38 %  | 09.12.2025            | 12.353.271       | 0,26                         |
| 28.609.000   | Ivory Coast Government International Bond*        | 5,38 %  | 23.07.2024            | 28.021.085       | 0,59                         |
| 25.591.897   | Ivory Coast Government International Bond*        | 5,75 %  | 31.12.2032            | 23.937.560       | 0,50                         |
| 28.100.000   | Ivory Coast Government International Bond*        | 6,38 %  | 03.03.2028            | 27.189.420       | 0,57                         |
| 15.000.000   | Korea Development Bank*                           | 3,25 %  | 19.02.2024            | 14.791.786       | 0,31                         |
| 9.372.000  | Korea Development Bank*                           | 4,38 %  | 15.02.2028            | 9.190.527        | 0,19                         |
| 5.600.000  | Korea Electric Power Corp*                        | 3,63 %  | 14.06.2025            | 5.396.564        | 0,11                         |
| 4.325.000  | Korea Expressway Corp*                            | 1,13 %  | 17.05.2026            | 3.832.015        | 0,08                         |
| 2.800.000  | Korea Expressway Corp**                           | 3,63 %  | 18.05.2025            | 2.702.142        | 0,06                         |
| 25.371.000   | Korea Housing Finance Corp*                       | 4,63 %  | 24.02.2028            | 25.009.176       | 0,52                         |

## Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                   | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$     | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|----------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 27,83 % (31. Dezember 2022: 23,53 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                      |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |        |                       |                      |                              |
| 34.802.000   | Korea Mine Rehabilitation & Mineral Resources Corp*     | 1,75 % | 15.04.2026            | 31.041.984           | 0,65                         |
| 37.754.000   | Korea Mine Rehabilitation & Mineral Resources Corp*     | 5,38 % | 11.05.2028            | 37.206.188           | 0,78                         |
| 29.086.000   | Korea National Oil Corp*                                | 1,75 % | 18.04.2025            | 27.189.810           | 0,57                         |
| 5.208.000  | Magyar Export-Import Bank Zrt**                         | 6,13 % | 04.12.2027            | 5.158.003            | 0,11                         |
| 12.488.000   | Mexico Government International Bond*                   | 5,40 % | 09.02.2028            | 12.728.916           | 0,27                         |
| 24.831.000   | MFB Magyar Fejlesztési Bank Zrt*                        | 6,50 % | 29.06.2028            | 24.625.946           | 0,52                         |
| 12.000.000   | Mongolia Government International Bond*                 | 5,13 % | 07.04.2026            | 11.189.733           | 0,23                         |
| 4.281.000  | Mongolia Government International Bond*                 | 8,65 % | 19.01.2028            | 4.318.459            | 0,09                         |
| 1.741.000  | Mongolia Government International Bond*                 | 8,75 % | 09.03.2024            | 1.754.928            | 0,04                         |
| 12.623.000   | Morocco Government International Bond*                  | 5,95 % | 08.03.2028            | 12.761.853           | 0,27                         |
| 3.200.000  | Oman Government International Bond*                     | 4,75 % | 15.06.2026            | 3.116.003            | 0,07                         |
| 8.764.000  | Oman Government International Bond*                     | 4,88 % | 01.02.2025            | 8.634.293            | 0,18                         |
| 16.000.000   | Oman Government International Bond*                     | 5,38 % | 08.03.2027            | 15.725.920           | 0,33                         |
| 12.746.000   | Oman Government International Bond*                     | 5,63 % | 17.01.2028            | 12.629.170           | 0,26                         |
| 4.300.000  | Oman Government International Bond*                     | 6,75 % | 28.10.2027            | 4.449.743            | 0,09                         |
| 3.189.996  | Provincia de Cordoba*                                   | 6,88 % | 10.12.2025            | 2.408.447            | 0,05                         |
| 6.461.538  | Provincia de Mendoza Argentina*                         | 5,75 % | 19.03.2029            | 5.007.692            | 0,10                         |
| 11.651.000   | Qatar Government International Bond*                    | 3,38 % | 14.03.2024            | 11.485.090           | 0,24                         |
| 9.800.000  | Qatar Government International Bond*                    | 3,40 % | 16.04.2025            | 9.531.392            | 0,20                         |
| 2.000.000  | Republic of Azerbaijan International Bond*              | 5,13 % | 01.09.2029            | 1.919.973            | 0,04                         |
| 14.000.000   | Republic of South Africa Government International Bond* | 5,88 % | 16.09.2025            | 13.852.280           | 0,29                         |
| 14.100.000   | Romanian Government International Bond*                 | 3,00 % | 27.02.2027            | 12.797.780           | 0,27                         |
| 13.634.000   | Romanian Government International Bond*                 | 6,63 % | 17.02.2028            | 14.046.974           | 0,29                         |
| 36.381.000   | Sri Lanka Government International Bond*                | 5,75 % | 18.04.2023            | 16.595.470           | 0,35                         |
| 15.000.000   | Sri Lanka Government International Bond*                | 5,88 % | 25.07.2024            | 6.977.101            | 0,15                         |
| 21.600.000   | Sri Lanka Government International Bond*                | 6,35 % | 28.06.2024            | 9.948.409            | 0,21                         |
| 27.037.000   | Sri Lanka Government International Bond*                | 6,85 % | 14.03.2024            | 12.452.128           | 0,26                         |
| 13.000.000   | Ukraine Government International Bond*                  | 7,75 % | 01.09.2025            | 3.311.412            | 0,07                         |
| 11.000.000   | Ukraine Government International Bond*                  | 7,75 % | 01.09.2026            | 2.678.115            | 0,06                         |
| 14.819.000   | Ukraine Government International Bond*                  | 7,75 % | 01.09.2027            | 3.608.427            | 0,08                         |
| 4.975.000  | Ukraine Government International Bond*                  | 7,75 % | 01.09.2028            | 1.205.169            | 0,03                         |
| 4.059.000  | Ukraine Government International Bond*                  | 7,75 % | 01.09.2029            | 983.167              | 0,02                         |
| 19.500.000   | Ukraine Government International Bond*                  | 8,99 % | 01.02.2026            | 4.945.687            | 0,10                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |   |        |                       | <b>988.193.694</b>   | <b>20,73</b>                 |
| <b>Staatsanleihen insgesamt</b>  |   |        |                       | <b>1.326.789.239</b> | <b>27,83</b>                 |



## Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der<br>Anteile                                     | Wertpapierbezeichnung                            | Zeitwert<br>US\$     | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--|----------------------|------------------------------|
| <b>Investmentfonds 1,52 % (31. Dezember 2022: 1,37 %)</b> |  |                      |                              |
| <b>US-Dollar</b>  |  |                      |                              |
| 655.000   | Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund | 72.567.450           | 1,52                         |
| <b>Investmentfonds insgesamt <sup>h</sup></b>             |  | <b>72.567.450</b>    | <b>1,52</b>                  |
| <b>Anlagen insgesamt</b>                                  |  | <b>4.689.995.127</b> | <b>98,39</b>                 |

### Devisenterminkontrakte 0,67 % (31. Dezember 2022: 0,91 %)

| Geforderter<br>Betrag  | Zu zahlender<br>Betrag | Fälligkeits-<br>datum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|------------------------|-----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------------|------------------------------|
| 37.061.653 US\$  | 33.931.058 €           | 05.07.2023            | Citibank NA                 | 1         | 42.857                               | 0,00                         |
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i>  |                        |                       |                             |           |                                      |                              |
| 35 US\$  | 52 AUD                 | 14.09.2023            | UBS AG                      | 1         | 0                                    | 0,00                         |
| 700.570 US\$   | 1.023.456 AUD          | 14.09.2023            | Westpac Banking Corp        | 2         | 17.920                               | 0,00                         |
| <i>Abgesicherte Klassen CAD</i>  |                        |                       |                             |           |                                      |                              |
| 2.278.614 CAD  | 1.710.959 US\$         | 14.09.2023            | Royal Bank of Canada        | 2         | 12.963                               | 0,00                         |
| 2.231.893 CAD  | 1.675.404 US\$         | 14.09.2023            | Westpac Banking Corp        | 1         | 13.170                               | 0,00                         |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i>  |                        |                       |                             |           |                                      |                              |
| 30.828.691 CHF   | 34.560.954 US\$        | 14.09.2023            | UBS AG                      | 3         | 161.514                              | 0,01                         |
| 30.626.200 CHF   | 34.353.408 US\$        | 14.09.2023            | Westpac Banking Corp        | 10        | 140.994                              | 0,00                         |
| 7.981.947 US\$   | 7.073.212 CHF          | 14.09.2023            | Westpac Banking Corp        | 3         | 15.361                               | 0,00                         |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>  |                        |                       |                             |           |                                      |                              |
| 804.281.194 €  | 870.019.117 US\$       | 14.09.2023            | Goldman Sachs International | 1         | 10.637.941                           | 0,22                         |
| 825.528.731 €  | 893.090.468 US\$       | 14.09.2023            | Westpac Banking Corp        | 6         | 10.831.827                           | 0,23                         |
| 30.960.701 US\$  | 28.245.233 €           | 14.09.2023            | Westpac Banking Corp        | 12        | 33.255                               | 0,00                         |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>  |                        |                       |                             |           |                                      |                              |
| 327.857.598 £  | 412.013.726 US\$       | 14.09.2023            | Goldman Sachs International | 2         | 4.899.444                            | 0,10                         |
| 9.017.201 £  | 11.339.004 US\$        | 14.09.2023            | Royal Bank of Canada        | 1         | 127.529                              | 0,00                         |
| 328.479.001 £  | 412.677.110 US\$       | 14.09.2023            | Westpac Banking Corp        | 6         | 5.026.252                            | 0,11                         |
| 2.028.072 US\$   | 1.584.334 £            | 14.09.2023            | Westpac Banking Corp        | 9         | 13.387                               | 0,00                         |
| <i>Abgesicherte Klassen JPY</i>  |                        |                       |                             |           |                                      |                              |
| 218.000.001 ¥  | 1.524.480 US\$         | 14.09.2023            | Westpac Banking Corp        | 1         | 911                                  | 0,00                         |
| 234.464 US\$   | 32.760.000 ¥           | 14.09.2023            | Westpac Banking Corp        | 2         | 5.235                                | 0,00                         |
| <i>Abgesicherte Klassen SEK</i>  |                        |                       |                             |           |                                      |                              |
| 6.639.194 SEK  | 615.059 US\$           | 14.09.2023            | Goldman Sachs International | 2         | 1.721                                | 0,00                         |
| 6.641.778 SEK  | 615.346 US\$           | 14.09.2023            | Westpac Banking Corp        | 5         | 1.675                                | 0,00                         |
| 14.357 US\$  | 153.066 SEK            | 14.09.2023            | Westpac Banking Corp        | 4         | 138                                  | 0,00                         |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>  |                        |                       |                             |           |                                      |                              |
| 38.628 SGD   | 28.616 US\$            | 14.09.2023            | Westpac Banking Corp        | 2         | 4                                    | 0,00                         |
| 63.437 US\$  | 84.777 SGD             | 14.09.2023            | Westpac Banking Corp        | 7         | 624                                  | 0,00                         |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>oo</sup></b> |                        |                       |                             |           | <b>31.984.722</b>                    | <b>0,67</b>                  |

## Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

|  | Zeitwert<br>US\$     | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|----------------------|------------------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> | <b>4.721.979.849</b> | <b>99,06</b>                 |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Umgekehrte Pensionsgeschäfte (0,01 %) (31. Dezember 2022: (0,04 %))

| Kapital-<br>betrag<br>US\$                                 | Beschreibung   | Zinsaufwand/<br>(Zinsein-<br>nahmen) | Fälligkeits-<br>datum* | Zeitwert<br>US\$ | Vertragliche<br>Restlaufzeit der<br>Vereinbarung* | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------------------------------------|------------------------|------------------|---|------------------------------|
| 752.400  | Citigroup Reverse Repurchase Agreement, collateralised by Sri Lanka Government International Bond, 5.88%, maturing on 25/07/2024 | (6,00) %                             | Open/Demand            | (752.400)        | Overnight and Continuous                          | (0,01)                       |
| <b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte insgesamt <sup>∞</sup></b> |  |                                      |                        | <b>(752.400)</b> |   | <b>(0,01)</b>                |

\* Offene umgekehrte Pensionsgeschäfte ohne ein bestimmtes Fälligkeitsdatum. Jede Partei kann die Vereinbarung auf Verlangen kündigen.

### Devisenterminkontrakte (0,67 %) (31. Dezember 2022: (0,47 %))

| Geforderter<br>Betrag           | Zu zahlender<br>Betrag | Fälligkeits-<br>datum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht<br>realisierter<br>Verlust US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---------------------------------|------------------------|-----------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------------|------------------------------|
| 323.404.177 US\$                | 302.351.446 €          | 05.07.2023            | Deutsche Bank AG            | 1         | (6.461.352)                           | (0,14)                       |
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> |                        |                       |                             |           |                                       |                              |
| 1.281.403 AUD                   | 863.140 US\$           | 14.09.2023            | UBS AG                      | 1         | (8.439)                               | (0,00)                       |
| 1.304.704 AUD                   | 878.773 US\$           | 14.09.2023            | Westpac Banking Corp        | 2         | (8.530)                               | (0,00)                       |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i> |                        |                       |                             |           |                                       |                              |
| 6.799 CHF                       | 7.660 US\$             | 14.09.2023            | Westpac Banking Corp        | 3         | (2)                                   | (0,00)                       |
| 339.770 US\$                    | 302.761 CHF            | 14.09.2023            | Westpac Banking Corp        | 6         | (1.230)                               | (0,00)                       |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> |                        |                       |                             |           |                                       |                              |
| 268 €                           | 295 US\$               | 14.09.2023            | Westpac Banking Corp        | 1         | (1)                                   | (0,00)                       |
| 111.136.861 US\$                | 102.739.452 €          | 14.09.2023            | Goldman Sachs International | 1         | (1.358.898)                           | (0,03)                       |
| 142.582.076 US\$                | 131.519.489 €          | 14.09.2023            | Westpac Banking Corp        | 11        | (1.426.719)                           | (0,03)                       |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> |                        |                       |                             |           |                                       |                              |
| 305.680 £                       | 389.172 US\$           | 14.09.2023            | Westpac Banking Corp        | 3         | (461)                                 | (0,00)                       |
| 1.113.009 US\$                  | 881.784 £              | 14.09.2023            | Westpac Banking Corp        | 8         | (8.293)                               | (0,00)                       |
| <i>Abgesicherte Klassen JPY</i> |                        |                       |                             |           |                                       |                              |
| 40.956.838.201 ¥                | 297.643.869 US\$       | 14.09.2023            | Goldman Sachs International | 2         | (11.060.383)                          | (0,23)                       |
| 40.977.410.202 ¥                | 297.834.864 US\$       | 14.09.2023            | Westpac Banking Corp        | 5         | (11.107.431)                          | (0,23)                       |
| <i>Abgesicherte Klassen SEK</i> |                        |                       |                             |           |                                       |                              |
| 161.373 SEK                     | 15.017 US\$            | 14.09.2023            | Goldman Sachs International | 1         | (25)                                  | (0,00)                       |
| 215 SEK                         | 21 US\$                | 14.09.2023            | Westpac Banking Corp        | 2         | (0)                                   | (0,00)                       |
| 5.978 US\$                      | 64.497 SEK             | 14.09.2023            | Westpac Banking Corp        | 1         | (13)                                  | (0,00)                       |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i> |                        |                       |                             |           |                                       |                              |
| 25.972.642 SGD                  | 19.389.804 US\$        | 14.09.2023            | Goldman Sachs International | 2         | (146.106)                             | (0,00)                       |
| 28.346.105 SGD                  | 21.180.643 US\$        | 14.09.2023            | Westpac Banking Corp        | 12        | (178.395)                             | (0,01)                       |

## Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (0,67 %) (31. Dezember 2022: (0,47 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei          | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|----------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen SGD (Fortsetzung)</i>                                    |                     |                  |                      |           |                                 |                      |
| 4.877 US\$   | 6.584 SGD           | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp | 1         | (1)                             | (0,00)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                      |           | <b>(31.766.279)</b>             | <b>(0,67)</b>        |

|   | Zeitwert US\$        | % des Nettovermögens |
|---|----------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(32.518.679)</b>  | <b>(0,68)</b>        |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>4.689.461.170</b> | <b>98,38</b>         |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>77.095.435</b>    | <b>1,62</b>          |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>4.766.556.605</b> | <b>100,00</b>        |

| Portfolioanalyse  | US\$                 | Gesamtvermögen |
|---|----------------------|----------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 3.840.456.889        | 79,60          |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden            | 723.383.703          | 14,99          |
| † Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente  | 53.587.085           | 1,11           |
| μ Investmentfonds   | 72.567.450           | 1,50           |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente   | (533.957)            | (0,01)         |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>4.689.461.170</b> | <b>97,19</b>   |

## Short Duration High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 91,73 % (31. Dezember 2022: 85,85 %)</b> |   |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 4.310.000  | 1011778 BC ULC/New Red Finance Inc**  | 3,88 % | 15.01.2028            | 3.944.119        | 0,55                         |
| 4.010.000  | 1011778 BC ULC/New Red Finance Inc**  | 4,38 % | 15.01.2028            | 3.707.420        | 0,52                         |
| 1.520.000  | Acadia Healthcare Co Inc**  | 5,50 % | 01.07.2028            | 1.455.035        | 0,20                         |
| 4.200.000  | Adient Global Holdings Ltd**  | 4,88 % | 15.08.2026            | 3.994.665        | 0,56                         |
| 4.580.000  | Advanced Drainage Systems Inc**   | 5,00 % | 30.09.2027            | 4.338.701        | 0,60                         |
| 600.000  | AerCap Global Aviation Trust*   | 6,50 % | 15.06.2045            | 580.976          | 0,08                         |
| 900.000  | AerCap Holdings NV*   | 5,88 % | 10.10.2079            | 850.127          | 0,12                         |
| 5.555.000  | Air Canada**  | 3,88 % | 15.08.2026            | 5.153.666        | 0,72                         |
| 790.000  | Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC**           | 3,25 % | 15.03.2026            | 730.386          | 0,10                         |
| 530.000  | Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC**           | 4,63 % | 15.01.2027            | 502.689          | 0,07                         |
| 1.235.000  | Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC**           | 5,88 % | 15.02.2028            | 1.201.408        | 0,17                         |
| 4.390.000  | Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC**           | 6,50 % | 15.02.2028            | 4.402.270        | 0,61                         |
| 1.300.000  | Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC**           | 7,50 % | 15.03.2026            | 1.323.205        | 0,18                         |
| 2.890.000  | Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer**              | 4,25 % | 15.10.2027            | 2.597.656        | 0,36                         |
| 4.255.000  | Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer**              | 6,75 % | 15.10.2027            | 4.005.785        | 0,56                         |
| 1.735.000  | Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer**              | 6,75 % | 15.04.2028            | 1.722.601        | 0,24                         |
| 3.825.000  | Altice France SA**  | 8,13 % | 01.02.2027            | 3.316.377        | 0,46                         |
| 4.315.000  | American Airlines Inc**   | 7,25 % | 15.02.2028            | 4.293.765        | 0,60                         |
| 7.835.000  | American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd**                           | 5,50 % | 20.04.2026            | 7.769.105        | 1,08                         |
| 5.170.000  | Amsted Industries Inc**   | 5,63 % | 01.07.2027            | 5.005.435        | 0,70                         |
| 625.000  | Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp**                | 7,88 % | 15.05.2026            | 634.463          | 0,09                         |
| 5.045.000  | APX Group Inc**   | 6,75 % | 15.02.2027            | 4.949.322        | 0,69                         |
| 1.160.000  | Aramark Services Inc**  | 5,00 % | 01.02.2028            | 1.094.947        | 0,15                         |
| 2.890.000  | Aramark Services Inc**  | 6,38 % | 01.05.2025            | 2.889.936        | 0,40                         |
| 1.660.000  | Arconic Corp**  | 6,00 % | 15.05.2025            | 1.677.352        | 0,23                         |
| 750.000  | Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc** | 3,25 % | 01.09.2028            | 645.073          | 0,09                         |
| 6.745.000  | Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc** | 6,00 % | 15.06.2027            | 6.632.895        | 0,92                         |
| 2.490.000  | Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc**                      | 4,13 % | 15.08.2026            | 2.322.302        | 0,32                         |
| 3.370.000  | Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc**                      | 5,25 % | 30.04.2025            | 3.300.123        | 0,46                         |
| 2.540.000  | Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc**                      | 5,25 % | 15.08.2027            | 2.154.901        | 0,30                         |
| 4.620.000  | Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**                      | 7,00 % | 01.11.2026            | 4.476.039        | 0,62                         |
| 2.130.000  | Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**                      | 8,25 % | 31.12.2028            | 2.096.568        | 0,29                         |
| 5.165.000  | ASGN Inc**  | 4,63 % | 15.05.2028            | 4.677.863        | 0,65                         |
| 6.280.000  | AssuredPartners Inc**   | 7,00 % | 15.08.2025            | 6.209.943        | 0,86                         |
| 1.190.000  | Avantor Funding Inc**   | 4,63 % | 15.07.2028            | 1.104.109        | 0,15                         |
| 8.265.000  | Avient Corp**   | 5,75 % | 15.05.2025            | 8.172.123        | 1,14                         |
| 2.025.000  | Avolon Holdings Funding Ltd**   | 5,25 % | 15.05.2024            | 1.990.127        | 0,28                         |
| 4.195.000  | Axalta Coating Systems LLC/Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV**      | 4,75 % | 15.06.2027            | 3.958.372        | 0,55                         |
| 1.405.000  | Ball Corp**   | 6,88 % | 15.03.2028            | 1.434.249        | 0,20                         |
| 2.268.000  | Banjay Entertainment SASU*  | 5,38 % | 01.03.2025            | 2.225.191        | 0,31                         |

## Short Duration High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung  | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 91,73 % (31. Dezember 2022: 85,85 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |         |                       |                  |                              |
| 1.310.000  | Bank of America Corp**   | 6,13 %  | 29.12.2049            | 1.283.341        | 0,18                         |
| 1.910.000  | Bath & Body Works Inc*   | 5,25 %  | 01.02.2028            | 1.817.564        | 0,25                         |
| 3.825.000  | Bausch Health Cos Inc**  | 5,50 %  | 01.11.2025            | 3.384.934        | 0,47                         |
| 3.785.000  | BCPE Empire Holdings Inc**   | 7,63 %  | 01.05.2027            | 3.524.173        | 0,49                         |
| 1.980.000  | Beacon Roofing Supply Inc**  | 4,50 %  | 15.11.2026            | 1.880.916        | 0,26                         |
| 2.630.000  | Benteler International AG**  | 10,50 % | 15.05.2028            | 2.658.812        | 0,37                         |
| 4.355.000  | Berry Global Inc**   | 4,88 %  | 15.07.2026            | 4.190.163        | 0,58                         |
| 2.825.000  | Berry Global Inc**   | 5,63 %  | 15.07.2027            | 2.767.511        | 0,39                         |
| 2.640.000  | Blue Racer Midstream LLC/Blue Racer Finance Corp**                 | 6,63 %  | 15.07.2026            | 2.616.442        | 0,36                         |
| 4.345.000  | Blue Racer Midstream LLC/Blue Racer Finance Corp**                 | 7,63 %  | 15.12.2025            | 4.396.323        | 0,61                         |
| 6.015.000  | Buckeye Partners LP**  | 4,13 %  | 01.12.2027            | 5.476.477        | 0,76                         |
| 735.000  | Buckeye Partners LP**  | 4,50 %  | 01.03.2028            | 659.258          | 0,09                         |
| 1.995.000  | Calderys Financing LLC**   | 11,25 % | 01.06.2028            | 2.046.950        | 0,28                         |
| 5.275.000  | Camelot Return Merger Sub Inc**                                    | 8,75 %  | 01.08.2028            | 4.991.834        | 0,69                         |
| 3.750.000  | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**                       | 5,00 %  | 01.02.2028            | 3.420.525        | 0,48                         |
| 6.715.000  | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**                       | 5,13 %  | 01.05.2027            | 6.260.192        | 0,87                         |
| 1.260.000  | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**                       | 5,50 %  | 01.05.2026            | 1.229.674        | 0,17                         |
| 2.730.000  | CDW LLC/CDW Finance Corp**   | 3,28 %  | 01.12.2028            | 2.373.200        | 0,33                         |
| 2.045.000  | Chesapeake Energy Corp**   | 5,50 %  | 01.02.2026            | 1.995.721        | 0,28                         |
| 1.690.000  | Chesapeake Energy Corp**   | 6,75 %  | 15.04.2029            | 1.678.399        | 0,23                         |
| 7.325.000  | CHS/Community Health Systems Inc**                                 | 8,00 %  | 15.03.2026            | 7.141.928        | 0,99                         |
| 1.850.000  | Civitas Resources Inc**  | 8,38 %  | 01.07.2028            | 1.873.217        | 0,26                         |
| 930.000  | Clarios Global LP**  | 6,75 %  | 15.05.2025            | 931.625          | 0,13                         |
| 1.626.000  | Clarios Global LP/Clarios US Finance Co**                          | 6,25 %  | 15.05.2026            | 1.617.391        | 0,23                         |
| 2.025.000  | CommScope Inc**  | 6,00 %  | 01.03.2026            | 1.889.656        | 0,26                         |
| 1.750.000  | CommScope Inc**  | 8,25 %  | 01.03.2027            | 1.402.411        | 0,20                         |
| 440.000  | CommScope Technologies LLC**                                       | 5,00 %  | 15.03.2027            | 306.894          | 0,04                         |
| 2.390.000  | Consensus Cloud Solutions Inc**                                    | 6,00 %  | 15.10.2026            | 2.171.073        | 0,30                         |
| 5.200.000  | Coty Inc**   | 5,00 %  | 15.04.2026            | 4.988.512        | 0,69                         |
| 845.000  | Coty Inc**   | 6,50 %  | 15.04.2026            | 838.493          | 0,12                         |
| 4.315.000  | Crestwood Midstream Partners LP/Crestwood Midstream Finance Corp** | 5,63 %  | 01.05.2027            | 4.094.935        | 0,57                         |
| 385.000  | Crestwood Midstream Partners LP/Crestwood Midstream Finance Corp*  | 5,75 %  | 01.04.2025            | 378.612          | 0,05                         |
| 1.120.000  | CSC Holdings LLC**   | 5,25 %  | 01.06.2024            | 1.042.953        | 0,15                         |
| 1.185.000  | CSC Holdings LLC**   | 5,38 %  | 01.02.2028            | 953.926          | 0,13                         |
| 4.015.000  | CSC Holdings LLC**   | 5,50 %  | 15.04.2027            | 3.346.116        | 0,47                         |
| 1.865.000  | CSC Holdings LLC**   | 11,25 % | 15.05.2028            | 1.810.756        | 0,25                         |
| 3.390.000  | Dana Inc*  | 5,38 %  | 15.11.2027            | 3.214.315        | 0,45                         |
| 1.415.000  | Dana Inc*  | 5,63 %  | 15.06.2028            | 1.331.254        | 0,19                         |

## Short Duration High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                          | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 91,73 % (31. Dezember 2022: 85,85 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |         |                       |                  |                              |
| 3.530.000  | DISH DBS Corp**                                | 5,25 %  | 01.12.2026            | 2.838.288        | 0,40                         |
| 1.750.000  | DISH DBS Corp**                                | 5,88 %  | 15.11.2024            | 1.532.793        | 0,21                         |
| 2.655.000  | DISH DBS Corp**                                | 7,75 %  | 01.07.2026            | 1.631.166        | 0,23                         |
| 2.255.000  | DISH Network Corp**                            | 3,38 %  | 15.08.2026            | 1.155.687        | 0,16                         |
| 2.425.000  | DISH Network Corp**                            | 11,75 % | 15.11.2027            | 2.369.325        | 0,33                         |
| 2.470.000  | Edgewell Personal Care Co**                    | 5,50 %  | 01.06.2028            | 2.337.361        | 0,33                         |
| 1.190.000  | Energizer Holdings Inc**                       | 4,75 %  | 15.06.2028            | 1.062.670        | 0,15                         |
| 5.180.000  | Energizer Holdings Inc**                       | 6,50 %  | 31.12.2027            | 4.986.543        | 0,69                         |
| 5.440.000  | EnerSys**                                      | 4,38 %  | 15.12.2027            | 5.015.151        | 0,70                         |
| 4.110.000  | Enviri Corp**                                  | 5,75 %  | 31.07.2027            | 3.582.317        | 0,50                         |
| 3.641.000  | EPR Properties*                                | 4,50 %  | 01.04.2025            | 3.451.053        | 0,48                         |
| 815.000  | EQM Midstream Partners LP*                     | 4,00 %  | 01.08.2024            | 798.020          | 0,11                         |
| 2.220.000  | EQM Midstream Partners LP**                    | 6,00 %  | 01.07.2025            | 2.197.486        | 0,31                         |
| 3.965.000  | EQM Midstream Partners LP**                    | 7,50 %  | 01.06.2027            | 4.006.791        | 0,56                         |
| 2.305.000  | EquipmentShare.com Inc**                       | 9,00 %  | 15.05.2028            | 2.240.397        | 0,31                         |
| 2.135.000  | Fair Isaac Corp**                              | 4,00 %  | 15.06.2028            | 1.960.584        | 0,27                         |
| 3.897.000  | First Quantum Minerals Ltd**                   | 7,50 %  | 01.04.2025            | 3.897.626        | 0,54                         |
| 660.000  | Ford Motor Credit Co LLC*                      | 2,70 %  | 10.08.2026            | 589.868          | 0,08                         |
| 1.115.000  | Ford Motor Credit Co LLC*                      | 2,90 %  | 16.02.2028            | 956.031          | 0,13                         |
| 790.000  | Ford Motor Credit Co LLC*                      | 3,37 %  | 17.11.2023            | 782.613          | 0,11                         |
| 2.440.000  | Ford Motor Credit Co LLC*                      | 3,38 %  | 13.11.2025            | 2.271.163        | 0,32                         |
| 970.000  | Ford Motor Credit Co LLC*                      | 3,66 %  | 08.09.2024            | 938.209          | 0,13                         |
| 770.000  | Ford Motor Credit Co LLC*                      | 4,39 %  | 08.01.2026            | 729.431          | 0,10                         |
| 995.000  | Ford Motor Credit Co LLC*                      | 4,95 %  | 28.05.2027            | 939.690          | 0,13                         |
| 3.830.000  | Ford Motor Credit Co LLC*                      | 5,13 %  | 16.06.2025            | 3.728.237        | 0,52                         |
| 1.955.000  | Ford Motor Credit Co LLC*                      | 5,58 %  | 18.03.2024            | 1.942.970        | 0,27                         |
| 800.000  | Ford Motor Credit Co LLC*                      | 6,80 %  | 12.05.2028            | 801.602          | 0,11                         |
| 2.305.000  | Ford Motor Credit Co LLC*                      | 6,95 %  | 06.03.2026            | 2.319.508        | 0,32                         |
| 2.075.000  | Ford Motor Credit Co LLC*                      | 6,95 %  | 10.06.2026            | 2.087.284        | 0,29                         |
| 2.740.000  | Ford Motor Credit Co LLC*                      | 7,35 %  | 04.11.2027            | 2.804.719        | 0,39                         |
| 3.925.000  | Frontier Communications Holdings LLC**         | 5,88 %  | 15.10.2027            | 3.606.078        | 0,50                         |
| 1.100.000  | Gates Global LLC/Gates Corp**                  | 6,25 %  | 15.01.2026            | 1.083.763        | 0,15                         |
| 375.000  | Gen Digital Inc**                              | 5,00 %  | 15.04.2025            | 367.596          | 0,05                         |
| 9.210.000  | Gen Digital Inc**                              | 6,75 %  | 30.09.2027            | 9.194.062        | 1,28                         |
| 8.155.000  | Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp* | 8,00 %  | 15.01.2027            | 7.960.189        | 1,11                         |
| 2.869.170  | Global Aircraft Leasing Co Ltd**               | 6,50 %  | 15.09.2024            | 2.629.709        | 0,37                         |
| 2.460.000  | Go Daddy Operating Co LLC/GD Finance Co Inc**  | 5,25 %  | 01.12.2027            | 2.339.312        | 0,33                         |
| 1.425.000  | Goodyear Tire & Rubber Co**                    | 4,88 %  | 15.03.2027            | 1.358.277        | 0,19                         |

## Short Duration High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung  | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 91,73 % (31. Dezember 2022: 85,85 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |        |                       |                  |                              |
| 730.000  | Goodyear Tire & Rubber Co**  | 5,00 % | 31.05.2026            | 714.171          | 0,10                         |
| 2.690.000  | Goodyear Tire & Rubber Co**  | 9,50 % | 31.05.2025            | 2.753.140        | 0,38                         |
| 2.730.000  | Graphic Packaging International LLC**                                  | 4,75 % | 15.07.2027            | 2.599.312        | 0,36                         |
| 3.635.000  | GTCR AP Finance Inc**  | 8,00 % | 15.05.2027            | 3.567.525        | 0,50                         |
| 1.740.000  | Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co**                               | 6,25 % | 01.11.2028            | 1.639.436        | 0,23                         |
| 1.880.000  | Hillenbrand Inc*   | 5,75 % | 15.06.2025            | 1.863.832        | 0,26                         |
| 3.105.000  | Howard Midstream Energy Partners LLC**                                 | 6,75 % | 15.01.2027            | 2.960.462        | 0,41                         |
| 540.000  | Howard Midstream Energy Partners LLC**                                 | 8,88 % | 15.07.2028            | 543.375          | 0,08                         |
| 10.175.000   | Hudbay Minerals Inc**  | 4,50 % | 01.04.2026            | 9.484.569        | 1,32                         |
| 650.000  | IHO Verwaltungs GmbH**   | 4,75 % | 15.09.2026            | 600.268          | 0,08                         |
| 1.035.000  | Iliad Holding SASU**   | 6,50 % | 15.10.2026            | 977.788          | 0,14                         |
| 740.000  | INEOS Finance Plc*   | 6,75 % | 15.05.2028            | 711.496          | 0,10                         |
| 2.105.000  | IQVIA Inc**  | 5,00 % | 15.10.2026            | 2.034.425        | 0,28                         |
| 2.990.000  | IQVIA Inc**  | 5,00 % | 15.05.2027            | 2.878.711        | 0,40                         |
| 6.155.000  | Iron Mountain Inc**  | 4,88 % | 15.09.2027            | 5.820.108        | 0,81                         |
| 1.785.000  | Iron Mountain Inc**  | 5,25 % | 15.03.2028            | 1.670.765        | 0,23                         |
| 4.745.000  | JELD-WEN Inc**   | 4,63 % | 15.12.2025            | 4.602.199        | 0,64                         |
| 2.250.000  | JELD-WEN Inc**   | 4,88 % | 15.12.2027            | 1.995.570        | 0,28                         |
| 615.000  | JELD-WEN Inc**   | 6,25 % | 15.05.2025            | 620.935          | 0,09                         |
| 1.780.000  | JPMorgan Chase & Co**  | 4,60 % | 29.12.2049            | 1.664.300        | 0,23                         |
| 3.995.000  | KB Home*   | 6,88 % | 15.06.2027            | 4.058.279        | 0,56                         |
| 4.455.000  | Legends Hospitality Holding Co LLC/Legends Hospitality Co-Issuer Inc** | 5,00 % | 01.02.2026            | 4.015.670        | 0,56                         |
| 2.280.000  | Level 3 Financing Inc**  | 3,40 % | 01.03.2027            | 1.937.042        | 0,27                         |
| 1.025.000  | Level 3 Financing Inc**  | 4,25 % | 01.07.2028            | 661.090          | 0,09                         |
| 1.490.000  | Level 3 Financing Inc**  | 4,63 % | 15.09.2027            | 1.038.511        | 0,14                         |
| 540.000  | Lindblad Expeditions Holdings Inc**                                    | 9,00 % | 15.05.2028            | 548.385          | 0,08                         |
| 2.805.000  | Lindblad Expeditions LLC**   | 6,75 % | 15.02.2027            | 2.674.399        | 0,37                         |
| 720.000  | Live Nation Entertainment Inc**  | 3,75 % | 15.01.2028            | 644.400          | 0,09                         |
| 3.200.000  | Live Nation Entertainment Inc**  | 4,75 % | 15.10.2027            | 2.988.912        | 0,42                         |
| 1.955.000  | Live Nation Entertainment Inc**  | 5,63 % | 15.03.2026            | 1.912.312        | 0,27                         |
| 2.110.000  | Live Nation Entertainment Inc**  | 6,50 % | 15.05.2027            | 2.123.131        | 0,30                         |
| 5.945.000  | LPL Holdings Inc**   | 4,63 % | 15.11.2027            | 5.580.080        | 0,78                         |
| 1.230.000  | Lumen Technologies Inc**   | 4,00 % | 15.02.2027            | 918.017          | 0,13                         |
| 3.275.000  | Manitowoc Co Inc**   | 9,00 % | 01.04.2026            | 3.261.998        | 0,45                         |
| 2.015.000  | Masonite International Corp**  | 5,38 % | 01.02.2028            | 1.922.834        | 0,27                         |
| 6.165.000  | Mattamy Group Corp**   | 5,25 % | 15.12.2027            | 5.752.049        | 0,80                         |
| 4.790.000  | Mauser Packaging Solutions Holding Co**                                | 7,88 % | 15.08.2026            | 4.764.079        | 0,66                         |
| 2.535.000  | Mauser Packaging Solutions Holding Co**                                | 9,25 % | 15.04.2027            | 2.342.788        | 0,33                         |

## Short Duration High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung  | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 91,73 % (31. Dezember 2022: 85,85 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |        |                       |                  |                              |
| 1.690.000  | McGraw-Hill Education Inc**  | 5,75 % | 01.08.2028            | 1.466.278        | 0,20                         |
| 1.430.000  | Meritage Homes Corp*   | 5,13 % | 06.06.2027            | 1.375.317        | 0,19                         |
| 1.310.000  | Meritage Homes Corp*   | 6,00 % | 01.06.2025            | 1.309.147        | 0,18                         |
| 1.015.000  | Midcontinent Communications/Midcontinent Finance Corp**                        | 5,38 % | 15.08.2027            | 952.207          | 0,13                         |
| 1.215.000  | Molina Healthcare Inc**  | 4,38 % | 15.06.2028            | 1.121.270        | 0,16                         |
| 920.000  | MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp*                                 | 5,00 % | 15.10.2027            | 774.906          | 0,11                         |
| 895.000  | MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp*                                 | 5,25 % | 01.08.2026            | 796.516          | 0,11                         |
| 928.000  | NCL Corp Ltd**   | 5,88 % | 15.02.2027            | 904.224          | 0,13                         |
| 4.625.000  | New Fortress Energy Inc**  | 6,50 % | 30.09.2026            | 4.142.919        | 0,58                         |
| 3.560.000  | New Fortress Energy Inc**  | 6,75 % | 15.09.2025            | 3.343.303        | 0,47                         |
| 5.325.000  | NextEra Energy Operating Partners LP**   | 3,88 % | 15.10.2026            | 4.953.453        | 0,69                         |
| 3.210.000  | NextEra Energy Operating Partners LP**   | 4,25 % | 15.07.2024            | 3.142.379        | 0,44                         |
| 2.115.000  | Northwest Fiber LLC/Northwest Fiber Finance Sub Inc**                          | 4,75 % | 30.04.2027            | 1.869.871        | 0,26                         |
| 650.000  | NuStar Logistics LP*   | 5,63 % | 28.04.2027            | 625.170          | 0,09                         |
| 1.300.000  | NuStar Logistics LP*   | 5,75 % | 01.10.2025            | 1.268.686        | 0,18                         |
| 915.000  | NuStar Logistics LP*   | 6,00 % | 01.06.2026            | 892.132          | 0,12                         |
| 2.080.000  | Olympus Water US Holding Corp**  | 7,13 % | 01.10.2027            | 1.877.196        | 0,26                         |
| 1.655.000  | OneMain Finance Corp*  | 3,50 % | 15.01.2027            | 1.421.595        | 0,20                         |
| 3.580.000  | OneMain Finance Corp**   | 6,13 % | 15.03.2024            | 3.571.009        | 0,50                         |
| 745.000  | OneMain Finance Corp**   | 6,88 % | 15.03.2025            | 738.330          | 0,10                         |
| 2.020.000  | OneMain Finance Corp**   | 7,13 % | 15.03.2026            | 1.986.462        | 0,28                         |
| 1.675.000  | OneMain Finance Corp*  | 9,00 % | 15.01.2029            | 1.690.661        | 0,24                         |
| 2.095.000  | Open Text Corp**   | 3,88 % | 15.02.2028            | 1.847.078        | 0,26                         |
| 1.295.000  | Organon & Co/Organon Foreign Debt Co-Issuer BV**                               | 4,13 % | 30.04.2028            | 1.150.745        | 0,16                         |
| 2.885.000  | Pactiv Evergreen Group Issuer Inc/Pactiv Evergreen Group Issuer LLC**          | 4,00 % | 15.10.2027            | 2.554.642        | 0,36                         |
| 6.390.000  | Park Intermediate Holdings LLC/PK Domestic Property LLC/PK Finance Co-Issuer** | 7,50 % | 01.06.2025            | 6.397.029        | 0,89                         |
| 1.140.000  | Performance Food Group Inc**   | 5,50 % | 15.10.2027            | 1.100.075        | 0,15                         |
| 5.930.000  | Performance Food Group Inc**   | 6,88 % | 01.05.2025            | 5.940.793        | 0,83                         |
| 865.000  | Permian Resources Operating LLC**  | 5,38 % | 15.01.2026            | 824.939          | 0,11                         |
| 2.370.000  | Permian Resources Operating LLC**  | 7,75 % | 15.02.2026            | 2.387.654        | 0,33                         |
| 2.225.000  | PetSmart Inc/PetSmart Finance Corp**   | 4,75 % | 15.02.2028            | 2.058.736        | 0,29                         |
| 995.000  | Pilgrim's Pride Corp**   | 5,88 % | 30.09.2027            | 984.177          | 0,14                         |
| 1.670.000  | Post Holdings Inc**  | 5,63 % | 15.01.2028            | 1.607.158        | 0,22                         |
| 590.000  | Presidio Holdings Inc**  | 4,88 % | 01.02.2027            | 554.308          | 0,08                         |
| 3.655.000  | Presidio Holdings Inc**  | 8,25 % | 01.02.2028            | 3.484.882        | 0,49                         |
| 1.435.000  | Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc**                       | 3,38 % | 31.08.2027            | 1.267.042        | 0,18                         |
| 5.440.000  | Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc**                       | 5,75 % | 15.04.2026            | 5.344.950        | 0,74                         |
| 4.510.000  | Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc**                       | 6,25 % | 15.01.2028            | 4.231.492        | 0,59                         |



## Short Duration High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 91,73 % (31. Dezember 2022: 85,85 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 1.395.000  | PTC Inc**   | 3,63 %  | 15.02.2025            | 1.348.323        | 0,19                         |
| 885.000  | Range Resources Corp*   | 4,88 %  | 15.05.2025            | 868.147          | 0,12                         |
| 2.710.000  | Regal Rexnord Corp**  | 6,05 %  | 15.02.2026            | 2.714.997        | 0,38                         |
| 1.020.000  | RHP Hotel Properties LP/RHP Finance Corp**                        | 4,75 %  | 15.10.2027            | 950.783          | 0,13                         |
| 1.190.000  | RHP Hotel Properties LP/RHP Finance Corp**                        | 7,25 %  | 15.07.2028            | 1.203.245        | 0,17                         |
| 2.045.000  | Ritchie Bros Holdings Inc**                                       | 6,75 %  | 15.03.2028            | 2.063.751        | 0,29                         |
| 6.660.000  | RLJ Lodging Trust LP**  | 3,75 %  | 01.07.2026            | 6.116.544        | 0,85                         |
| 1.330.000  | Royal Caribbean Cruises Ltd**                                     | 4,25 %  | 01.07.2026            | 1.222.071        | 0,17                         |
| 685.000  | Royal Caribbean Cruises Ltd**                                     | 5,50 %  | 31.08.2026            | 650.097          | 0,09                         |
| 2.805.000  | Royal Caribbean Cruises Ltd**                                     | 11,63 % | 15.08.2027            | 3.052.903        | 0,43                         |
| 2.075.000  | SCIH Salt Holdings Inc**  | 4,88 %  | 01.05.2028            | 1.855.705        | 0,26                         |
| 665.000  | SCIL IV LLC/SCIL USA Holdings LLC**                               | 5,38 %  | 01.11.2026            | 606.893          | 0,08                         |
| 2.625.000  | Sealed Air Corp**   | 5,50 %  | 15.09.2025            | 2.586.251        | 0,36                         |
| 1.000.000  | Select Medical Corp**   | 6,25 %  | 15.08.2026            | 984.009          | 0,14                         |
| 2.845.000  | Sensata Technologies BV**   | 5,63 %  | 01.11.2024            | 2.826.092        | 0,39                         |
| 1.870.000  | Sirius XM Radio Inc**   | 4,00 %  | 15.07.2028            | 1.626.792        | 0,23                         |
| 2.080.000  | Sirius XM Radio Inc**   | 5,00 %  | 01.08.2027            | 1.931.904        | 0,27                         |
| 6.385.000  | Solaris Midstream Holdings LLC**                                  | 7,63 %  | 01.04.2026            | 6.185.432        | 0,86                         |
| 4.740.000  | SPCM SA**   | 3,13 %  | 15.03.2027            | 4.255.113        | 0,59                         |
| 3.070.000  | Sprint LLC**  | 7,13 %  | 15.06.2024            | 3.100.218        | 0,43                         |
| 2.860.000  | Sprint LLC**  | 7,63 %  | 15.02.2025            | 2.923.967        | 0,41                         |
| 1.910.000  | Sprint LLC**  | 7,63 %  | 01.03.2026            | 1.985.777        | 0,28                         |
| 8.620.000  | Standard Industries Inc**   | 5,00 %  | 15.02.2027            | 8.223.564        | 1,14                         |
| 2.605.000  | Starwood Property Trust Inc**                                     | 4,38 %  | 15.01.2027            | 2.245.992        | 0,31                         |
| 1.405.000  | Summer BC Bidco B LLC**   | 5,50 %  | 31.10.2026            | 1.183.916        | 0,16                         |
| 4.255.000  | Sunnova Energy Corp**   | 5,88 %  | 01.09.2026            | 3.892.891        | 0,54                         |
| 1.430.000  | Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**      | 5,50 %  | 15.01.2028            | 1.309.069        | 0,18                         |
| 3.165.000  | Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**      | 6,00 %  | 01.03.2027            | 2.979.385        | 0,41                         |
| 4.220.000  | Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**      | 7,50 %  | 01.10.2025            | 4.216.012        | 0,59                         |
| 1.145.000  | Taylor Morrison Communities Inc**                                 | 5,88 %  | 15.06.2027            | 1.125.644        | 0,16                         |
| 2.755.000  | Taylor Morrison Communities Inc/Taylor Morrison Holdings II Inc** | 5,63 %  | 01.03.2024            | 2.736.817        | 0,38                         |
| 1.555.000  | Tempo Acquisition LLC/Tempo Acquisition Finance Corp**            | 5,75 %  | 01.06.2025            | 1.554.720        | 0,22                         |
| 900.000  | Tenet Healthcare Corp**   | 5,13 %  | 01.11.2027            | 860.208          | 0,12                         |
| 1.535.000  | Tenet Healthcare Corp**   | 6,13 %  | 01.10.2028            | 1.479.218        | 0,21                         |
| 2.580.000  | TK Elevator US Newco Inc**  | 5,25 %  | 15.07.2027            | 2.386.662        | 0,33                         |
| 3.710.000  | TMS International Corp**  | 6,25 %  | 15.04.2029            | 3.120.221        | 0,43                         |
| 3.835.000  | TransDigm Inc*  | 5,50 %  | 15.11.2027            | 3.621.620        | 0,50                         |
| 3.435.000  | TransDigm Inc**   | 6,25 %  | 15.03.2026            | 3.421.304        | 0,48                         |

## Short Duration High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|---------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 91,73 % (31. Dezember 2022: 85,85 %) (Fortsetzung)</b>             |   |         |                       |                    |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                    |                              |
| 2.235.000  | TransDigm Inc <sup>*</sup>  | 6,38 %  | 15.06.2026            | 2.208.709          | 0,31                         |
| 1.160.000  | TransDigm Inc <sup>**</sup>   | 6,75 %  | 15.08.2028            | 1.165.846          | 0,16                         |
| 1.255.000  | TransDigm Inc <sup>*</sup>  | 7,50 %  | 15.03.2027            | 1.258.319          | 0,18                         |
| 3.840.000  | TransDigm UK Holdings Plc <sup>**</sup>                               | 6,88 %  | 15.05.2026            | 3.808.987          | 0,53                         |
| 1.725.000  | TRI Pointe Group Inc/TRI Pointe Homes Inc <sup>*</sup>                | 5,88 %  | 15.06.2024            | 1.713.615          | 0,24                         |
| 4.070.000  | Tri Pointe Homes Inc <sup>*</sup>                                     | 5,25 %  | 01.06.2027            | 3.853.881          | 0,54                         |
| 4.775.000  | Trivium Packaging Finance BV <sup>*</sup>                             | 5,50 %  | 15.08.2026            | 4.590.944          | 0,64                         |
| 4.165.000  | United Airlines Inc <sup>**</sup>                                     | 4,38 %  | 15.04.2026            | 3.960.939          | 0,55                         |
| 1.010.000  | United Rentals North America Inc <sup>*</sup>                         | 3,88 %  | 15.11.2027            | 944.104            | 0,13                         |
| 2.035.000  | United Rentals North America Inc <sup>*</sup>                         | 4,88 %  | 15.01.2028            | 1.938.399          | 0,27                         |
| 3.210.000  | United Rentals North America Inc <sup>*</sup>                         | 5,50 %  | 15.05.2027            | 3.162.123          | 0,44                         |
| 1.765.000  | Uniti Group LP/Uniti Group Finance Inc/CSL Capital LLC <sup>**</sup>  | 10,50 % | 15.02.2028            | 1.752.581          | 0,24                         |
| 910.000  | US Acute Care Solutions LLC <sup>**</sup>                             | 6,38 %  | 01.03.2026            | 780.125            | 0,11                         |
| 4.205.000  | US Foods Inc <sup>**</sup>  | 6,25 %  | 15.04.2025            | 4.207.059          | 0,59                         |
| 715.000  | Viasat Inc <sup>**</sup>  | 5,63 %  | 15.09.2025            | 693.550            | 0,10                         |
| 1.925.000  | VICI Properties LP/VICI Note Co Inc <sup>**</sup>                     | 4,63 %  | 15.06.2025            | 1.861.755          | 0,26                         |
| 4.320.000  | VistaJet Malta Finance Plc/Vista Management Holding Inc <sup>**</sup> | 7,88 %  | 01.05.2027            | 3.885.300          | 0,54                         |
| 2.115.000  | VistaJet Malta Finance Plc/Vista Management Holding Inc <sup>**</sup> | 9,50 %  | 01.06.2028            | 1.943.844          | 0,27                         |
| 2.545.000  | White Cap Parent LLC <sup>**</sup>                                    | 8,25 %  | 15.03.2026            | 2.440.566          | 0,34                         |
| 720.000  | William Carter Co <sup>**</sup>                                       | 5,63 %  | 15.03.2027            | 699.292            | 0,10                         |
| 7.455.000  | WR Grace Holdings LLC <sup>**</sup>                                   | 4,88 %  | 15.06.2027            | 6.923.323          | 0,96                         |
| 1.880.000  | Wyndham Hotels & Resorts Inc <sup>**</sup>                            | 4,38 %  | 15.08.2028            | 1.718.508          | 0,24                         |
| 9.700.000  | XHR LP <sup>**</sup>  | 6,38 %  | 15.08.2025            | 9.531.850          | 1,33                         |
| 2.680.000  | ZF North America Capital Inc <sup>**</sup>                            | 4,75 %  | 29.04.2025            | 2.615.147          | 0,36                         |
| 890.000  | ZF North America Capital Inc <sup>**</sup>                            | 6,88 %  | 14.04.2028            | 902.179            | 0,13                         |
| <b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>  |   |         |                       | <b>658.803.630</b> | <b>91,73</b>                 |
| <b>Mittelfristige Schuldverschreibungen<sup>^</sup> 5,73 % (31. Dezember 2022: 4,24 %)</b> |   |         |                       |                    |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |   |         |                       |                    |                              |
| 1.630.000  | AAdvantage Loyalty IP Ltd   | 10,00 % | 20.04.2028            | 1.666.968          | 0,23                         |
| 2.571.977  | AppLovin Corp   | 8,20 %  | 25.10.2028            | 2.568.531          | 0,36                         |
| 3.646.697  | CQP Holdco LP   | 8,69 %  | 05.06.2028            | 3.644.619          | 0,51                         |
| 1.156.532  | Engineered Machinery Holdings Inc                                     | 0,00 %  | 21.05.2029            | 1.084.249          | 0,15                         |
| 910.107  | First Brands Group LLC  | 10,25 % | 30.03.2027            | 893.329            | 0,12                         |
| 1.935.077  | Gates Global LLC  | 7,70 %  | 31.03.2027            | 1.927.820          | 0,27                         |
| 3.480.777  | Gen Digital Inc   | 7,20 %  | 12.09.2029            | 3.467.741          | 0,48                         |
| 2.424.856  | GIP III Stetson I LP  | 9,45 %  | 18.07.2025            | 2.423.850          | 0,34                         |
| 767.331  | GYP Holdings III Corp   | 8,10 %  | 12.05.2030            | 768.651            | 0,11                         |

## Short Duration High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag  | Wertpapierbezeichnung            | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|----------------------------------|---------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Mittelfristige Schuldverschreibungen^ 5,73 % (31. Dezember 2022: 4,24 %) (Fortsetzung)</b> |                                  |         |                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>  |                                  |         |                       |                   |                              |
| 2.318.762   | Ingram Micro Inc                 | 9,04 %  | 30.06.2028            | 2.314.426         | 0,32                         |
| 5.640.549   | Medline Borrower LP              | 8,35 %  | 23.10.2028            | 5.582.367         | 0,78                         |
| 3.417.232   | MKS Instruments Inc              | 7,94 %  | 17.08.2029            | 3.425.775         | 0,48                         |
| 1.532.700   | MPH Acquisition Holdings LLC     | 9,73 %  | 01.09.2028            | 1.373.958         | 0,19                         |
| 1.574.416   | Nautilus Power LLC               | 10,24 % | 16.11.2026            | 1.184.748         | 0,16                         |
| 697.386   | Nouryon Finance BV               | 8,07 %  | 01.10.2025            | 698.171           | 0,10                         |
| 2.576.575   | Peraton Corp                     | 8,95 %  | 01.02.2028            | 2.536.548         | 0,35                         |
| 4.024.771   | Petco Health and Wellness Co Inc | 8,75 %  | 03.03.2028            | 4.001.890         | 0,56                         |
| 1.018.297   | Team Health Holdings Inc         | 10,35 % | 02.03.2027            | 704.153           | 0,10                         |
| 203.965   | Tempo Acquisition LLC            | 8,10 %  | 31.08.2028            | 204.275           | 0,03                         |
| 678.164   | TransDigm Inc                    | 8,49 %  | 24.08.2028            | 678.557           | 0,09                         |
| <b>Mittelfristige Schuldverschreibungen insgesamt †</b>                                       |                                  |         |                       | <b>41.150.626</b> | <b>5,73</b>                  |

| Anzahl der<br>Anteile                                     | Wertpapierbezeichnung             | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-----------------------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Investmentfonds 0,08 % (31. Dezember 2022: 0,22 %)</b> |                                   |                    |                              |
| <b>Britisches Pfund</b>                                   |                                   |                    |                              |
| 619.956   | NB Global Monthly Income Fund Ltd | 591.136            | 0,08                         |
| <b>Investmentfonds insgesamt †</b>                        |                                   | <b>591.136</b>     | <b>0,08</b>                  |
| <b>Anlagen insgesamt</b>                                  |                                   | <b>700.545.392</b> | <b>97,54</b>                 |

Devisenterminkontrakte 0,20 % (31. Dezember 2022: 4,13 %)

| Geforderter<br>Betrag           | Zu zahlender<br>Betrag | Fälligkeits-<br>datum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---------------------------------|------------------------|-----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------------|------------------------------|
| 264.981 €                       | 328.956 US\$           | 20.07.2023            | Westpac Banking Corp        | 1         | 7.965                                | 0,00                         |
| 346.142 US\$                    | 269.691 €              | 20.07.2023            | Goldman Sachs International | 1         | 3.233                                | 0,00                         |
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> |                        |                       |                             |           |                                      |                              |
| 188 AUD                         | 125 US\$               | 20.07.2023            | Westpac Banking Corp        | 1         | 0                                    | 0,00                         |
| 5.779 US\$                      | 8.626 AUD              | 20.07.2023            | Goldman Sachs International | 1         | 35                                   | 0,00                         |
| 40.335 US\$                     | 59.836 AUD             | 20.07.2023            | UBS AG                      | 3         | 487                                  | 0,00                         |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i> |                        |                       |                             |           |                                      |                              |
| 1.851.107 CHF                   | 2.068.955 US\$         | 20.07.2023            | Westpac Banking Corp        | 4         | 3.477                                | 0,00                         |
| 104.439 US\$                    | 92.214 CHF             | 20.07.2023            | Westpac Banking Corp        | 3         | 1.200                                | 0,00                         |
| <i>Abgesicherte Klassen CNY</i> |                        |                       |                             |           |                                      |                              |
| 40.566 US\$                     | 277.316 CNY            | 20.07.2023            | UBS AG                      | 2         | 2.399                                | 0,00                         |
| 41.109 US\$                     | 280.503 CNY            | 20.07.2023            | Westpac Banking Corp        | 2         | 2.503                                | 0,00                         |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> |                        |                       |                             |           |                                      |                              |
| 670.242 €                       | 719.851 US\$           | 20.07.2023            | Goldman Sachs International | 1         | 11.951                               | 0,00                         |
| 2.880.980 €                     | 3.128.024 US\$         | 20.07.2023            | Westpac Banking Corp        | 20        | 17.571                               | 0,01                         |

## Short Duration High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 0,20 % (31. Dezember 2022: 4,13 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens        |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|-----------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR (Fortsetzung)</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 58.120.270 US\$  | 52.907.252 €        | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 34        | 353.566                        | 0,05                        |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 458.242 £  | 571.968 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 2         | 10.681                         | 0,00                        |
| 242.552 £  | 301.754 US\$        | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | 6.648                          | 0,00                        |
| 37.100.003 £   | 46.302.435 US\$     | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 28        | 869.778                        | 0,12                        |
| 14.112.752 US\$  | 11.072.047 £        | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 1         | 34.776                         | 0,01                        |
| <i>Abgesicherte Klassen HKD</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 2.566 US\$   | 20.080 HKD          | 20.07.2023       | UBS AG                      | 2         | 2                              | 0,00                        |
| 110.213 US\$   | 861.282 HKD         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 3         | 278                            | 0,00                        |
| <i>Abgesicherte Klassen JPY</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 42.246 US\$  | 5.448.001 ¥         | 20.07.2023       | UBS AG                      | 2         | 4.461                          | 0,00                        |
| 2.600.106 US\$   | 363.987.242 ¥       | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 2         | 75.711                         | 0,01                        |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 5.000 SGD  | 3.696 US\$          | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 2         | 1                              | 0,00                        |
| 184.771 US\$   | 244.203 SGD         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | 4.223                          | 0,00                        |
| 184.515 US\$   | 244.203 SGD         | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | 3.967                          | 0,00                        |
| 37.382 US\$  | 50.044 SGD          | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 10        | 383                            | 0,00                        |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>                        |                     |                  |                             |           | <b>1.415.296</b>               | <b>0,20</b>                 |
|  |                     |                  |                             |           | <b>Zeitwert US\$</b>           | <b>% des Nettovermögens</b> |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> |                     |                  |                             |           | <b>701.960.688</b>             | <b>97,74</b>                |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (2,36 %) (31. Dezember 2022: (0,95 %))

| Geforderter Betrag              | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 2.763.554 US\$                  | 2.211.622 £         | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | (48.497)                        | (0,01)               |
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 1.253.683 AUD                   | 844.399 US\$        | 20.07.2023       | UBS AG                      | 2         | (9.497)                         | (0,00)               |
| 14.404 AUD                      | 9.755 US\$          | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 4         | (163)                           | (0,00)               |
| 5.043 US\$                      | 7.732 AUD           | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (106)                           | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i> |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 4.809 CHF                       | 5.393 US\$          | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | (9)                             | (0,00)               |
| 1.060.168 US\$                  | 949.462 CHF         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 5         | (2.815)                         | (0,00)               |

## Short Duration High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (2,36 %) (31. Dezember 2022: (0,95 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens        |
|---|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|-----------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen CNY</i>   |                     |                  |                             |           |                                 |                             |
| 1.340.074 CNY   | 196.309 US\$        | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | (11.874)                        | (0,00)                      |
| 1.340.074 CNY   | 196.482 US\$        | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 1         | (12.047)                        | (0,00)                      |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>   |                     |                  |                             |           |                                 |                             |
| 845.983 €   | 931.619 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (7.934)                         | (0,00)                      |
| 150.588.414 €   | 165.475.801 US\$    | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 25        | (1.056.069)                     | (0,15)                      |
| 2.239.613 US\$  | 2.074.116 €         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 28        | (25.007)                        | (0,00)                      |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>   |                     |                  |                             |           |                                 |                             |
| 11.312.883 £  | 14.410.783 US\$     | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 4         | (26.587)                        | (0,01)                      |
| 228.574 US\$  | 184.177 £           | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (5.605)                         | (0,00)                      |
| 7.681.457 US\$  | 6.161.207 £         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 19        | (152.444)                       | (0,02)                      |
| <i>Abgesicherte Klassen HKD</i>   |                     |                  |                             |           |                                 |                             |
| 992.528 HKD   | 127.049 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (362)                           | (0,00)                      |
| 1.002.766 HKD   | 128.368 US\$        | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 2         | (374)                           | (0,00)                      |
| <i>Abgesicherte Klassen JPY</i>   |                     |                  |                             |           |                                 |                             |
| 131.089.413 ¥   | 944.749 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (35.592)                        | (0,01)                      |
| 18.735.662.232 ¥  | 145.281.670 US\$    | 20.07.2023       | UBS AG                      | 2         | (15.342.471)                    | (2,14)                      |
| 339.054.999 ¥   | 2.505.552 US\$      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 6         | (154.072)                       | (0,02)                      |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>   |                     |                  |                             |           |                                 |                             |
| 1.513.317 SGD   | 1.145.014 US\$      | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (26.168)                        | (0,00)                      |
| 1.513.317 SGD   | 1.143.478 US\$      | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | (24.632)                        | (0,00)                      |
| 183.348 SGD   | 137.581 US\$        | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 30        | (2.025)                         | (0,00)                      |
| 26 US\$   | 35 SGD              | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 1         | (0)                             | (0,00)                      |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>                          |                     |                  |                             |           | <b>(16.944.350)</b>             | <b>(2,36)</b>               |
|   |                     |                  |                             |           | <b>Zeitwert</b>                 | <b>% des Nettovermögens</b> |
|   |                     |                  |                             |           | <b>US\$</b>                     |                             |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> |                     |                  |                             |           | <b>(16.944.350)</b>             | <b>(2,36)</b>               |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              |                     |                  |                             |           | <b>685.016.338</b>              | <b>95,38</b>                |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  |                     |                  |                             |           | <b>33.168.582</b>               | <b>4,62</b>                 |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   |                     |                  |                             |           | <b>718.184.920</b>              | <b>100,00</b>               |

<sup>∞</sup> Schuldverschreibungen mit einem Zinssatz von 0,00 %, wurden zum 30. Juni 2023 eventuell noch nicht abgerechnet und haben somit keinen gültigen Zinssatz. Die Zinssätze werden erst bei Abrechnung gültig.

## Short Duration High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

| Portfolioanalyse  | US\$               | % des Gesamtvermögens |
|---|--------------------|-----------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 84.446.224         | 11,30                 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden            | 574.357.406        | 76,88                 |
| † Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente  | 41.150.626         | 5,51                  |
| μ Investmentfonds   | 591.136            | 0,08                  |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente   | (15.529.054)       | (2,08)                |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>685.016.338</b> | <b>91,69</b>          |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der Anteile  | Wertpapierbezeichnung                                  |         |            | Zeitwert US\$     | % des Nettovermögens |
|---|--|---------|------------|-------------------|----------------------|
| <b>Aktien 0,00 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)</b>  |  |         |            |                   |                      |
| <b>US-Dollar</b>  |  |         |            |                   |                      |
| 1.792   | GTT Communications Inc                                 |         |            | 27.776            | 0,00                 |
| <b>Aktien insgesamt †</b>   |  |         |            | <b>27.776</b>     | <b>0,00</b>          |
| <b>Schatzwechsel 3,54 % (31. Dezember 2022: 0,61 %)</b>                                   |  |         |            |                   |                      |
| <b>US-Dollar</b>  |  |         |            |                   |                      |
| 52.900.000  | United States Treasury Bill                            | 0,00 %  | 28.09.2023 | 52.240.976        | 3,54                 |
| <b>Schatzwechsel insgesamt **</b>   |  |         |            | <b>52.240.976</b> | <b>3,54</b>          |
| <b>Agency Bonds 0,05 % (31. Dezember 2022: 0,06 %)</b>                                    |  |         |            |                   |                      |
| <b>US-Dollar</b>  |  |         |            |                   |                      |
| 690.000   | Federal National Mortgage Association                  | 5,63 %  | 15.07.2037 | 791.771           | 0,05                 |
| <b>Agency Bonds insgesamt **</b>  |  |         |            | <b>791.771</b>    | <b>0,05</b>          |
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 9,10 % (31. Dezember 2022: 7,97 %)</b> |  |         |            |                   |                      |
| <b>US-Dollar</b>  |  |         |            |                   |                      |
| 3.599.000   | Avis Budget Rental Car Funding AESOP LLC Class B       | 3,55 %  | 22.09.2025 | 3.483.526         | 0,24                 |
| 3.110.000   | BXP Trust 2017-GM Class A                              | 3,38 %  | 13.06.2039 | 2.791.296         | 0,19                 |
| 1.465.000   | Citigroup Commercial Mortgage Trust 2013-GC17 Class B  | 5,10 %  | 10.11.2046 | 1.432.310         | 0,10                 |
| 19.782.968  | Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC25 Class XA | 1,09 %  | 10.10.2047 | 157.704           | 0,01                 |
| 14.474.143  | Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC27 Class XA | 1,45 %  | 10.02.2048 | 208.792           | 0,01                 |
| 970.000   | Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P8 Class C    | 4,40 %  | 15.09.2050 | 807.733           | 0,06                 |
| 5.755.274   | COMM 2014-CCRE16 Mortgage Trust Class XA               | 1,10 %  | 10.04.2047 | 26.196            | 0,00                 |
| 8.387.565   | COMM 2014-CCRE17 Mortgage Trust Class XA               | 1,11 %  | 10.05.2047 | 36.376            | 0,00                 |
| 2.300.000   | COMM 2014-CCRE21 Mortgage Trust Class AM               | 3,99 %  | 10.12.2047 | 2.188.357         | 0,15                 |
| 22.791.698  | COMM 2014-LC15 Mortgage Trust Class XA                 | 1,21 %  | 10.04.2047 | 77.136            | 0,01                 |
| 1.751.196   | COMM 2014-UBS3 Mortgage Trust Class XA                 | 1,21 %  | 10.06.2047 | 8.458             | 0,00                 |
| 13.204.716  | COMM 2014-UBS6 Mortgage Trust Class XA                 | 0,98 %  | 10.12.2047 | 108.044           | 0,01                 |
| 2.270.000   | Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R01 Class 1B1 | 8,22 %  | 25.12.2041 | 2.233.938         | 0,15                 |
| 3.725.000   | Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R01 Class 1M2 | 6,97 %  | 25.12.2041 | 3.633.260         | 0,25                 |
| 5.195.000   | Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R03 Class 1M2 | 8,57 %  | 25.03.2042 | 5.308.012         | 0,36                 |
| 2.119.000   | Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R04 Class 1M2 | 8,17 %  | 25.03.2042 | 2.142.362         | 0,15                 |
| 1.860.186   | Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R07 Class 1M1 | 8,02 %  | 25.06.2042 | 1.905.127         | 0,13                 |
| 609.000   | Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R08 Class 1M2 | 8,67 %  | 25.07.2042 | 622.724           | 0,04                 |
| 972.000   | CSAIL 2018-C14 Commercial Mortgage Trust Class C       | 5,06 %  | 15.11.2051 | 757.124           | 0,05                 |
| 4.098.068   | Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 1M2     | 7,40 %  | 25.07.2030 | 4.141.977         | 0,28                 |
| 5.192.410   | Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 1M2     | 7,50 %  | 25.01.2031 | 5.284.157         | 0,36                 |
| 2.918.000   | Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 2B1     | 9,65 %  | 25.12.2030 | 3.171.197         | 0,22                 |
| 4.031.000   | Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 2B1     | 10,65 % | 25.09.2029 | 4.464.030         | 0,30                 |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag  | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 9,10 % (31. Dezember 2022: 7,97 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>  |   |         |                       |                  |                              |
| 1.151.988   | Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 2M2            | 7,35 %  | 25.08.2030            | 1.165.898        | 0,08                         |
| 3.852.134   | Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 2M2            | 7,70 %  | 25.12.2030            | 3.935.429        | 0,27                         |
| 4.259.047   | Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 2M2            | 7,95 %  | 25.02.2030            | 4.337.019        | 0,29                         |
| 3.597.432   | Fannie Mae Interest Strip Class C24                           | 4,00 %  | 25.08.2043            | 661.712          | 0,05                         |
| 2.779.808   | Fannie Mae Interest Strip Class C26                           | 4,00 %  | 25.10.2041            | 489.693          | 0,03                         |
| 6.314.651   | Fannie Mae REMICS Class AI                                    | 3,50 %  | 25.11.2051            | 1.058.450        | 0,07                         |
| 3.045.820   | Fannie Mae REMICS Class DS                                    | 1,00 %  | 25.06.2043            | 331.859          | 0,02                         |
| 1.891.268   | Fannie Mae REMICS Class HS                                    | 0,85 %  | 25.06.2046            | 202.107          | 0,01                         |
| 3.270.757   | Fannie Mae REMICS Class SA                                    | 0,85 %  | 25.09.2046            | 312.276          | 0,02                         |
| 1.862.541   | Fannie Mae REMICS Class SB                                    | 0,95 %  | 25.03.2046            | 165.269          | 0,01                         |
| 2.956.572   | Fannie Mae REMICS Class SN                                    | 0,95 %  | 25.07.2049            | 278.757          | 0,02                         |
| 3.184.654   | Fannie Mae REMICS Class ST                                    | 0,95 %  | 25.12.2044            | 316.194          | 0,02                         |
| 3.137.938   | Fannie Mae REMICS Class SY                                    | 1,00 %  | 25.07.2043            | 335.068          | 0,02                         |
| 1.963.125   | Freddie Mac REMICS Class BI                                   | 4,50 %  | 25.02.2050            | 392.873          | 0,03                         |
| 1.799.199   | Freddie Mac REMICS Class EC                                   | 1,50 %  | 25.02.2049            | 1.438.119        | 0,10                         |
| 1.778.899   | Freddie Mac REMICS Class LI                                   | 4,00 %  | 25.12.2048            | 328.163          | 0,02                         |
| 1.058.218   | Freddie Mac REMICS Class SA                                   | 0,81 %  | 15.10.2046            | 123.460          | 0,01                         |
| 1.612.789   | Freddie Mac REMICS Class SA                                   | 0,96 %  | 15.03.2045            | 168.458          | 0,01                         |
| 2.630.382   | Freddie Mac REMICS Class SP                                   | 0,96 %  | 15.01.2043            | 285.520          | 0,02                         |
| 3.691.000   | Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA2 Class M2              | 8,82 %  | 25.02.2042            | 3.719.857        | 0,25                         |
| 3.749.162   | Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA3 Class M1B             | 7,97 %  | 25.04.2042            | 3.747.660        | 0,25                         |
| 4.211.000   | Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-HQA1 Class M2              | 10,32 % | 25.03.2042            | 4.367.127        | 0,30                         |
| 2.635.000   | Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-HQA3 Class M1B             | 8,62 %  | 25.08.2042            | 2.674.944        | 0,18                         |
| 1.141.308   | Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes Class M2 | 6,95 %  | 25.07.2030            | 1.142.220        | 0,08                         |
| 3.268.739   | Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes Class M2 | 7,45 %  | 25.09.2030            | 3.300.195        | 0,22                         |
| 4.759.056   | Government National Mortgage Association Class AB             | 1,00 %  | 20.07.2050            | 3.747.301        | 0,25                         |
| 9.712.523   | Government National Mortgage Association Class CI             | 2,00 %  | 20.10.2050            | 1.096.310        | 0,07                         |
| 7.728.591   | Government National Mortgage Association Class DI             | 2,50 %  | 20.02.2051            | 1.053.584        | 0,07                         |
| 3.492.302   | Government National Mortgage Association Class HE             | 2,00 %  | 20.06.2051            | 2.942.068        | 0,20                         |
| 7.736.903   | Government National Mortgage Association Class HS             | 1,04 %  | 20.10.2045            | 804.628          | 0,05                         |
| 6.959.387   | Government National Mortgage Association Class IO             | 2,50 %  | 20.11.2051            | 953.934          | 0,06                         |
| 3.970.897   | Government National Mortgage Association Class KA             | 1,00 %  | 20.08.2050            | 3.114.547        | 0,21                         |
| 2.597.517   | Government National Mortgage Association Class KS             | 1,04 %  | 20.07.2047            | 276.275          | 0,02                         |
| 3.525.062   | Government National Mortgage Association Class NC             | 1,50 %  | 20.07.2051            | 2.888.744        | 0,20                         |
| 1.619.388   | Government National Mortgage Association Class SA             | 0,94 %  | 16.12.2043            | 155.453          | 0,01                         |
| 3.667.156   | Government National Mortgage Association Class WK             | 1,00 %  | 20.06.2050            | 2.873.038        | 0,19                         |
| 18.871.042  | GS Mortgage Securities Trust 2014-GC18 Class XA               | 1,18 %  | 10.01.2047            | 35.194           | 0,00                         |
| 10.346.939  | GS Mortgage Securities Trust 2014-GC26 Class XA               | 1,06 %  | 10.11.2047            | 95.266           | 0,01                         |
| 9.855.762   | GS Mortgage Securities Trust 2015-GC30 Class XA               | 0,86 %  | 10.05.2050            | 103.588          | 0,01                         |
| 2.110.000   | GS Mortgage Securities Trust 2015-GS1 Class AS                | 4,04 %  | 10.11.2048            | 1.875.094        | 0,13                         |



## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag  | Wertpapierbezeichnung  | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--|--------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 9,10 % (31. Dezember 2022: 7,97 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                    |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>  |  |        |                       |                    |                              |
| 2.514.000   | GS Mortgage Securities Trust 2016-GS4 Class B                                  | 3,85 % | 10.11.2049            | 2.183.412          | 0,15                         |
| 3.675.897   | Hilton Grand Vacations Trust 2018-A Class A                                    | 3,54 % | 25.02.2032            | 3.540.214          | 0,24                         |
| 1.748.000   | Hilton USA Trust 2016-HHV Class C  | 4,33 % | 05.11.2038            | 1.619.878          | 0,11                         |
| 1.244.000   | Hilton USA Trust 2016-HHV Class D  | 4,33 % | 05.11.2038            | 1.141.688          | 0,08                         |
| 1.800.000   | Hudson Yards 2016-10HY Mortgage Trust Class C                                  | 3,08 % | 10.08.2038            | 1.567.941          | 0,11                         |
| 452.715   | Laurel Road Prime Student Loan Trust 2017-B Class BFX                          | 3,02 % | 25.08.2042            | 417.836            | 0,03                         |
| 2.433.000   | MetroNet Infrastructure Issuer LLC Class A2                                    | 6,35 % | 20.10.2052            | 2.351.514          | 0,16                         |
| 1.200.000   | Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Securities Trust 2017-C33 Class C | 4,56 % | 15.05.2050            | 1.019.294          | 0,07                         |
| 2.726.000   | Morgan Stanley Capital I Trust 2017-H1 Class C                                 | 4,28 % | 15.06.2050            | 2.159.115          | 0,15                         |
| 2.340.000   | Morgan Stanley Capital I Trust 2018-H4 Class C                                 | 5,24 % | 15.12.2051            | 1.968.490          | 0,13                         |
| 3.337.000   | OneMain Financial Issuance Trust 2022-2 Class A                                | 4,89 % | 14.10.2034            | 3.265.585          | 0,22                         |
| 125.386   | Securitized Asset Backed Receivables LLC Trust 2004-DO1 Class M1               | 6,13 % | 25.07.2034            | 129.737            | 0,01                         |
| 900.000   | Sofi Professional Loan Program 2017-F LLC Class BFX                            | 3,62 % | 25.01.2041            | 800.511            | 0,05                         |
| 3.000.000   | Sofi Professional Loan Program 2018-A LLC Class B                              | 3,61 % | 25.02.2042            | 2.689.900          | 0,18                         |
| 650.000   | Sofi Professional Loan Program 2018-D Trust Class BFX                          | 4,14 % | 25.02.2048            | 597.966            | 0,04                         |
| 1.391.000   | Vantage Data Centers Issuer LLC Class A2                                       | 2,17 % | 15.10.2046            | 1.222.040          | 0,08                         |
| 1.941.000   | Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-NXS4 Class C                        | 4,84 % | 15.12.2048            | 1.740.473          | 0,12                         |
| 1.189.000   | Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-NXS6 Class B                        | 3,81 % | 15.11.2049            | 1.037.483          | 0,07                         |
| 2.350.000   | Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-NXS6 Class C                        | 4,53 % | 15.11.2049            | 1.974.953          | 0,13                         |
| 425.000   | Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-C47 Class C                         | 5,09 % | 15.09.2061            | 354.791            | 0,02                         |
| 8.645.571   | WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C21 Class XA                              | 1,15 % | 15.08.2047            | 79.248             | 0,01                         |
| 14.757.062  | WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C22 Class XA                              | 0,93 % | 15.09.2057            | 86.844             | 0,01                         |
| 6.384.800   | WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-LC14 Class XA                             | 1,40 % | 15.03.2047            | 15.505             | 0,00                         |
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) insgesamt **</b>                                     |  |        |                       | <b>134.247.605</b> | <b>9,10</b>                  |
| <b>Unternehmensanleihen 34,15 % (31. Dezember 2022: 48,20 %)</b>  |  |        |                       |                    |                              |
| <b>Euro</b>   |  |        |                       |                    |                              |
| 179.000   | 888 Acquisitions Ltd**   | 7,56 % | 15.07.2027            | 184.499            | 0,01                         |
| 300.000   | Abertis Infraestructuras Finance BV*   | 3,25 % | 29.12.2049            | 294.999            | 0,02                         |
| 74.727  | Adient Global Holdings Ltd*  | 3,50 % | 15.08.2024            | 80.129             | 0,01                         |
| 200.000   | Ahlstrom Holding 3 Oy*   | 3,63 % | 04.02.2028            | 181.409            | 0,01                         |
| 485.000   | Allwyn International AS**  | 3,88 % | 15.02.2027            | 498.220            | 0,03                         |
| 540.000   | Altice Financing SA**  | 4,25 % | 15.08.2029            | 454.014            | 0,03                         |
| 189.000   | Altice France Holding SA*  | 4,00 % | 15.02.2028            | 102.106            | 0,01                         |
| 620.000   | Altice France SA**   | 4,13 % | 15.01.2029            | 493.054            | 0,03                         |
| 100.000   | Altice France SA**   | 4,25 % | 15.10.2029            | 78.752             | 0,01                         |
| 246.000   | Apollo Swedish Bidco AB**  | 8,59 % | 05.07.2029            | 260.353            | 0,02                         |
| 469.000   | Aramark International Finance Sarl*  | 3,13 % | 01.04.2025            | 494.166            | 0,03                         |
| 273.000   | Autostrade per l'Italia SpA*   | 2,25 % | 25.01.2032            | 242.464            | 0,02                         |
| 210.000   | Avantor Funding Inc*   | 3,88 % | 15.07.2028            | 210.491            | 0,01                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                         | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 34,15 % (31. Dezember 2022: 48,20 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                  |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |   |        |                       |                  |                              |
| 400.000  | Bayer AG*                                     | 5,38 % | 25.03.2082            | 405.306          | 0,03                         |
| 545.000  | BCP V Modular Services Finance II Plc**       | 4,75 % | 30.11.2028            | 508.941          | 0,03                         |
| 268.000  | Benteler International AG*                    | 9,38 % | 15.05.2028            | 296.043          | 0,02                         |
| 188.000  | BK LC Lux Finco1 Sarl*                        | 5,25 % | 30.04.2029            | 193.279          | 0,01                         |
| 200.000  | CECONOMY AG*                                  | 1,75 % | 24.06.2026            | 171.462          | 0,01                         |
| 415.000  | Cheplapharm Arzneimittel GmbH**               | 4,38 % | 15.01.2028            | 415.822          | 0,03                         |
| 129.000  | Cheplapharm Arzneimittel GmbH*                | 7,50 % | 15.05.2030            | 141.672          | 0,01                         |
| 547.000  | Cirsa Finance International Sarl*             | 4,50 % | 15.03.2027            | 547.595          | 0,04                         |
| 710.000  | Clarios Global LP/Clarios US Finance Co**     | 4,38 % | 15.05.2026            | 739.615          | 0,05                         |
| 325.000  | Coty Inc**                                    | 3,88 % | 15.04.2026            | 344.591          | 0,02                         |
| 185.000  | Ctec II GmbH**                                | 5,25 % | 15.02.2030            | 167.772          | 0,01                         |
| 280.000  | Dana Financing Luxembourg Sarl*               | 8,50 % | 15.07.2031            | 316.076          | 0,02                         |
| 400.000  | Deutsche Lufthansa AG*                        | 3,00 % | 29.05.2026            | 415.575          | 0,03                         |
| 300.000  | Deutsche Lufthansa AG*                        | 3,75 % | 11.02.2028            | 309.385          | 0,02                         |
| 210.000  | Douglas GmbH*                                 | 6,00 % | 08.04.2026            | 210.972          | 0,01                         |
| 400.000  | Dufry One BV**                                | 2,00 % | 15.02.2027            | 381.742          | 0,03                         |
| 200.000  | Dufry One BV**                                | 2,50 % | 15.10.2024            | 213.560          | 0,01                         |
| 396.000  | Dufry One BV*                                 | 3,38 % | 15.04.2028            | 383.582          | 0,03                         |
| 500.000  | EDP - Energias de Portugal SA*                | 5,94 % | 23.04.2083            | 541.674          | 0,04                         |
| 300.000  | eG Global Finance Plc*                        | 4,38 % | 07.02.2025            | 310.910          | 0,02                         |
| 371.000  | eircom Finance DAC**                          | 3,50 % | 15.05.2026            | 378.994          | 0,03                         |
| 800.000  | Electricite de France SA*                     | 2,63 % | 29.12.2049            | 706.859          | 0,05                         |
| 400.000  | Electricite de France SA*                     | 7,50 % | 29.12.2049            | 444.349          | 0,03                         |
| 326.000  | Emerald Debt Merger Sub LLC**                 | 6,38 % | 15.12.2030            | 355.486          | 0,02                         |
| 463.000  | Emeria SASU**                                 | 3,38 % | 31.03.2028            | 407.601          | 0,03                         |
| 186.000  | Enel SpA*                                     | 6,38 % | 29.12.2049            | 204.799          | 0,01                         |
| 375.000  | Ford Motor Credit Co LLC*                     | 4,87 % | 03.08.2027            | 401.983          | 0,03                         |
| 200.000  | Forvia*                                       | 2,63 % | 15.06.2025            | 208.547          | 0,01                         |
| 279.000  | Forvia*                                       | 2,75 % | 15.02.2027            | 276.197          | 0,02                         |
| 360.000  | Gruenthal GmbH*                               | 3,63 % | 15.11.2026            | 370.549          | 0,03                         |
| 390.000  | Heimstaden Bostad AB*                         | 3,25 % | 29.12.2049            | 257.445          | 0,02                         |
| 495.000  | IHO Verwaltungs GmbH*                         | 3,88 % | 15.05.2027            | 489.287          | 0,03                         |
| 279.000  | IHO Verwaltungs GmbH*                         | 8,75 % | 15.05.2028            | 314.428          | 0,02                         |
| 600.000  | Iliad Holding SASU**                          | 5,13 % | 15.10.2026            | 626.754          | 0,04                         |
| 100.000  | INEOS Finance Plc*                            | 2,88 % | 01.05.2026            | 100.224          | 0,01                         |
| 720.000  | INEOS Finance Plc*                            | 3,38 % | 31.03.2026            | 737.635          | 0,05                         |
| 1.030.000  | INEOS Quattro Finance 1 Plc*                  | 3,75 % | 15.07.2026            | 991.645          | 0,07                         |
| 200.000  | Infineon Technologies AG*                     | 2,88 % | 29.12.2049            | 208.130          | 0,01                         |
| 400.000  | International Consolidated Airlines Group SA* | 3,75 % | 25.03.2029            | 381.881          | 0,03                         |
| 199.000  | Intrum AB*                                    | 3,00 % | 15.09.2027            | 150.364          | 0,01                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                      | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 34,15 % (31. Dezember 2022: 48,20 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                  |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |  |        |                       |                  |                              |
| 200.000  | Intrum AB <sup>†</sup>                                     | 3,50 % | 15.07.2026            | 162.681          | 0,01                         |
| 157.000  | IPD 3 BV <sup>†</sup>                                      | 8,00 % | 15.06.2028            | 175.054          | 0,01                         |
| 498.000  | Jaguar Land Rover Automotive Plc <sup>†</sup>              | 4,50 % | 15.07.2028            | 475.770          | 0,03                         |
| 259.000  | Kapla Holding SAS <sup>†</sup>                             | 3,38 % | 15.12.2026            | 257.307          | 0,02                         |
| 185.000  | Koninklijke KPN NV <sup>†</sup>                            | 6,00 % | 29.12.2049            | 204.754          | 0,01                         |
| 405.000  | Kronos International Inc <sup>**</sup>                     | 3,75 % | 15.09.2025            | 404.021          | 0,03                         |
| 208.000  | LHMC Finco 2 Sarl <sup>†</sup>                             | 7,25 % | 02.10.2025            | 224.090          | 0,02                         |
| 1.580.000  | Lorca Telecom Bondco SA <sup>†</sup>                       | 4,00 % | 18.09.2027            | 1.576.498        | 0,11                         |
| 100.000  | Lorca Telecom Bondco SA 144A <sup>†</sup>                  | 4,00 % | 18.09.2027            | 99.802           | 0,01                         |
| 351.000  | Loxam SAS <sup>†</sup>                                     | 5,75 % | 15.07.2027            | 351.468          | 0,02                         |
| 200.000  | Loxam SAS <sup>†</sup>                                     | 6,38 % | 15.05.2028            | 216.474          | 0,01                         |
| 185.000  | Lune Holdings Sarl <sup>**</sup>                           | 5,63 % | 15.11.2028            | 165.432          | 0,01                         |
| 192.000  | Maxeda DIY Holding BV <sup>**</sup>                        | 5,88 % | 01.10.2026            | 150.916          | 0,01                         |
| 250.000  | Motion Bondco DAC <sup>†</sup>                             | 4,50 % | 15.11.2027            | 238.948          | 0,02                         |
| 157.000  | Motion Finco Sarl <sup>†</sup>                             | 7,38 % | 15.06.2030            | 170.735          | 0,01                         |
| 195.000  | Multiversity SRL <sup>†</sup>                              | 7,50 % | 30.10.2028            | 210.624          | 0,01                         |
| 275.000  | Olympus Water US Holding Corp <sup>†</sup>                 | 3,88 % | 01.10.2028            | 237.416          | 0,02                         |
| 199.000  | PEU Finance Plc <sup>†</sup>                               | 7,25 % | 01.07.2028            | 217.595          | 0,02                         |
| 200.000  | Playtech Plc <sup>†</sup>                                  | 4,25 % | 07.03.2026            | 213.583          | 0,01                         |
| 287.000  | Playtech Plc <sup>†</sup>                                  | 5,88 % | 28.06.2028            | 312.334          | 0,02                         |
| 400.000  | PLT VII Finance Sarl <sup>**</sup>                         | 4,63 % | 05.01.2026            | 424.540          | 0,03                         |
| 159.000  | Repsol International Finance BV <sup>†</sup>               | 4,25 % | 29.12.2049            | 156.535          | 0,01                         |
| 100.000  | Sappi Papier Holding GmbH <sup>†</sup>                     | 3,63 % | 15.03.2028            | 96.037           | 0,01                         |
| 700.000  | Schaeffler AG <sup>†</sup>                                 | 3,38 % | 12.10.2028            | 697.950          | 0,05                         |
| 375.000  | SGL Carbon SE <sup>†</sup>                                 | 4,63 % | 30.09.2024            | 409.734          | 0,03                         |
| 217.000  | Summer BC Holdco B Sarl <sup>**</sup>                      | 5,75 % | 31.10.2026            | 211.281          | 0,01                         |
| 200.000  | Synthomer Plc <sup>†</sup>                                 | 3,88 % | 01.07.2025            | 202.637          | 0,01                         |
| 373.659  | Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH <sup>**</sup>       | 6,00 % | 30.07.2026            | 400.726          | 0,03                         |
| 500.000  | Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH <sup>**</sup>       | 2,00 % | 15.07.2025            | 519.580          | 0,04                         |
| 605.000  | Telecom Italia SpA <sup>**</sup>                           | 3,00 % | 30.09.2025            | 624.099          | 0,04                         |
| 264.000  | Telecom Italia SpA <sup>†</sup>                            | 6,88 % | 15.02.2028            | 287.560          | 0,02                         |
| 200.000  | Telefonica Europe BV <sup>†</sup>                          | 7,13 % | 29.12.2049            | 223.207          | 0,02                         |
| 510.000  | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV <sup>†</sup> | 1,88 % | 31.03.2027            | 474.883          | 0,03                         |
| 1.085.000  | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV <sup>†</sup> | 3,75 % | 09.05.2027            | 1.072.900        | 0,07                         |
| 295.000  | TK Elevator Midco GmbH <sup>**</sup>                       | 4,38 % | 15.07.2027            | 288.590          | 0,02                         |
| 200.000  | United Group BV <sup>†</sup>                               | 4,00 % | 15.11.2027            | 179.587          | 0,01                         |
| 300.000  | Valeo <sup>†</sup>   | 5,38 % | 28.05.2027            | 327.824          | 0,02                         |
| 345.000  | Verisure Holding AB <sup>†</sup>                           | 3,25 % | 15.02.2027            | 335.373          | 0,02                         |
| 945.000  | Verisure Holding AB <sup>†</sup>                           | 3,88 % | 15.07.2026            | 969.831          | 0,07                         |
| 284.000  | WEPA Hygieneprodukte GmbH <sup>**</sup>                    | 2,88 % | 15.12.2027            | 268.743          | 0,02                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 34,15 % (31. Dezember 2022: 48,20 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                   |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |   |        |                       |                   |                              |
| 220.000  | Wp/ap Telecom Holdings III BV**                                   | 5,50 % | 15.01.2030            | 200.491           | 0,01                         |
| 600.000  | ZF Europe Finance BV*   | 3,00 % | 23.10.2029            | 553.902           | 0,04                         |
| 300.000  | ZF Finance GmbH*  | 3,75 % | 21.09.2028            | 295.136           | 0,02                         |
| 634.000  | Ziggo Bond Co BV*   | 3,38 % | 28.02.2030            | 511.811           | 0,03                         |
| <b>Euro insgesamt</b>  |   |        |                       | <b>34.401.846</b> | <b>2,33</b>                  |
| <b>Britisches Pfund</b>  |   |        |                       |                   |                              |
| 100.000  | AA Bond Co Ltd*   | 6,50 % | 31.01.2026            | 110.200           | 0,01                         |
| 217.000  | AA Bond Co Ltd*   | 7,38 % | 31.07.2029            | 249.692           | 0,02                         |
| 160.000  | AA Bond Co Ltd 144A*  | 6,50 % | 31.01.2026            | 176.319           | 0,01                         |
| 320.000  | Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc*             | 4,75 % | 15.07.2027            | 323.851           | 0,02                         |
| 290.000  | Aroundtown SA*  | 4,75 % | 29.12.2049            | 132.729           | 0,01                         |
| 216.000  | B&M European Value Retail SA*                                     | 3,63 % | 15.07.2025            | 264.907           | 0,02                         |
| 205.000  | Bellis Finco Plc**  | 4,00 % | 16.02.2027            | 194.560           | 0,01                         |
| 286.000  | British Telecommunications Plc*                                   | 8,38 % | 20.12.2083            | 357.867           | 0,02                         |
| 320.000  | Centrica Plc*   | 5,25 % | 10.04.2075            | 385.571           | 0,03                         |
| 235.000  | CPUK Finance Ltd**  | 6,50 % | 28.08.2026            | 285.100           | 0,02                         |
| 525.000  | Encore Capital Group Inc*   | 4,25 % | 01.06.2028            | 511.769           | 0,03                         |
| 200.000  | Maison Finco Plc**  | 6,00 % | 31.10.2027            | 198.525           | 0,01                         |
| 340.000  | Mobico Group Plc*   | 4,25 % | 29.12.2049            | 378.512           | 0,03                         |
| 155.000  | NGG Finance Plc*  | 5,63 % | 18.06.2073            | 187.581           | 0,01                         |
| 100.000  | Pinnacle Bidco Plc*   | 6,38 % | 15.02.2025            | 121.394           | 0,01                         |
| 137.000  | Premier Foods Finance Plc*  | 3,50 % | 15.10.2026            | 152.940           | 0,01                         |
| 165.000  | RAC Bond Co Plc**   | 5,25 % | 04.11.2027            | 167.318           | 0,01                         |
| 400.000  | Rolls-Royce Plc*  | 5,75 % | 15.10.2027            | 473.400           | 0,03                         |
| 197.000  | Virgin Media Secured Finance Plc*                                 | 5,00 % | 15.04.2027            | 227.792           | 0,02                         |
| 1.045.000  | Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC**                     | 4,88 % | 15.07.2028            | 1.058.745         | 0,07                         |
| <b>Britisches Pfund insgesamt</b>  |   |        |                       | <b>5.958.772</b>  | <b>0,40</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>   |   |        |                       |                   |                              |
| 945.000  | 1011778 BC ULC/New Red Finance Inc**                              | 3,88 % | 15.01.2028            | 864.778           | 0,06                         |
| 650.000  | 1011778 BC ULC/New Red Finance Inc**                              | 4,00 % | 15.10.2030            | 557.071           | 0,04                         |
| 400.000  | 1011778 BC ULC/New Red Finance Inc**                              | 4,38 % | 15.01.2028            | 369.817           | 0,03                         |
| 6.840.000  | AbbVie Inc**  | 3,80 % | 15.03.2025            | 6.653.759         | 0,45                         |
| 2.000.000  | ABN AMRO Bank NV**  | 3,32 % | 13.03.2037            | 1.520.343         | 0,10                         |
| 610.000  | ADT Security Corp**   | 4,88 % | 15.07.2032            | 522.422           | 0,04                         |
| 611.000  | AerCap Global Aviation Trust*                                     | 6,50 % | 15.06.2045            | 591.627           | 0,04                         |
| 2.905.000  | AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust*          | 3,30 % | 30.01.2032            | 2.377.977         | 0,16                         |
| 360.000  | Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC** | 3,50 % | 15.03.2029            | 311.978           | 0,02                         |
| 340.000  | Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC** | 4,88 % | 15.02.2030            | 314.225           | 0,02                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 34,15 % (31. Dezember 2022: 48,20 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 1.175.000  | Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC**                   | 5,88 % | 15.02.2028            | 1.143.040        | 0,08                         |
| 880.000  | Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer**                      | 6,75 % | 15.10.2027            | 828.458          | 0,06                         |
| 870.000  | Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer**                      | 6,75 % | 15.04.2028            | 863.782          | 0,06                         |
| 645.000  | Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp**                         | 6,00 % | 01.06.2029            | 476.784          | 0,03                         |
| 590.000  | Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl 144A** | 4,63 % | 01.06.2028            | 497.001          | 0,03                         |
| 1.838.000  | Ally Financial Inc**  | 4,70 % | 29.12.2049            | 1.190.105        | 0,08                         |
| 1.410.000  | Ally Financial Inc*   | 6,70 % | 14.02.2033            | 1.248.837        | 0,08                         |
| 1.745.000  | Ally Financial Inc Series B**   | 4,70 % | 29.12.2049            | 1.235.678        | 0,08                         |
| 1.605.000  | Altice France Holding SA**  | 6,00 % | 15.02.2028            | 784.405          | 0,05                         |
| 710.000  | Altice France SA*   | 5,50 % | 15.01.2028            | 536.974          | 0,04                         |
| 440.000  | American Airlines Inc**   | 7,25 % | 15.02.2028            | 437.835          | 0,03                         |
| 2.020.000  | American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd**                                  | 5,50 % | 20.04.2026            | 2.003.011        | 0,14                         |
| 2.275.000  | American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd**                                  | 5,75 % | 20.04.2029            | 2.211.024        | 0,15                         |
| 2.455.000  | American Express Co**   | 3,55 % | 29.12.2049            | 2.043.787        | 0,14                         |
| 3.715.000  | American Tower Corp*  | 2,40 % | 15.03.2025            | 3.499.996        | 0,24                         |
| 2.495.000  | Amgen Inc**   | 2,77 % | 01.09.2053            | 1.552.404        | 0,11                         |
| 480.000  | Amgen Inc**   | 5,65 % | 02.03.2053            | 486.446          | 0,03                         |
| 1.300.000  | Amgen Inc**   | 5,75 % | 02.03.2063            | 1.319.801        | 0,09                         |
| 625.000  | AmWINS Group Inc**  | 4,88 % | 30.06.2029            | 565.049          | 0,04                         |
| 725.000  | Analog Devices Inc**  | 2,95 % | 01.10.2051            | 512.845          | 0,03                         |
| 2.000.000  | Apple Inc**   | 2,85 % | 05.08.2061            | 1.363.026        | 0,09                         |
| 1.275.000  | APX Group Inc**   | 5,75 % | 15.07.2029            | 1.108.355        | 0,08                         |
| 680.000  | Aramark Services Inc**  | 5,00 % | 01.04.2025            | 670.864          | 0,05                         |
| 295.000  | Aramark Services Inc**  | 5,00 % | 01.02.2028            | 278.456          | 0,02                         |
| 45.000   | Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc**         | 4,00 % | 01.09.2029            | 35.690           | 0,00                         |
| 840.000  | Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc**         | 6,00 % | 15.06.2027            | 826.039          | 0,06                         |
| 710.000  | Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc**                              | 4,13 % | 15.08.2026            | 662.183          | 0,04                         |
| 820.000  | Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc**                              | 5,25 % | 15.08.2027            | 695.677          | 0,05                         |
| 875.000  | Ascension Health**  | 3,11 % | 15.11.2039            | 685.094          | 0,05                         |
| 780.000  | Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**                              | 5,88 % | 30.06.2029            | 696.681          | 0,05                         |
| 495.000  | Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**                              | 7,00 % | 01.11.2026            | 479.576          | 0,03                         |
| 1.165.000  | Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**                              | 8,25 % | 31.12.2028            | 1.146.714        | 0,08                         |
| 650.000  | AssuredPartners Inc**   | 5,63 % | 15.01.2029            | 563.240          | 0,04                         |
| 1.145.000  | AssuredPartners Inc**   | 7,00 % | 15.08.2025            | 1.132.227        | 0,08                         |
| 3.875.000  | AT&T Inc**  | 3,50 % | 15.09.2053            | 2.745.919        | 0,19                         |
| 1.165.000  | AT&T Inc*   | 3,65 % | 01.06.2051            | 855.911          | 0,06                         |
| 2.802.000  | AT&T Inc*   | 4,50 % | 09.03.2048            | 2.372.275        | 0,16                         |
| 817.000  | Australia & New Zealand Banking Group Ltd*  | 6,75 % | 29.12.2049            | 799.601          | 0,05                         |
| 760.000  | Avient Corp**   | 7,13 % | 01.08.2030            | 769.366          | 0,05                         |
| 1.615.000  | Ball Corp*  | 2,88 % | 15.08.2030            | 1.342.109        | 0,09                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                           | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 34,15 % (31. Dezember 2022: 48,20 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 310.000  | Ball Corp <sup>*</sup>                          | 3,13 % | 15.09.2031            | 255.378          | 0,02                         |
| 1.000.000  | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA <sup>*</sup> | 6,50 % | 29.12.2049            | 940.200          | 0,06                         |
| 800.000  | Banco do Brasil SA <sup>*</sup>                 | 6,25 % | 29.12.2049            | 712.683          | 0,05                         |
| 200.000  | Banco Mercantil del Norte SA <sup>*</sup>       | 7,63 % | 29.12.2049            | 182.223          | 0,01                         |
| 2.000.000  | Banco Santander SA <sup>*</sup>                 | 5,15 % | 18.08.2025            | 1.965.362        | 0,13                         |
| 1.200.000  | Banco Santander SA <sup>*</sup>                 | 7,50 % | 29.12.2049            | 1.148.536        | 0,08                         |
| 9.310.000  | Bank of America Corp <sup>**</sup>              | 1,84 % | 04.02.2025            | 9.072.041        | 0,61                         |
| 3.785.000  | Bank of America Corp <sup>**</sup>              | 2,48 % | 21.09.2036            | 2.897.359        | 0,20                         |
| 3.320.000  | Bank of America Corp <sup>**</sup>              | 2,97 % | 04.02.2033            | 2.768.815        | 0,19                         |
| 418.000  | Bank of America Corp <sup>**</sup>              | 4,30 % | 29.12.2049            | 377.521          | 0,03                         |
| 1.690.000  | Bank of America Corp <sup>**</sup>              | 4,38 % | 29.12.2049            | 1.445.372        | 0,10                         |
| 1.915.000  | Bank of America Corp <sup>**</sup>              | 4,95 % | 22.07.2028            | 1.882.274        | 0,13                         |
| 1.830.000  | Bank of America Corp <sup>**</sup>              | 6,10 % | 29.12.2049            | 1.819.020        | 0,12                         |
| 210.000  | Bank of New York Mellon Corp <sup>**</sup>      | 3,70 % | 29.12.2049            | 186.165          | 0,01                         |
| 3.475.000  | Bank of New York Mellon Corp <sup>**</sup>      | 3,75 % | 29.12.2049            | 2.862.531        | 0,19                         |
| 3.455.000  | Barclays Plc <sup>*</sup>                       | 4,38 % | 29.12.2049            | 2.355.964        | 0,16                         |
| 445.000  | Barclays Plc <sup>*</sup>                       | 6,13 % | 29.12.2049            | 390.599          | 0,03                         |
| 1.740.000  | Barclays Plc <sup>*</sup>                       | 8,00 % | 29.12.2049            | 1.558.866        | 0,11                         |
| 745.000  | Bath & Body Works Inc <sup>**</sup>             | 6,63 % | 01.10.2030            | 720.056          | 0,05                         |
| 600.000  | Bath & Body Works Inc <sup>*</sup>              | 6,75 % | 01.07.2036            | 540.679          | 0,04                         |
| 765.000  | Beacon Roofing Supply Inc <sup>**</sup>         | 4,50 % | 15.11.2026            | 726.717          | 0,05                         |
| 1.055.000  | Berry Global Inc <sup>**</sup>                  | 5,63 % | 15.07.2027            | 1.033.531        | 0,07                         |
| 465.000  | BNP Paribas SA <sup>*</sup>                     | 4,50 % | 29.12.2049            | 330.894          | 0,02                         |
| 535.000  | BNP Paribas SA <sup>*</sup>                     | 4,63 % | 29.12.2049            | 383.194          | 0,03                         |
| 914.000  | BNP Paribas SA <sup>*</sup>                     | 7,38 % | 29.12.2049            | 888.475          | 0,06                         |
| 920.000  | BNP Paribas SA <sup>*</sup>                     | 9,25 % | 29.12.2049            | 950.464          | 0,06                         |
| 1.745.000  | BNP Paribas SA REG S <sup>*</sup>               | 4,63 % | 29.12.2049            | 1.381.866        | 0,09                         |
| 4.040.000  | Boeing Co <sup>*</sup>                          | 5,81 % | 01.05.2050            | 4.028.682        | 0,27                         |
| 4.750.000  | BP Capital Markets Plc <sup>*</sup>             | 4,88 % | 29.12.2049            | 4.332.594        | 0,29                         |
| 2.315.000  | BPCE SA <sup>**</sup>                           | 3,65 % | 14.01.2037            | 1.841.684        | 0,12                         |
| 235.000  | Buckeye Partners LP <sup>**</sup>               | 4,13 % | 01.03.2025            | 223.766          | 0,02                         |
| 1.110.000  | Buckeye Partners LP <sup>**</sup>               | 5,60 % | 15.10.2044            | 801.004          | 0,05                         |
| 240.000  | Buckeye Partners LP <sup>**</sup>               | 5,85 % | 15.11.2043            | 178.332          | 0,01                         |
| 310.000  | Builders FirstSource Inc <sup>**</sup>          | 4,25 % | 01.02.2032            | 270.107          | 0,02                         |
| 305.000  | Builders FirstSource Inc <sup>**</sup>          | 6,38 % | 15.06.2032            | 303.359          | 0,02                         |
| 385.000  | C&W Senior Financing DAC <sup>**</sup>          | 6,88 % | 15.09.2027            | 336.259          | 0,02                         |
| 750.000  | Caesars Entertainment Inc <sup>**</sup>         | 4,63 % | 15.10.2029            | 655.583          | 0,04                         |
| 740.000  | Caesars Entertainment Inc <sup>**</sup>         | 6,25 % | 01.07.2025            | 737.239          | 0,05                         |
| 975.000  | Caesars Entertainment Inc <sup>**</sup>         | 8,13 % | 01.07.2027            | 998.979          | 0,07                         |
| 410.000  | Callon Petroleum Co <sup>**</sup>               | 7,50 % | 15.06.2030            | 387.381          | 0,03                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 34,15 % (31. Dezember 2022: 48,20 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 420.000  | Callon Petroleum Co**   | 8,00 %  | 01.08.2028            | 415.764          | 0,03                         |
| 310.000  | Calpine Corp**  | 3,75 %  | 01.03.2031            | 251.432          | 0,02                         |
| 1.462.000  | Calpine Corp**  | 4,63 %  | 01.02.2029            | 1.235.181        | 0,08                         |
| 1.549.000  | Calpine Corp**  | 5,00 %  | 01.02.2031            | 1.283.119        | 0,09                         |
| 210.000  | Calpine Corp**  | 5,13 %  | 15.03.2028            | 187.694          | 0,01                         |
| 535.000  | Camelot Return Merger Sub Inc**   | 8,75 %  | 01.08.2028            | 506.281          | 0,03                         |
| 2.850.000  | Capital One Financial Corp**  | 3,95 %  | 29.12.2049            | 2.123.250        | 0,14                         |
| 295.000  | Carnival Corp**   | 4,00 %  | 01.08.2028            | 261.789          | 0,02                         |
| 240.000  | Carnival Corp**   | 5,75 %  | 01.03.2027            | 221.164          | 0,02                         |
| 545.000  | Carnival Corp**   | 7,63 %  | 01.03.2026            | 534.277          | 0,04                         |
| 1.090.000  | Carnival Corp**   | 9,88 %  | 01.08.2027            | 1.136.362        | 0,08                         |
| 685.000  | Carnival Holdings Bermuda Ltd**   | 10,38 % | 01.05.2028            | 749.851          | 0,05                         |
| 65.000   | Carpenter Technology Corp*  | 6,38 %  | 15.07.2028            | 63.765           | 0,00                         |
| 610.000  | Carpenter Technology Corp*  | 7,63 %  | 15.03.2030            | 617.632          | 0,04                         |
| 990.000  | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**                                    | 4,25 %  | 01.02.2031            | 801.771          | 0,05                         |
| 595.000  | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**                                    | 4,25 %  | 15.01.2034            | 450.295          | 0,03                         |
| 310.000  | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**                                    | 4,50 %  | 01.05.2032            | 247.824          | 0,02                         |
| 320.000  | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**                                    | 4,50 %  | 01.06.2033            | 251.632          | 0,02                         |
| 470.000  | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**                                    | 4,75 %  | 01.03.2030            | 402.312          | 0,03                         |
| 1.260.000  | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**                                    | 4,75 %  | 01.02.2032            | 1.028.853        | 0,07                         |
| 503.000  | CDW LLC/CDW Finance Corp**  | 3,57 %  | 01.12.2031            | 425.166          | 0,03                         |
| 790.000  | Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co/Magnum Management Corp/Millennium Op*      | 5,38 %  | 15.04.2027            | 751.967          | 0,05                         |
| 570.000  | Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co/Magnum Management Corp/Millennium Op**     | 5,50 %  | 01.05.2025            | 566.214          | 0,04                         |
| 2.804.000  | Charles Schwab Corp**   | 4,00 %  | 29.12.2049            | 2.049.724        | 0,14                         |
| 925.000  | Chart Industries Inc**  | 7,50 %  | 01.01.2030            | 944.892          | 0,06                         |
| 390.000  | Chart Industries Inc**  | 9,50 %  | 01.01.2031            | 414.187          | 0,03                         |
| 3.710.000  | Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital** | 3,90 %  | 01.06.2052            | 2.431.080        | 0,16                         |
| 1.990.000  | Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital** | 4,80 %  | 01.03.2050            | 1.503.088        | 0,10                         |
| 535.000  | CHS/Community Health Systems Inc**  | 4,75 %  | 15.02.2031            | 404.941          | 0,03                         |
| 275.000  | CHS/Community Health Systems Inc**  | 5,25 %  | 15.05.2030            | 216.910          | 0,01                         |
| 300.000  | CHS/Community Health Systems Inc**  | 5,63 %  | 15.03.2027            | 264.661          | 0,02                         |
| 330.000  | CHS/Community Health Systems Inc**  | 6,00 %  | 15.01.2029            | 277.967          | 0,02                         |
| 797.000  | CHS/Community Health Systems Inc**  | 8,00 %  | 15.12.2027            | 772.280          | 0,05                         |
| 1.240.000  | Churchill Downs Inc**   | 6,75 %  | 01.05.2031            | 1.227.600        | 0,08                         |
| 5.385.000  | Citigroup Inc**   | 3,29 %  | 17.03.2026            | 5.153.005        | 0,35                         |
| 1.650.000  | Citigroup Inc**   | 4,15 %  | 29.12.2049            | 1.331.550        | 0,09                         |
| 360.000  | Citigroup Inc**   | 4,70 %  | 29.12.2049            | 310.104          | 0,02                         |
| 297.000  | Citigroup Inc**   | 5,00 %  | 29.12.2049            | 277.974          | 0,02                         |
| 1.550.000  | Citigroup Inc**   | 7,38 %  | 29.12.2049            | 1.542.491        | 0,10                         |
| 294.000  | Citizens Financial Group Inc**  | 6,00 %  | 29.12.2049            | 257.209          | 0,02                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                    | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 34,15 % (31. Dezember 2022: 48,20 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |        |                       |                  |                              |
| 393.000  | Citizens Financial Group Inc**           | 6,38 % | 29.12.2049            | 339.945          | 0,02                         |
| 490.000  | Civitas Resources Inc**                  | 8,38 % | 01.07.2028            | 496.150          | 0,03                         |
| 575.000  | Civitas Resources Inc**                  | 8,75 % | 01.07.2031            | 583.654          | 0,04                         |
| 7.095.000  | Comcast Corp**                           | 2,94 % | 01.11.2056            | 4.625.436        | 0,31                         |
| 600.000  | Commerzbank AG**                         | 7,00 % | 29.12.2049            | 548.660          | 0,04                         |
| 845.000  | CommonSpirit Health**                    | 4,19 % | 01.10.2049            | 686.378          | 0,05                         |
| 735.000  | CommScope Inc**                          | 4,75 % | 01.09.2029            | 580.180          | 0,04                         |
| 565.000  | CommScope Inc**                          | 7,13 % | 01.07.2028            | 401.890          | 0,03                         |
| 515.000  | CommScope Inc**                          | 8,25 % | 01.03.2027            | 412.710          | 0,03                         |
| 830.000  | CommScope Technologies LLC**             | 5,00 % | 15.03.2027            | 578.914          | 0,04                         |
| 1.945.000  | Comstock Resources Inc**                 | 6,75 % | 01.03.2029            | 1.781.555        | 0,12                         |
| 2.685.000  | Constellation Brands Inc*                | 2,25 % | 01.08.2031            | 2.195.712        | 0,15                         |
| 1.425.000  | Corebridge Financial Inc**               | 4,35 % | 05.04.2042            | 1.151.957        | 0,08                         |
| 455.000  | Cornerstone Building Brands Inc**        | 6,13 % | 15.01.2029            | 360.198          | 0,02                         |
| 1.350.000  | Corp. Nacional del Cobre de Chile*       | 3,15 % | 14.01.2030            | 1.197.593        | 0,08                         |
| 850.000  | Coty Inc**                               | 5,00 % | 15.04.2026            | 815.430          | 0,06                         |
| 150.000  | Coty Inc**                               | 6,50 % | 15.04.2026            | 148.845          | 0,01                         |
| 565.000  | Country Garden Holdings Co Ltd*          | 4,80 % | 06.08.2030            | 163.632          | 0,01                         |
| 1.130.000  | CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC** | 5,50 % | 15.06.2031            | 1.009.681        | 0,07                         |
| 1.289.000  | Crown Castle Towers LLC†                 | 3,66 % | 15.05.2025            | 1.228.726        | 0,08                         |
| 765.000  | CSC Holdings LLC**                       | 4,13 % | 01.12.2030            | 535.876          | 0,04                         |
| 895.000  | CSC Holdings LLC**                       | 4,63 % | 01.12.2030            | 399.150          | 0,03                         |
| 1.520.000  | CSC Holdings LLC**                       | 5,75 % | 15.01.2030            | 719.849          | 0,05                         |
| 280.000  | CSC Holdings LLC**                       | 6,50 % | 01.02.2029            | 226.628          | 0,02                         |
| 745.000  | CSC Holdings LLC**                       | 7,50 % | 01.04.2028            | 425.777          | 0,03                         |
| 1.290.000  | CSN Inova Ventures**                     | 6,75 % | 28.01.2028            | 1.197.999        | 0,08                         |
| 4.400.000  | CVS Health Corp*                         | 5,05 % | 25.03.2048            | 4.058.805        | 0,28                         |
| 1.335.000  | Delta Air Lines Inc*                     | 3,75 % | 28.10.2029            | 1.201.767        | 0,08                         |
| 2.012.000  | Discover Financial Services**            | 5,50 % | 29.12.2049            | 1.534.293        | 0,10                         |
| 2.480.000  | Discovery Communications LLC**           | 4,65 % | 15.05.2050            | 1.890.984        | 0,13                         |
| 1.005.000  | DISH DBS Corp**                          | 5,13 % | 01.06.2029            | 467.668          | 0,03                         |
| 565.000  | Dominion Energy Inc**                    | 4,35 % | 29.12.2049            | 477.494          | 0,03                         |
| 1.350.000  | DT Midstream Inc**                       | 4,13 % | 15.06.2029            | 1.186.036        | 0,08                         |
| 385.000  | DT Midstream Inc**                       | 4,38 % | 15.06.2031            | 332.166          | 0,02                         |
| 500.000  | Ecopetrol SA*                            | 5,88 % | 28.05.2045            | 343.042          | 0,02                         |
| 3.280.000  | Edison International**                   | 5,00 % | 29.12.2049            | 2.841.792        | 0,19                         |
| 445.000  | Emerald Debt Merger Sub LLC**            | 6,63 % | 15.12.2030            | 441.663          | 0,03                         |
| 870.000  | Emirates NBD Bank PJSC*                  | 6,13 % | 29.12.2049            | 860.486          | 0,06                         |
| 4.830.000  | Enbridge Inc*                            | 2,50 % | 14.02.2025            | 4.590.078        | 0,31                         |
| 630.000  | Encompass Health Corp*                   | 4,75 % | 01.02.2030            | 574.375          | 0,04                         |



## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                      | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 34,15 % (31. Dezember 2022: 48,20 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |         |                       |                  |                              |
| 3.070.000  | Enterprise Products Operating LLC <sup>*</sup>             | 4,20 %  | 31.01.2050            | 2.570.392        | 0,17                         |
| 355.000  | EQM Midstream Partners LP <sup>**</sup>                    | 4,50 %  | 15.01.2029            | 317.002          | 0,02                         |
| 460.000  | EQM Midstream Partners LP <sup>**</sup>                    | 4,75 %  | 15.01.2031            | 403.486          | 0,03                         |
| 605.000  | EQM Midstream Partners LP <sup>*</sup>                     | 5,50 %  | 15.07.2028            | 573.005          | 0,04                         |
| 520.000  | EQM Midstream Partners LP <sup>**</sup>                    | 6,00 %  | 01.07.2025            | 514.726          | 0,03                         |
| 145.000  | EQM Midstream Partners LP <sup>**</sup>                    | 6,50 %  | 01.07.2027            | 143.155          | 0,01                         |
| 135.000  | EQM Midstream Partners LP <sup>**</sup>                    | 7,50 %  | 01.06.2027            | 136.423          | 0,01                         |
| 275.000  | EQM Midstream Partners LP <sup>**</sup>                    | 7,50 %  | 01.06.2030            | 278.541          | 0,02                         |
| 531.000  | Fifth Third Bancorp <sup>**</sup>                          | 8,57 %  | 29.12.2049            | 477.951          | 0,03                         |
| 570.000  | First Quantum Minerals Ltd <sup>**</sup>                   | 6,88 %  | 01.03.2026            | 561.899          | 0,04                         |
| 80.000   | First Quantum Minerals Ltd <sup>**</sup>                   | 6,88 %  | 15.10.2027            | 78.161           | 0,01                         |
| 230.000  | First Quantum Minerals Ltd <sup>**</sup>                   | 7,50 %  | 01.04.2025            | 230.037          | 0,02                         |
| 1.470.000  | First Quantum Minerals Ltd <sup>**</sup>                   | 8,63 %  | 01.06.2031            | 1.508.411        | 0,10                         |
| 610.000  | FMG Resources August 2006 Pty Ltd <sup>**</sup>            | 4,50 %  | 15.09.2027            | 568.651          | 0,04                         |
| 630.000  | FMG Resources August 2006 Pty Ltd <sup>**</sup>            | 5,88 %  | 15.04.2030            | 600.632          | 0,04                         |
| 300.000  | FMG Resources August 2006 Pty Ltd <sup>**</sup>            | 6,13 %  | 15.04.2032            | 286.334          | 0,02                         |
| 325.000  | Ford Motor Co <sup>*</sup>                                 | 3,25 %  | 12.02.2032            | 255.971          | 0,02                         |
| 800.000  | Ford Motor Co <sup>*</sup>                                 | 4,75 %  | 15.01.2043            | 615.891          | 0,04                         |
| 1.700.000  | Ford Motor Co <sup>*</sup>                                 | 5,29 %  | 08.12.2046            | 1.401.645        | 0,10                         |
| 425.000  | Ford Motor Co <sup>*</sup>                                 | 9,63 %  | 22.04.2030            | 494.782          | 0,03                         |
| 305.000  | Ford Motor Credit Co LLC <sup>*</sup>                      | 2,90 %  | 16.02.2028            | 261.515          | 0,02                         |
| 310.000  | Ford Motor Credit Co LLC <sup>*</sup>                      | 2,90 %  | 10.02.2029            | 256.836          | 0,02                         |
| 475.000  | Ford Motor Credit Co LLC <sup>*</sup>                      | 3,38 %  | 13.11.2025            | 442.132          | 0,03                         |
| 300.000  | Ford Motor Credit Co LLC <sup>*</sup>                      | 3,63 %  | 17.06.2031            | 246.208          | 0,02                         |
| 45.000   | Ford Motor Credit Co LLC <sup>*</sup>                      | 4,13 %  | 17.08.2027            | 41.132           | 0,00                         |
| 80.000   | Ford Motor Credit Co LLC <sup>*</sup>                      | 4,39 %  | 08.01.2026            | 75.785           | 0,01                         |
| 360.000  | Ford Motor Credit Co LLC <sup>*</sup>                      | 5,11 %  | 03.05.2029            | 334.215          | 0,02                         |
| 185.000  | Ford Motor Credit Co LLC <sup>*</sup>                      | 6,80 %  | 12.05.2028            | 185.370          | 0,01                         |
| 850.000  | Ford Motor Credit Co LLC <sup>*</sup>                      | 6,95 %  | 06.03.2026            | 855.350          | 0,06                         |
| 610.000  | Ford Motor Credit Co LLC <sup>*</sup>                      | 6,95 %  | 10.06.2026            | 613.611          | 0,04                         |
| 345.000  | Ford Motor Credit Co LLC <sup>*</sup>                      | 7,20 %  | 10.06.2030            | 348.529          | 0,02                         |
| 200.000  | Ford Motor Credit Co LLC <sup>*</sup>                      | 7,35 %  | 04.11.2027            | 204.724          | 0,01                         |
| 460.000  | Frontier Communications Holdings LLC <sup>**</sup>         | 5,00 %  | 01.05.2028            | 397.337          | 0,03                         |
| 550.000  | Frontier Communications Holdings LLC <sup>**</sup>         | 5,88 %  | 15.10.2027            | 505.310          | 0,03                         |
| 650.000  | Frontier Communications Holdings LLC <sup>**</sup>         | 5,88 %  | 01.11.2029            | 475.157          | 0,03                         |
| 410.000  | Frontier Communications Holdings LLC <sup>**</sup>         | 8,75 %  | 15.05.2030            | 401.092          | 0,03                         |
| 175.000  | FS Luxembourg Sarl <sup>**</sup>                           | 10,00 % | 15.12.2025            | 179.470          | 0,01                         |
| 285.000  | Garda World Security Corp <sup>**</sup>                    | 7,75 %  | 15.02.2028            | 283.202          | 0,02                         |
| 5.865.000  | General Motors Financial Co Inc <sup>*</sup>               | 3,80 %  | 07.04.2025            | 5.659.398        | 0,38                         |
| 425.000  | Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp <sup>*</sup> | 6,25 %  | 15.05.2026            | 404.172          | 0,03                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                          | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 34,15 % (31. Dezember 2022: 48,20 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |        |                       |                  |                              |
| 330.000  | Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp* | 6,50 % | 01.10.2025            | 325.376          | 0,02                         |
| 475.000  | Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp* | 7,75 % | 01.02.2028            | 452.347          | 0,03                         |
| 845.000  | Georgetown University**                        | 2,94 % | 01.04.2050            | 573.099          | 0,04                         |
| 9.310.000  | Goldman Sachs Group Inc**                      | 1,76 % | 24.01.2025            | 9.066.557        | 0,61                         |
| 905.000  | Goldman Sachs Group Inc**                      | 3,65 % | 29.12.2049            | 701.827          | 0,05                         |
| 1.120.000  | Goldman Sachs Group Inc**                      | 3,80 % | 29.12.2049            | 897.680          | 0,06                         |
| 1.105.000  | Goldman Sachs Group Inc**                      | 4,13 % | 29.12.2049            | 925.117          | 0,06                         |
| 655.000  | Goodyear Tire & Rubber Co**                    | 5,00 % | 31.05.2026            | 640.797          | 0,04                         |
| 1.290.000  | Goodyear Tire & Rubber Co**                    | 5,00 % | 15.07.2029            | 1.164.768        | 0,08                         |
| 590.000  | Grupo Aval Ltd*                                | 4,38 % | 04.02.2030            | 463.336          | 0,03                         |
| 425.000  | GTCR AP Finance Inc**                          | 8,00 % | 15.05.2027            | 417.111          | 0,03                         |
| 1.145.000  | Harvest Midstream I LP**                       | 7,50 % | 01.09.2028            | 1.136.264        | 0,08                         |
| 715.000  | HB Fuller Co*                                  | 4,25 % | 15.10.2028            | 637.258          | 0,04                         |
| 630.000  | HSBC Holdings Plc*                             | 4,00 % | 29.12.2049            | 534.373          | 0,04                         |
| 560.000  | HSBC Holdings Plc*                             | 4,70 % | 29.12.2049            | 420.230          | 0,03                         |
| 4.140.000  | HSBC Holdings Plc**                            | 6,00 % | 29.12.2049            | 3.710.475        | 0,25                         |
| 781.000  | HSBC Holdings Plc**                            | 6,38 % | 29.12.2049            | 748.999          | 0,05                         |
| 1.925.000  | HSBC Holdings Plc**                            | 8,00 % | 29.12.2049            | 1.915.866        | 0,13                         |
| 385.000  | HUB International Ltd**                        | 7,00 % | 01.05.2026            | 384.457          | 0,03                         |
| 2.270.000  | HUB International Ltd**                        | 7,25 % | 15.06.2030            | 2.346.068        | 0,16                         |
| 1.850.000  | Hudbay Minerals Inc**                          | 4,50 % | 01.04.2026            | 1.724.467        | 0,12                         |
| 610.000  | Hudbay Minerals Inc**                          | 6,13 % | 01.04.2029            | 562.347          | 0,04                         |
| 124.000  | Huntington Bancshares Inc**                    | 4,45 % | 29.12.2049            | 101.016          | 0,01                         |
| 284.000  | Huntington Bancshares Inc**                    | 5,63 % | 29.12.2049            | 255.206          | 0,02                         |
| 613.000  | Huntington Bancshares Inc**                    | 8,14 % | 29.12.2049            | 524.663          | 0,04                         |
| 260.000  | Iliad Holding SASU**                           | 6,50 % | 15.10.2026            | 245.628          | 0,02                         |
| 200.000  | Iliad Holding SASU**                           | 7,00 % | 15.10.2028            | 184.532          | 0,01                         |
| 690.000  | Imola Merger Corp**                            | 4,75 % | 15.05.2029            | 600.797          | 0,04                         |
| 1.760.000  | INEOS Finance Plc*                             | 6,75 % | 15.05.2028            | 1.692.208        | 0,11                         |
| 1.375.000  | INEOS Quattro Finance 2 Plc*                   | 3,38 % | 15.01.2026            | 1.256.105        | 0,09                         |
| 2.358.000  | ING Groep NV**                                 | 3,88 % | 29.12.2049            | 1.690.184        | 0,11                         |
| 1.202.000  | ING Groep NV*                                  | 5,75 % | 29.12.2049            | 1.062.545        | 0,07                         |
| 859.000  | ING Groep NV*                                  | 6,50 % | 29.12.2049            | 802.392          | 0,05                         |
| 1.325.000  | Intesa Sanpaolo SpA**                          | 7,78 % | 20.06.2054            | 1.319.068        | 0,09                         |
| 1.865.000  | Intesa Sanpaolo SpA**                          | 8,25 % | 21.11.2033            | 1.960.201        | 0,13                         |
| 600.000  | Iron Mountain Inc**                            | 4,50 % | 15.02.2031            | 516.083          | 0,04                         |
| 355.000  | Iron Mountain Inc**                            | 4,88 % | 15.09.2027            | 335.685          | 0,02                         |
| 1.180.000  | Iron Mountain Inc**                            | 4,88 % | 15.09.2029            | 1.057.323        | 0,07                         |
| 495.000  | Iron Mountain Inc**                            | 5,00 % | 15.07.2028            | 459.102          | 0,03                         |
| 880.000  | Iron Mountain Inc**                            | 5,25 % | 15.03.2028            | 823.682          | 0,06                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                               | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 34,15 % (31. Dezember 2022: 48,20 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 390.000  | Iron Mountain Inc**                                 | 5,25 %  | 15.07.2030            | 351.776          | 0,02                         |
| 1.145.000  | Iron Mountain Inc**                                 | 5,63 %  | 15.07.2032            | 1.025.983        | 0,07                         |
| 295.000  | Iron Mountain Information Management Services Inc** | 5,00 %  | 15.07.2032            | 255.094          | 0,02                         |
| 760.000  | ITT Holdings LLC**                                  | 6,50 %  | 01.08.2029            | 641.242          | 0,04                         |
| 730.000  | Jaguar Land Rover Automotive Plc**                  | 7,75 %  | 15.10.2025            | 733.648          | 0,05                         |
| 1.100.000  | JELD-WEN Inc**                                      | 4,88 %  | 15.12.2027            | 975.612          | 0,07                         |
| 30.000   | JELD-WEN Inc**                                      | 6,25 %  | 15.05.2025            | 30.290           | 0,00                         |
| 7.015.000  | JPMorgan Chase & Co**                               | 1,56 %  | 10.12.2025            | 6.571.292        | 0,45                         |
| 2.715.000  | JPMorgan Chase & Co**                               | 2,18 %  | 01.06.2028            | 2.414.886        | 0,16                         |
| 870.000  | JPMorgan Chase & Co**                               | 3,65 %  | 29.12.2049            | 767.906          | 0,05                         |
| 1.841.000  | JPMorgan Chase & Co**                               | 4,60 %  | 29.12.2049            | 1.721.335        | 0,12                         |
| 449.000  | JPMorgan Chase & Co**                               | 5,00 %  | 29.12.2049            | 438.898          | 0,03                         |
| 263.000  | JPMorgan Chase & Co**                               | 7,88 %  | 29.12.2049            | 259.713          | 0,02                         |
| 580.000  | KazMunayGas National Co JSC*                        | 5,75 %  | 19.04.2047            | 473.260          | 0,03                         |
| 255.000  | KB Home*  | 4,00 %  | 15.06.2031            | 220.165          | 0,01                         |
| 370.000  | KB Home**   | 7,25 %  | 15.07.2030            | 375.125          | 0,03                         |
| 3.285.000  | Kinder Morgan Inc*                                  | 5,55 %  | 01.06.2045            | 3.030.282        | 0,21                         |
| 550.000  | Kinetik Holdings LP**                               | 5,88 %  | 15.06.2030            | 523.322          | 0,04                         |
| 425.000  | Latam Airlines Group SA**                           | 13,38 % | 15.10.2027            | 460.124          | 0,03                         |
| 410.000  | Latam Airlines Group SA**                           | 13,38 % | 15.10.2029            | 444.008          | 0,03                         |
| 560.000  | Leeward Renewable Energy Operations LLC**           | 4,25 %  | 01.07.2029            | 499.591          | 0,03                         |
| 690.000  | Level 3 Financing Inc**                             | 3,63 %  | 15.01.2029            | 414.658          | 0,03                         |
| 265.000  | Level 3 Financing Inc**                             | 3,75 %  | 15.07.2029            | 159.883          | 0,01                         |
| 510.000  | Level 3 Financing Inc**                             | 3,88 %  | 15.11.2029            | 406.389          | 0,03                         |
| 445.000  | Level 3 Financing Inc**                             | 4,63 %  | 15.09.2027            | 310.159          | 0,02                         |
| 955.000  | Liberty Mutual Group Inc**                          | 4,13 %  | 15.12.2051            | 752.297          | 0,05                         |
| 755.000  | Live Nation Entertainment Inc**                     | 5,63 %  | 15.03.2026            | 738.514          | 0,05                         |
| 805.000  | Live Nation Entertainment Inc**                     | 6,50 %  | 15.05.2027            | 810.010          | 0,05                         |
| 310.000  | Lloyds Banking Group Plc**                          | 7,50 %  | 29.12.2049            | 290.672          | 0,02                         |
| 1.315.000  | Lloyds Banking Group Plc**                          | 8,00 %  | 29.12.2049            | 1.204.737        | 0,08                         |
| 964.000  | Lloyds Banking Group Plc Series WI**                | 7,50 %  | 29.12.2049            | 921.729          | 0,06                         |
| 1.535.000  | Lockheed Martin Corp*                               | 5,70 %  | 15.11.2054            | 1.705.624        | 0,12                         |
| 1.835.000  | M&T Bank Corp**                                     | 3,50 %  | 29.12.2049            | 1.228.543        | 0,08                         |
| 540.000  | Macy's Retail Holdings LLC*                         | 4,50 %  | 15.12.2034            | 388.908          | 0,03                         |
| 140.000  | Macy's Retail Holdings LLC*                         | 5,13 %  | 15.01.2042            | 95.453           | 0,01                         |
| 810.000  | Macy's Retail Holdings LLC**                        | 5,88 %  | 15.03.2030            | 722.674          | 0,05                         |
| 200.000  | MARB BondCo Plc*                                    | 3,95 %  | 29.01.2031            | 143.322          | 0,01                         |
| 1.060.000  | Masonite International Corp**                       | 3,50 %  | 15.02.2030            | 892.905          | 0,06                         |
| 1.135.000  | Mauser Packaging Solutions Holding Co**             | 7,88 %  | 15.08.2026            | 1.128.858        | 0,08                         |
| 810.000  | Mauser Packaging Solutions Holding Co**             | 9,25 %  | 15.04.2027            | 748.583          | 0,05                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                     | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 34,15 % (31. Dezember 2022: 48,20 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 1.125.000  | McAfee Corp**   | 7,38 %  | 15.02.2030            | 979.377          | 0,07                         |
| 450.000  | McGraw-Hill Education Inc**                               | 5,75 %  | 01.08.2028            | 390.429          | 0,03                         |
| 555.000  | McGraw-Hill Education Inc**                               | 8,00 %  | 01.08.2029            | 474.198          | 0,03                         |
| 200.000  | Medco Bell Pte Ltd*                                       | 6,38 %  | 30.01.2027            | 187.407          | 0,01                         |
| 525.000  | Medco Bell Pte Ltd 144A*                                  | 6,38 %  | 30.01.2027            | 491.944          | 0,03                         |
| 1.875.000  | Medline Borrower LP**                                     | 3,88 %  | 01.04.2029            | 1.631.265        | 0,11                         |
| 915.000  | Melco Resorts Finance Ltd**                               | 5,63 %  | 17.07.2027            | 829.836          | 0,06                         |
| 2.155.000  | Merck & Co Inc*   | 2,90 %  | 10.12.2061            | 1.429.138        | 0,10                         |
| 215.000  | Metinvest BV*   | 7,65 %  | 01.10.2027            | 137.600          | 0,01                         |
| 900.000  | Metinvest BV*   | 7,75 %  | 17.10.2029            | 544.500          | 0,04                         |
| 445.000  | MHP SE**  | 7,75 %  | 10.05.2024            | 305.381          | 0,02                         |
| 940.000  | Midwest Gaming Borrower LLC/Midwest Gaming Finance Corp** | 4,88 %  | 01.05.2029            | 830.911          | 0,06                         |
| 560.000  | Molina Healthcare Inc**                                   | 3,88 %  | 15.11.2030            | 481.725          | 0,03                         |
| 1.010.000  | Molina Healthcare Inc**                                   | 3,88 %  | 15.05.2032            | 848.046          | 0,06                         |
| 3.070.000  | Molson Coors Beverage Co*                                 | 4,20 %  | 15.07.2046            | 2.544.954        | 0,17                         |
| 6.775.000  | Morgan Stanley**  | 2,48 %  | 16.09.2036            | 5.143.371        | 0,35                         |
| 2.895.000  | Morgan Stanley**  | 5,25 %  | 21.04.2034            | 2.860.025        | 0,19                         |
| 635.000  | Morgan Stanley**  | 5,95 %  | 19.01.2038            | 627.129          | 0,04                         |
| 875.000  | Mount Sinai Hospitals Group Inc**                         | 3,74 %  | 01.07.2049            | 675.398          | 0,05                         |
| 1.010.000  | MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp*            | 3,50 %  | 15.03.2031            | 696.928          | 0,05                         |
| 855.000  | MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp*            | 4,63 %  | 01.08.2029            | 647.141          | 0,04                         |
| 277.395  | MV24 Capital BV*  | 6,75 %  | 01.06.2034            | 250.596          | 0,02                         |
| 390.000  | Natura Cosmeticos SA**                                    | 4,13 %  | 03.05.2028            | 337.671          | 0,02                         |
| 4.640.000  | NatWest Group Plc*  | 3,03 %  | 28.11.2035            | 3.563.457        | 0,24                         |
| 1.580.000  | NatWest Group Plc*  | 4,60 %  | 29.12.2049            | 1.098.100        | 0,07                         |
| 1.030.000  | NatWest Group Plc*  | 6,00 %  | 29.12.2049            | 955.325          | 0,06                         |
| 590.000  | NCL Corp Ltd**  | 5,88 %  | 15.02.2027            | 574.884          | 0,04                         |
| 720.000  | Neptune Bidco US Inc**                                    | 9,29 %  | 15.04.2029            | 661.768          | 0,04                         |
| 1.555.000  | New Fortress Energy Inc**                                 | 6,50 %  | 30.09.2026            | 1.392.917        | 0,09                         |
| 940.000  | New Fortress Energy Inc**                                 | 6,75 %  | 15.09.2025            | 882.782          | 0,06                         |
| 355.000  | Newfold Digital Holdings Group Inc**                      | 6,00 %  | 15.02.2029            | 266.814          | 0,02                         |
| 1.690.000  | Nordea Bank Abp*  | 3,75 %  | 29.12.2049            | 1.254.656        | 0,09                         |
| 680.000  | Northern Oil & Gas Inc**                                  | 8,13 %  | 01.03.2028            | 667.083          | 0,05                         |
| 805.000  | Northwest Fiber LLC/Northwest Fiber Finance Sub Inc**     | 4,75 %  | 30.04.2027            | 711.701          | 0,05                         |
| 765.000  | Northwest Fiber LLC/Northwest Fiber Finance Sub Inc**     | 6,00 %  | 15.02.2028            | 611.654          | 0,04                         |
| 1.475.000  | Novelis Corp**  | 3,88 %  | 15.08.2031            | 1.215.447        | 0,08                         |
| 420.000  | NRG Energy Inc**  | 3,38 %  | 15.02.2029            | 343.899          | 0,02                         |
| 2.045.000  | NRG Energy Inc**  | 3,63 %  | 15.02.2031            | 1.598.300        | 0,11                         |
| 315.000  | NRG Energy Inc**  | 3,88 %  | 15.02.2032            | 243.073          | 0,02                         |
| 720.000  | NRG Energy Inc**  | 10,25 % | 29.12.2049            | 679.669          | 0,05                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 34,15 % (31. Dezember 2022: 48,20 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 840.000  | Olympus Water US Holding Corp**                                       | 4,25 % | 01.10.2028            | 664.815          | 0,05                         |
| 395.000  | Olympus Water US Holding Corp**                                       | 6,25 % | 01.10.2029            | 286.059          | 0,02                         |
| 685.000  | Olympus Water US Holding Corp**                                       | 9,75 % | 15.11.2028            | 668.937          | 0,05                         |
| 730.000  | OneMain Finance Corp*   | 3,50 % | 15.01.2027            | 627.048          | 0,04                         |
| 1.265.000  | OneMain Finance Corp*   | 3,88 % | 15.09.2028            | 1.035.276        | 0,07                         |
| 440.000  | OneMain Finance Corp*   | 4,00 % | 15.09.2030            | 339.196          | 0,02                         |
| 1.070.000  | OneMain Finance Corp**  | 6,88 % | 15.03.2025            | 1.060.420        | 0,07                         |
| 715.000  | OneMain Finance Corp**  | 7,13 % | 15.03.2026            | 703.129          | 0,05                         |
| 1.830.000  | Oracle Corp*  | 3,95 % | 25.03.2051            | 1.384.739        | 0,09                         |
| 3.570.000  | Oracle Corp*  | 4,00 % | 15.11.2047            | 2.750.710        | 0,19                         |
| 2.920.000  | Oracle Corp*  | 5,55 % | 06.02.2053            | 2.829.673        | 0,19                         |
| 1.075.000  | Oztel Holdings SPC Ltd*   | 6,63 % | 24.04.2028            | 1.117.357        | 0,08                         |
| 50.000   | Pactiv Evergreen Group Issuer Inc/Pactiv Evergreen Group Issuer LLC** | 4,00 % | 15.10.2027            | 44.275           | 0,00                         |
| 910.000  | Pactiv Evergreen Group Issuer LLC/Pactiv Evergreen Group Issuer Inc** | 4,38 % | 15.10.2028            | 788.987          | 0,05                         |
| 3.460.000  | Paramount Global**  | 4,20 % | 19.05.2032            | 2.901.105        | 0,20                         |
| 775.000  | Performance Food Group Inc**  | 5,50 % | 15.10.2027            | 747.858          | 0,05                         |
| 460.000  | Periana Holdings LLC*   | 5,95 % | 19.04.2026            | 444.086          | 0,03                         |
| 420.000  | Pertamina Persero PT*   | 6,45 % | 30.05.2044            | 436.730          | 0,03                         |
| 195.000  | Petrobras Global Finance BV*  | 5,50 % | 10.06.2051            | 153.659          | 0,01                         |
| 762.400  | Petroleos de Venezuela SA*  | 5,38 % | 12.04.2027            | 26.920           | 0,00                         |
| 4.488.565  | Petroleos de Venezuela SA*  | 6,00 % | 16.05.2024            | 173.932          | 0,01                         |
| 2.302.978  | Petroleos de Venezuela SA**   | 6,00 % | 15.11.2026            | 80.028           | 0,01                         |
| 810.000  | Petroleos Mexicanos*  | 6,35 % | 12.02.2048            | 490.689          | 0,03                         |
| 1.935.000  | Petroleos Mexicanos*  | 7,69 % | 23.01.2050            | 1.313.176        | 0,09                         |
| 700.000  | PetSmart Inc/PetSmart Finance Corp.**                                 | 4,75 % | 15.02.2028            | 647.692          | 0,04                         |
| 740.000  | PetSmart Inc/PetSmart Finance Corp.**                                 | 7,75 % | 15.02.2029            | 736.106          | 0,05                         |
| 1.475.000  | Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd*                                | 5,34 % | 19.05.2063            | 1.493.856        | 0,10                         |
| 1.460.000  | Pilgrim's Pride Corp**  | 3,50 % | 01.03.2032            | 1.155.590        | 0,08                         |
| 620.000  | Pilgrim's Pride Corp**  | 4,25 % | 15.04.2031            | 532.261          | 0,04                         |
| 345.000  | Pilgrim's Pride Corp**  | 6,25 % | 01.07.2033            | 334.595          | 0,02                         |
| 3.783.000  | PNC Financial Services Group Inc**                                    | 3,40 % | 29.12.2049            | 2.799.420        | 0,19                         |
| 685.000  | PNC Financial Services Group Inc**                                    | 6,25 % | 29.12.2049            | 616.671          | 0,04                         |
| 545.000  | Presidio Holdings Inc**   | 4,88 % | 01.02.2027            | 512.030          | 0,03                         |
| 910.000  | Presidio Holdings Inc**   | 8,25 % | 01.02.2028            | 867.645          | 0,06                         |
| 548.000  | Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc**              | 5,25 % | 15.04.2024            | 543.973          | 0,04                         |
| 460.000  | Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc**              | 5,75 % | 15.04.2026            | 451.963          | 0,03                         |
| 1.375.000  | Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc**              | 6,25 % | 15.01.2028            | 1.290.089        | 0,09                         |
| 655.000  | Prudential Financial Inc**  | 5,13 % | 01.03.2052            | 593.142          | 0,04                         |
| 920.000  | Raptor Acquisition Corp./Raptor Co-Issuer LLC**                       | 4,88 % | 01.11.2026            | 867.928          | 0,06                         |
| 1.510.000  | Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp**                            | 5,25 % | 15.04.2030            | 1.074.810        | 0,07                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 34,15 % (31. Dezember 2022: 48,20 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 1.351.000  | Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp**                    | 5,75 % | 15.01.2029            | 1.012.368        | 0,07                         |
| 280.000  | RHP Hotel Properties LP/RHP Finance Corp**                    | 4,50 % | 15.02.2029            | 248.052          | 0,02                         |
| 805.000  | RHP Hotel Properties LP/RHP Finance Corp**                    | 4,75 % | 15.10.2027            | 750.373          | 0,05                         |
| 225.000  | Ritchie Bros Holdings Inc**                                   | 6,75 % | 15.03.2028            | 227.063          | 0,02                         |
| 450.000  | Ritchie Bros Holdings Inc**                                   | 7,75 % | 15.03.2031            | 467.404          | 0,03                         |
| 795.000  | RLJ Lodging Trust LP**  | 3,75 % | 01.07.2026            | 730.128          | 0,05                         |
| 1.875.000  | Roche Holdings Inc**  | 2,61 % | 13.12.2051            | 1.272.239        | 0,09                         |
| 540.000  | Rockcliff Energy II LLC**                                     | 5,50 % | 15.10.2029            | 498.674          | 0,03                         |
| 1.420.000  | Rogers Communications Inc**                                   | 3,80 % | 15.03.2032            | 1.241.815        | 0,08                         |
| 3.495.000  | Royal Bank of Canada**  | 3,38 % | 14.04.2025            | 3.365.953        | 0,23                         |
| 1.130.000  | Royal Caribbean Cruises Ltd**                                 | 5,50 % | 31.08.2026            | 1.072.423        | 0,07                         |
| 1.280.000  | Royal Caribbean Cruises Ltd**                                 | 5,50 % | 01.04.2028            | 1.194.924        | 0,08                         |
| 230.000  | Royal Caribbean Cruises Ltd**                                 | 8,25 % | 15.01.2029            | 241.673          | 0,02                         |
| 3.970.000  | SBA Tower Trust**   | 2,59 % | 15.10.2031            | 3.155.321        | 0,21                         |
| 1.355.000  | SBA Tower Trust**   | 2,84 % | 15.01.2025            | 1.287.181        | 0,09                         |
| 955.000  | Scientific Games International Inc**                          | 7,25 % | 15.11.2029            | 957.053          | 0,06                         |
| 855.000  | Sealed Air Corp**   | 5,00 % | 15.04.2029            | 796.458          | 0,05                         |
| 580.000  | SeaWorld Parks & Entertainment Inc**                          | 5,25 % | 15.08.2029            | 519.701          | 0,04                         |
| 245.000  | Sensata Technologies BV**                                     | 4,00 % | 15.04.2029            | 218.340          | 0,01                         |
| 625.000  | Sensata Technologies BV**                                     | 5,88 % | 01.09.2030            | 608.344          | 0,04                         |
| 1.000.000  | Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp**                       | 4,75 % | 15.02.2028            | 888.341          | 0,06                         |
| 2.000.000  | Skandinaviska Enskilda Banken AB*                             | 5,13 % | 29.12.2049            | 1.846.728        | 0,13                         |
| 460.000  | Societe Generale SA*  | 4,75 % | 29.12.2049            | 364.545          | 0,02                         |
| 745.000  | Solaris Midstream Holdings LLC**                              | 7,63 % | 01.04.2026            | 721.714          | 0,05                         |
| 3.475.000  | Southern Co**   | 4,00 % | 15.01.2051            | 3.222.437        | 0,22                         |
| 1.300.000  | Southwestern Energy Co*                                       | 4,75 % | 01.02.2032            | 1.147.590        | 0,08                         |
| 750.000  | SPX FLOW Inc**  | 8,75 % | 01.04.2030            | 675.861          | 0,05                         |
| 1.640.000  | Standard Chartered Plc*                                       | 4,30 % | 29.12.2049            | 1.192.116        | 0,08                         |
| 655.000  | Standard Industries Inc**                                     | 3,38 % | 15.01.2031            | 528.024          | 0,04                         |
| 940.000  | Standard Industries Inc**                                     | 4,38 % | 15.07.2030            | 814.977          | 0,06                         |
| 750.000  | Starwood Property Trust Inc**                                 | 5,50 % | 01.11.2023            | 744.318          | 0,05                         |
| 290.000  | Summer BC Bidco B LLC**                                       | 5,50 % | 31.10.2026            | 244.367          | 0,02                         |
| 1.540.000  | Summit Midstream Holdings LLC/Summit Midstream Finance Corp** | 9,00 % | 15.10.2026            | 1.497.381        | 0,10                         |
| 1.295.000  | Sunnova Energy Corp**   | 5,88 % | 01.09.2026            | 1.184.793        | 0,08                         |
| 1.555.000  | Sysco Corp*   | 3,15 % | 14.12.2051            | 1.078.410        | 0,07                         |
| 2.073.000  | Sysco Corp*   | 6,60 % | 01.04.2050            | 2.364.657        | 0,16                         |
| 650.000  | Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**  | 5,50 % | 15.01.2028            | 595.031          | 0,04                         |
| 1.220.000  | Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**  | 6,00 % | 31.12.2030            | 1.076.333        | 0,07                         |
| 230.000  | Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**  | 6,00 % | 01.09.2031            | 198.445          | 0,01                         |
| 345.000  | Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**  | 7,50 % | 01.10.2025            | 344.674          | 0,02                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                     | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 34,15 % (31. Dezember 2022: 48,20 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 580.000  | Tenet Healthcare Corp**                                   | 6,13 %  | 01.10.2028            | 558.923          | 0,04                         |
| 890.000  | Tenet Healthcare Corp**                                   | 6,13 %  | 15.06.2030            | 878.386          | 0,06                         |
| 935.000  | Terex Corp**  | 5,00 %  | 15.05.2029            | 870.237          | 0,06                         |
| 4.665.000  | T-Mobile USA Inc*   | 3,40 %  | 15.10.2052            | 3.333.853        | 0,23                         |
| 1.360.000  | T-Mobile USA Inc*   | 4,50 %  | 15.04.2050            | 1.167.790        | 0,08                         |
| 1.295.000  | TransDigm Inc*  | 5,50 %  | 15.11.2027            | 1.222.946        | 0,08                         |
| 655.000  | TransDigm Inc**   | 6,25 %  | 15.03.2026            | 652.388          | 0,04                         |
| 880.000  | TransDigm Inc**   | 6,75 %  | 15.08.2028            | 884.435          | 0,06                         |
| 490.000  | TransDigm Inc*  | 7,50 %  | 15.03.2027            | 491.296          | 0,03                         |
| 990.000  | Travelers Cos Inc*  | 5,45 %  | 25.05.2053            | 1.037.024        | 0,07                         |
| 750.000  | Trivium Packaging Finance BV*                             | 5,50 %  | 15.08.2026            | 721.091          | 0,05                         |
| 650.000  | Trivium Packaging Finance BV*                             | 8,50 %  | 15.08.2027            | 626.494          | 0,04                         |
| 1.215.000  | Tronox Inc**  | 4,63 %  | 15.03.2029            | 1.010.799        | 0,07                         |
| 395.000  | Truist Financial Corp**                                   | 4,95 %  | 29.12.2049            | 366.363          | 0,02                         |
| 190.000  | Truist Financial Corp**                                   | 5,10 %  | 29.12.2049            | 165.300          | 0,01                         |
| 2.630.000  | Truist Financial Corp**                                   | 5,87 %  | 08.06.2034            | 2.632.277        | 0,18                         |
| 289.000  | Truist Financial Corp*                                    | 8,65 %  | 29.12.2049            | 283.954          | 0,02                         |
| 200.000  | UBS Group AG*   | 4,38 %  | 29.12.2049            | 141.388          | 0,01                         |
| 2.330.000  | UBS Group AG*   | 4,70 %  | 05.08.2027            | 2.227.879        | 0,15                         |
| 1.215.000  | UBS Group AG**  | 4,88 %  | 29.12.2049            | 975.706          | 0,07                         |
| 1.516.000  | UBS Group AG*   | 6,88 %  | 29.12.2049            | 1.391.665        | 0,09                         |
| 481.000  | UniCredit SpA**   | 8,00 %  | 29.12.2049            | 471.996          | 0,03                         |
| 1.405.000  | United Airlines Inc**                                     | 4,38 %  | 15.04.2026            | 1.336.163        | 0,09                         |
| 790.000  | United Rentals North America Inc*                         | 3,75 %  | 15.01.2032            | 669.971          | 0,05                         |
| 765.000  | United Rentals North America Inc*                         | 5,25 %  | 15.01.2030            | 730.939          | 0,05                         |
| 370.000  | Uniti Group LP/Uniti Group Finance Inc/CSL Capital LLC**  | 10,50 % | 15.02.2028            | 367.397          | 0,02                         |
| 3.350.000  | US Bancorp**  | 3,70 %  | 29.12.2049            | 2.493.740        | 0,17                         |
| 3.345.000  | Verizon Communications Inc**                              | 2,36 %  | 15.03.2032            | 2.691.477        | 0,18                         |
| 2.775.000  | Verizon Communications Inc*                               | 2,99 %  | 30.10.2056            | 1.764.333        | 0,12                         |
| 875.000  | Virgin Media Secured Finance Plc*                         | 5,50 %  | 15.05.2029            | 792.307          | 0,05                         |
| 865.000  | VistaJet Malta Finance Plc/Vista Management Holding Inc** | 6,38 %  | 01.02.2030            | 697.304          | 0,05                         |
| 1.085.000  | VistaJet Malta Finance Plc/Vista Management Holding Inc** | 7,88 %  | 01.05.2027            | 975.822          | 0,07                         |
| 450.000  | VistaJet Malta Finance Plc/Vista Management Holding Inc** | 9,50 %  | 01.06.2028            | 413.584          | 0,03                         |
| 470.000  | Vistra Corp**   | 7,00 %  | 29.12.2049            | 410.604          | 0,03                         |
| 1.390.000  | Vistra Operations Co LLC**                                | 4,38 %  | 01.05.2029            | 1.218.832        | 0,08                         |
| 890.000  | Vistra Operations Co LLC**                                | 5,00 %  | 31.07.2027            | 833.856          | 0,06                         |
| 445.000  | Vistra Operations Co LLC**                                | 5,50 %  | 01.09.2026            | 428.599          | 0,03                         |
| 193.000  | Volcan Compania Minera SAA*                               | 4,38 %  | 11.02.2026            | 143.692          | 0,01                         |
| 4.120.000  | Warnermedia Holdings Inc**                                | 5,14 %  | 15.03.2052            | 3.357.432        | 0,23                         |
| 2.565.000  | Westpac Banking Corp**                                    | 3,02 %  | 18.11.2036            | 1.969.998        | 0,13                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                            | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 34,15 % (31. Dezember 2022: 48,20 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                    |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |        |                       |                    |                              |
| 530.000  | White Cap Parent LLC**                           | 8,25 % | 15.03.2026            | 508.251            | 0,03                         |
| 600.000  | Windsor Holdings III LLC**                       | 8,50 % | 15.06.2030            | 597.942            | 0,04                         |
| 390.000  | WMG Acquisition Corp**                           | 3,88 % | 15.07.2030            | 336.770            | 0,02                         |
| 1.615.000  | WR Grace Holdings LLC**                          | 5,63 % | 15.08.2029            | 1.324.704          | 0,09                         |
| 1.010.000  | Wyndham Hotels & Resorts Inc**                   | 4,38 % | 15.08.2028            | 923.241            | 0,06                         |
| 790.000  | Wynn Las Vegas LLC/Wynn Las Vegas Capital Corp** | 5,25 % | 15.05.2027            | 749.270            | 0,05                         |
| 1.091.000  | Wynn Las Vegas LLC/Wynn Las Vegas Capital Corp** | 5,50 % | 01.03.2025            | 1.074.544          | 0,07                         |
| 660.000  | Wynn Macau Ltd*                                  | 5,50 % | 15.01.2026            | 613.767            | 0,04                         |
| 805.000  | XHR LP**   | 6,38 % | 15.08.2025            | 791.045            | 0,05                         |
| 1.610.000  | Yum! Brands Inc*                                 | 5,38 % | 01.04.2032            | 1.532.158          | 0,10                         |
| 1.380.000  | ZF North America Capital Inc**                   | 6,88 % | 14.04.2028            | 1.398.884          | 0,09                         |
| 390.000  | ZF North America Capital Inc**                   | 7,13 % | 14.04.2030            | 397.074            | 0,03                         |
| 470.000  | Ziff Davis Inc**                                 | 4,63 % | 15.10.2030            | 407.526            | 0,03                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |  |        |                       | <b>463.541.516</b> | <b>31,42</b>                 |
| <b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>503.902.134</b> | <b>34,15</b>                 |
| <b>Staatsanleihen 17,53 % (31. Dezember 2022: 18,40 %)</b>                     |  |        |                       |                    |                              |
| <b>Kolumbianischer Peso</b>  |  |        |                       |                    |                              |
| 911.400.000  | Colombian TES*                                   | 6,00 % | 28.04.2028            | 187.235            | 0,01                         |
| 5.168.900.000  | Colombian TES*                                   | 7,00 % | 30.06.2032            | 1.015.822          | 0,07                         |
| 3.618.000.000  | Colombian TES*                                   | 7,25 % | 18.10.2034            | 699.652            | 0,05                         |
| <b>Kolumbianischer Peso insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>1.902.709</b>   | <b>0,13</b>                  |
| <b>Ungarischer Forint</b>  |  |        |                       |                    |                              |
| 995.190.000  | Hungary Government Bond*                         | 3,25 % | 22.10.2031            | 2.268.232          | 0,15                         |
| <b>Ungarischer Forint insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>2.268.232</b>   | <b>0,15</b>                  |
| <b>Indonesische Rupiah</b>   |  |        |                       |                    |                              |
| 1.848.000.000  | Indonesia Treasury Bond*                         | 6,13 % | 15.05.2028            | 124.006            | 0,01                         |
| 12.889.000.000   | Indonesia Treasury Bond*                         | 7,00 % | 15.09.2030            | 895.023            | 0,06                         |
| 7.386.000.000  | Indonesia Treasury Bond*                         | 7,00 % | 15.02.2033            | 519.121            | 0,04                         |
| 28.842.000.000   | Indonesia Treasury Bond*                         | 8,25 % | 15.05.2029            | 2.123.168          | 0,14                         |
| <b>Indonesische Rupiah insgesamt</b>   |  |        |                       | <b>3.661.318</b>   | <b>0,25</b>                  |
| <b>Mexikanischer Peso</b>  |  |        |                       |                    |                              |
| 84.500.000   | Mexican Bonos*                                   | 7,50 % | 26.05.2033            | 4.576.594          | 0,31                         |
| 27.490.000   | Mexican Bonos*                                   | 7,75 % | 29.05.2031            | 1.516.939          | 0,10                         |
| 17.327.800   | Mexican Bonos*                                   | 8,50 % | 31.05.2029            | 1.001.316          | 0,07                         |
| <b>Mexikanischer Peso insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>7.094.849</b>   | <b>0,48</b>                  |



## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                      | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 17,53 % (31. Dezember 2022: 18,40 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                  |                              |
| <b>Peruanischer Sol</b>  |  |        |                       |                  |                              |
| 9.907.000  | Peru Government Bond*                      | 6,15 % | 12.08.2032            | 2.611.956        | 0,17                         |
| 4.237.000  | Peruvian Government International Bond**   | 6,90 % | 12.08.2037            | 1.152.752        | 0,08                         |
| <b>Peruanischer Sol insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>3.764.708</b> | <b>0,25</b>                  |
| <b>Polnischer Zloty</b>  |  |        |                       |                  |                              |
| 7.714.000  | Republic of Poland Government Bond*        | 6,00 % | 25.10.2033            | 1.939.346        | 0,13                         |
| 3.271.000  | Republic of Poland Government Bond*        | 7,50 % | 25.07.2028            | 869.651          | 0,06                         |
| <b>Polnischer Zloty insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>2.808.997</b> | <b>0,19</b>                  |
| <b>Rumänischer neuer Leu</b>   |  |        |                       |                  |                              |
| 5.210.000  | Romania Government Bond**                  | 4,85 % | 25.07.2029            | 1.042.722        | 0,07                         |
| 10.790.000   | Romania Government Bond*                   | 8,25 % | 29.09.2032            | 2.614.223        | 0,18                         |
| <b>Rumänischer neuer Leu insgesamt</b>                                   |  |        |                       | <b>3.656.945</b> | <b>0,25</b>                  |
| <b>Südafrikanischer Rand</b>   |  |        |                       |                  |                              |
| 24.429.108   | Republic of South Africa Government Bond*  | 8,00 % | 31.01.2030            | 1.142.978        | 0,08                         |
| 9.356.291  | Republic of South Africa Government Bond*  | 8,25 % | 31.03.2032            | 416.226          | 0,03                         |
| 7.351.842  | Republic of South Africa Government Bond*  | 8,50 % | 31.01.2037            | 297.693          | 0,02                         |
| <b>Südafrikanischer Rand insgesamt</b>                                   |  |        |                       | <b>1.856.897</b> | <b>0,13</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>   |  |        |                       |                  |                              |
| 585.000  | Angolan Government International Bond*     | 8,00 % | 26.11.2029            | 497.235          | 0,03                         |
| 1.175.000  | Angolan Government International Bond*     | 9,38 % | 08.05.2048            | 933.232          | 0,06                         |
| 750.000  | Brazilian Government International Bond*   | 6,00 % | 20.10.2033            | 742.804          | 0,05                         |
| 485.000  | Colombia Government International Bond*    | 3,00 % | 30.01.2030            | 378.195          | 0,03                         |
| 400.000  | Colombia Government International Bond*    | 7,50 % | 02.02.2034            | 392.170          | 0,03                         |
| 1.925.000  | Dominican Republic International Bond*     | 6,85 % | 27.01.2045            | 1.752.126        | 0,12                         |
| 645.000  | Ecuador Government International Bond*     | 2,50 % | 31.07.2035            | 225.446          | 0,02                         |
| 420.000  | Ecuador Government International Bond*     | 5,50 % | 31.07.2030            | 204.048          | 0,01                         |
| 345.000  | Egypt Government International Bond*       | 5,88 % | 16.02.2031            | 190.854          | 0,01                         |
| 1.310.000  | Egypt Government International Bond*       | 8,50 % | 31.01.2047            | 699.422          | 0,05                         |
| 200.000  | El Salvador Government International Bond* | 9,50 % | 15.07.2052            | 126.803          | 0,01                         |
| 1.815.000  | Indonesia Government International Bond*   | 4,63 % | 15.04.2043            | 1.727.125        | 0,12                         |
| 1.700.000  | Ivory Coast Government International Bond* | 6,13 % | 15.06.2033            | 1.493.737        | 0,10                         |
| 1.895.000  | Mexico Government International Bond*      | 3,50 % | 12.02.2034            | 1.591.932        | 0,11                         |
| 1.890.000  | Mexico Government International Bond*      | 4,40 % | 12.02.2052            | 1.494.849        | 0,10                         |
| 485.000  | Mongolia Government International Bond*    | 5,13 % | 07.04.2026            | 452.252          | 0,03                         |
| 1.195.000  | Oman Government International Bond*        | 7,00 % | 25.01.2051            | 1.186.094        | 0,08                         |
| 825.000  | Panama Government International Bond*      | 2,25 % | 29.09.2032            | 632.500          | 0,04                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                   | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 17,53 % (31. Dezember 2022: 18,40 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                    |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |        |                       |                    |                              |
| 1.100.000  | Panama Government International Bond*                   | 3,30 % | 19.01.2033            | 922.207            | 0,06                         |
| 815.000  | Paraguay Government International Bond*                 | 4,95 % | 28.04.2031            | 784.936            | 0,05                         |
| 635.000  | Qatar Government International Bond*                    | 4,40 % | 16.04.2050            | 578.992            | 0,04                         |
| 785.000  | Republic of South Africa Government International Bond* | 5,65 % | 27.09.2047            | 557.220            | 0,04                         |
| 485.000  | Republic of South Africa Government International Bond* | 5,75 % | 30.09.2049            | 344.520            | 0,02                         |
| 1.422.000  | Romanian Government International Bond*                 | 3,00 % | 14.02.2031            | 1.182.066          | 0,08                         |
| 580.000  | Romanian Government International Bond*                 | 3,63 % | 27.03.2032            | 494.407            | 0,03                         |
| 630.000  | Romanian Government International Bond*                 | 4,00 % | 14.02.2051            | 451.354            | 0,03                         |
| 1.184.000  | Romanian Government International Bond 144A*            | 4,00 % | 14.02.2051            | 848.265            | 0,06                         |
| 725.000  | Saudi Government International Bond*                    | 3,25 % | 17.11.2051            | 509.261            | 0,03                         |
| 580.000  | Saudi Government International Bond*                    | 3,75 % | 21.01.2055            | 439.793            | 0,03                         |
| 1.800.000  | Ukraine Government International Bond*                  | 7,25 % | 15.03.2035            | 423.000            | 0,03                         |
| 6.157.144  | United States Treasury Inflation Indexed Bonds*         | 0,13 % | 15.02.2052            | 4.090.638          | 0,28                         |
| 14.721.951   | United States Treasury Inflation Indexed Bonds*         | 0,63 % | 15.07.2032            | 13.539.317         | 0,92                         |
| 5.718.428  | United States Treasury Inflation Indexed Bonds*         | 1,13 % | 15.01.2033            | 5.482.386          | 0,37                         |
| 65.546.240   | United States Treasury Inflation Indexed Bonds*         | 1,63 % | 15.10.2027            | 64.603.070         | 4,38                         |
| 19.265.000   | United States Treasury Note/Bond*                       | 0,38 % | 31.10.2023            | 18.962.783         | 1,29                         |
| 19.825.000   | United States Treasury Note/Bond*                       | 0,88 % | 30.06.2026            | 17.866.894         | 1,21                         |
| 18.530.000   | United States Treasury Note/Bond*                       | 1,25 % | 31.03.2028            | 16.221.350         | 1,10                         |
| 20.000.000   | United States Treasury Note/Bond*                       | 1,25 % | 15.08.2031            | 16.418.359         | 1,11                         |
| 4.690.000  | United States Treasury Note/Bond*                       | 1,38 % | 15.08.2050            | 2.727.986          | 0,19                         |
| 28.860.000   | United States Treasury Note/Bond*                       | 1,63 % | 15.05.2031            | 24.533.255         | 1,66                         |
| 3.900.000  | United States Treasury Note/Bond*                       | 2,38 % | 15.05.2051            | 2.901.539          | 0,20                         |
| 2.100.000  | United States Treasury Note/Bond**                      | 2,88 % | 15.05.2043            | 1.757.848          | 0,12                         |
| 4.555.000  | United States Treasury Note/Bond*                       | 3,00 % | 15.08.2052            | 3.874.597          | 0,26                         |
| 1.845.000  | United States Treasury Note/Bond*                       | 3,75 % | 15.11.2043            | 1.764.317          | 0,12                         |
| 5.640.000  | United States Treasury Note/Bond*                       | 4,00 % | 15.11.2052            | 5.795.100          | 0,39                         |
| 7.405.000  | United States Treasury Note/Bond*                       | 4,50 % | 15.05.2038            | 7.982.214          | 0,54                         |
| 545.000  | Uruguay Government International Bond*                  | 5,10 % | 18.06.2050            | 544.426            | 0,04                         |
| 3.136.300  | Venezuela Government International Bond*                | 8,25 % | 13.10.2024            | 290.108            | 0,02                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |   |        |                       | <b>231.613.032</b> | <b>15,70</b>                 |
| <b>Staatsanleihen insgesamt</b>  |   |        |                       | <b>258.627.687</b> | <b>17,53</b>                 |
| <b>Mortgage-Backed Securities 39,98% (31. Dezember 2022: 26,22 %)</b>    |   |        |                       |                    |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |   |        |                       |                    |                              |
| 2.040.274  | Fannie Mae Pool   | 2,50 % | 01.08.2051            | 1.733.384          | 0,12                         |
| 2.836.961  | Fannie Mae Pool   | 2,50 % | 01.10.2051            | 2.411.807          | 0,16                         |
| 4.148.588  | Fannie Mae Pool   | 2,50 % | 01.11.2051            | 3.530.030          | 0,24                         |
| 3.444.395  | Fannie Mae Pool   | 2,50 % | 01.12.2051            | 2.926.884          | 0,20                         |
| 636.901  | Fannie Mae Pool   | 2,50 % | 01.01.2052            | 543.465            | 0,04                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|-----------------------|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Mortgage-Backed Securities 39,98 % (31. Dezember 2022: 26,22 %) (Fortsetzung)</b> |                       |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |                       |        |                       |                  |                              |
| 335.436  | Fannie Mae Pool       | 2,50 % | 01.02.2052            | 285.115          | 0,02                         |
| 685.504  | Fannie Mae Pool       | 2,50 % | 01.03.2052            | 583.592          | 0,04                         |
| 3.440.576  | Fannie Mae Pool       | 2,50 % | 01.04.2052            | 2.936.070        | 0,20                         |
| 2.414.361  | Fannie Mae Pool       | 2,50 % | 01.05.2052            | 2.060.028        | 0,14                         |
| 2.137.552  | Fannie Mae Pool       | 3,00 % | 01.06.2050            | 1.891.818        | 0,13                         |
| 1.489.794  | Fannie Mae Pool       | 3,00 % | 01.05.2051            | 1.318.926        | 0,09                         |
| 2.244.420  | Fannie Mae Pool       | 3,00 % | 01.08.2051            | 1.977.639        | 0,13                         |
| 2.433.952  | Fannie Mae Pool       | 3,00 % | 01.11.2051            | 2.158.177        | 0,15                         |
| 225.356  | Fannie Mae Pool       | 3,00 % | 01.12.2051            | 198.707          | 0,01                         |
| 346.525  | Fannie Mae Pool       | 3,00 % | 01.02.2052            | 305.618          | 0,02                         |
| 3.884.204  | Fannie Mae Pool       | 3,00 % | 01.03.2052            | 3.424.696        | 0,23                         |
| 886.480  | Fannie Mae Pool       | 3,00 % | 01.04.2052            | 781.713          | 0,05                         |
| 1.773.942  | Fannie Mae Pool       | 3,00 % | 01.05.2052            | 1.563.021        | 0,11                         |
| 1.142.612  | Fannie Mae Pool       | 3,00 % | 01.06.2052            | 1.007.443        | 0,07                         |
| 1.185.707  | Fannie Mae Pool       | 3,50 % | 01.05.2051            | 1.086.246        | 0,07                         |
| 831.098  | Fannie Mae Pool       | 3,50 % | 01.12.2051            | 758.564          | 0,05                         |
| 735.330  | Fannie Mae Pool       | 3,50 % | 01.02.2052            | 670.682          | 0,05                         |
| 2.199.287  | Fannie Mae Pool       | 3,50 % | 01.04.2052            | 2.007.616        | 0,14                         |
| 3.963.245  | Fannie Mae Pool       | 3,50 % | 01.04.2052            | 3.616.814        | 0,25                         |
| 679.480  | Fannie Mae Pool       | 3,50 % | 01.05.2052            | 619.738          | 0,04                         |
| 2.779.642  | Fannie Mae Pool       | 3,50 % | 01.05.2052            | 2.535.784        | 0,17                         |
| 3.935.422  | Fannie Mae Pool       | 3,50 % | 01.06.2052            | 3.589.408        | 0,24                         |
| 4.710.487  | Fannie Mae Pool       | 3,50 % | 01.07.2052            | 4.296.324        | 0,29                         |
| 1.326.816  | Fannie Mae Pool       | 4,00 % | 01.02.2052            | 1.247.508        | 0,08                         |
| 1.334.413  | Fannie Mae Pool       | 4,00 % | 01.05.2052            | 1.255.029        | 0,09                         |
| 3.704.826  | Fannie Mae Pool       | 4,00 % | 01.06.2052            | 3.481.461        | 0,24                         |
| 8.378.565  | Fannie Mae Pool       | 4,00 % | 01.07.2052            | 7.872.550        | 0,53                         |
| 1.863.379  | Fannie Mae Pool       | 4,00 % | 01.08.2052            | 1.750.265        | 0,12                         |
| 1.385.736  | Fannie Mae Pool       | 4,00 % | 01.10.2052            | 1.301.616        | 0,09                         |
| 6.160.417  | Fannie Mae Pool       | 4,00 % | 01.12.2052            | 5.786.452        | 0,39                         |
| 4.044.460  | Fannie Mae Pool       | 4,00 % | 01.02.2053            | 3.797.898        | 0,26                         |
| 1.114.834  | Fannie Mae Pool       | 4,50 % | 01.06.2052            | 1.072.761        | 0,07                         |
| 1.174.267  | Fannie Mae Pool       | 4,50 % | 01.07.2052            | 1.129.919        | 0,08                         |
| 3.064.028  | Fannie Mae Pool       | 4,50 % | 01.08.2052            | 2.948.311        | 0,20                         |
| 295.811  | Fannie Mae Pool       | 4,50 % | 01.08.2052            | 284.646          | 0,02                         |
| 1.903.391  | Fannie Mae Pool       | 4,50 % | 01.09.2052            | 1.831.458        | 0,12                         |
| 861.446  | Fannie Mae Pool       | 4,50 % | 01.10.2052            | 828.845          | 0,06                         |
| 2.819.789  | Fannie Mae Pool       | 4,50 % | 01.11.2052            | 2.712.639        | 0,18                         |
| 17.215.000   | Fannie Mae Pool       | 5,00 % | 01.07.2052            | 16.869.355       | 1,14                         |
| 2.004.852  | Fannie Mae Pool       | 5,00 % | 01.08.2052            | 1.967.774        | 0,13                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung    | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Mortgage-Backed Securities 39,98 % (31. Dezember 2022: 26,22 %) (Fortsetzung)</b> |                          |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |                          |        |                       |                  |                              |
| 5.873.911  | Fannie Mae Pool          | 5,00 % | 01.09.2052            | 5.770.288        | 0,39                         |
| 3.241.498  | Fannie Mae Pool          | 5,00 % | 01.10.2052            | 3.185.800        | 0,22                         |
| 648.919  | Fannie Mae Pool          | 5,00 % | 01.11.2052            | 636.224          | 0,04                         |
| 1.061.783  | Fannie Mae Pool          | 5,00 % | 01.12.2052            | 1.041.522        | 0,07                         |
| 3.521.520  | Fannie Mae Pool          | 5,00 % | 01.01.2053            | 3.452.655        | 0,23                         |
| 1.946.019  | Fannie Mae Pool          | 5,00 % | 01.02.2053            | 1.907.929        | 0,13                         |
| 1.562.581  | Fannie Mae Pool          | 5,00 % | 01.03.2053            | 1.532.009        | 0,10                         |
| 762.633  | Fannie Mae Pool          | 5,00 % | 01.04.2053            | 747.574          | 0,05                         |
| 1.305.155  | Fannie Mae Pool          | 5,50 % | 01.12.2052            | 1.303.314        | 0,09                         |
| 1.314.970  | Fannie Mae Pool          | 5,50 % | 01.01.2053            | 1.309.304        | 0,09                         |
| 1.083.700  | Fannie Mae Pool          | 5,50 % | 01.02.2053            | 1.079.031        | 0,07                         |
| 3.379.152  | Fannie Mae Pool          | 5,50 % | 01.03.2053            | 3.367.968        | 0,23                         |
| 3.660.363  | Fannie Mae Pool          | 5,50 % | 01.04.2053            | 3.644.845        | 0,25                         |
| 3.306.379  | Fannie Mae Pool          | 5,50 % | 01.05.2053            | 3.292.361        | 0,22                         |
| 3.656.890  | Fannie Mae Pool          | 5,50 % | 01.06.2053            | 3.641.387        | 0,25                         |
| 3.119.209  | Fannie Mae Pool          | 6,00 % | 01.01.2053            | 3.147.993        | 0,21                         |
| 3.607.593  | Fannie Mae Pool          | 6,00 % | 01.02.2053            | 3.644.352        | 0,25                         |
| 1.379.408  | Fannie Mae Pool          | 6,00 % | 01.04.2053            | 1.394.412        | 0,09                         |
| 1.568.220  | Fannie Mae Pool          | 6,00 % | 01.06.2053            | 1.582.692        | 0,11                         |
| 2.874.099  | Fannie Mae Pool (BU8723) | 3,50 % | 01.06.2052            | 2.621.759        | 0,18                         |
| 1.425.138  | Fannie Mae Pool (BV2623) | 4,50 % | 01.07.2052            | 1.371.272        | 0,09                         |
| 1.471.536  | Fannie Mae Pool (BV2634) | 4,00 % | 01.07.2052            | 1.382.055        | 0,09                         |
| 1.200.525  | Fannie Mae Pool (BV7928) | 4,50 % | 01.08.2052            | 1.155.205        | 0,08                         |
| 1.773.158  | Fannie Mae Pool (BV7959) | 5,00 % | 01.08.2052            | 1.740.254        | 0,12                         |
| 729.089  | Fannie Mae Pool (BV8055) | 4,50 % | 01.09.2052            | 701.514          | 0,05                         |
| 2.624.687  | Fannie Mae Pool (BW1192) | 4,50 % | 01.09.2052            | 2.525.422        | 0,17                         |
| 4.925.892  | Fannie Mae Pool (BW1502) | 4,50 % | 01.07.2052            | 4.739.733        | 0,32                         |
| 2.850.484  | Fannie Mae Pool (BW9903) | 4,50 % | 01.10.2052            | 2.742.167        | 0,19                         |
| 1.662.581  | Fannie Mae Pool (BX3198) | 4,00 % | 01.12.2052            | 1.561.485        | 0,11                         |
| 2.381.286  | Fannie Mae Pool (BX5065) | 5,50 % | 01.01.2053            | 2.371.652        | 0,16                         |
| 2.028.448  | Fannie Mae Pool (BX7768) | 5,00 % | 01.03.2053            | 1.988.740        | 0,13                         |
| 2.279.956  | Fannie Mae Pool (BX8626) | 5,50 % | 01.04.2053            | 2.270.313        | 0,15                         |
| 2.533.837  | Fannie Mae Pool (CB3158) | 2,50 % | 01.03.2052            | 2.164.752        | 0,15                         |
| 2.576.637  | Fannie Mae Pool (CB3796) | 3,50 % | 01.06.2052            | 2.350.091        | 0,16                         |
| 2.124.347  | Fannie Mae Pool (CB3897) | 3,50 % | 01.06.2052            | 1.937.567        | 0,13                         |
| 1.410.695  | Fannie Mae Pool (CB3899) | 3,50 % | 01.06.2052            | 1.287.206        | 0,09                         |
| 483.752  | Fannie Mae Pool (CB4612) | 4,50 % | 01.09.2052            | 465.444          | 0,03                         |
| 1.845.110  | Fannie Mae Pool (CB4613) | 4,50 % | 01.09.2052            | 1.776.187        | 0,12                         |
| 1.890.359  | Fannie Mae Pool (CB5636) | 5,00 % | 01.02.2053            | 1.855.109        | 0,13                         |
| 4.721.140  | Fannie Mae Pool (CB6031) | 5,00 % | 01.04.2053            | 4.633.102        | 0,31                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung    | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Mortgage-Backed Securities 39,98 % (31. Dezember 2022: 26,22 %) (Fortsetzung)</b> |                          |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |                          |        |                       |                  |                              |
| 2.467.071  | Fannie Mae Pool (FS1172) | 3,00 % | 01.11.2051            | 2.179.643        | 0,15                         |
| 3.534.676  | Fannie Mae Pool (FS1632) | 2,50 % | 01.08.2051            | 3.013.580        | 0,20                         |
| 1.431.898  | Fannie Mae Pool (FS1866) | 3,50 % | 01.05.2052            | 1.307.383        | 0,09                         |
| 4.227.495  | Fannie Mae Pool (FS1921) | 2,50 % | 01.02.2052            | 3.597.691        | 0,24                         |
| 3.363.646  | Fannie Mae Pool (FS2043) | 2,50 % | 01.04.2052            | 2.870.843        | 0,19                         |
| 5.007.878  | Fannie Mae Pool (FS3457) | 4,50 % | 01.11.2052            | 4.818.365        | 0,33                         |
| 3.915.605  | Fannie Mae Pool (FS3539) | 3,50 % | 01.07.2052            | 3.572.136        | 0,24                         |
| 1.865.577  | Fannie Mae Pool (FS3642) | 5,00 % | 01.11.2052            | 1.829.386        | 0,12                         |
| 1.189.465  | Fannie Mae Pool (FS3662) | 5,00 % | 01.01.2053            | 1.166.917        | 0,08                         |
| 3.658.210  | Fannie Mae Pool (FS3881) | 5,50 % | 01.02.2053            | 3.648.451        | 0,25                         |
| 1.971.246  | Fannie Mae Pool (FS4190) | 5,00 % | 01.04.2053            | 1.934.488        | 0,13                         |
| 3.097.044  | Fannie Mae Pool (FS4357) | 5,50 % | 01.04.2053            | 3.087.641        | 0,21                         |
| 28.255.000   | Fannie Mae Pool (TBA)    | 3,50 % | 01.07.2053            | 25.750.680       | 1,75                         |
| 82.415.000   | Fannie Mae Pool (TBA)    | 4,00 % | 01.07.2053            | 77.350.985       | 5,24                         |
| 62.955.000   | Fannie Mae Pool (TBA)    | 4,50 % | 01.07.2053            | 60.530.249       | 4,10                         |
| 1.843.355  | Freddie Mac Pool         | 2,50 % | 01.05.2051            | 1.569.048        | 0,11                         |
| 950.337  | Freddie Mac Pool         | 2,50 % | 01.10.2051            | 808.756          | 0,06                         |
| 910.103  | Freddie Mac Pool         | 2,50 % | 01.11.2051            | 773.833          | 0,05                         |
| 1.312.973  | Freddie Mac Pool         | 2,50 % | 01.12.2051            | 1.115.967        | 0,08                         |
| 1.531.302  | Freddie Mac Pool         | 2,50 % | 01.01.2052            | 1.301.534        | 0,09                         |
| 2.361.899  | Freddie Mac Pool         | 2,50 % | 01.02.2052            | 2.007.573        | 0,14                         |
| 3.044.579  | Freddie Mac Pool         | 2,50 % | 01.03.2052            | 2.585.405        | 0,18                         |
| 4.125.890  | Freddie Mac Pool         | 2,50 % | 01.04.2052            | 3.508.621        | 0,24                         |
| 1.777.327  | Freddie Mac Pool         | 3,00 % | 01.07.2051            | 1.569.409        | 0,11                         |
| 2.676.417  | Freddie Mac Pool         | 3,00 % | 01.12.2051            | 2.362.034        | 0,16                         |
| 497.417  | Freddie Mac Pool         | 3,00 % | 01.03.2052            | 439.183          | 0,03                         |
| 2.330.124  | Freddie Mac Pool         | 3,00 % | 01.04.2052            | 2.057.937        | 0,14                         |
| 352.867  | Freddie Mac Pool         | 3,00 % | 01.04.2052            | 310.989          | 0,02                         |
| 2.850.206  | Freddie Mac Pool         | 3,00 % | 01.05.2052            | 2.512.381        | 0,17                         |
| 536.314  | Freddie Mac Pool         | 3,00 % | 01.06.2052            | 473.669          | 0,03                         |
| 3.906.095  | Freddie Mac Pool         | 3,50 % | 01.04.2052            | 3.564.018        | 0,24                         |
| 1.976.042  | Freddie Mac Pool         | 3,50 % | 01.05.2052            | 1.802.473        | 0,12                         |
| 482.601  | Freddie Mac Pool         | 3,50 % | 01.06.2052            | 440.415          | 0,03                         |
| 1.333.257  | Freddie Mac Pool         | 3,50 % | 01.07.2052            | 1.216.026        | 0,08                         |
| 4.569.112  | Freddie Mac Pool         | 3,50 % | 01.09.2052            | 4.167.358        | 0,28                         |
| 1.208.802  | Freddie Mac Pool         | 3,50 % | 01.11.2052            | 1.102.512        | 0,07                         |
| 2.108.874  | Freddie Mac Pool         | 4,00 % | 01.04.2052            | 1.983.419        | 0,13                         |
| 1.576.824  | Freddie Mac Pool         | 4,00 % | 01.05.2052            | 1.481.597        | 0,10                         |
| 1.499.123  | Freddie Mac Pool         | 4,00 % | 01.06.2052            | 1.408.740        | 0,10                         |
| 1.637.680  | Freddie Mac Pool         | 4,00 % | 01.07.2052            | 1.538.792        | 0,10                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung     | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---------------------------|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Mortgage-Backed Securities 39,98 % (31. Dezember 2022: 26,22 %) (Fortsetzung)</b> |                           |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |                           |        |                       |                  |                              |
| 3.431.804  | Freddie Mac Pool          | 4,00 % | 01.08.2052            | 3.224.186        | 0,22                         |
| 4.360.287  | Freddie Mac Pool          | 4,00 % | 01.09.2052            | 4.095.146        | 0,28                         |
| 3.362.284  | Freddie Mac Pool          | 4,00 % | 01.11.2052            | 3.157.832        | 0,21                         |
| 1.144.582  | Freddie Mac Pool          | 4,00 % | 01.12.2052            | 1.074.805        | 0,07                         |
| 2.542.736  | Freddie Mac Pool          | 4,00 % | 01.01.2053            | 2.387.719        | 0,16                         |
| 1.288.314  | Freddie Mac Pool          | 4,00 % | 01.04.2053            | 1.209.769        | 0,08                         |
| 1.213.674  | Freddie Mac Pool          | 4,50 % | 01.07.2052            | 1.167.814        | 0,08                         |
| 1.056.284  | Freddie Mac Pool          | 4,50 % | 01.08.2052            | 1.016.393        | 0,07                         |
| 1.598.002  | Freddie Mac Pool          | 4,50 % | 01.09.2052            | 1.537.677        | 0,10                         |
| 4.205.597  | Freddie Mac Pool          | 4,50 % | 01.10.2052            | 4.048.521        | 0,27                         |
| 288.998  | Freddie Mac Pool          | 4,50 % | 01.11.2052            | 278.062          | 0,02                         |
| 6.926.120  | Freddie Mac Pool          | 5,00 % | 01.10.2052            | 6.791.985        | 0,46                         |
| 2.069.356  | Freddie Mac Pool          | 5,00 % | 01.11.2052            | 2.033.680        | 0,14                         |
| 2.923.092  | Freddie Mac Pool          | 5,00 % | 01.11.2052            | 2.867.688        | 0,19                         |
| 1.491.822  | Freddie Mac Pool          | 5,00 % | 01.12.2052            | 1.463.060        | 0,10                         |
| 3.810.840  | Freddie Mac Pool          | 5,00 % | 01.01.2053            | 3.736.318        | 0,25                         |
| 1.028.124  | Freddie Mac Pool          | 5,00 % | 01.02.2053            | 1.008.008        | 0,07                         |
| 657.286  | Freddie Mac Pool          | 5,00 % | 01.03.2053            | 645.029          | 0,04                         |
| 3.940.222  | Freddie Mac Pool          | 5,00 % | 01.04.2053            | 3.863.091        | 0,26                         |
| 2.370.608  | Freddie Mac Pool          | 5,00 % | 01.05.2053            | 2.324.393        | 0,16                         |
| 2.621.010  | Freddie Mac Pool          | 5,50 % | 01.11.2052            | 2.618.313        | 0,18                         |
| 4.691.300  | Freddie Mac Pool          | 5,50 % | 01.04.2053            | 4.671.411        | 0,32                         |
| 3.603.271  | Freddie Mac Pool          | 5,50 % | 01.05.2053            | 3.587.996        | 0,24                         |
| 3.654.662  | Freddie Mac Pool          | 5,50 % | 01.06.2053            | 3.639.169        | 0,25                         |
| 1.517.691  | Freddie Mac Pool          | 6,00 % | 01.01.2053            | 1.531.696        | 0,10                         |
| 672.452  | Freddie Mac Pool          | 6,00 % | 01.05.2053            | 679.745          | 0,05                         |
| 1.266.280  | Freddie Mac Pool (QE2363) | 3,50 % | 01.05.2052            | 1.155.136        | 0,08                         |
| 2.245.101  | Freddie Mac Pool (QE2482) | 3,50 % | 01.05.2052            | 2.048.451        | 0,14                         |
| 2.596.220  | Freddie Mac Pool (QE6925) | 4,50 % | 01.08.2052            | 2.498.103        | 0,17                         |
| 610.749  | Freddie Mac Pool (QF7085) | 5,50 % | 01.02.2053            | 608.555          | 0,04                         |
| 2.285.810  | Freddie Mac Pool (RA7642) | 4,50 % | 01.08.2052            | 2.200.426        | 0,15                         |
| 1.563.810  | Freddie Mac Pool (SD1060) | 4,00 % | 01.07.2052            | 1.470.777        | 0,10                         |
| 3.886.578  | Freddie Mac Pool (SD1724) | 4,00 % | 01.09.2052            | 3.656.012        | 0,25                         |
| 1.256.305  | Freddie Mac Pool (SD1913) | 5,00 % | 01.11.2052            | 1.232.891        | 0,08                         |
| 534.633  | Freddie Mac Pool (SD2125) | 3,00 % | 01.04.2052            | 472.244          | 0,03                         |
| 302.026  | Freddie Mac Pool (SD2190) | 4,50 % | 01.10.2052            | 290.591          | 0,02                         |
| 1.026.953  | Freddie Mac Pool (SD2334) | 5,00 % | 01.02.2053            | 1.008.948        | 0,07                         |
| 2.639.342  | Freddie Mac Pool (SD2467) | 4,50 % | 01.10.2052            | 2.539.570        | 0,17                         |
| 2.198.037  | Freddie Mac Pool (SD2642) | 5,50 % | 01.04.2053            | 2.188.718        | 0,15                         |
| 2.022.865  | Freddie Mac Pool (SD3010) | 5,50 % | 01.06.2053            | 2.016.578        | 0,14                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Mortgage-Backed Securities 39,98 % (31. Dezember 2022: 26,22 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                    |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |        |                       |                    |                              |
| 820.000  | Freddie Mac Pool (SD3136)   | 5,50 % | 01.06.2053            | 817.758            | 0,06                         |
| 1.889.396  | Freddie Mac Pool (SD8213)   | 3,00 % | 01.05.2052            | 1.664.747          | 0,11                         |
| 1.604.422  | Freddie Mac Pool (SD8221)   | 3,50 % | 01.06.2052            | 1.463.560          | 0,10                         |
| 1.152.198  | Freddie Mac Pool (SD8231)   | 4,50 % | 01.07.2052            | 1.108.715          | 0,08                         |
| 3.656.275  | Freddie Mac Pool (SD8237)   | 4,00 % | 01.08.2052            | 3.435.078          | 0,23                         |
| 1.978.117  | Freddie Mac Pool (SD8238)   | 4,50 % | 01.08.2052            | 1.903.412          | 0,13                         |
| 2.197.338  | Freddie Mac Pool (SD8257)   | 4,50 % | 01.10.2052            | 2.114.239          | 0,14                         |
| 2.633.733  | Freddie Mac Pool (SD8300)   | 5,50 % | 01.02.2053            | 2.622.569          | 0,18                         |
| 23.165.000   | Ginnie Mae  | 5,00 % | 01.07.2053            | 22.765.042         | 1,54                         |
| 8.205.000  | Ginnie Mae  | 5,50 % | 01.07.2038            | 8.167.180          | 0,55                         |
| 13.420.000   | Ginnie Mae  | 6,00 % | 01.07.2053            | 13.510.166         | 0,92                         |
| 1.484.504  | Ginnie Mae II Pool  | 5,00 % | 20.11.2052            | 1.460.766          | 0,10                         |
| 1.483.346  | Ginnie Mae II Pool  | 5,00 % | 20.03.2053            | 1.458.704          | 0,10                         |
| 2.145.213  | Ginnie Mae II Pool  | 5,50 % | 20.06.2053            | 2.137.014          | 0,15                         |
| 2.120.131  | Ginnie Mae II Pool  | 6,00 % | 20.06.2053            | 2.137.084          | 0,15                         |
| <b>Mortgage-Backed Securities insgesamt **</b>                                       |   |        |                       | <b>589.853.152</b> | <b>39,98</b>                 |
| <b>Kommunalanleihen 0,87 % (31. Dezember 2022: 1,57 %)</b>                           |   |        |                       |                    |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |   |        |                       |                    |                              |
| 565.000  | Bay Area Toll Authority   | 7,04 % | 01.04.2050            | 727.142            | 0,05                         |
| 845.000  | California State University   | 2,98 % | 01.11.2051            | 609.573            | 0,04                         |
| 875.000  | Central Texas Turnpike System   | 3,03 % | 15.08.2041            | 640.363            | 0,04                         |
| 265.000  | City of Atlantic City NJ  | 4,29 % | 01.09.2026            | 255.545            | 0,02                         |
| 845.000  | Commonwealth Financing Authority                                      | 3,53 % | 01.06.2042            | 706.580            | 0,05                         |
| 845.000  | County of Clark NV  | 3,23 % | 01.07.2044            | 648.469            | 0,04                         |
| 705.000  | Dallas Area Rapid Transit   | 2,82 % | 01.12.2042            | 524.590            | 0,04                         |
| 795.000  | Foothill-Eastern Transportation Corridor Agency                       | 3,92 % | 15.01.2053            | 641.025            | 0,04                         |
| 845.000  | Grand Parkway Transportation Corp                                     | 3,24 % | 01.10.2052            | 622.998            | 0,04                         |
| 845.000  | Highland Local School District/Medina County                          | 3,19 % | 01.12.2049            | 619.134            | 0,04                         |
| 845.000  | JobsOhio Beverage System  | 2,83 % | 01.01.2038            | 675.834            | 0,05                         |
| 460.000  | Los Angeles Community College District                                | 6,75 % | 01.08.2049            | 575.398            | 0,04                         |
| 400.000  | Massachusetts Educational Financing Authority                         | 4,08 % | 01.07.2027            | 382.227            | 0,03                         |
| 725.000  | Michigan Finance Authority  | 3,38 % | 01.12.2040            | 588.110            | 0,04                         |
| 200.000  | New Jersey Housing & Mortgage Finance Agency                          | 3,80 % | 01.10.2032            | 194.855            | 0,01                         |
| 1.125.000  | New York State Dormitory Authority                                    | 2,69 % | 01.07.2040            | 841.398            | 0,06                         |
| 840.000  | Ohio Turnpike & Infrastructure Commission                             | 3,22 % | 15.02.2048            | 616.790            | 0,04                         |
| 845.000  | Ohio University   | 2,91 % | 01.12.2043            | 610.521            | 0,04                         |
| 705.000  | Regents of the University of California Medical Center Pooled Revenue | 3,01 % | 15.05.2050            | 497.158            | 0,03                         |
| 565.000  | State of California   | 7,63 % | 01.03.2040            | 711.565            | 0,05                         |
| 530.000  | Texas Private Activity Bond Surface Transportation Corp               | 3,92 % | 31.12.2049            | 431.124            | 0,03                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                  | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$     | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|---------|-----------------------|----------------------|------------------------------|
| <b>Kommunalanleihen 0,87 % (31. Dezember 2022: 1,57 %) (Fortsetzung)</b>                   |  |         |                       |                      |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |         |                       |                      |                              |
| 845.000  | Utah Transit Authority                                 | 2,77 %  | 15.12.2038            | 653.447              | 0,05                         |
| <b>Kommunalanleihen insgesamt <sup>†</sup></b>   |  |         |                       | <b>12.773.846</b>    | <b>0,87</b>                  |
| <b>Mittelfristige Schuldverschreibungen<sup>^</sup> 0,03 % (31. Dezember 2022: 0,04 %)</b> |  |         |                       |                      |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |  |         |                       |                      |                              |
| 143.864  | Envision Healthcare Corp                               | 0,00 %  | 31.03.2027            | 2.743                | 0,00                         |
| 90.056   | GTT Communications Inc                                 | 12,20 % | 30.12.2027            | 75.797               | 0,01                         |
| 72.789   | GTT Communications Inc                                 | 14,34 % | 30.06.2028            | 41.369               | 0,00                         |
| 785  | Lightstone Holdco LLC                                  | 0,00 %  | 29.01.2027            | 713                  | 0,00                         |
| 365.370  | Nautilus Power LLC                                     | 10,24 % | 16.11.2026            | 274.941              | 0,02                         |
| <b>Mittelfristige Schuldverschreibungen insgesamt <sup>†</sup></b>                         |  |         |                       | <b>395.563</b>       | <b>0,03</b>                  |
| <b>Investmentfonds 4,02 % (31. Dezember 2022: 4,40 %)</b>                                  |  |         |                       |                      |                              |
| <b>Britisches Pfund</b>  |  |         |                       |                      |                              |
| 375.051  | NB Global Monthly Income Fund Ltd                      |         |                       | 357.616              | 0,02                         |
| <b>Britisches Pfund insgesamt</b>  |  |         |                       | <b>357.616</b>       | <b>0,02</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>   |  |         |                       |                      |                              |
| 1.208.113  | Neuberger Berman China Bond Fund                       |         |                       | 11.634.127           | 0,79                         |
| 945.691  | Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund        |         |                       | 10.572.829           | 0,72                         |
| 486.855  | Neuberger Berman European High Yield Bond Fund         |         |                       | 5.822.785            | 0,39                         |
| 459.982  | Neuberger Berman Global Flexible Credit Income Fund    |         |                       | 5.133.394            | 0,35                         |
| 654.438  | Neuberger Berman Global High Yield SDG Engagement Fund |         |                       | 8.363.721            | 0,57                         |
| 2.000.000  | Neuberger Berman Global Investment Grade Credit Fund   |         |                       | 17.500.000           | 1,18                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |  |         |                       | <b>59.026.856</b>    | <b>4,00</b>                  |
| <b>Investmentfonds insgesamt <sup>‡</sup></b>  |  |         |                       | <b>59.384.472</b>    | <b>4,02</b>                  |
| <b>Anlagen insgesamt</b>   |  |         |                       | <b>1.612.244.982</b> | <b>109,27</b>                |

Devisenterminkontrakte 0,29 % (31. Dezember 2022: 2,24 %)

| Geforderter<br>Betrag | Zu zahlender<br>Betrag | Fälligkeits-<br>datum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|-----------------------|------------------------|-----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------------|------------------------------|
| 2.418.153 BRL         | 478.952 US\$           | 25.07.2023            | Goldman Sachs International | 2         | 20.423                               | 0,00                         |
| 13.302.943 BRL        | 2.595.286 US\$         | 05.07.2023            | HSBC Bank Plc               | 1         | 162.372                              | 0,01                         |
| 1.317.313.324 COP     | 308.176 US\$           | 20.09.2023            | Goldman Sachs International | 1         | 655                                  | 0,00                         |
| 1.132.035 €           | 1.218.853 US\$         | 05.07.2023            | Citibank NA                 | 2         | 16.197                               | 0,00                         |
| 139.074 €             | 149.252 US\$           | 05.07.2023            | Goldman Sachs International | 1         | 2.477                                | 0,00                         |
| 95.531 €              | 35.935.889 HUF         | 11.08.2023            | Goldman Sachs International | 1         | 413                                  | 0,00                         |
| 600.247 €             | 652.001 US\$           | 05.07.2023            | JPMorgan Chase Bank         | 3         | 2.870                                | 0,00                         |



## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Devisenterminkontrakte 0,29 % (31. Dezember 2022: 2,24 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag              | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 23.889 £                        | 30.141 US\$         | 20.07.2023       | Citibank NA                 | 1         | 234                            | 0,00                 |
| 2 £                             | 2 US\$              | 20.07.2023       | Royal Bank of Canada        | 1         | 0                              | 0,00                 |
| 70.121.723 HUF                  | 185.451 €           | 01.08.2023       | Citibank NA                 | 1         | 851                            | 0,00                 |
| 26.227.191 HUF                  | 69.555 €            | 01.08.2023       | HSBC Bank Plc               | 1         | 108                            | 0,00                 |
| 29.828.754 INR                  | 363.167 US\$        | 20.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 146                            | 0,00                 |
| 8.622.598 MXN                   | 492.853 US\$        | 20.09.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 2.409                          | 0,00                 |
| 552.193 PEN                     | 150.694 US\$        | 18.08.2023       | Goldman Sachs International | 1         | 1.043                          | 0,00                 |
| 148.000 PLN                     | 32.733 €            | 20.09.2023       | Goldman Sachs International | 1         | 434                            | 0,00                 |
| 5.081.971 RON                   | 1.017.200 €         | 25.07.2023       | Goldman Sachs International | 2         | 6.308                          | 0,00                 |
| 346.816 US\$                    | 280.647.043 CLP     | 20.09.2023       | Barclays Bank Plc           | 1         | 269                            | 0,00                 |
| 261.920 US\$                    | 239.509 €           | 05.07.2023       | Citibank NA                 | 1         | 616                            | 0,00                 |
| 679.149 US\$                    | 12.729.495 ZAR      | 12.07.2023       | Citibank NA                 | 2         | 5.768                          | 0,00                 |
| 1.157.816 US\$                  | 34.459.745 TWD      | 06.07.2023       | Citibank NA                 | 2         | 51.473                         | 0,01                 |
| 648.130 US\$                    | 4.605.669 CNH       | 20.09.2023       | Citibank NA                 | 1         | 10.847                         | 0,00                 |
| 178.127 US\$                    | 162.961 €           | 20.07.2023       | Citibank NA                 | 1         | 198                            | 0,00                 |
| 816.881 US\$                    | 742.836 €           | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 3         | 5.816                          | 0,00                 |
| 5.105 US\$                      | 52.924 NOK          | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | 162                            | 0,00                 |
| 521.099 US\$                    | 12.672.618 TRY      | 21.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | 36.995                         | 0,00                 |
| 259.498 US\$                    | 236.648 €           | 05.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | 1.315                          | 0,00                 |
| 2.773.136 US\$                  | 13.189.367 BRL      | 05.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | 39.022                         | 0,00                 |
| 2.760.405 US\$                  | 13.302.943 BRL      | 05.07.2023       | HSBC Bank Plc               | 1         | 2.747                          | 0,00                 |
| 124.522 US\$                    | 3.028.379 TRY       | 21.07.2023       | HSBC Bank Plc               | 1         | 8.836                          | 0,00                 |
| 259.157 US\$                    | 237.205 €           | 20.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 165                            | 0,00                 |
| 259.646 US\$                    | 237.352 €           | 05.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 2         | 695                            | 0,00                 |
| 1.415.251 US\$                  | 42.722.986 TWD      | 06.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 3         | 43.613                         | 0,01                 |
| 70.837 US\$                     | 1.325.567 ZAR       | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 715                            | 0,00                 |
| 358.109 US\$                    | 11.682.055 THB      | 06.07.2023       | Morgan Stanley              | 1         | 28.589                         | 0,00                 |
| 34.010.793 US\$                 | 30.882.153 €        | 20.07.2023       | Royal Bank of Canada        | 1         | 292.161                        | 0,02                 |
| 42.698 US\$                     | 1.307.178 TWD       | 06.07.2023       | Standard Chartered Bank     | 1         | 730                            | 0,00                 |
| 22.234.497 UYU                  | 554.615 US\$        | 10.08.2023       | Citibank NA                 | 1         | 36.807                         | 0,00                 |
| 1.431.007 UYU                   | 36.036 US\$         | 10.08.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 2.027                          | 0,00                 |
| 1.219.024 ZAR                   | 62.398 US\$         | 12.07.2023       | Citibank NA                 | 1         | 2.087                          | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 906.889 AUD                     | 603.633 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | 319                            | 0,00                 |
| 10.860.852 AUD                  | 7.181.927 US\$      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 20        | 50.960                         | 0,00                 |
| 1.006.737 US\$                  | 1.507.634 AUD       | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 2         | 2.714                          | 0,00                 |
| 1.144.425 US\$                  | 1.690.538 AUD       | 20.07.2023       | UBS AG                      | 3         | 18.596                         | 0,00                 |
| 2.749.582 US\$                  | 4.106.060 AUD       | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 11        | 15.114                         | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 149.677 €                       | 163.042 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | 383                            | 0,00                 |
| 6.916.334 €                     | 7.497.165 US\$      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 34        | 54.422                         | 0,00                 |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 0,29 % (31. Dezember 2022: 2,24 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR (Fortsetzung)</i>                                   |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 137.930 US\$  | 125.173 €           | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | 1.260                          | 0,00                 |
| 228.247 US\$  | 207.199 €           | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | 2.017                          | 0,00                 |
| 1.070.024 US\$  | 971.075 €           | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 16        | 9.759                          | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>   |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 83.247 £  | 104.212 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | 1.635                          | 0,00                 |
| 18.378.456 £  | 22.926.683 US\$     | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 52        | 441.305                        | 0,03                 |
| 267 US\$  | 209 £               | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 1         | 0                              | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen HKD</i>   |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 1.674.018 US\$  | 13.091.654 HKD      | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 2         | 2.996                          | 0,00                 |
| 846.358 US\$  | 6.620.796 HKD       | 20.07.2023       | UBS AG                      | 4         | 1.278                          | 0,00                 |
| 1.314.806 US\$  | 10.283.463 HKD      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 15        | 2.223                          | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen JPY</i>   |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 2.281.322 US\$  | 312.354.363 ¥       | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 2         | 115.022                        | 0,01                 |
| 6.315.856 US\$  | 830.235.809 ¥       | 20.07.2023       | UBS AG                      | 4         | 557.844                        | 0,04                 |
| 55.698.689 US\$   | 7.721.878.011 ¥     | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 6         | 2.144.422                      | 0,15                 |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>   |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 201.384 SGD   | 148.859 US\$        | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 6         | 30                             | 0,00                 |
| 582.097 US\$  | 778.907 SGD         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 3         | 6.225                          | 0,00                 |
| 225.744 US\$  | 305.191 SGD         | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | 106                            | 0,00                 |
| 3.485.018 US\$  | 4.635.031 SGD       | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 35        | 58.184                         | 0,01                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                             |           | <b>4.275.407</b>               | <b>0,29</b>          |

### Futures-Kontrakte 0,03 % (31. Dezember 2022: 0,22 %)

| Anzahl Kontrakte   | Beschreibung                                      | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---|--------------------------------|----------------------|
| (71)   | Canadian 10-Year Bond Future September 2023       | 61.485                         | 0,00                 |
| (59)   | Euro-Bund Future September 2023                   | 105.838                        | 0,01                 |
| 2  | Euro-Buxl 30-Year Bond Future September 2023      | 2.487                          | 0,00                 |
| (3)  | Euro-OAT Future September 2023                    | 4.713                          | 0,00                 |
| (182)  | US Treasury 10-Year Ultra Future September 2023   | 225.086                        | 0,02                 |
| (582)  | US Treasury Long Bond (CBT) Future September 2023 | 50.016                         | 0,00                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten <sup>*</sup></b> |   | <b>449.625</b>                 | <b>0,03</b>          |

### Verkaufte Optionskontrakte 0,00 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)

| Anzahl Kontrakte   | Fälligkeit | Art                                       | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|--|------------|---|---------------|----------------------|
| <b>Kaufoptionen</b>  |            |   |               |                      |
| 115  | 15.12.2023 | 3 Month SOFR Future, Strike Price \$98.00 | 5.750         | 0,00                 |
| <b>Beizulegender Zeitwert aus gekauften Optionskontrakten insgesamt <sup>*</sup> (Prämie: (30.188) US\$)</b> |            |   | <b>5.750</b>  | <b>0,00</b>          |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Zinsswap-Kontrakte 0,05 % (31. Dezember 2022: 0,03 %)

|   | Nominalwert | Fälligkeit | Gegenpartei                              | Erhalt/(Zahlung) <sup>#</sup> | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|-------------|------------|--|-------------------------------|-----------------|--------------------|--------------------------------|----------------------|
| CAD   | 13.647.000  | 17.02.2027 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | Erhalt                        | 2,67 %          | 3M CDOR            | 609.058                        | 0,04                 |
| AUD   | 6.639.000   | 06.06.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 4,01 %          | 6M BBSW            | 58.372                         | 0,01                 |
| BRL   | 2.262.674   | 02.01.2031 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 11,21 %         | 1D BROIS           | 18.065                         | 0,00                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Zinsswapkontrakten<sup>∞</sup></b> |             |            |  |                               |                 |                    | <b>685.495</b>                 | <b>0,05</b>          |

<sup>#</sup>Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

### Inflation-Swap-Kontrakte 0,00 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)

|  | Nominalwert | Fälligkeit | Gegenpartei                   | Erhalt/(Zahlung) <sup>#</sup> | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|-------------|------------|-------------------------------|-------------------------------|-----------------|--------------------|--------------------------------|----------------------|
| USD  | 9.835.000   | 23.03.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | Erhalt                        | 2,46 %          | CPURNSA            | 31.002                         | 0,00                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Inflation-Swap-Kontrakten<sup>∞</sup></b> |             |            |                               |                               |                 |                    | <b>31.002</b>                  | <b>0,00</b>          |

<sup>#</sup>Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

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

|   | Nominalwert | Datum der Schließung | Variabler Zinssatz | Referenzunternehmen                                  | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|-------------|----------------------|--------------------|--|--------------------------------|----------------------|
| USD   | 35.080.000  | 20.09.2023           | 5,09 <sup>1</sup>  | iBoxx USD Liquid Investment Grade Index <sup>2</sup> | 404.409                        | 0,03                 |
| USD   | 38.600.000  | 20.09.2023           | 5,09 <sup>1</sup>  | iBoxx USD Liquid High Yield Index <sup>2</sup>       | 94.989                         | 0,00                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Total Return Swap-Kontrakten<sup>∞</sup></b> |             |                      |                    |  | <b>499.398</b>                 | <b>0,03</b>          |

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

<sup>2</sup> Die Gegenpartei für die Total Return Swap-Kontrakte ist Goldman Sachs International.

|  | Zeitwert US\$        | % des Nettovermögens |
|--|----------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> | <b>1.618.191.659</b> | <b>109,67</b>        |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Devisenterminkontrakte (1,84 %) (31. Dezember 2022: (0,54 %))

| Geforderter Betrag              | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 113.576 BRL                     | 23.567 US\$         | 05.07.2023       | Citibank NA                 | 1         | (23)                            | (0,00)               |
| 13.189.367 BRL                  | 2.746.537 US\$      | 28.08.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (39.860)                        | (0,01)               |
| 13.189.367 BRL                  | 2.736.837 US\$      | 05.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (2.723)                         | (0,00)               |
| 4.605.669 CNY                   | 645.629 US\$        | 20.09.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (8.347)                         | (0,00)               |
| 1.044.306.057 COP               | 246.188 US\$        | 20.09.2023       | Barclays Bank Plc           | 1         | (1.361)                         | (0,00)               |
| 13.864 €                        | 333.593 CZK         | 20.09.2023       | Citibank NA                 | 1         | (82)                            | (0,00)               |
| 70.460 €                        | 77.223 US\$         | 03.08.2023       | Citibank NA                 | 1         | (230)                           | (0,00)               |
| 842.443 €                       | 4.190.426 RON       | 25.07.2023       | Citibank NA                 | 3         | (1.167)                         | (0,00)               |
| 396.024 €                       | 435.384 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 2         | (2.986)                         | (0,00)               |
| 236.666 €                       | 259.251 US\$        | 05.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | (1.049)                         | (0,00)               |
| 104.336 €                       | 519.087 RON         | 25.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | (168)                           | (0,00)               |
| 2.659.466 €                     | 2.926.716 US\$      | 20.07.2023       | Royal Bank of Canada        | 2         | (22.982)                        | (0,00)               |
| 277.042.035 HUF                 | 734.190 €           | 11.08.2023       | Citibank NA                 | 2         | (678)                           | (0,00)               |
| 11.990.619.848 IDR              | 802.302 US\$        | 20.09.2023       | Citibank NA                 | 2         | (5.849)                         | (0,00)               |
| 51.500.000.000 IDR              | 3.442.974 US\$      | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (18.646)                        | (0,00)               |
| 45.868 ¥                        | 354 US\$            | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | (36)                            | (0,00)               |
| 8.273.334 THB                   | 257.104 US\$        | 06.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (23.734)                        | (0,00)               |
| 1.307.428 THB                   | 38.421 US\$         | 06.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | (1.542)                         | (0,00)               |
| 24.238.090 THB                  | 705.678 US\$        | 20.09.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | (16.769)                        | (0,00)               |
| 46.963.022 TWD                  | 1.603.779 US\$      | 06.07.2023       | Citibank NA                 | 3         | (96.013)                        | (0,01)               |
| 11.689.533 TWD                  | 381.052 US\$        | 06.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | (5.755)                         | (0,00)               |
| 362.146 US\$                    | 333.484 €           | 05.07.2023       | Citibank NA                 | 2         | (1.685)                         | (0,00)               |
| 206.757 US\$                    | 1.005.416 BRL       | 25.07.2023       | Citibank NA                 | 1         | (872)                           | (0,00)               |
| 435.594 US\$                    | 399.160 €           | 03.08.2023       | Citibank NA                 | 1         | (570)                           | (0,00)               |
| 22.713 US\$                     | 113.576 BRL         | 05.07.2023       | Citibank NA                 | 1         | (831)                           | (0,00)               |
| 600.788 US\$                    | 554.975 €           | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 2         | (5.161)                         | (0,00)               |
| 118.594 US\$                    | 109.741 €           | 05.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (1.134)                         | (0,00)               |
| 28.553 US\$                     | 1.080.231 UYU       | 10.08.2023       | HSBC Bank Plc               | 1         | (180)                           | (0,00)               |
| 1.025.405 US\$                  | 951.288 €           | 05.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 4         | (12.450)                        | (0,00)               |
| 260.933 US\$                    | 239.509 €           | 03.08.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | (779)                           | (0,00)               |
| 6.586.661 US\$                  | 5.268.777 £         | 20.07.2023       | Royal Bank of Canada        | 1         | (112.526)                       | (0,01)               |
| 5.553 ZAR                       | 299 US\$            | 12.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (5)                             | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 1.550.450 AUD                   | 1.048.744 US\$      | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 2         | (16.206)                        | (0,00)               |
| 100.850.843 AUD                 | 67.927.682 US\$     | 20.07.2023       | UBS AG                      | 2         | (765.113)                       | (0,05)               |
| 27.970.507 AUD                  | 18.847.838 US\$     | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 43        | (220.618)                       | (0,02)               |
| 629.256 US\$                    | 964.756 AUD         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (13.232)                        | (0,00)               |
| 162.694 US\$                    | 249.336 AUD         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 6         | (3.354)                         | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen CNY</i> |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 213.653 CNY                     | 30.112 US\$         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 2         | (707)                           | (0,00)               |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Devisenterminkontrakte (1,84 %) (31. Dezember 2022: (0,54 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>   |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 28.069.563 €  | 30.852.883 US\$     | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 36        | (205.171)                       | (0,01)               |
| 326.630 US\$  | 300.356 €           | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 2         | (1.313)                         | (0,00)               |
| 245.434 US\$  | 228.229 €           | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 8         | (3.758)                         | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>   |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 247.117 £   | 315.004 US\$        | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 3         | (798)                           | (0,00)               |
| 237.937 US\$  | 189.061 £           | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 2         | (2.452)                         | (0,00)               |
| 2.502.497 US\$  | 1.991.062 £         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 15        | (29.114)                        | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen HKD</i>   |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 88.542.384 HKD  | 11.333.885 US\$     | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (32.310)                        | (0,00)               |
| 11.225.389 HKD  | 1.435.626 US\$      | 20.07.2023       | UBS AG                      | 3         | (2.815)                         | (0,00)               |
| 327.735.487 HKD   | 41.918.471 US\$     | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 65        | (86.222)                        | (0,01)               |
| 295.137 US\$  | 2.312.354 HKD       | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | (13)                            | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen JPY</i>   |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 154.508.187 ¥   | 1.110.737 US\$      | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (39.162)                        | (0,00)               |
| 29.623.584.364 ¥  | 229.708.768 US\$    | 20.07.2023       | UBS AG                      | 3         | (24.257.539)                    | (1,64)               |
| 391.579.663 ¥   | 2.882.027 US\$      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 4         | (166.268)                       | (0,01)               |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>   |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 22.180.211 SGD  | 16.780.346 US\$     | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 3         | (381.766)                       | (0,03)               |
| 22.436.926 SGD  | 16.947.728 US\$     | 20.07.2023       | UBS AG                      | 4         | (359.351)                       | (0,03)               |
| 7.457.381 SGD   | 5.587.800 US\$      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 65        | (74.308)                        | (0,01)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>oo</sup></b> |                     |                  |                             |           | <b>(27.047.783)</b>             | <b>(1,84)</b>        |

## Futures-Kontrakte (0,25 %) (31. Dezember 2022: (0,11 %))

| Anzahl Kontrakte   | Beschreibung   | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|--|---------------------------------|----------------------|
| 17   | 3 Month SONIA Future September 2024                      | (5.133)                         | (0,00)               |
| 190  | 3-Month Euro EURIBOR Future June 2024                    | (103.645)                       | (0,01)               |
| 40   | Australian Government Bond 10-Year Future September 2023 | (20.092)                        | (0,00)               |
| 357  | Canadian 2-Year Bond Future September 2023               | (210.291)                       | (0,02)               |
| 65   | Euro-BOBL Future September 2023                          | (126.933)                       | (0,01)               |
| (63)   | Euro-BTP Future September 2023                           | (28.180)                        | (0,00)               |
| 425  | Euro-Schatz Future September 2023                        | (355.502)                       | (0,02)               |
| 41   | United Kingdom Long Gilt Future September 2023           | (39.463)                        | (0,00)               |
| 561  | US Treasury 10-Year Note (CBT) Future September 2023     | (866.307)                       | (0,06)               |
| 670  | US Treasury 2-Year Note (CBT) Future September 2023      | (852.290)                       | (0,06)               |
| 244  | US Treasury 5-Year Note (CBT) Future September 2023      | (203.452)                       | (0,01)               |
| (527)  | US Treasury Ultra Bond (CBT) Future September 2023       | (835.074)                       | (0,06)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten *</b> |  | <b>(3.646.362)</b>              | <b>(0,25)</b>        |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Credit-Default-Swap-Kontrakte (0,00 %) (31. Dezember 2022: (0,01 %))

|   | Nominalwert | Fälligkeit | Gegenpartei                 | Referenzverbindlichkeit                                  | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|------------|-----------------------------|--|------------------|------------------------------|
| EUR   | 2.000.000   | 20.06.2028 | ICE Clear U.S. <sup>1</sup> | Buying default protection on iTRAXX Europe Crossover S39 | (86.715)         | (0,00)                       |
| <b>Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten insgesamt <sup>±</sup></b> |             |            |                             |  | <b>(86.715)</b>  | <b>(0,00)</b>                |

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

### Zinsswap-Kontrakte (0,08 %) (31. Dezember 2022: (0,07 %))

|   | Nominalwert | Fälligkeit | Gegenpartei                              | Erhalt/(Zahlung) <sup>#</sup> | Fester<br>Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht<br>realisierter<br>Verlust US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|------------|--|-------------------------------|--------------------|--------------------|---------------------------------------|------------------------------|
| AUD   | 1.827.000   | 06.06.2033 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 4,26 %             | 6M BBSW            | (14.287)                              | (0,00)                       |
| AUD   | 7.922.000   | 06.06.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 4,23 %             | 6M BBSW            | (33.293)                              | (0,00)                       |
| CAD   | 16.050.000  | 07.06.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 4,91 %             | 3M CDOR            | (50.259)                              | (0,00)                       |
| CAD   | 24.488.000  | 26.05.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 4,85 %             | 3M CDOR            | (96.436)                              | (0,01)                       |
| BRL   | 3.860.376   | 04.01.2027 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 6,17 %             | 1D BROIS           | (170.615)                             | (0,01)                       |
| BRL   | 6.266.079   | 02.01.2025 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 6,17 %             | 1D BROIS           | (216.695)                             | (0,02)                       |
| CAD   | 13.647.000  | 17.02.2027 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 2,67 %             | 3M CDOR            | (609.058)                             | (0,04)                       |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Zinsswapkontrakten <sup>∞</sup></b> |             |            |  |                               |                    |                    | <b>(1.190.643)</b>                    | <b>(0,08)</b>                |

<sup>#</sup>Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

|   | Zeitwert<br>US\$     | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|----------------------|------------------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(31.971.503)</b>  | <b>(2,17)</b>                |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>1.586.220.156</b> | <b>107,50</b>                |
| <b>Sonstige Nettoverbindlichkeiten</b>  | <b>(110.713.470)</b> | <b>(7,50)</b>                |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>1.475.506.686</b> | <b>100,00</b>                |

<sup>^</sup> Schuldverschreibungen mit einem Zinssatz von 0,00 %, wurden zum 30. Juni 2023 eventuell noch nicht abgerechnet und haben somit keinen gültigen Zinssatz. Die Zinssätze werden erst bei Abrechnung gültig.

| Portfolioanalyse  | US\$                 | % des<br>Gesamtver-<br>mögens |
|---|----------------------|-------------------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 420.402.599          | 23,59                         |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden            | 1.118.032.000        | 62,73                         |
| † Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente  | 14.425.911           | 0,81                          |
| µ Investmentfonds   | 59.384.472           | 3,33                          |
| ± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden                          | (3.190.987)          | (0,18)                        |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap                            | (22.833.839)         | (1,28)                        |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>1.586.220.156</b> | <b>89,00</b>                  |

## Sustainable Asia High Yield - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 86,19 % (31. Dezember 2022: 86,13 %)</b> |   |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 240.000  | Adani Green Energy Ltd*   | 4,38 % | 08.09.2024            | 221.980          | 0,78                         |
| 400.000  | Adani Green Energy UP Ltd/Prayatna Developers Pvt Ltd/Parampujya Solar Energ* | 6,25 % | 10.12.2024            | 383.919          | 1,35                         |
| 700.000  | Agile Group Holdings Ltd*   | 6,05 % | 13.10.2025            | 167.765          | 0,59                         |
| 300.000  | Agile Group Holdings Ltd*   | 8,38 % | 29.12.2049            | 37.996           | 0,13                         |
| 200.000  | Axis Bank Ltd*  | 4,10 % | 29.12.2049            | 175.014          | 0,62                         |
| 200.000  | Bangkok Bank PCL**  | 3,73 % | 25.09.2034            | 169.780          | 0,60                         |
| 300.000  | Bangkok Bank PCL**  | 5,00 % | 29.12.2049            | 284.586          | 1,00                         |
| 600.000  | Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT**  | 3,75 % | 30.03.2026            | 555.773          | 1,96                         |
| 400.000  | Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT*   | 4,30 % | 29.12.2049            | 331.502          | 1,17                         |
| 450.000  | CAS Capital No 1 Ltd*   | 4,00 % | 29.12.2049            | 373.725          | 1,32                         |
| 200.000  | Champion Path Holdings Ltd*   | 4,85 % | 27.01.2028            | 162.000          | 0,57                         |
| 200.000  | China Hongqiao Group Ltd*   | 6,25 % | 08.06.2024            | 196.720          | 0,69                         |
| 700.000  | China SCE Group Holdings Ltd*   | 7,00 % | 02.05.2025            | 101.500          | 0,36                         |
| 300.000  | CIFI Holdings Group Co Ltd*   | 5,95 % | 20.10.2025            | 34.782           | 0,12                         |
| 651.000  | Continuum Energy Levanter Pte Ltd**   | 4,50 % | 09.02.2027            | 607.057          | 2,14                         |
| 250.000  | Country Garden Holdings Co Ltd*   | 3,13 % | 22.10.2025            | 78.787           | 0,28                         |
| 350.000  | Country Garden Holdings Co Ltd*   | 4,80 % | 06.08.2030            | 101.365          | 0,36                         |
| 250.000  | Country Garden Holdings Co Ltd*   | 5,13 % | 17.01.2025            | 109.994          | 0,39                         |
| 700.000  | Country Garden Holdings Co Ltd*   | 5,13 % | 14.01.2027            | 221.733          | 0,78                         |
| 300.000  | Elect Global Investments Ltd*   | 4,10 % | 29.12.2049            | 270.240          | 0,95                         |
| 300.000  | ENN Clean Energy International Investment Ltd*                                | 3,38 % | 12.05.2026            | 277.955          | 0,98                         |
| 200.000  | Fortune Star BVI Ltd*   | 5,00 % | 18.05.2026            | 150.210          | 0,53                         |
| 200.000  | Fortune Star BVI Ltd*   | 5,95 % | 19.10.2025            | 160.320          | 0,57                         |
| 500.000  | Franshion Brilliant Ltd*  | 4,25 % | 23.07.2029            | 397.517          | 1,40                         |
| 200.000  | FWD Group Ltd*  | 8,05 % | 29.12.2049            | 181.797          | 0,64                         |
| 200.000  | GENM Capital Labuan Ltd*  | 3,88 % | 19.04.2031            | 161.973          | 0,57                         |
| 729.000  | Globe Telecom Inc*  | 4,20 % | 29.12.2049            | 678.881          | 2,39                         |
| 300.000  | GLP Pte Ltd*  | 4,50 % | 29.12.2049            | 112.179          | 0,40                         |
| 376.000  | Greenko Dutch BV**  | 3,85 % | 29.03.2026            | 338.455          | 1,19                         |
| 1.298.500  | Greenko Power II Ltd*   | 4,30 % | 13.12.2028            | 1.131.855        | 3,99                         |
| 300.000  | Greenko Solar Mauritius Ltd*  | 5,95 % | 29.07.2026            | 282.000          | 0,99                         |
| 400.000  | HDFC Bank Ltd**   | 3,70 % | 29.12.2049            | 347.467          | 1,23                         |
| 400.000  | Huarong Finance 2017 Co Ltd*  | 4,75 % | 27.04.2027            | 346.438          | 1,22                         |
| 400.000  | Huarong Finance 2019 Co Ltd*  | 3,38 % | 24.02.2030            | 303.360          | 1,07                         |
| 200.000  | Huarong Finance 2019 Co Ltd*  | 3,88 % | 13.11.2029            | 154.442          | 0,54                         |
| 200.000  | Huarong Finance 2019 Co Ltd*  | 4,50 % | 29.05.2029            | 160.502          | 0,57                         |
| 200.000  | Huarong Finance II Co Ltd*  | 4,63 % | 03.06.2026            | 178.258          | 0,63                         |
| 200.000  | Huarong Finance II Co Ltd*  | 5,50 % | 16.01.2025            | 190.291          | 0,67                         |
| 200.000  | Hyundai Capital America**   | 5,68 % | 26.06.2028            | 198.506          | 0,70                         |
| 588.000  | JSW Hydro Energy Ltd*   | 4,13 % | 18.05.2031            | 496.625          | 1,75                         |

## Sustainable Asia High Yield - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung  | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 86,19 % (31. Dezember 2022: 86,13 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |        |                       |                   |                              |
| 400.000  | JSW Steel Ltd*   | 5,05 % | 05.04.2032            | 323.582           | 1,14                         |
| 400.000  | Kasikornbank PCL*  | 3,34 % | 02.10.2031            | 353.492           | 1,25                         |
| 200.000  | Lenovo Group Ltd*  | 3,42 % | 02.11.2030            | 168.672           | 0,59                         |
| 273.000  | Lenovo Group Ltd*  | 5,83 % | 27.01.2028            | 272.498           | 0,96                         |
| 200.000  | Longfor Group Holdings Ltd*                                      | 3,95 % | 16.09.2029            | 149.752           | 0,53                         |
| 500.000  | Medco Bell Pte Ltd*  | 6,38 % | 30.01.2027            | 468.518           | 1,65                         |
| 300.000  | Medco Oak Tree Pte Ltd*  | 7,38 % | 14.05.2026            | 295.394           | 1,04                         |
| 300.000  | Meituan*   | 3,05 % | 28.10.2030            | 237.846           | 0,84                         |
| 900.000  | Melco Resorts Finance Ltd*                                       | 5,38 % | 04.12.2029            | 748.246           | 2,64                         |
| 700.000  | Melco Resorts Finance Ltd*                                       | 5,75 % | 21.07.2028            | 619.500           | 2,18                         |
| 360.000  | MGM China Holdings Ltd*  | 5,88 % | 15.05.2026            | 343.343           | 1,21                         |
| 600.000  | Network i2i Ltd*   | 5,65 % | 29.12.2049            | 584.250           | 2,06                         |
| 200.000  | New Metro Global Ltd*  | 4,80 % | 15.12.2024            | 136.930           | 0,48                         |
| 400.000  | NWD Finance BVI Ltd*   | 4,13 % | 29.12.2049            | 271.760           | 0,96                         |
| 260.000  | NWD MTN Ltd*   | 4,13 % | 18.07.2029            | 213.243           | 0,75                         |
| 700.000  | PCPD Capital Ltd*  | 5,13 % | 18.06.2026            | 560.000           | 1,97                         |
| 400.000  | Periama Holdings LLC*  | 5,95 % | 19.04.2026            | 385.872           | 1,36                         |
| 200.000  | Philippine National Bank*  | 3,28 % | 27.09.2024            | 193.790           | 0,68                         |
| 600.000  | ReNew Wind Energy AP2/ReNew Power Pvt Ltd other 9 Subsidiaries** | 4,50 % | 14.07.2028            | 511.912           | 1,81                         |
| 781.000  | RKPF Overseas 2020 A Ltd*  | 5,20 % | 12.01.2026            | 419.016           | 1,48                         |
| 200.000  | Sands China Ltd**  | 3,75 % | 08.08.2031            | 162.957           | 0,57                         |
| 1.200.000  | Sands China Ltd*   | 5,90 % | 08.08.2028            | 1.144.980         | 4,04                         |
| 330.000  | Shriram Finance Ltd*   | 4,40 % | 13.03.2024            | 322.929           | 1,14                         |
| 450.000  | Shui On Development Holding Ltd*                                 | 6,15 % | 24.08.2024            | 393.750           | 1,39                         |
| 300.000  | Sino-Ocean Land Treasure IV Ltd*                                 | 2,70 % | 13.01.2025            | 95.250            | 0,34                         |
| 500.000  | Sino-Ocean Land Treasure IV Ltd*                                 | 4,75 % | 05.08.2029            | 102.056           | 0,36                         |
| 200.000  | SK Hynix Inc*  | 6,50 % | 17.01.2033            | 202.054           | 0,71                         |
| 1.150.000  | Standard Chartered Plc*  | 4,30 % | 29.12.2049            | 835.935           | 2,95                         |
| 200.000  | Standard Chartered Plc*  | 4,75 % | 29.12.2049            | 146.155           | 0,52                         |
| 262.000  | Standard Chartered Plc**   | 6,30 % | 06.07.2034            | 262.439           | 0,93                         |
| 486.480  | Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd*                         | 6,75 % | 24.04.2033            | 478.086           | 1,69                         |
| 200.000  | Studio City Finance Ltd*   | 6,00 % | 15.07.2025            | 185.897           | 0,66                         |
| 800.000  | Studio City Finance Ltd*   | 6,50 % | 15.01.2028            | 668.864           | 2,36                         |
| 400.000  | Vedanta Resources Finance II Plc*                                | 8,95 % | 11.03.2025            | 302.412           | 1,07                         |
| 300.000  | Wynn Macau Ltd*  | 5,50 % | 01.10.2027            | 267.368           | 0,94                         |
| 600.000  | Wynn Macau Ltd*  | 5,63 % | 26.08.2028            | 524.202           | 1,85                         |
| 310.000  | Yanlord Land HK Co Ltd*  | 5,13 % | 20.05.2026            | 255.270           | 0,90                         |
| <b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>24.443.469</b> | <b>86,19</b>                 |



## Sustainable Asia High Yield - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag                                       | Wertpapierbezeichnung                    | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 6,40 % (31. Dezember 2022: 2,63 %)</b> |  |        |                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |  |        |                       |                   |                              |
| 333.000  | Philippine Government International Bond | 5,00 % | 17.07.2033            | 337.606           | 1,19                         |
| 600.000  | Sri Lanka Government International Bond  | 5,75 % | 18.04.2023            | 273.695           | 0,97                         |
| 200.000  | Sri Lanka Government International Bond  | 5,88 % | 25.07.2024            | 93.028            | 0,33                         |
| 600.000  | Sri Lanka Government International Bond  | 6,13 % | 03.06.2025            | 286.232           | 1,01                         |
| 1.150.000  | Sri Lanka Government International Bond  | 6,85 % | 03.11.2025            | 548.004           | 1,93                         |
| 600.000  | Sri Lanka Government International Bond  | 7,55 % | 28.03.2030            | 276.239           | 0,97                         |
| <b>Staatsanleihen insgesamt *</b>                        |  |        |                       | <b>1.814.804</b>  | <b>6,40</b>                  |
| <b>Anlagen insgesamt</b>                                 |  |        |                       | <b>26.258.273</b> | <b>92,59</b>                 |

Devisenterminkontrakte 0,06 % (31. Dezember 2022: 0,88 %)

| Geforderter<br>Betrag   | Zu zahlender<br>Betrag | Fälligkeits-<br>datum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|------------------------|-----------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------------|------------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>   |                        |                       |                                |           |                                      |                              |
| 11.571 €  | 12.469 US\$            | 20.07.2023            | Goldman Sachs International    | 3         | 165                                  | 0,00                         |
| 9.486 €   | 10.218 US\$            | 20.07.2023            | Westpac Banking Corp           | 3         | 139                                  | 0,00                         |
| 29.755 US\$   | 27.036 €               | 20.07.2023            | Goldman Sachs International    | 3         | 235                                  | 0,00                         |
| 13.715 US\$   | 12.375 €               | 20.07.2023            | Standard Chartered Bank        | 1         | 204                                  | 0,00                         |
| 15.735 US\$   | 14.303 €               | 20.07.2023            | State Street Bank and Trust Co | 1         | 119                                  | 0,00                         |
| 1.726.337 US\$  | 1.567.387 €            | 20.07.2023            | Westpac Banking Corp           | 4         | 14.989                               | 0,06                         |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>   |                        |                       |                                |           |                                      |                              |
| 1.067 £   | 1.337 US\$             | 20.07.2023            | Goldman Sachs International    | 3         | 19                                   | 0,00                         |
| 734 £   | 919 US\$               | 20.07.2023            | Standard Chartered Bank        | 1         | 14                                   | 0,00                         |
| 18.862 £  | 23.521 US\$            | 20.07.2023            | State Street Bank and Trust Co | 1         | 462                                  | 0,00                         |
| 19.631 £  | 24.519 US\$            | 20.07.2023            | Westpac Banking Corp           | 4         | 442                                  | 0,00                         |
| 330 US\$  | 259 £                  | 20.07.2023            | Goldman Sachs International    | 1         | 1                                    | 0,00                         |
| 365 US\$  | 286 £                  | 20.07.2023            | Westpac Banking Corp           | 1         | 1                                    | 0,00                         |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                        |                       |                                |           | <b>16.790</b>                        | <b>0,06</b>                  |

Futures-Kontrakte 0,09 % (31. Dezember 2022: 0,04 %)

| Anzahl<br>Kontrakte   | Beschreibung   | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--|--------------------------------------|------------------------------|
| (18)  | US Treasury 10-Year Note (CBT) Future September 2023 | 26.898                               | 0,09                         |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten *</b> |  | <b>26.898</b>                        | <b>0,09</b>                  |

|  |  | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|-------------------|------------------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> |  | <b>26.301.961</b> | <b>92,74</b>                 |

## Sustainable Asia High Yield - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (0,05 %) (31. Dezember 2022: (0,09 %))

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>  |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 2.572 €  | 2.813 US\$          | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | (4)                             | (0,00)               |
| 31.960 €   | 35.193 US\$         | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 1         | (298)                           | (0,00)               |
| 991.805 €  | 1.090.702 US\$      | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (7.801)                         | (0,03)               |
| 1.002.704 €  | 1.099.417 US\$      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 2         | (4.616)                         | (0,02)               |
| 4.358 US\$   | 3.996 €             | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | (5)                             | (0,00)               |
| 9.287 US\$   | 8.599 €             | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 2         | (102)                           | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>  |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 234 £  | 299 US\$            | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (2)                             | (0,00)               |
| 1.588 US\$   | 1.271 £             | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 4         | (28)                            | (0,00)               |
| 337 US\$   | 269 £               | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (5)                             | (0,00)               |
| 1.441 US\$   | 1.153 £             | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 4         | (25)                            | (0,00)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                                |           | <b>(12.886)</b>                 | <b>(0,05)</b>        |

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

| Anzahl Kontrakte  | Beschreibung                                       | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|--|---------------------------------|----------------------|
| 1   | US Treasury Ultra Bond (CBT) Future September 2023 | (1.250)                         | (0,00)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten <sup>*</sup></b> |  | <b>(1.250)</b>                  | <b>(0,00)</b>        |

|   | Zeitwert US\$     | % des Nettovermögens |
|---|-------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(14.136)</b>   | <b>(0,05)</b>        |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>26.287.825</b> | <b>92,69</b>         |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>2.072.921</b>  | <b>7,31</b>          |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>28.360.746</b> | <b>100,00</b>        |

| Portfolioanalyse  | US\$              | % des Gesamtvermögens |
|---|-------------------|-----------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 22.819.341        | 79,11                 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden            | 3.438.932         | 11,92                 |
| ± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden                          | 25.648            | 0,09                  |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente   | 3.904             | 0,01                  |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>26.287.825</b> | <b>91,13</b>          |

## Sustainable Emerging Market Corporate Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 87,97 % (31. Dezember 2022: 88,54 %)</b> |   |        |                       |                  |                              |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi</b>                                |   |        |                       |                  |                              |
| 550.000  | Bank of Chengdu Co Ltd*   | 0,40 % | 03.03.2028            | 88.386           | 0,09                         |
| 1.500.000  | China Southern Airlines Co Ltd*   | 0,60 % | 15.10.2026            | 258.395          | 0,27                         |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt</b>                      |   |        |                       | <b>346.781</b>   | <b>0,36</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 391.000  | ABQ Finance Ltd*  | 3,13 % | 24.09.2024            | 378.196          | 0,39                         |
| 268.000  | Abu Dhabi Commercial Bank PJSC*   | 4,50 % | 14.09.2027            | 264.160          | 0,27                         |
| 300.000  | Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC*   | 4,60 % | 02.11.2047            | 279.031          | 0,29                         |
| 301.000  | Abu Dhabi National Energy Co PJSC*  | 4,70 % | 24.04.2033            | 299.673          | 0,31                         |
| 200.000  | Access Bank Plc*  | 6,13 % | 21.09.2026            | 169.740          | 0,18                         |
| 500.000  | Adani Green Energy UP Ltd/Prayatna Developers Pvt Ltd/Parampujya Solar Energ* | 6,25 % | 10.12.2024            | 479.898          | 0,50                         |
| 217.000  | Africa Finance Corp*  | 2,88 % | 28.04.2028            | 179.568          | 0,19                         |
| 335.000  | African Export-Import Bank*   | 3,99 % | 21.09.2029            | 283.800          | 0,29                         |
| 200.000  | Agile Group Holdings Ltd*   | 8,38 % | 29.12.2049            | 25.331           | 0,03                         |
| 303.000  | AIA Group Ltd*  | 2,70 % | 29.12.2049            | 269.621          | 0,28                         |
| 300.000  | AIA Group Ltd**   | 3,60 % | 09.04.2029            | 277.943          | 0,29                         |
| 200.000  | AIA Group Ltd**   | 4,95 % | 04.04.2033            | 200.205          | 0,21                         |
| 352.000  | Akbank TAS**  | 6,80 % | 06.02.2026            | 336.741          | 0,35                         |
| 320.000  | Aldar Investment Properties Sukuk Ltd*  | 4,88 % | 24.05.2033            | 318.000          | 0,33                         |
| 363.201  | Alfa Desarrollo SpA**   | 4,55 % | 27.09.2051            | 266.845          | 0,28                         |
| 450.000  | Alfa SAB de CV**  | 6,88 % | 25.03.2044            | 452.273          | 0,47                         |
| 200.000  | Alpek SAB de CV**   | 4,25 % | 18.09.2029            | 178.650          | 0,18                         |
| 206.000  | Alsea SAB de CV**   | 7,75 % | 14.12.2026            | 204.605          | 0,21                         |
| 400.000  | Altice Financing SA*  | 5,00 % | 15.01.2028            | 320.100          | 0,33                         |
| 200.000  | Altice Financing SA**   | 5,75 % | 15.08.2029            | 155.152          | 0,16                         |
| 300.000  | America Movil SAB de CV*  | 4,70 % | 21.07.2032            | 289.597          | 0,30                         |
| 450.000  | Anglo American Capital Plc*   | 3,88 % | 16.03.2029            | 409.312          | 0,42                         |
| 200.000  | AngloGold Ashanti Holdings Plc*   | 3,38 % | 01.11.2028            | 175.361          | 0,18                         |
| 260.000  | AngloGold Ashanti Holdings Plc*   | 3,75 % | 01.10.2030            | 223.381          | 0,23                         |
| 388.000  | Antofagasta Plc*  | 5,63 % | 13.05.2032            | 386.119          | 0,40                         |
| 381.000  | Arabian Centres Sukuk II Ltd*   | 5,63 % | 07.10.2026            | 349.516          | 0,36                         |
| 200.000  | Axiata Spv5 Labuan Ltd*   | 3,06 % | 19.08.2050            | 141.439          | 0,15                         |
| 200.000  | Banco BTG Pactual SA*   | 2,75 % | 11.01.2026            | 182.521          | 0,19                         |
| 400.000  | Banco Davivienda SA**   | 6,65 % | 29.12.2049            | 294.747          | 0,30                         |
| 300.000  | Banco de Chile**  | 2,99 % | 09.12.2031            | 256.401          | 0,27                         |
| 400.000  | Banco de Credito del Peru SA**  | 3,13 % | 01.07.2030            | 367.481          | 0,38                         |
| 300.000  | Banco de Credito e Inversiones SA**   | 2,88 % | 14.10.2031            | 248.786          | 0,26                         |
| 351.000  | Banco do Brasil SA**  | 6,25 % | 18.04.2030            | 349.157          | 0,36                         |
| 300.000  | Banco do Brasil SA*   | 6,25 % | 29.12.2049            | 267.256          | 0,28                         |
| 300.000  | Banco Internacional del Peru SAA Interbank**                                  | 3,25 % | 04.10.2026            | 279.343          | 0,29                         |

## Sustainable Emerging Market Corporate Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 87,97 % (31. Dezember 2022: 88,54 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 384.000  | Banco Mercantil del Norte SA**  | 6,63 % | 29.12.2049            | 297.216          | 0,31                         |
| 250.000  | Banco Mercantil del Norte SA*   | 7,63 % | 29.12.2049            | 227.779          | 0,24                         |
| 241.000  | Banco Santander Chile**   | 3,18 % | 26.10.2031            | 209.015          | 0,22                         |
| 395.000  | Bancolombia SA*   | 4,63 % | 18.12.2029            | 336.556          | 0,35                         |
| 648.000  | Bangkok Bank PCL**  | 3,73 % | 25.09.2034            | 550.088          | 0,57                         |
| 320.000  | Bangkok Bank PCL*   | 4,30 % | 15.06.2027            | 311.240          | 0,32                         |
| 225.000  | Bangkok Bank PCL**  | 5,00 % | 29.12.2049            | 213.439          | 0,22                         |
| 200.000  | Bank Hapoalim BM*   | 3,26 % | 21.01.2032            | 171.796          | 0,18                         |
| 285.000  | Bank Leumi Le-Israel BM*  | 3,28 % | 29.01.2031            | 255.400          | 0,26                         |
| 333.000  | Bank Muscat SAOG*   | 4,75 % | 17.03.2026            | 322.845          | 0,33                         |
| 413.000  | Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT**                                  | 3,75 % | 30.03.2026            | 382.474          | 0,40                         |
| 200.000  | Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT*                                   | 4,30 % | 29.12.2049            | 165.751          | 0,17                         |
| 400.000  | BBVA Bancomer SA**  | 5,13 % | 18.01.2033            | 347.453          | 0,36                         |
| 249.000  | Bidvest Group UK Plc*   | 3,63 % | 23.09.2026            | 222.575          | 0,23                         |
| 700.000  | BOC Aviation Ltd*   | 3,00 % | 11.09.2029            | 615.849          | 0,64                         |
| 405.000  | BOC Aviation Ltd**  | 3,50 % | 18.09.2027            | 378.719          | 0,39                         |
| 240.000  | BOC Aviation Ltd*   | 4,50 % | 23.05.2028            | 232.118          | 0,24                         |
| 200.000  | BOC Aviation USA Corp**   | 4,88 % | 03.05.2033            | 194.791          | 0,20                         |
| 437.000  | Braskem Netherlands Finance BV*   | 7,25 % | 13.02.2033            | 429.700          | 0,44                         |
| 200.000  | BRF SA**  | 4,88 % | 24.01.2030            | 162.850          | 0,17                         |
| 385.000  | BSF Finance*  | 5,50 % | 23.11.2027            | 391.874          | 0,41                         |
| 200.000  | C&W Senior Financing DAC**  | 6,88 % | 15.09.2027            | 174.680          | 0,18                         |
| 400.000  | Canacol Energy Ltd**  | 5,75 % | 24.11.2028            | 342.503          | 0,35                         |
| 200.000  | CAS Capital No 1 Ltd*   | 4,00 % | 29.12.2049            | 166.088          | 0,17                         |
| 321.000  | CBQ Finance Ltd*  | 2,00 % | 12.05.2026            | 293.258          | 0,30                         |
| 200.000  | Cemex SAB de CV**   | 5,13 % | 29.12.2049            | 178.165          | 0,18                         |
| 200.000  | Cemex SAB de CV**   | 5,45 % | 19.11.2029            | 193.005          | 0,20                         |
| 534.000  | Cemex SAB de CV**   | 9,13 % | 29.12.2049            | 541.474          | 0,56                         |
| 700.000  | Cencosud SA*  | 4,38 % | 17.07.2027            | 665.067          | 0,69                         |
| 300.000  | Central American Bottling Corp/CBC Bottling Holdco SL/Beliv Holdco SL** | 5,25 % | 27.04.2029            | 277.471          | 0,29                         |
| 200.000  | Champion Path Holdings Ltd*   | 4,85 % | 27.01.2028            | 162.000          | 0,17                         |
| 200.000  | China Cinda Finance 2017 I Ltd*   | 4,75 % | 08.02.2028            | 192.393          | 0,20                         |
| 300.000  | China Construction Bank Corp*   | 2,45 % | 24.06.2030            | 280.937          | 0,29                         |
| 400.000  | China Development Bank Financial Leasing Co Ltd*                        | 2,88 % | 28.09.2030            | 375.096          | 0,39                         |
| 350.000  | China Hongqiao Group Ltd*   | 6,25 % | 08.06.2024            | 344.120          | 0,36                         |
| 200.000  | China Overseas Finance Cayman VI Ltd*                                   | 6,45 % | 11.06.2034            | 212.550          | 0,22                         |
| 200.000  | China SCE Group Holdings Ltd*   | 7,00 % | 02.05.2025            | 29.000           | 0,03                         |
| 300.000  | Cibanco SA Ibm/PLA Administradora Industrial S de RL de CV**            | 4,96 % | 18.07.2029            | 282.048          | 0,29                         |

## Sustainable Emerging Market Corporate Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 87,97 % (31. Dezember 2022: 88,54 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |        |                       |                  |                              |
| 600.000  | CIFI Holdings Group Co Ltd*                          | 5,95 % | 20.10.2025            | 69.564           | 0,07                         |
| 200.000  | CK Hutchison International 21 Ltd*                   | 2,50 % | 15.04.2031            | 169.488          | 0,18                         |
| 400.000  | CK Hutchison International 23 Ltd*                   | 4,88 % | 21.04.2033            | 396.033          | 0,41                         |
| 320.000  | CMB International Leasing Management Ltd*            | 1,88 % | 12.08.2025            | 295.639          | 0,31                         |
| 390.000  | Commercial Bank of Dubai PSC*                        | 5,32 % | 14.06.2028            | 388.401          | 0,40                         |
| 200.000  | Commercial Bank PSQC*                                | 4,50 % | 29.12.2049            | 181.270          | 0,19                         |
| 200.000  | Compania Cervecerias Unidas SA**                     | 3,35 % | 19.01.2032            | 170.674          | 0,18                         |
| 279.000  | Continuum Energy Levanter Pte Ltd**                  | 4,50 % | 09.02.2027            | 260.167          | 0,27                         |
| 300.000  | Country Garden Holdings Co Ltd*                      | 3,13 % | 22.10.2025            | 94.545           | 0,10                         |
| 353.000  | Country Garden Holdings Co Ltd*                      | 4,80 % | 06.08.2030            | 102.234          | 0,11                         |
| 239.000  | CSN Inova Ventures**                                 | 6,75 % | 28.01.2028            | 221.955          | 0,23                         |
| 400.000  | CSN Resources SA**                                   | 4,63 % | 10.06.2031            | 305.739          | 0,32                         |
| 355.000  | CT Trust**   | 5,13 % | 03.02.2032            | 285.239          | 0,29                         |
| 300.000  | DBS Group Holdings Ltd**                             | 1,82 % | 10.03.2031            | 268.503          | 0,28                         |
| 200.000  | DBS Group Holdings Ltd*                              | 4,52 % | 11.12.2028            | 198.553          | 0,21                         |
| 323.000  | DIB Sukuk Ltd*                                       | 1,96 % | 22.06.2026            | 295.695          | 0,31                         |
| 322.000  | DIB Sukuk Ltd*                                       | 4,80 % | 16.08.2028            | 321.730          | 0,33                         |
| 308.000  | DIB Sukuk Ltd*                                       | 5,49 % | 30.11.2027            | 315.479          | 0,33                         |
| 250.000  | DIB Tier 1 Sukuk 3 Ltd*                              | 6,25 % | 29.12.2049            | 250.125          | 0,26                         |
| 273.000  | Eastern & Southern African Trade & Development Bank* | 4,13 % | 30.06.2028            | 215.479          | 0,22                         |
| 263.000  | Ecopetrol SA*  | 4,63 % | 02.11.2031            | 203.263          | 0,21                         |
| 680.000  | Ecopetrol SA*  | 5,88 % | 28.05.2045            | 466.549          | 0,48                         |
| 200.000  | Ecopetrol SA*  | 6,88 % | 29.04.2030            | 182.602          | 0,19                         |
| 300.000  | Ecopetrol SA*  | 7,38 % | 18.09.2043            | 250.380          | 0,26                         |
| 687.000  | Ecopetrol SA*  | 8,88 % | 13.01.2033            | 680.882          | 0,70                         |
| 200.000  | EI Sukuk Co Ltd*                                     | 1,83 % | 23.09.2025            | 185.502          | 0,19                         |
| 300.000  | EIG Pearl Holdings Sarl*                             | 3,55 % | 31.08.2036            | 256.468          | 0,27                         |
| 224.000  | EIG Pearl Holdings Sarl*                             | 4,39 % | 30.11.2046            | 176.284          | 0,18                         |
| 275.000  | Elect Global Investments Ltd*                        | 4,10 % | 29.12.2049            | 247.720          | 0,26                         |
| 292.000  | Emaar Sukuk Ltd*                                     | 3,88 % | 17.09.2029            | 274.639          | 0,28                         |
| 200.000  | Emirates NBD Bank PJSC*                              | 4,25 % | 29.12.2049            | 178.588          | 0,18                         |
| 329.000  | Emirates NBD Bank PJSC*                              | 5,63 % | 21.10.2027            | 338.349          | 0,35                         |
| 300.000  | Emirates NBD Bank PJSC*                              | 6,13 % | 29.12.2049            | 296.719          | 0,31                         |
| 531.000  | Endeavour Mining Plc**                               | 5,00 % | 14.10.2026            | 472.325          | 0,49                         |
| 205.000  | Enel Chile SA*                                       | 4,88 % | 12.06.2028            | 197.248          | 0,20                         |
| 200.000  | Energiean Israel Finance Ltd*                        | 4,88 % | 30.03.2026            | 186.133          | 0,19                         |
| 200.000  | Energiean Israel Finance Ltd*                        | 5,88 % | 30.03.2031            | 174.900          | 0,18                         |
| 235.294  | Energiean Israel Finance Ltd**                       | 8,50 % | 30.09.2033            | 235.147          | 0,24                         |

## Sustainable Emerging Market Corporate Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                      | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 87,97 % (31. Dezember 2022: 88,54 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |         |                       |                  |                              |
| 280.000  | ENN Clean Energy International Investment Ltd <sup>†</sup> | 3,38 %  | 12.05.2026            | 259.425          | 0,27                         |
| 406.000  | First Abu Dhabi Bank PJSC <sup>†</sup>                     | 5,13 %  | 13.10.2027            | 411.737          | 0,43                         |
| 400.000  | First Quantum Minerals Ltd <sup>**</sup>                   | 6,88 %  | 15.10.2027            | 390.806          | 0,40                         |
| 500.000  | Formosa Group Cayman Ltd <sup>†</sup>                      | 3,38 %  | 22.04.2025            | 479.378          | 0,50                         |
| 400.000  | Franshion Brilliant Ltd <sup>†</sup>                       | 4,25 %  | 23.07.2029            | 315.380          | 0,33                         |
| 350.000  | FS Luxembourg Sarl <sup>**</sup>                           | 10,00 % | 15.12.2025            | 358.858          | 0,37                         |
| 300.000  | Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd <sup>†</sup>              | 2,63 %  | 31.03.2036            | 242.674          | 0,25                         |
| 284.955  | Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd <sup>†</sup>              | 2,94 %  | 30.09.2040            | 229.299          | 0,24                         |
| 600.000  | GC Treasury Center Co Ltd <sup>†</sup>                     | 2,98 %  | 18.03.2031            | 496.162          | 0,51                         |
| 380.000  | GC Treasury Center Co Ltd <sup>†</sup>                     | 4,40 %  | 30.03.2032            | 343.599          | 0,36                         |
| 234.000  | GCC SAB de CV <sup>**</sup>                                | 3,61 %  | 20.04.2032            | 199.022          | 0,21                         |
| 400.000  | GENM Capital Labuan Ltd <sup>†</sup>                       | 3,88 %  | 19.04.2031            | 323.947          | 0,33                         |
| 360.000  | Globe Telecom Inc <sup>†</sup>                             | 4,20 %  | 29.12.2049            | 335.250          | 0,35                         |
| 376.000  | Greenko Dutch BV <sup>**</sup>                             | 3,85 %  | 29.03.2026            | 338.454          | 0,34                         |
| 649.250  | Greenko Power II Ltd <sup>†</sup>                          | 4,30 %  | 13.12.2028            | 565.928          | 0,59                         |
| 200.000  | Greensaif Pipelines Bidco Sarl <sup>†</sup>                | 6,51 %  | 23.02.2042            | 207.889          | 0,21                         |
| 500.000  | Grupo Aval Ltd <sup>†</sup>                                | 4,38 %  | 04.02.2030            | 392.662          | 0,41                         |
| 300.000  | Grupo Televisa SAB <sup>†</sup>                            | 6,63 %  | 15.01.2040            | 311.649          | 0,32                         |
| 442.130  | Guara Norte Sarl <sup>**</sup>                             | 5,20 %  | 15.06.2034            | 387.649          | 0,40                         |
| 245.000  | HDFC Bank Ltd <sup>**</sup>                                | 3,70 %  | 29.12.2049            | 212.823          | 0,22                         |
| 203.000  | HPHT Finance 21 Ltd <sup>**</sup>                          | 2,00 %  | 19.03.2026            | 184.215          | 0,19                         |
| 575.000  | Huarong Finance II Co Ltd <sup>†</sup>                     | 5,50 %  | 16.01.2025            | 547.085          | 0,57                         |
| 249.600  | Hunt Oil Co of Peru LLC Sucursal Del Peru <sup>**</sup>    | 6,38 %  | 01.06.2028            | 240.240          | 0,25                         |
| 300.000  | Hyundai Capital America <sup>**</sup>                      | 3,50 %  | 02.11.2026            | 278.693          | 0,29                         |
| 200.000  | IHS Holding Ltd <sup>**</sup>                              | 5,63 %  | 29.11.2026            | 175.040          | 0,18                         |
| 291.000  | IHS Netherlands Holdco BV <sup>**</sup>                    | 8,00 %  | 18.09.2027            | 265.974          | 0,27                         |
| 216.000  | Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT <sup>†</sup>             | 3,40 %  | 09.06.2031            | 182.794          | 0,19                         |
| 411.000  | Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT <sup>†</sup>             | 3,54 %  | 27.04.2032            | 346.268          | 0,36                         |
| 300.000  | InRetail Consumer <sup>**</sup>                            | 3,25 %  | 22.03.2028            | 257.916          | 0,27                         |
| 300.000  | Inversiones CMPC SA <sup>**</sup>                          | 3,00 %  | 06.04.2031            | 248.154          | 0,26                         |
| 266.000  | Inversiones CMPC SA <sup>**</sup>                          | 6,13 %  | 23.06.2033            | 267.939          | 0,28                         |
| 200.000  | Investment Energy Resources Ltd <sup>†</sup>               | 6,25 %  | 26.04.2029            | 182.384          | 0,19                         |
| 400.000  | JMH Co Ltd <sup>†</sup>                                    | 2,50 %  | 09.04.2031            | 336.859          | 0,35                         |
| 240.000  | JSW Steel Ltd <sup>†</sup>                                 | 5,05 %  | 05.04.2032            | 194.149          | 0,20                         |
| 350.000  | Kallpa Generacion SA <sup>†</sup>                          | 4,13 %  | 16.08.2027            | 327.199          | 0,34                         |
| 245.000  | Kasikornbank PCL <sup>†</sup>                              | 5,46 %  | 07.03.2028            | 245.263          | 0,25                         |
| 600.000  | KazMunayGas National Co JSC <sup>†</sup>                   | 4,75 %  | 19.04.2027            | 570.852          | 0,59                         |
| 200.000  | KazMunayGas National Co JSC <sup>†</sup>                   | 5,38 %  | 24.04.2030            | 186.126          | 0,19                         |

## Sustainable Emerging Market Corporate Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------------------|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 87,97 % (31. Dezember 2022: 88,54 %) (Fortsetzung)</b> |                                      |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |                                      |        |                       |                  |                              |
| 550.000  | KazMunayGas National Co JSC*         | 5,75 % | 19.04.2047            | 449.644          | 0,46                         |
| 207.000  | Khazanah Capital Ltd*                | 4,88 % | 01.06.2033            | 205.072          | 0,21                         |
| 200.000  | Klabin Austria GmbH*                 | 7,00 % | 03.04.2049            | 191.875          | 0,20                         |
| 223.000  | Kookmin Bank**                       | 2,50 % | 04.11.2030            | 181.160          | 0,19                         |
| 226.000  | Kookmin Bank*                        | 4,35 % | 29.12.2049            | 220.071          | 0,23                         |
| 700.000  | Kosmos Energy Ltd*                   | 7,13 % | 04.04.2026            | 616.238          | 0,64                         |
| 200.000  | Kyobo Life Insurance Co Ltd*         | 5,90 % | 15.06.2052            | 196.404          | 0,20                         |
| 400.000  | Lenovo Group Ltd*                    | 3,42 % | 02.11.2030            | 337.344          | 0,35                         |
| 171.671  | Leviathan Bond Ltd*                  | 6,50 % | 30.06.2027            | 165.508          | 0,17                         |
| 309.038  | Leviathan Bond Ltd*                  | 6,75 % | 30.06.2030            | 288.894          | 0,30                         |
| 229.000  | LG Chem Ltd*                         | 2,38 % | 07.07.2031            | 188.555          | 0,19                         |
| 200.000  | Longfor Group Holdings Ltd*          | 3,95 % | 16.09.2029            | 149.042          | 0,15                         |
| 258.000  | MAF Global Securities Ltd*           | 7,88 % | 29.12.2049            | 262.090          | 0,27                         |
| 200.000  | MAF Sukuk Ltd*                       | 4,64 % | 14.05.2029            | 195.762          | 0,20                         |
| 400.000  | MARB BondCo Plc*                     | 3,95 % | 29.01.2031            | 286.670          | 0,30                         |
| 369.108  | MC Brazil Downstream Trading Sarl**  | 7,25 % | 30.06.2031            | 249.662          | 0,26                         |
| 240.000  | MDGH GMTN RSC Ltd*                   | 4,38 % | 22.11.2033            | 231.570          | 0,24                         |
| 200.000  | MDGH GMTN RSC Ltd*                   | 5,50 % | 28.04.2033            | 210.506          | 0,22                         |
| 400.000  | Medco Bell Pte Ltd*                  | 6,38 % | 30.01.2027            | 374.814          | 0,39                         |
| 279.000  | Medco Oak Tree Pte Ltd*              | 7,38 % | 14.05.2026            | 274.717          | 0,28                         |
| 200.000  | MEGlobal BV**                        | 2,63 % | 28.04.2028            | 174.656          | 0,18                         |
| 322.000  | MEGlobal Canada ULC*                 | 5,88 % | 18.05.2030            | 325.674          | 0,34                         |
| 750.000  | Melco Resorts Finance Ltd**          | 5,63 % | 17.07.2027            | 680.194          | 0,70                         |
| 550.000  | Melco Resorts Finance Ltd*           | 5,75 % | 21.07.2028            | 486.750          | 0,50                         |
| 200.000  | MGM China Holdings Ltd**             | 4,75 % | 01.02.2027            | 182.213          | 0,19                         |
| 200.000  | MHP Lux SA*                          | 6,95 % | 03.04.2026            | 114.097          | 0,12                         |
| 250.000  | Millicom International Cellular SA** | 4,50 % | 27.04.2031            | 192.388          | 0,20                         |
| 315.000  | Millicom International Cellular SA*  | 6,25 % | 25.03.2029            | 282.726          | 0,29                         |
| 679.000  | Minera Mexico SA de CV**             | 4,50 % | 26.01.2050            | 533.653          | 0,55                         |
| 494.000  | Minerva Luxembourg SA*               | 4,38 % | 18.03.2031            | 386.897          | 0,40                         |
| 500.000  | Minsur SA**                          | 4,50 % | 28.10.2031            | 439.823          | 0,45                         |
| 300.000  | MTN Mauritius Investments Ltd*       | 6,50 % | 13.10.2026            | 296.463          | 0,31                         |
| 420.295  | MV24 Capital BV*                     | 6,75 % | 01.06.2034            | 379.691          | 0,39                         |
| 215.673  | Nakilat Inc**                        | 6,07 % | 31.12.2033            | 226.399          | 0,23                         |
| 388.000  | NBK SPC Ltd*                         | 1,63 % | 15.09.2027            | 346.329          | 0,36                         |
| 359.000  | NBK Tier 1 Financing 2 Ltd*          | 4,50 % | 29.12.2049            | 330.409          | 0,34                         |
| 200.000  | Nemak SAB de CV**                    | 3,63 % | 28.06.2031            | 156.472          | 0,16                         |
| 200.000  | Network iZi Ltd*                     | 5,65 % | 29.12.2049            | 194.750          | 0,20                         |

## Sustainable Emerging Market Corporate Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung  | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 87,97 % (31. Dezember 2022: 88,54 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |        |                       |                  |                              |
| 200.000  | Nexa Resources SA**  | 5,38 % | 04.05.2027            | 186.810          | 0,19                         |
| 343.000  | Nexa Resources SA**  | 6,50 % | 18.01.2028            | 328.631          | 0,34                         |
| 377.000  | NWD MTN Ltd*   | 4,13 % | 18.07.2029            | 309.223          | 0,32                         |
| 294.000  | Ooredoo International Finance Ltd*                               | 2,63 % | 08.04.2031            | 253.868          | 0,26                         |
| 338.000  | Orbia Advance Corp SAB de CV**                                   | 2,88 % | 11.05.2031            | 268.614          | 0,28                         |
| 300.000  | Orbia Advance Corp SAB de CV*                                    | 5,88 % | 17.09.2044            | 262.669          | 0,27                         |
| 200.000  | Oversea-Chinese Banking Corp Ltd**                               | 1,83 % | 10.09.2030            | 182.438          | 0,19                         |
| 262.000  | Oversea-Chinese Banking Corp Ltd*                                | 4,60 % | 15.06.2032            | 254.023          | 0,26                         |
| 283.000  | Oztel Holdings SPC Ltd*  | 6,63 % | 24.04.2028            | 294.168          | 0,30                         |
| 300.000  | Periama Holdings LLC*  | 5,95 % | 19.04.2026            | 289.621          | 0,30                         |
| 342.000  | Philippine National Bank*  | 3,28 % | 27.09.2024            | 331.540          | 0,34                         |
| 400.000  | Power Finance Corp Ltd*  | 3,95 % | 23.04.2030            | 356.096          | 0,37                         |
| 200.000  | Power Finance Corp Ltd*  | 4,50 % | 18.06.2029            | 186.396          | 0,19                         |
| 400.000  | Prosus NV*   | 3,83 % | 08.02.2051            | 245.993          | 0,25                         |
| 200.000  | Prosus NV*   | 4,19 % | 19.01.2032            | 168.530          | 0,17                         |
| 400.000  | Prudential Funding Asia Plc*                                     | 2,95 % | 03.11.2033            | 338.203          | 0,35                         |
| 241.000  | QNB Finance Ltd*   | 2,63 % | 12.05.2025            | 228.964          | 0,24                         |
| 367.000  | QNB Finance Ltd*   | 2,75 % | 12.02.2027            | 339.430          | 0,35                         |
| 390.000  | REC Ltd*   | 2,25 % | 01.09.2026            | 348.427          | 0,36                         |
| 295.000  | Rede D'or Finance Sarl**   | 4,50 % | 22.01.2030            | 251.709          | 0,26                         |
| 450.000  | Reliance Industries Ltd*   | 2,88 % | 12.01.2032            | 375.561          | 0,39                         |
| 378.000  | Reliance Industries Ltd*   | 3,63 % | 12.01.2052            | 270.151          | 0,28                         |
| 400.000  | ReNew Wind Energy AP2/ReNew Power Pvt Ltd other 9 Subsidiaries** | 4,50 % | 14.07.2028            | 341.275          | 0,35                         |
| 337.000  | SABIC Capital I BV*  | 2,15 % | 14.09.2030            | 283.737          | 0,29                         |
| 231.000  | Sable International Finance Ltd**                                | 5,75 % | 07.09.2027            | 216.803          | 0,22                         |
| 200.000  | Sagcor Financial Co Ltd**  | 5,30 % | 13.05.2028            | 189.060          | 0,20                         |
| 200.000  | Sands China Ltd**  | 4,30 % | 08.01.2026            | 188.199          | 0,19                         |
| 275.000  | Sands China Ltd*   | 5,63 % | 08.08.2025            | 268.467          | 0,28                         |
| 950.000  | Sands China Ltd*   | 5,90 % | 08.08.2028            | 906.443          | 0,94                         |
| 327.000  | Sasol Financing USA LLC*   | 8,75 % | 03.05.2029            | 318.893          | 0,33                         |
| 475.000  | SEPLAT Energy Plc*   | 7,75 % | 01.04.2026            | 400.435          | 0,41                         |
| 232.000  | SF Holding Investment 2021 Ltd*                                  | 3,13 % | 17.11.2031            | 197.958          | 0,20                         |
| 200.000  | Shanghai Port Group BVI Development Co Ltd*                      | 2,85 % | 11.09.2029            | 177.636          | 0,18                         |
| 200.000  | Shelf Drilling Holdings Ltd**                                    | 8,25 % | 15.02.2025            | 186.925          | 0,19                         |
| 600.000  | Shinhan Bank Co Ltd*   | 4,38 % | 13.04.2032            | 547.197          | 0,57                         |
| 350.000  | Shinhan Bank Co Ltd**  | 4,50 % | 12.04.2028            | 341.428          | 0,35                         |
| 200.000  | Siam Commercial Bank PCL*  | 4,40 % | 11.02.2029            | 191.137          | 0,20                         |
| 600.000  | SierraCol Energy Andina LLC**                                    | 6,00 % | 15.06.2028            | 441.765          | 0,46                         |



## Sustainable Emerging Market Corporate Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 87,97 % (31. Dezember 2022: 88,54 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 200.000  | Sigma Finance Netherlands BV <sup>*</sup>                                   | 4,88 % | 27.03.2028            | 192.195          | 0,20                         |
| 400.000  | SingTel Group Treasury Pte Ltd <sup>*</sup>                                 | 1,88 % | 10.06.2030            | 333.914          | 0,35                         |
| 200.000  | Sino-Ocean Land Treasure IV Ltd <sup>*</sup>                                | 4,75 % | 05.08.2029            | 40.822           | 0,04                         |
| 400.000  | Sitios Latinoamerica SAB de CV <sup>**</sup>                                | 5,38 % | 04.04.2032            | 362.635          | 0,37                         |
| 208.000  | SK Battery America Inc <sup>*</sup>   | 2,13 % | 26.01.2026            | 183.145          | 0,19                         |
| 566.000  | SK Hynix Inc <sup>*</sup>   | 2,38 % | 19.01.2031            | 436.909          | 0,45                         |
| 266.000  | SK Hynix Inc <sup>*</sup>   | 6,38 % | 17.01.2028            | 267.144          | 0,28                         |
| 225.000  | SK Hynix Inc <sup>*</sup>   | 6,50 % | 17.01.2033            | 227.311          | 0,23                         |
| 250.000  | SNB Funding Ltd <sup>*</sup>  | 2,75 % | 02.10.2024            | 241.142          | 0,25                         |
| 300.000  | SNB Funding Ltd <sup>*</sup>  | 2,90 % | 29.01.2027            | 281.014          | 0,29                         |
| 446.000  | SNB Sukuk Ltd <sup>*</sup>  | 2,34 % | 19.01.2027            | 410.484          | 0,42                         |
| 300.000  | Southern Copper Corp <sup>*</sup>   | 6,75 % | 16.04.2040            | 330.961          | 0,34                         |
| 400.000  | Standard Chartered Plc <sup>*</sup>   | 4,30 % | 29.12.2049            | 290.760          | 0,30                         |
| 300.000  | Standard Chartered Plc <sup>*</sup>   | 6,30 % | 09.01.2029            | 301.820          | 0,31                         |
| 483.000  | Standard Chartered Plc <sup>*</sup>   | 6,30 % | 06.07.2034            | 483.809          | 0,50                         |
| 200.000  | Star Energy Geothermal Darajat II/Star Energy Geothermal Salak <sup>*</sup> | 4,85 % | 14.10.2038            | 181.153          | 0,19                         |
| 536.000  | Stillwater Mining Co <sup>*</sup>   | 4,00 % | 16.11.2026            | 478.718          | 0,49                         |
| 200.000  | Studio City Finance Ltd <sup>*</sup>  | 6,00 % | 15.07.2025            | 185.897          | 0,19                         |
| 400.000  | Studio City Finance Ltd <sup>*</sup>  | 6,50 % | 15.01.2028            | 334.432          | 0,35                         |
| 200.000  | Sun Hung Kai Properties Capital Market Ltd <sup>*</sup>                     | 3,75 % | 25.02.2029            | 186.180          | 0,19                         |
| 276.000  | Suzano Austria GmbH <sup>**</sup>   | 7,00 % | 16.03.2047            | 278.467          | 0,29                         |
| 129.000  | Telecom Argentina SA <sup>**</sup>  | 8,00 % | 18.07.2026            | 116.877          | 0,12                         |
| 390.000  | Telefonica Celular del Paraguay SA <sup>**</sup>                            | 5,88 % | 15.04.2027            | 358.268          | 0,37                         |
| 200.000  | Telefonica Moviles Chile SA <sup>**</sup>                                   | 3,54 % | 18.11.2031            | 159.258          | 0,16                         |
| 283.000  | Tencent Holdings Ltd <sup>*</sup>   | 3,24 % | 03.06.2050            | 185.920          | 0,19                         |
| 429.000  | Tengizchevroil Finance Co International Ltd <sup>**</sup>                   | 3,25 % | 15.08.2030            | 328.378          | 0,34                         |
| 500.000  | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV <sup>*</sup>                 | 3,15 % | 01.10.2026            | 448.653          | 0,46                         |
| 550.000  | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV <sup>*</sup>                 | 4,10 % | 01.10.2046            | 362.314          | 0,37                         |
| 910.000  | Thaioil Treasury Center Co Ltd <sup>*</sup>                                 | 3,75 % | 18.06.2050            | 609.165          | 0,63                         |
| 400.000  | Total Play Telecomunicaciones SA de CV <sup>*</sup>                         | 6,38 % | 20.09.2028            | 232.753          | 0,24                         |
| 500.000  | Transportadora de Gas del Sur SA <sup>*</sup>                               | 6,75 % | 02.05.2025            | 474.034          | 0,49                         |
| 200.000  | Trust Fibra Uno <sup>**</sup>   | 4,87 % | 15.01.2030            | 176.863          | 0,18                         |
| 500.000  | TSMC Arizona Corp <sup>*</sup>  | 1,75 % | 25.10.2026            | 448.703          | 0,46                         |
| 400.000  | TSMC Arizona Corp <sup>*</sup>  | 2,50 % | 25.10.2031            | 335.594          | 0,35                         |
| 550.000  | TSMC Arizona Corp <sup>*</sup>  | 3,25 % | 25.10.2051            | 423.179          | 0,44                         |
| 893.000  | TSMC Arizona Corp <sup>*</sup>  | 4,25 % | 22.04.2032            | 866.278          | 0,90                         |
| 500.000  | TSMC Global Ltd <sup>*</sup>  | 1,75 % | 23.04.2028            | 430.741          | 0,45                         |
| 1.000.000  | TSMC Global Ltd <sup>*</sup>  | 2,25 % | 23.04.2031            | 827.057          | 0,86                         |

## Sustainable Emerging Market Corporate Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                             | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 87,97 % (31. Dezember 2022: 88,54 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |        |                       |                   |                              |
| 200.000  | Turk Telekomunikasyon AS*                         | 6,88 % | 28.02.2025            | 190.230           | 0,20                         |
| 400.000  | Turkcell Iletisim Hizmetleri AS*                  | 5,80 % | 11.04.2028            | 356.136           | 0,37                         |
| 245.000  | Turkiye Is Bankasi AS*                            | 6,13 % | 25.04.2024            | 240.681           | 0,25                         |
| 200.000  | Turkiye Petrol Rafinerileri AS*                   | 4,50 % | 18.10.2024            | 191.674           | 0,20                         |
| 215.000  | Turkiye Sise ve Cam Fabrikalari AS*               | 6,95 % | 14.03.2026            | 209.625           | 0,22                         |
| 657.000  | Turkiye Vakiflar Bankasi TAO*                     | 5,50 % | 01.10.2026            | 580.709           | 0,60                         |
| 400.000  | United Overseas Bank Ltd*                         | 2,00 % | 14.10.2031            | 351.619           | 0,36                         |
| 300.000  | United Overseas Bank Ltd*                         | 3,75 % | 15.04.2029            | 293.983           | 0,30                         |
| 500.000  | United Overseas Bank Ltd*                         | 3,86 % | 07.10.2032            | 468.686           | 0,48                         |
| 302.000  | Vale Overseas Ltd*                                | 6,13 % | 12.06.2033            | 302.918           | 0,31                         |
| 185.000  | Vale Overseas Ltd*                                | 6,88 % | 21.11.2036            | 193.622           | 0,20                         |
| 400.000  | Vedanta Resources Finance II Plc*                 | 8,95 % | 11.03.2025            | 302.412           | 0,31                         |
| 921.000  | VTR Finance NV**                                  | 6,38 % | 15.07.2028            | 354.556           | 0,37                         |
| 200.000  | Wharf REIC Finance BVI Ltd*                       | 3,50 % | 17.01.2028            | 185.603           | 0,19                         |
| 300.000  | Woori Bank*                                       | 4,75 % | 30.04.2024            | 295.665           | 0,31                         |
| 985.000  | Wynn Macau Ltd*                                   | 5,63 % | 26.08.2028            | 860.565           | 0,89                         |
| 200.000  | XP Inc**  | 3,25 % | 01.07.2026            | 177.394           | 0,18                         |
| 200.000  | Yapi ve Kredi Bankasi AS*                         | 5,85 % | 21.06.2024            | 195.252           | 0,20                         |
| 300.000  | Yapi ve Kredi Bankasi AS*                         | 8,25 % | 15.10.2024            | 298.422           | 0,31                         |
| 300.000  | YPF SA*   | 6,95 % | 21.07.2027            | 246.520           | 0,25                         |
| 250.000  | YPF SA**  | 7,00 % | 15.12.2047            | 170.230           | 0,18                         |
| 150.000  | YPF SA**  | 8,50 % | 23.03.2025            | 143.789           | 0,15                         |
| 285.000  | YPF SA*   | 8,50 % | 28.07.2025            | 262.171           | 0,27                         |
| 169.231  | YPF SA**  | 9,00 % | 12.02.2026            | 168.180           | 0,17                         |
| 300.000  | YPF SA**  | 9,00 % | 30.06.2029            | 273.673           | 0,28                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |   |        |                       | <b>84.740.150</b> | <b>87,61</b>                 |
| <b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>  |   |        |                       | <b>85.086.931</b> | <b>87,97</b>                 |
| <b>Staatsanleihen 7,27 % (31. Dezember 2022: 4,48 %)</b>                       |   |        |                       |                   |                              |
| <b>Euro</b>  |   |        |                       |                   |                              |
| 6.298  | Argentine Republic Government International Bond* | 0,50 % | 09.07.2029            | 1.976             | 0,00                         |
| 200.000  | Bank Gospodarstwa Krajowego*                      | 5,13 % | 22.02.2033            | 226.718           | 0,24                         |
| 1.175.000  | Ivory Coast Government International Bond*        | 5,25 % | 22.03.2030            | 1.086.403         | 1,13                         |
| 200.000  | Republic of Poland Government International Bond* | 4,25 % | 14.02.2043            | 214.975           | 0,22                         |
| 1.375.000  | Romanian Government International Bond*           | 3,62 % | 26.05.2030            | 1.317.055         | 1,36                         |
| <b>Euro insgesamt</b>  |   |        |                       | <b>2.847.127</b>  | <b>2,95</b>                  |

## Sustainable Emerging Market Corporate Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                               | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 7,27 % (31. Dezember 2022: 4,48 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |   |        |                       |                   |                              |
| 300.000  | Airport Authority*                                  | 3,25 % | 12.01.2052            | 233.428           | 0,24                         |
| 288.000  | Airport Authority*                                  | 4,88 % | 12.01.2030            | 293.494           | 0,30                         |
| 579.253  | Argentine Republic Government International Bond*   | 0,50 % | 09.07.2030            | 193.799           | 0,20                         |
| 439.246  | Argentine Republic Government International Bond*   | 1,50 % | 09.07.2035            | 132.128           | 0,14                         |
| 452.025  | Argentine Republic Government International Bond*   | 3,50 % | 09.07.2041            | 145.973           | 0,15                         |
| 415.685  | Argentine Republic Government International Bond*   | 3,88 % | 09.01.2038            | 147.578           | 0,15                         |
| 200.000  | Brazilian Government International Bond*            | 6,00 % | 20.10.2033            | 198.081           | 0,21                         |
| 401.000  | Chile Government International Bond**               | 4,95 % | 05.01.2036            | 396.330           | 0,41                         |
| 200.000  | Dominican Republic International Bond*              | 5,50 % | 22.02.2029            | 187.635           | 0,19                         |
| 399.000  | Dominican Republic International Bond*              | 7,05 % | 03.02.2031            | 398.396           | 0,41                         |
| 204.000  | Export-Import Bank of Korea*                        | 5,13 % | 11.01.2033            | 209.285           | 0,22                         |
| 273.000  | Guatemala Government Bond*                          | 6,60 % | 13.06.2036            | 275.026           | 0,29                         |
| 279.000  | Korea Mine Rehabilitation & Mineral Resources Corp* | 1,75 % | 15.04.2026            | 248.857           | 0,26                         |
| 200.000  | Korea Mine Rehabilitation & Mineral Resources Corp* | 5,38 % | 11.05.2028            | 197.098           | 0,20                         |
| 284.000  | Philippine Government International Bond*           | 5,50 % | 17.01.2048            | 291.763           | 0,30                         |
| 295.000  | Turkiye Ihracat Kredi Bankasi AS*                   | 9,38 % | 31.01.2026            | 294.240           | 0,31                         |
| 156.000  | Ukraine Government International Bond*              | 7,75 % | 01.09.2027            | 37.986            | 0,04                         |
| 500.000  | Ukraine Government International Bond*              | 7,75 % | 01.08.2041            | 197.390           | 0,20                         |
| 400.000  | Ukraine Government International Bond*              | 9,75 % | 01.11.2030            | 100.024           | 0,10                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |   |        |                       | <b>4.178.511</b>  | <b>4,32</b>                  |
| <b>Staatsanleihen insgesamt</b>  |   |        |                       | <b>7.025.638</b>  | <b>7,27</b>                  |
| <b>Anlagen insgesamt</b>   |   |        |                       | <b>92.112.569</b> | <b>95,24</b>                 |

### Devisenterminkontrakte 0,81 % (31. Dezember 2022: 0,87 %)

| Geforderter<br>Betrag           | Zu zahlender<br>Betrag | Fälligkeits-<br>datum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---------------------------------|------------------------|-----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------------|------------------------------|
| 1.082.591 US\$                  | 7.705.136 CNH          | 20.09.2023            | Goldman Sachs International | 1         | 16.437                               | 0,02                         |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i> |                        |                       |                             |           |                                      |                              |
| 5.882.766 CHF                   | 6.594.960 US\$         | 14.09.2023            | UBS AG                      | 3         | 30.820                               | 0,03                         |
| 5.810.690 CHF                   | 6.517.828 US\$         | 14.09.2023            | Westpac Banking Corp        | 2         | 26.774                               | 0,03                         |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> |                        |                       |                             |           |                                      |                              |
| 26.604.100 €                    | 28.778.586 US\$        | 14.09.2023            | Goldman Sachs International | 1         | 351.883                              | 0,36                         |
| 27.113.685 €                    | 29.332.745 US\$        | 14.09.2023            | Westpac Banking Corp        | 4         | 355.700                              | 0,37                         |
| 69.105 US\$                     | 62.799 €               | 14.09.2023            | Westpac Banking Corp        | 1         | 343                                  | 0,00                         |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> |                        |                       |                             |           |                                      |                              |
| 111.929 £                       | 140.659 US\$           | 14.09.2023            | Goldman Sachs International | 1         | 1.673                                | 0,00                         |
| 106 £                           | 133 US\$               | 14.09.2023            | UBS AG                      | 1         | 1                                    | 0,00                         |
| 111.929 £                       | 140.618 US\$           | 14.09.2023            | Westpac Banking Corp        | 1         | 1.714                                | 0,00                         |

## Sustainable Emerging Market Corporate Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 0,81 % (31. Dezember 2022: 0,87 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen SEK</i>   |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 1.383.020 SEK   | 128.124 US\$        | 14.09.2023       | Goldman Sachs International | 2         | 359                            | 0,00                 |
| 1.383.020 SEK   | 128.134 US\$        | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 2         | 349                            | 0,00                 |
| 400 US\$  | 4.262 SEK           | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 2         | 4                              | 0,00                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                             |           | <b>786.057</b>                 | <b>0,81</b>          |

### Futures-Kontrakte 0,09 % (31. Dezember 2022: 0,05 %)

| Anzahl Kontrakte   | Beschreibung   | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens        |
|--|--|--------------------------------|-----------------------------|
| (39)   | US Treasury 10-Year Note (CBT) Future September 2023 | 82.875                         | 0,09                        |
| (7)  | US Treasury Long Bond (CBT) Future September 2023    | 1.805                          | 0,00                        |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten <sup>*</sup></b>                             |  | <b>84.680</b>                  | <b>0,09</b>                 |
|  |  | <b>Zeitwert US\$</b>           | <b>% des Nettovermögens</b> |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> |  | <b>92.983.306</b>              | <b>96,14</b>                |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (0,18 %) (31. Dezember 2022: (0,14 %))

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 2.813.911 US\$   | 2.630.498 €         | 05.07.2023       | Deutsche Bank AG            | 1         | (55.963)                        | (0,06)               |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 82.901 CHF   | 93.831 US\$         | 14.09.2023       | UBS AG                      | 1         | (459)                           | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 303.859 €  | 334.002 US\$        | 14.09.2023       | Citibank NA                 | 1         | (1.288)                         | (0,00)               |
| 3.996 €  | 4.375 US\$          | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 1         | (0)                             | (0,00)               |
| 4.593.732 US\$   | 4.246.633 €         | 14.09.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (56.169)                        | (0,06)               |
| 4.594.042 US\$   | 4.246.633 €         | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 1         | (55.859)                        | (0,06)               |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 64 £   | 82 US\$             | 14.09.2023       | Citibank NA                 | 1         | (1)                             | (0,00)               |
| 134.455 US\$   | 106.992 £           | 14.09.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (1.599)                         | (0,00)               |
| 134.416 US\$   | 106.992 £           | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 1         | (1.638)                         | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen SEK</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 31.294 SEK   | 2.912 US\$          | 14.09.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (5)                             | (0,00)               |
| 20.136 SEK   | 1.907 US\$          | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 2         | (36)                            | (0,00)               |
| 2.113 US\$   | 22.745 SEK          | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp        | 1         | (0)                             | (0,00)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                             |           | <b>(173.017)</b>                | <b>(0,18)</b>        |

## Sustainable Emerging Market Corporate Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

**Futures- Kontrakte (0,02 %) (31. Dezember 2022: (0,01 %))**

| Anzahl Kontrakte  | Beschreibung  | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens        |
|---|---|---------------------------------|-----------------------------|
| 10  | US Treasury 5-Year Note (CBT) Future September 2023   | (21.953)                        | (0,02)                      |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten *</b>  |   | <b>(21.953)</b>                 | <b>(0,02)</b>               |
|   |   | <b>Zeitwert US\$</b>            | <b>% des Nettovermögens</b> |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> |   | <b>(194.970)</b>                | <b>(0,20)</b>               |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              |   | <b>92.788.336</b>               | <b>95,94</b>                |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  |   | <b>3.931.500</b>                | <b>4,06</b>                 |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   |   | <b>96.719.836</b>               | <b>100,00</b>               |
| <b>Portfolioanalyse</b>   |   | <b>US\$</b>                     | <b>Gesamtvermögen</b>       |
| *   | Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 67.888.142                      | 68,71                       |
| **  | Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden             | 24.224.427                      | 24,52                       |
| ±   | Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden                          | 62.727                          | 0,06                        |
| ∞   | OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente   | 613.040                         | 0,62                        |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  |   | <b>92.788.336</b>               | <b>93,91</b>                |

## Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung  | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 5,01 % (31. Dezember 2022: 4,87 %)</b> |  |        |                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |  |        |                       |                   |                              |
| 1.470.000  | Abu Dhabi Commercial Bank PJSC <sup>*</sup>  | 4,50 % | 14.09.2027            | 1.448.935         | 0,43                         |
| 1.419.000  | Banco do Brasil SA <sup>**</sup>   | 6,25 % | 18.04.2030            | 1.411.550         | 0,41                         |
| 670.000  | Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand <sup>**</sup> | 5,38 % | 17.04.2025            | 663.344           | 0,19                         |
| 2.623.000  | Banque Ouest Africaine de Developpement <sup>†</sup>   | 4,70 % | 22.10.2031            | 2.131.305         | 0,63                         |
| 486.500  | Brazil Minas SPE via State of Minas Gerais <sup>†</sup>  | 5,33 % | 15.02.2028            | 477.860           | 0,14                         |
| 560.000  | Cemex SAB de CV <sup>**</sup>  | 5,13 % | 29.12.2049            | 498.862           | 0,15                         |
| 569.000  | Cemex SAB de CV <sup>**</sup>  | 9,13 % | 29.12.2049            | 576.964           | 0,17                         |
| 600.000  | Eastern & Southern African Trade & Development Bank <sup>†</sup>                               | 4,88 % | 23.05.2024            | 577.914           | 0,17                         |
| 4.460.000  | Empresa de los Ferrocarriles del Estado <sup>†</sup>   | 3,83 % | 14.09.2061            | 3.043.122         | 0,89                         |
| 3.110.000  | Inversiones CMPC SA <sup>**</sup>  | 3,00 % | 06.04.2031            | 2.572.533         | 0,76                         |
| 1.940.000  | Suzano Austria GmbH <sup>†</sup>   | 5,00 % | 15.01.2030            | 1.836.695         | 0,54                         |
| 1.290.000  | Suzano Austria GmbH <sup>**</sup>  | 7,00 % | 16.03.2047            | 1.305.062         | 0,38                         |
| 600.000  | Telecomunicaciones Digitales SA <sup>**</sup>  | 4,50 % | 30.01.2030            | 510.790           | 0,15                         |
| <b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>                          |  |        |                       | <b>17.054.936</b> | <b>5,01</b>                  |
| <b>Staatsanleihen 90,38 % (31. Dezember 2022: 85,91 %)</b>     |  |        |                       |                   |                              |
| <b>Euro</b>  |  |        |                       |                   |                              |
| 1.150.000  | Bank Gospodarstwa Krajowego <sup>*</sup>   | 0,50 % | 08.07.2031            | 916.723           | 0,27                         |
| 2.441.000  | Bank Gospodarstwa Krajowego <sup>*</sup>   | 5,13 % | 22.02.2033            | 2.767.094         | 0,81                         |
| 4.413.000  | Benin Government International Bond <sup>†</sup>   | 4,95 % | 22.01.2035            | 3.415.224         | 1,00                         |
| 1.600.000  | Bulgaria Government International Bond <sup>†</sup>  | 4,13 % | 23.09.2029            | 1.731.807         | 0,51                         |
| 2.180.000  | Bulgaria Government International Bond <sup>†</sup>  | 4,50 % | 27.01.2033            | 2.360.692         | 0,69                         |
| 9.060.000  | Chile Government International Bond <sup>†</sup>   | 1,88 % | 27.05.2030            | 8.696.822         | 2,56                         |
| 2.200.000  | Ivory Coast Government International Bond <sup>†</sup>   | 5,25 % | 22.03.2030            | 2.034.116         | 0,60                         |
| 2.750.000  | Ivory Coast Government International Bond <sup>†</sup>   | 5,88 % | 17.10.2031            | 2.519.300         | 0,74                         |
| 2.488.000  | Ivory Coast Government International Bond <sup>†</sup>   | 6,63 % | 22.03.2048            | 1.931.962         | 0,57                         |
| 4.185.000  | Ivory Coast Government International Bond <sup>†</sup>   | 6,88 % | 17.10.2040            | 3.478.979         | 1,02                         |
| 2.950.000  | Latvia Government International Bond <sup>†</sup>  | 0,25 % | 23.01.2030            | 2.566.199         | 0,75                         |
| 5.930.000  | Mexico Government International Bond <sup>†</sup>  | 2,25 % | 12.08.2036            | 4.802.393         | 1,41                         |
| 4.810.000  | Mexico Government International Bond <sup>†</sup>  | 3,38 % | 23.02.2031            | 4.915.897         | 1,45                         |
| 10.916.000   | Peruvian Government International Bond <sup>†</sup>  | 1,25 % | 11.03.2033            | 8.996.458         | 2,64                         |
| 3.534.000  | Peruvian Government International Bond <sup>†</sup>  | 1,95 % | 17.11.2036            | 2.798.861         | 0,82                         |
| 3.107.000  | Peruvian Government International Bond <sup>†</sup>  | 3,75 % | 01.03.2030            | 3.292.028         | 0,97                         |
| 2.850.000  | Philippine Government International Bond <sup>†</sup>  | 0,70 % | 03.02.2029            | 2.590.953         | 0,76                         |
| 3.260.000  | Philippine Government International Bond <sup>†</sup>  | 1,20 % | 28.04.2033            | 2.725.942         | 0,80                         |
| 4.430.000  | Philippine Government International Bond <sup>†</sup>  | 1,75 % | 28.04.2041            | 3.160.113         | 0,93                         |
| 41.293   | Provincia de Buenos Aires <sup>*</sup>   | 4,00 % | 01.09.2037            | 15.354            | 0,01                         |
| 806.000  | Republic of Poland Government International Bond <sup>†</sup>                                  | 4,25 % | 14.02.2043            | 866.349           | 0,26                         |
| 2.810.000  | Romanian Government International Bond <sup>†</sup>  | 2,00 % | 28.01.2032            | 2.258.092         | 0,66                         |
| 2.582.000  | Romanian Government International Bond <sup>†</sup>  | 2,00 % | 14.04.2033            | 1.996.316         | 0,59                         |

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

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                             | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|---------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 90,38 % (31. Dezember 2022: 85,91 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                    |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |   |         |                       |                    |                              |
| 913.000  | Romanian Government International Bond*           | 2,12 %  | 16.07.2031            | 757.282            | 0,22                         |
| 93.000   | Romanian Government International Bond*           | 2,63 %  | 02.12.2040            | 61.975             | 0,02                         |
| 500.000  | Romanian Government International Bond**          | 2,88 %  | 26.05.2028            | 490.659            | 0,15                         |
| 1.040.000  | Romanian Government International Bond*           | 2,88 %  | 13.04.2042            | 700.013            | 0,21                         |
| 2.045.000  | Romanian Government International Bond*           | 3,38 %  | 28.01.2050            | 1.402.470          | 0,41                         |
| 6.740.000  | Romanian Government International Bond*           | 3,62 %  | 26.05.2030            | 6.455.965          | 1,90                         |
| 5.858.000  | Romanian Government International Bond*           | 3,75 %  | 07.02.2034            | 5.183.260          | 1,52                         |
| 2.990.000  | Romanian Government International Bond*           | 3,88 %  | 29.10.2035            | 2.593.313          | 0,76                         |
| 4.556.000  | Romanian Government International Bond*           | 4,63 %  | 03.04.2049            | 3.851.396          | 1,13                         |
| 6.748.000  | Serbia International Bond*                        | 1,50 %  | 26.06.2029            | 5.708.651          | 1,68                         |
| 9.727.000  | Serbia International Bond*                        | 1,65 %  | 03.03.2033            | 7.092.349          | 2,08                         |
| 4.822.000  | Serbia International Bond*                        | 2,05 %  | 23.09.2036            | 3.240.033          | 0,95                         |
| 303.000  | Ukraine Government International Bond**           | 6,75 %  | 20.06.2028            | 71.462             | 0,02                         |
| <b>Euro insgesamt</b>  |   |         |                       | <b>108.446.502</b> | <b>31,87</b>                 |
| <b>US-Dollar</b>   |   |         |                       |                    |                              |
| 1.002.000  | Airport Authority*                                | 4,88 %  | 12.01.2033            | 1.021.665          | 0,30                         |
| 9.070.000  | Argentine Republic Government International Bond* | 0,50 %  | 09.07.2030            | 3.034.516          | 0,89                         |
| 216.342  | Argentine Republic Government International Bond* | 1,00 %  | 09.07.2029            | 70.572             | 0,02                         |
| 28.103.136   | Argentine Republic Government International Bond* | 1,50 %  | 09.07.2035            | 8.453.619          | 2,48                         |
| 1.871.000  | Bank Gospodarstwa Krajowego*                      | 5,38 %  | 22.05.2033            | 1.862.216          | 0,55                         |
| 4.782.000  | Brazilian Government International Bond*          | 5,63 %  | 07.01.2041            | 4.242.426          | 1,25                         |
| 4.930.000  | Brazilian Government International Bond*          | 5,63 %  | 21.02.2047            | 4.162.989          | 1,22                         |
| 5.764.000  | Brazilian Government International Bond*          | 6,00 %  | 20.10.2033            | 5.708.700          | 1,68                         |
| 6.270.000  | Chile Government International Bond*              | 2,55 %  | 27.07.2033            | 5.139.399          | 1,51                         |
| 2.250.000  | Chile Government International Bond*              | 3,50 %  | 31.01.2034            | 1.987.239          | 0,58                         |
| 200.000  | Chile Government International Bond*              | 3,50 %  | 15.04.2053            | 149.456            | 0,04                         |
| 489.000  | Chile Government International Bond*              | 4,34 %  | 07.03.2042            | 435.340            | 0,13                         |
| 804.000  | Chile Government International Bond**             | 4,95 %  | 05.01.2036            | 794.636            | 0,23                         |
| 4.373.000  | Colombia Government International Bond*           | 3,00 %  | 30.01.2030            | 3.409.991          | 1,00                         |
| 6.227.000  | Colombia Government International Bond*           | 3,88 %  | 25.04.2027            | 5.659.833          | 1,66                         |
| 1.626.000  | Colombia Government International Bond*           | 5,00 %  | 15.06.2045            | 1.136.036          | 0,33                         |
| 3.176.000  | Colombia Government International Bond*           | 5,20 %  | 15.05.2049            | 2.189.852          | 0,64                         |
| 3.750.000  | Colombia Government International Bond*           | 6,13 %  | 18.01.2041            | 3.064.571          | 0,90                         |
| 4.282.000  | Colombia Government International Bond*           | 7,50 %  | 02.02.2034            | 4.198.174          | 1,23                         |
| 3.170.000  | Colombia Government International Bond*           | 8,00 %  | 20.04.2033            | 3.224.220          | 0,95                         |
| 1.290.000  | Colombia Government International Bond*           | 10,38 % | 28.01.2033            | 1.491.382          | 0,44                         |
| 2.935.000  | Costa Rica Government International Bond*         | 6,55 %  | 03.04.2034            | 2.951.142          | 0,87                         |

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

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                      | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 90,38 % (31. Dezember 2022: 85,91 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |         |                       |                  |                              |
| 5.443.000  | Costa Rica Government International Bond*  | 7,16 %  | 12.03.2045            | 5.404.096        | 1,59                         |
| 3.900.000  | Dominican Republic International Bond*     | 4,50 %  | 30.01.2030            | 3.427.667        | 1,01                         |
| 1.433.000  | Dominican Republic International Bond*     | 5,88 %  | 30.01.2060            | 1.114.069        | 0,33                         |
| 2.210.000  | Dominican Republic International Bond*     | 5,95 %  | 25.01.2027            | 2.171.546        | 0,64                         |
| 9.019.000  | Dominican Republic International Bond*     | 6,00 %  | 22.02.2033            | 8.339.721        | 2,45                         |
| 6.782.000  | Dominican Republic International Bond*     | 6,40 %  | 05.06.2049            | 5.795.378        | 1,70                         |
| 360.000  | Dominican Republic International Bond*     | 6,50 %  | 15.02.2048            | 311.969          | 0,09                         |
| 1.049.121  | Ecuador Government International Bond*     | 0,00 %  | 31.07.2030            | 307.267          | 0,09                         |
| 15.312.673   | Ecuador Government International Bond*     | 2,50 %  | 31.07.2035            | 5.352.222        | 1,57                         |
| 1.059.214  | Ecuador Government International Bond*     | 5,50 %  | 31.07.2030            | 514.597          | 0,15                         |
| 5.636.000  | El Salvador Government International Bond* | 7,65 %  | 15.06.2035            | 3.347.999        | 0,98                         |
| 5.571.000  | El Salvador Government International Bond* | 9,50 %  | 15.07.2052            | 3.532.090        | 1,04                         |
| 858.000  | Fondo MIVIVIENDA SA*                       | 4,63 %  | 12.04.2027            | 829.717          | 0,24                         |
| 910.000  | Ghana Government International Bond*       | 6,38 %  | 11.02.2027            | 394.922          | 0,12                         |
| 1.513.000  | Ghana Government International Bond*       | 7,75 %  | 07.04.2029            | 652.280          | 0,19                         |
| 370.000  | Ghana Government International Bond*       | 7,88 %  | 26.03.2027            | 164.532          | 0,05                         |
| 600.000  | Ghana Government International Bond*       | 8,95 %  | 26.03.2051            | 251.340          | 0,07                         |
| 7.613.000  | Ghana Government International Bond*       | 10,75 % | 14.10.2030            | 5.142.299        | 1,51                         |
| 3.474.000  | Hungary Government International Bond*     | 7,63 %  | 29.03.2041            | 3.925.380        | 1,15                         |
| 1.349.896  | Ivory Coast Government International Bond* | 5,75 %  | 31.12.2032            | 1.262.635        | 0,37                         |
| 1.055.000  | Jordan Government International Bond*      | 7,50 %  | 13.01.2029            | 1.063.427        | 0,31                         |
| 670.000  | Mexico Government International Bond*      | 3,50 %  | 12.02.2034            | 562.847          | 0,17                         |
| 938.000  | Mexico Government International Bond*      | 4,88 %  | 19.05.2033            | 896.784          | 0,26                         |
| 7.370.000  | Mexico Government International Bond*      | 5,75 %  | 12.10.2110            | 6.595.550        | 1,94                         |
| 208.000  | Mexico Government International Bond*      | 6,35 %  | 09.02.2035            | 219.189          | 0,06                         |
| 6.600.000  | Morocco Government International Bond*     | 5,50 %  | 11.12.2042            | 5.698.143        | 1,68                         |
| 1.311.000  | Morocco Government International Bond*     | 6,50 %  | 08.09.2033            | 1.353.608        | 0,40                         |
| 5.530.000  | Oman Government International Bond*        | 6,25 %  | 25.01.2031            | 5.623.042        | 1,65                         |
| 10.642.000   | Oman Government International Bond*        | 6,75 %  | 17.01.2048            | 10.248.161       | 3,01                         |
| 4.625.000  | Panama Government International Bond*      | 6,40 %  | 14.02.2035            | 4.834.648        | 1,42                         |
| 640.000  | Panama Government International Bond*      | 6,70 %  | 26.01.2036            | 686.883          | 0,20                         |
| 3.240.000  | Panama Government International Bond*      | 6,85 %  | 28.03.2054            | 3.378.496        | 0,99                         |
| 81.000   | Panama Government International Bond*      | 8,88 %  | 30.09.2027            | 93.147           | 0,03                         |
| 5.513.000  | Peruvian Government International Bond*    | 3,00 %  | 15.01.2034            | 4.593.707        | 1,35                         |
| 295.000  | Philippine Government International Bond*  | 5,50 %  | 17.01.2048            | 303.064          | 0,09                         |
| 211.000  | Philippine Government International Bond*  | 5,61 %  | 13.04.2033            | 223.220          | 0,07                         |
| 56.308   | Provincia de Mendoza Argentina*            | 5,75 %  | 19.03.2029            | 43.638           | 0,01                         |
| 701.000  | Republic of Armenia International Bond*    | 3,60 %  | 02.02.2031            | 551.266          | 0,16                         |



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

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                             | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 90,38 % (31. Dezember 2022: 85,91 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                    |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |        |                       |                    |                              |
| 11.060.000   | Republic of Armenia International Bond*           | 3,95 % | 26.09.2029            | 9.204.906          | 2,71                         |
| 2.258.000  | Republic of Poland Government International Bond* | 5,75 % | 16.11.2032            | 2.372.530          | 0,70                         |
| 800.000  | Republic of Uzbekistan International Bond*        | 3,70 % | 25.11.2030            | 648.416            | 0,19                         |
| 770.000  | Republic of Uzbekistan International Bond*        | 4,75 % | 20.02.2024            | 763.609            | 0,22                         |
| 4.025.000  | Republic of Uzbekistan International Bond*        | 5,38 % | 20.02.2029            | 3.692.306          | 1,09                         |
| 1.077.000  | Sri Lanka Government International Bond*          | 6,20 % | 11.05.2027            | 495.858            | 0,15                         |
| 1.060.000  | Sri Lanka Government International Bond*          | 6,75 % | 18.04.2028            | 488.141            | 0,14                         |
| 5.120.000  | Sri Lanka Government International Bond*          | 6,83 % | 18.07.2026            | 2.425.527          | 0,71                         |
| 1.398.000  | Sri Lanka Government International Bond*          | 6,85 % | 14.03.2024            | 643.861            | 0,19                         |
| 4.624.000  | Sri Lanka Government International Bond*          | 6,85 % | 03.11.2025            | 2.203.450          | 0,65                         |
| 491.000  | Sri Lanka Government International Bond*          | 7,55 % | 28.03.2030            | 226.056            | 0,07                         |
| 677.000  | Sri Lanka Government International Bond*          | 7,85 % | 14.03.2029            | 311.688            | 0,09                         |
| 290.000  | Tunisian Republic*                                | 5,75 % | 30.01.2025            | 193.859            | 0,06                         |
| 1.293.000  | Turkey Government International Bond*             | 9,13 % | 13.07.2030            | 1.284.893          | 0,38                         |
| 600.000  | Turkey Government International Bond*             | 9,38 % | 14.03.2029            | 602.874            | 0,18                         |
| 876.000  | Turkiye Ihracat Kredi Bankasi AS*                 | 9,38 % | 31.01.2026            | 873.743            | 0,26                         |
| 3.774.000  | Ukraine Government International Bond*            | 6,88 % | 21.05.2031            | 871.983            | 0,26                         |
| 270.000  | Ukraine Government International Bond*            | 7,38 % | 25.09.2034            | 63.087             | 0,02                         |
| 705.000  | Ukraine Government International Bond*            | 7,75 % | 01.09.2027            | 171.667            | 0,05                         |
| 225.000  | Ukraine Government International Bond*            | 7,75 % | 01.09.2029            | 54.499             | 0,02                         |
| 884.000  | Ukraine Government International Bond*            | 7,75 % | 01.08.2041            | 348.986            | 0,10                         |
| 7.554.000  | Ukraine Government International Bond*            | 9,75 % | 01.11.2030            | 1.888.961          | 0,56                         |
| 4.540.000  | Uruguay Government International Bond*            | 4,38 % | 23.01.2031            | 4.483.732          | 1,32                         |
| 1.190.000  | Uruguay Government International Bond*            | 5,10 % | 18.06.2050            | 1.188.707          | 0,35                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |   |        |                       | <b>199.101.859</b> | <b>58,51</b>                 |
| <b>Staatsanleihen insgesamt</b>  |   |        |                       | <b>307.548.361</b> | <b>90,38</b>                 |
| <b>Anlagen insgesamt</b>   |   |        |                       | <b>324.603.297</b> | <b>95,39</b>                 |

Devisenterminkontrakte 0,91 % (31. Dezember 2022: 0,78 %)

| Geforderter<br>Betrag   | Zu zahlender<br>Betrag | Fälligkeits-<br>datum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|------------------------|-----------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------------|------------------------------|
| 8.092.362 US\$  | 7.349.225 €            | 05.07.2023            | Citibank NA                    | 1         | 74.356                               | 0,02                         |
| 1.499.836 US\$  | 1.372.136 €            | 05.07.2023            | State Street Bank and Trust Co | 1         | 2.835                                | 0,00                         |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>   |                        |                       |                                |           |                                      |                              |
| 114.511.905 €   | 123.903.496 US\$       | 14.09.2023            | Standard Chartered Bank        | 1         | 1.482.648                            | 0,44                         |
| 116.723.131 €   | 126.275.584 US\$       | 14.09.2023            | Westpac Banking Corp           | 9         | 1.531.767                            | 0,45                         |
| 24.388 US\$   | 22.195 €               | 14.09.2023            | Westpac Banking Corp           | 3         | 85                                   | 0,00                         |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                        |                       |                                |           | <b>3.091.691</b>                     | <b>0,91</b>                  |

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

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Futures-Kontrakte 0,33 % (31. Dezember 2022: 1,59 %)

| Anzahl Kontrakte  | Beschreibung                                       | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|--|--------------------------------|----------------------|
| (92)  | Euro-BOBL Future September 2023                    | 179.666                        | 0,05                 |
| (402)   | Euro-Bund Future September 2023                    | 745.175                        | 0,22                 |
| 158   | US Treasury Ultra Bond (CBT) Future September 2023 | 197.457                        | 0,06                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten *</b> |  | <b>1.122.298</b>               | <b>0,33</b>          |

### Credit-Default-Swap-Kontrakten 0,02 % (31. Dezember 2022: 0,03 %)

| Nominalwert  | Fälligkeit | Gegenpartei                 | Referenzverbindlichkeit                   | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|--|------------|-----------------------------|---|---------------|----------------------|
| USD 1.720.000  | 20.06.2028 | ICE Clear U.S. <sup>1</sup> | Buying default protection on CDX.EM.39.V1 | 83.107        | 0,02                 |
| <b>Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten insgesamt *</b> |            |                             |   | <b>83.107</b> | <b>0,02</b>          |

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

|  |  |  |  | Zeitwert US\$      | % des Nettovermögens |
|--|--|--|--|--------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> |  |  |  | <b>328.900.393</b> | <b>96,65</b>         |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (0,60 %) (31. Dezember 2022: (0,54 %))

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 1.361.498 US\$   | 1.268.778 €         | 05.07.2023       | Citibank NA                    | 1         | (22.740)                        | (0,01)               |
| 101.305.883 US\$   | 94.673.925 €        | 05.07.2023       | Standard Chartered Bank        | 2         | (1.983.400)                     | (0,58)               |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>  |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 1.425.784 €  | 1.567.222 US\$      | 14.09.2023       | Citibank NA                    | 1         | (6.043)                         | (0,00)               |
| 1.615.998 €  | 1.778.515 US\$      | 14.09.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (9.059)                         | (0,00)               |
| 23.898.880 €   | 26.168.964 US\$     | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp           | 7         | (608)                           | (0,00)               |
| 5.468.650 US\$   | 5.004.323 €         | 14.09.2023       | Westpac Banking Corp           | 7         | (10.892)                        | (0,01)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten **</b> |                     |                  |                                |           | <b>(2.032.742)</b>              | <b>(0,60)</b>        |

### Futures-Kontrakte (0,44 %) (31. Dezember 2022: (0,03 %))

| Anzahl Kontrakte | Beschreibung   | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|------------------|--|---------------------------------|----------------------|
| (78)             | Euro-Buxl 30-Year Bond Future September 2023         | (141.568)                       | (0,04)               |
| 6                | Euro-Schatz Future September 2023                    | (6.153)                         | (0,00)               |
| 54               | US Treasury 10-Year Note (CBT) Future September 2023 | (49.156)                        | (0,01)               |
| 115              | US Treasury 2-Year Note (CBT) Future September 2023  | (336.914)                       | (0,10)               |
| 432              | US Treasury 5-Year Note (CBT) Future September 2023  | (948.375)                       | (0,28)               |

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

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

**Futures-Kontrakte (0,44 %) (31. Dezember 2022: (0,03 %)) (Fortsetzung)**

| Anzahl Kontrakte   | Beschreibung                                      | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---|---------------------------------|----------------------|
| 77   | US Treasury Long Bond (CBT) Future September 2023 | (19.852)                        | (0,01)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten *</b> |   | <b>(1.502.018)</b>              | <b>(0,44)</b>        |

|   | Zeitwert US\$      | % des Nettovermögens |
|---|--------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(3.534.760)</b> | <b>(1,04)</b>        |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>325.365.633</b> | <b>95,61</b>         |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>14.932.214</b>  | <b>4,39</b>          |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>340.297.847</b> | <b>100,00</b>        |

| Portfolioanalyse         |   | US\$               | % des Gesamtvermögens |
|--------------------------|---|--------------------|-----------------------|
| *                        | Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 315.229.575        | 89,87                 |
| **                       | Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden             | 8.895.862          | 2,54                  |
| †                        | Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente  | 477.860            | 0,14                  |
| ±                        | Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden                          | (379.720)          | (0,11)                |
| ∞                        | OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap                            | 1.142.056          | 0,33                  |
| <b>Anlagen insgesamt</b> |   | <b>325.365.633</b> | <b>92,77</b>          |

## Systematic Global Sustainable Value - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der Anteile                                 | Wertpapierbezeichnung                 | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---------------------------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Aktien 97,05 % (31. Dezember 2022: 97,79 %)</b> |                                       |                  |                              |
| <b>Australischer Dollar</b>                        |                                       |                  |                              |
| 3.209  | Ampol Ltd*                            | 64.056           | 0,14                         |
| 5.530  | ANZ Group Holdings Ltd*               | 87.473           | 0,19                         |
| 11.265   | Brambles Ltd*                         | 108.238          | 0,23                         |
| 29.054   | Fortescue Metals Group Ltd*           | 430.801          | 0,94                         |
| 9.327  | National Australia Bank Ltd*          | 163.919          | 0,36                         |
| 1.842  | Rio Tinto Ltd*                        | 140.954          | 0,30                         |
| 85.173   | Telstra Group Ltd*                    | 244.152          | 0,53                         |
| <b>Australischer Dollar insgesamt</b>              |                                       | <b>1.239.593</b> | <b>2,69</b>                  |
| <b>Brasilianischer Real</b>                        |                                       |                  |                              |
| 46.168   | Ambev SA*                             | 147.481          | 0,32                         |
| 10.831   | B3 SA - Brasil Bolsa Balcao*          | 32.803           | 0,07                         |
| 38.676   | Banco Bradesco SA - Preferred Shares* | 131.886          | 0,29                         |
| <b>Brasilianischer Real insgesamt</b>              |                                       | <b>312.170</b>   | <b>0,68</b>                  |
| <b>Kanadischer Dollar</b>                          |                                       |                  |                              |
| 2.674  | Bank of Nova Scotia*                  | 133.938          | 0,29                         |
| 4.272  | Enbridge Inc*                         | 158.967          | 0,34                         |
| 1.329  | George Weston Ltd**                   | 157.301          | 0,34                         |
| 6.521  | Hydro One Ltd**                       | 186.525          | 0,40                         |
| 1.635  | IGM Financial Inc**                   | 49.832           | 0,11                         |
| 2.372  | Loblaw Cos Ltd**                      | 217.401          | 0,47                         |
| 21.084   | Manulife Financial Corp*              | 398.975          | 0,87                         |
| 2.634  | Metro Inc**                           | 148.933          | 0,32                         |
| 1.603  | Nutrien Ltd*                          | 94.745           | 0,21                         |
| 4.373  | Pembina Pipeline Corp*                | 137.643          | 0,30                         |
| 682  | Restaurant Brands International Inc*  | 52.936           | 0,11                         |
| 976  | TC Energy Corp*                       | 39.490           | 0,09                         |
| 2.282  | Toronto-Dominion Bank*                | 141.602          | 0,31                         |
| 662  | West Fraser Timber Co Ltd*            | 56.937           | 0,12                         |
| <b>Kanadischer Dollar insgesamt</b>                |                                       | <b>1.975.225</b> | <b>4,28</b>                  |
| <b>Dänische Krone</b>                              |                                       |                  |                              |
| 351  | Carlsberg A/S Class B*                | 56.084           | 0,12                         |
| <b>Dänische Krone insgesamt</b>                    |                                       | <b>56.084</b>    | <b>0,12</b>                  |
| <b>Euro</b>  |                                       |                  |                              |
| 228  | Air Liquide SA*                       | 40.844           | 0,09                         |
| 5.259  | Assicurazioni Generali SpA*           | 106.834          | 0,23                         |
| 2.245  | AXA SA*                               | 66.192           | 0,14                         |

## Systematic Global Sustainable Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile  | Wertpapierbezeichnung                                 | Zeitwert US\$    | % des Nettovermögens |
|---|---|------------------|----------------------|
| <b>Aktien 97,05% (31. Dezember 2022: 97,79 %) (Fortsetzung)</b> |   |                  |                      |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>                                       |   |                  |                      |
| 50.141  | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA*                   | 384.677          | 0,84                 |
| 3.212   | Bayerische Motoren Werke AG*                          | 394.303          | 0,85                 |
| 1.024   | Capgemini SE*   | 193.887          | 0,42                 |
| 606   | Cie de Saint-Gobain*                                  | 36.846           | 0,08                 |
| 950   | Deutsche Post AG*                                     | 46.360           | 0,10                 |
| 1.576   | Eiffage SA*   | 164.342          | 0,36                 |
| 801   | Eurazeo SE*   | 56.322           | 0,12                 |
| 1.897   | Evonik Industries AG*                                 | 36.074           | 0,08                 |
| 31.449  | Iberdrola SA*   | 410.015          | 0,89                 |
| 3.123   | Industria de Diseno Textil SA*                        | 120.819          | 0,26                 |
| 1.380   | Koninklijke Ahold Delhaize NV*                        | 47.064           | 0,10                 |
| 9.351   | Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA*          | 111.813          | 0,25                 |
| 1.478   | Mercedes-Benz Group AG*                               | 118.793          | 0,26                 |
| 1.826   | Randstad NV*  | 96.242           | 0,21                 |
| 5.880   | Redeia Corp SA*                                       | 98.696           | 0,21                 |
| 2.021   | Sanofi*   | 216.522          | 0,47                 |
| 611   | SAP SE*   | 83.418           | 0,18                 |
| 2.903   | STMicroelectronics NV*                                | 144.312          | 0,31                 |
| 11.528  | TotalEnergies SE*                                     | 660.924          | 1,43                 |
| 3.983   | UniCredit SpA*  | 92.406           | 0,20                 |
| 1.579   | Vinci SA*   | 183.260          | 0,40                 |
| 498   | Wendel SE*  | 51.072           | 0,11                 |
| 859   | Wolters Kluwer NV*                                    | 108.993          | 0,24                 |
| <b>Euro insgesamt</b>   |   | <b>4.071.030</b> | <b>8,83</b>          |
| <b>Hongkong-Dollar</b>  |   |                  |                      |
| 31.700  | Alibaba Group Holding Ltd*                            | 329.966          | 0,72                 |
| 1.100   | Baidu Inc Class A*                                    | 18.760           | 0,04                 |
| 264.000   | China Construction Bank Corp - H Shares*              | 170.907          | 0,37                 |
| 27.500  | China Merchants Bank Co Ltd - H Shares*               | 125.421          | 0,27                 |
| 4.000   | China Overseas Land & Investment Ltd*                 | 8.750            | 0,02                 |
| 6.000   | China Resources Land Ltd*                             | 25.532           | 0,05                 |
| 37.000  | Country Garden Holdings Co Ltd*                       | 7.547            | 0,02                 |
| 293.000   | Industrial & Commercial Bank of China Ltd - H Shares* | 156.571          | 0,34                 |
| 1.150   | JD.com Inc Class A*                                   | 19.611           | 0,04                 |
| 5.210   | Meituan Class B*                                      | 81.691           | 0,18                 |
| 26.000  | Ping An Insurance Group Co of China Ltd - H Shares*   | 166.047          | 0,36                 |
| 7.500   | Sun Hung Kai Properties Ltd*                          | 94.752           | 0,21                 |
| 4.200   | Tencent Holdings Ltd*                                 | 178.071          | 0,38                 |

## Systematic Global Sustainable Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile  | Wertpapierbezeichnung                       | Zeitwert US\$    | % des Nettovermögens |
|---|---|------------------|----------------------|
| <b>Aktien 97,05% (31. Dezember 2022: 97,79 %) (Fortsetzung)</b> |   |                  |                      |
| <b>Hongkong-Dollar (Fortsetzung)</b>                            |   |                  |                      |
| 10.000  | Wuxi Biologics Cayman Inc*                  | 48.057           | 0,10                 |
|   | <b>Hongkong-Dollar insgesamt</b>            | <b>1.431.683</b> | <b>3,10</b>          |
| <b>Indonesische Rupiah</b>                                      |   |                  |                      |
| 215.831   | Bank Central Asia Tbk PT*                   | 132.369          | 0,29                 |
| 409.953   | Telkom Indonesia Persero Tbk PT*            | 109.672          | 0,24                 |
|   | <b>Indonesische Rupiah insgesamt</b>        | <b>242.041</b>   | <b>0,53</b>          |
| <b>Israelischer Schekel</b>                                     |   |                  |                      |
| 6.192   | ICL Group Ltd*                              | 33.946           | 0,07                 |
|   | <b>Israelischer Schekel insgesamt</b>       | <b>33.946</b>    | <b>0,07</b>          |
| <b>Japanischer Yen</b>  |   |                  |                      |
| 2.500   | Astellas Pharma Inc*                        | 37.169           | 0,08                 |
| 200   | Bridgestone Corp*                           | 8.203            | 0,02                 |
| 13.200  | Canon Inc*                                  | 346.408          | 0,75                 |
| 300   | Hirose Electric Co Ltd*                     | 39.874           | 0,09                 |
| 2.700   | Hitachi Ltd*                                | 167.598          | 0,36                 |
| 13.200  | Honda Motor Co Ltd*                         | 399.215          | 0,87                 |
| 1.400   | KDDI Corp*                                  | 43.165           | 0,09                 |
| 6.600   | Kirin Holdings Co Ltd*                      | 96.218           | 0,21                 |
| 12.700  | Mizuho Financial Group Inc*                 | 193.803          | 0,42                 |
| 900   | Nippon Express Holdings Inc*                | 50.683           | 0,11                 |
| 146.800   | Nippon Telegraph & Telephone Corp*          | 173.421          | 0,38                 |
| 7.400   | Nippon Yusen KK*                            | 164.071          | 0,35                 |
| 1.500   | Nitto Denko Corp*                           | 111.154          | 0,24                 |
| 9.400   | Obayashi Corp*                              | 81.159           | 0,18                 |
| 3.100   | Sekisui House Ltd*                          | 62.515           | 0,14                 |
| 2.700   | Sompo Holdings Inc*                         | 120.946          | 0,26                 |
| 2.800   | SUMCO Corp*                                 | 39.658           | 0,09                 |
| 3.200   | Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc*         | 113.333          | 0,24                 |
| 8.600   | Takeda Pharmaceutical Co Ltd*               | 269.785          | 0,58                 |
| 8.800   | Tokio Marine Holdings Inc*                  | 202.534          | 0,44                 |
| 2.500   | Toppan Inc*                                 | 53.940           | 0,12                 |
|   | <b>Japanischer Yen insgesamt</b>            | <b>2.774.852</b> | <b>6,02</b>          |
| <b>Mexikanischer Peso</b>                                       |   |                  |                      |
| 8.209   | Fomento Economico Mexicano SAB de CV*       | 90.660           | 0,20                 |
| 22.794  | Grupo Financiero Banorte SAB de CV Class O* | 187.158          | 0,40                 |
|   | <b>Mexikanischer Peso insgesamt</b>         | <b>277.818</b>   | <b>0,60</b>          |

## Systematic Global Sustainable Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl<br>der Anteile   | Wertpapierbezeichnung                        | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--|------------------|------------------------------|
| <b>Aktien 97,05% (31. Dezember 2022: 97,79 %) (Fortsetzung)</b> |  |                  |                              |
| <b>Neuer taiwanesischer Dollar</b>                              |  |                  |                              |
| 4.000   | ASE Technology Holding Co Ltd*               | 14.225           | 0,03                         |
| 114.650   | China Steel Corp*                            | 108.416          | 0,23                         |
| 36.492  | Chunghwa Telecom Co Ltd*                     | 136.678          | 0,30                         |
| 2.624   | MediaTek Inc*                                | 58.084           | 0,13                         |
| 89.519  | Taiwan Cement Corp*                          | 109.565          | 0,24                         |
| 16.559  | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd*   | 305.900          | 0,66                         |
| 8.000   | United Microelectronics Corp*                | 12.569           | 0,03                         |
|   | <b>Neuer taiwanesischer Dollar insgesamt</b> | <b>745.437</b>   | <b>1,62</b>                  |
| <b>Neuseeländischer Dollar</b>                                  |  |                  |                              |
| 16.238  | Spark New Zealand Ltd*                       | 50.727           | 0,11                         |
|   | <b>Neuseeländischer Dollar insgesamt</b>     | <b>50.727</b>    | <b>0,11</b>                  |
| <b>Norwegische Krone</b>  |  |                  |                              |
| 6.370   | Norsk Hydro ASA*                             | 37.934           | 0,08                         |
|   | <b>Norwegische Krone insgesamt</b>           | <b>37.934</b>    | <b>0,08</b>                  |
| <b>Britisches Pfund</b>   |  |                  |                              |
| 45.728  | Barclays Plc*                                | 89.169           | 0,20                         |
| 14.076  | Barratt Developments Plc*                    | 73.998           | 0,16                         |
| 1.528   | Burberry Group Plc*                          | 41.184           | 0,09                         |
| 833   | Ferguson Plc*                                | 131.426          | 0,29                         |
| 39.489  | NatWest Group Plc*                           | 120.892          | 0,26                         |
| 641   | Next Plc*                                    | 56.231           | 0,12                         |
| 3.143   | RELX Plc*                                    | 104.731          | 0,23                         |
| 3.036   | Rio Tinto Plc*                               | 192.431          | 0,42                         |
| 24.681  | Shell Plc*                                   | 735.034          | 1,59                         |
| 8.821   | SSE Plc*                                     | 206.460          | 0,45                         |
|   | <b>Britisches Pfund insgesamt</b>            | <b>1.751.556</b> | <b>3,81</b>                  |
| <b>Singapur-Dollar</b>  |  |                  |                              |
| 10.400  | Oversea-Chinese Banking Corp Ltd*            | 94.542           | 0,21                         |
|   | <b>Singapur-Dollar insgesamt</b>             | <b>94.542</b>    | <b>0,21</b>                  |
| <b>Südafrikanischer Rand</b>                                    |  |                  |                              |
| 35.042  | FirstRand Ltd*                               | 127.063          | 0,28                         |
| 8.082   | Impala Platinum Holdings Ltd*                | 53.614           | 0,12                         |
| 4.994   | Sasol Ltd*                                   | 61.663           | 0,13                         |
|   | <b>Südafrikanischer Rand insgesamt</b>       | <b>242.340</b>   | <b>0,53</b>                  |

## Systematic Global Sustainable Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile  | Wertpapierbezeichnung                     | Zeitwert US\$    | % des Nettovermögens |
|---|---|------------------|----------------------|
| <b>Aktien 97,05% (31. Dezember 2022: 97,79 %) (Fortsetzung)</b> |   |                  |                      |
| <b>Südkoreanischer Won</b>                                      |   |                  |                      |
| 1.107   | Hyundai Motor Co*                         | 174.125          | 0,38                 |
| 3.410   | KB Financial Group Inc*                   | 123.765          | 0,27                 |
| 9.177   | Samsung Electronics Co Ltd*               | 505.315          | 1,10                 |
| 2.236   | SK Hynix Inc*                             | 196.465          | 0,42                 |
| <b>Südkoreanischer Won insgesamt</b>                            |   | <b>999.670</b>   | <b>2,17</b>          |
| <b>Schwedische Krone</b>  |   |                  |                      |
| 1.803   | Boliden AB*                               | 52.005           | 0,11                 |
| 9.513   | Nordea Bank Abp*                          | 103.309          | 0,22                 |
| 5.469   | Skandinaviska Enskilda Banken AB Class A* | 60.329           | 0,13                 |
| <b>Schwedische Krone insgesamt</b>                              |   | <b>215.643</b>   | <b>0,46</b>          |
| <b>Schweizer Franken</b>  |   |                  |                      |
| 3.136   | ABB Ltd*                                  | 123.316          | 0,27                 |
| 797   | Kuehne + Nagel International AG*          | 235.808          | 0,51                 |
| 2.770   | Novartis AG*                              | 278.657          | 0,60                 |
| 796   | Roche Holding AG*                         | 243.342          | 0,53                 |
| 464   | Swiss Prime Site AG*                      | 40.272           | 0,09                 |
| 839   | Swiss Re AG*                              | 84.439           | 0,18                 |
| 202   | Zurich Insurance Group AG*                | 95.937           | 0,21                 |
| <b>Schweizer Franken insgesamt</b>                              |   | <b>1.101.771</b> | <b>2,39</b>          |
| <b>US-Dollar</b>  |   |                  |                      |
| 3.235   | AbbVie Inc*                               | 435.852          | 0,94                 |
| 814   | Accenture Plc Class A*                    | 251.184          | 0,54                 |
| 3.375   | Aflac Inc*                                | 235.575          | 0,51                 |
| 170   | Agilent Technologies Inc*                 | 20.442           | 0,04                 |
| 6.469   | Alphabet Inc Class A*                     | 774.339          | 1,68                 |
| 2.654   | Alphabet Inc Class C*                     | 321.055          | 0,70                 |
| 1.187   | American Express Co*                      | 206.775          | 0,45                 |
| 1.531   | Ameriprise Financial Inc*                 | 508.537          | 1,10                 |
| 1.250   | AmerisourceBergen Corp*                   | 240.537          | 0,52                 |
| 1.302   | Amgen Inc*                                | 289.070          | 0,63                 |
| 5.695   | Apple Inc*                                | 1.104.659        | 2,40                 |
| 3.513   | Applied Materials Inc*                    | 507.769          | 1,10                 |
| 35.184  | AT&T Inc*                                 | 561.185          | 1,22                 |
| 34  | AutoZone Inc*                             | 84.774           | 0,18                 |
| 2.213   | Bank of New York Mellon Corp*             | 98.523           | 0,21                 |
| 203   | Becton Dickinson & Co*                    | 53.594           | 0,12                 |
| 6.841   | Bristol-Myers Squibb Co*                  | 437.482          | 0,95                 |



## Systematic Global Sustainable Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl<br>der Anteile   | Wertpapierbezeichnung                       | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---|------------------|------------------------------|
| <b>Aktien 97,05% (31. Dezember 2022: 97,79 %) (Fortsetzung)</b> |   |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>                                  |   |                  |                              |
| 485   | Broadcom Inc*                               | 420.704          | 0,91                         |
| 1.831   | Campbell Soup Co*                           | 83.695           | 0,18                         |
| 1.441   | CH Robinson Worldwide Inc*                  | 135.959          | 0,30                         |
| 797   | Cheniere Energy Inc*                        | 121.431          | 0,26                         |
| 19  | Chipotle Mexican Grill Inc Class A*         | 40.641           | 0,09                         |
| 1.355   | Chubb Ltd*                                  | 260.919          | 0,57                         |
| 1.816   | Cigna Corp*                                 | 509.569          | 1,10                         |
| 66  | Cintas Corp*                                | 32.807           | 0,07                         |
| 8.644   | Cisco Systems Inc*                          | 447.241          | 0,97                         |
| 11.424  | Citigroup Inc*                              | 525.961          | 1,14                         |
| 3.511   | Citizens Financial Group Inc*               | 91.567           | 0,20                         |
| 3.201   | Coca-Cola Europacific Partners Plc*         | 206.240          | 0,45                         |
| 1.141   | Colgate-Palmolive Co*                       | 87.903           | 0,19                         |
| 19.198  | Comcast Corp Class A*                       | 797.677          | 1,73                         |
| 16.153  | CSX Corp*                                   | 550.817          | 1,19                         |
| 750   | Cummins Inc*                                | 183.870          | 0,40                         |
| 554   | CVS Health Corp*                            | 38.298           | 0,08                         |
| 1.250   | Discover Financial Services*                | 146.062          | 0,32                         |
| 308   | Dow Inc*                                    | 16.404           | 0,04                         |
| 1.120   | DR Horton Inc*                              | 136.293          | 0,30                         |
| 691   | Electronic Arts Inc*                        | 89.623           | 0,19                         |
| 476   | Elevance Health Inc*                        | 211.482          | 0,46                         |
| 331   | Everest Re Group Ltd*                       | 113.156          | 0,25                         |
| 3.417   | Expeditors International of Washington Inc* | 413.901          | 0,90                         |
| 1.532   | Ferguson Plc*                               | 240.999          | 0,52                         |
| 403   | Fox Corp Class A*                           | 13.702           | 0,03                         |
| 6.492   | Fox Corp Class B*                           | 207.030          | 0,45                         |
| 5.529   | General Mills Inc*                          | 424.074          | 0,92                         |
| 7.798   | Gilead Sciences Inc*                        | 600.992          | 1,30                         |
| 1.294   | Goldman Sachs Group Inc*                    | 417.367          | 0,91                         |
| 1.386   | Halliburton Co*                             | 45.724           | 0,10                         |
| 4.148   | Hartford Financial Services Group Inc*      | 298.739          | 0,65                         |
| 25  | HCA Healthcare Inc*                         | 7.587            | 0,02                         |
| 6.368   | Hewlett Packard Enterprise Co*              | 106.983          | 0,23                         |
| 1.789   | HF Sinclair Corp*                           | 79.807           | 0,17                         |
| 681   | Home Depot Inc*                             | 211.546          | 0,46                         |
| 1.229   | Howmet Aerospace Inc*                       | 60.909           | 0,13                         |
| 603   | Humana Inc*                                 | 269.620          | 0,58                         |
| 3.941   | Huntington Bancshares Inc*                  | 42.484           | 0,09                         |
| 1.685   | International Business Machines Corp*       | 225.470          | 0,49                         |

## Systematic Global Sustainable Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl<br>der Anteile   | Wertpapierbezeichnung                 | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---------------------------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Aktien 97,05% (31. Dezember 2022: 97,79 %) (Fortsetzung)</b> |                                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>                                  |                                       |                  |                              |
| 1.333   | Johnson & Johnson*                    | 220.638          | 0,48                         |
| 1.534   | JPMorgan Chase & Co*                  | 223.105          | 0,48                         |
| 1.582   | Kellogg Co*                           | 106.627          | 0,23                         |
| 289   | Kimberly-Clark Corp*                  | 39.899           | 0,09                         |
| 929   | KLA Corp*                             | 450.583          | 0,98                         |
| 637   | Lam Research Corp*                    | 409.502          | 0,89                         |
| 5.057   | LKQ Corp*                             | 294.671          | 0,64                         |
| 1.772   | LyondellBasell Industries NV Class A* | 162.723          | 0,35                         |
| 4.469   | Marathon Petroleum Corp*              | 521.085          | 1,13                         |
| 570   | Marsh & McLennan Cos Inc*             | 107.205          | 0,23                         |
| 289   | Mastercard Inc Class A*               | 113.664          | 0,25                         |
| 1.066   | McDonald's Corp*                      | 318.105          | 0,69                         |
| 28  | MercadoLibre Inc*                     | 33.169           | 0,07                         |
| 6.294   | Merck & Co Inc*                       | 726.265          | 1,57                         |
| 1.381   | Meta Platforms Inc Class A*           | 396.319          | 0,86                         |
| 1.900   | Microchip Technology Inc*             | 170.221          | 0,37                         |
| 1.602   | Microsoft Corp*                       | 545.545          | 1,18                         |
| 1.028   | Morgan Stanley*                       | 87.791           | 0,19                         |
| 249   | Motorola Solutions Inc*               | 73.027           | 0,16                         |
| 1.685   | NIKE Inc Class B*                     | 185.973          | 0,40                         |
| 3.096   | NIO Inc ADR*                          | 30.000           | 0,07                         |
| 2.591   | Nucor Corp*                           | 424.872          | 0,92                         |
| 37  | NVR Inc*                              | 234.973          | 0,51                         |
| 1.110   | NXP Semiconductors NV*                | 227.195          | 0,49                         |
| 3.624   | ONEOK Inc*                            | 223.673          | 0,48                         |
| 1.762   | Owens Corning*                        | 229.941          | 0,50                         |
| 596   | Parker-Hannifin Corp*                 | 232.464          | 0,51                         |
| 535   | PepsiCo Inc*                          | 99.093           | 0,21                         |
| 1.006   | PNC Financial Services Group Inc*     | 126.706          | 0,28                         |
| 2.660   | Principal Financial Group Inc*        | 201.734          | 0,44                         |
| 1.982   | Procter & Gamble Co*                  | 300.749          | 0,65                         |
| 3.952   | PulteGroup Inc*                       | 306.991          | 0,67                         |
| 951   | Quest Diagnostics Inc*                | 133.672          | 0,29                         |
| 1.789   | Skyworks Solutions Inc*               | 198.025          | 0,43                         |
| 342   | Snap-on Inc*                          | 98.561           | 0,21                         |
| 976   | Starbucks Corp*                       | 96.683           | 0,21                         |
| 1.252   | State Street Corp*                    | 91.621           | 0,20                         |
| 2.417   | Steel Dynamics Inc*                   | 263.284          | 0,57                         |
| 992   | Targa Resources Corp*                 | 75.491           | 0,16                         |
| 2.995   | Texas Instruments Inc*                | 539.160          | 1,17                         |

## Systematic Global Sustainable Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl<br>der Anteile  | Wertpapierbezeichnung                 | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---------------------------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Aktien 97,05% (31. Dezember 2022: 97,79 %) (Fortsetzung)</b>          |                                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |                                       |                   |                              |
| 240  | Trane Technologies Plc*               | 45.903            | 0,10                         |
| 1.690  | Travelers Cos Inc*                    | 293.485           | 0,64                         |
| 249  | Union Pacific Corp*                   | 50.950            | 0,11                         |
| 452  | United Parcel Service Inc Class B*    | 81.021            | 0,17                         |
| 970  | United Rentals Inc*                   | 432.009           | 0,94                         |
| 1.092  | UnitedHealth Group Inc*               | 524.859           | 1,14                         |
| 4.160  | Valero Energy Corp*                   | 487.968           | 1,06                         |
| 2.297  | Verizon Communications Inc*           | 85.425            | 0,19                         |
| 2.173  | Webster Financial Corp*               | 82.031            | 0,18                         |
| 2.911  | Williams Cos Inc*                     | 94.986            | 0,21                         |
| 308  | WW Grainger Inc*                      | 242.886           | 0,53                         |
| 2.327  | Yum China Holdings Inc*               | 131.476           | 0,28                         |
| 762  | Yum! Brands Inc*                      | 105.575           | 0,23                         |
| 398  | Zimmer Biomet Holdings Inc*           | 57.949            | 0,13                         |
|  | <b>US-Dollar insgesamt</b>            | <b>27.084.133</b> | <b>58,75</b>                 |
|  | <b>Aktien insgesamt</b>               | <b>44.738.195</b> | <b>97,05</b>                 |
| <b>Immobilienaktiengesellschaften 2,35 % (31. Dezember 2022: 1,57 %)</b> |                                       |                   |                              |
| <b>Australischer Dollar</b>  |                                       |                   |                              |
| 45.976   | Stockland                             | 123.504           | 0,27                         |
|  | <b>Australischer Dollar insgesamt</b> | <b>123.504</b>    | <b>0,27</b>                  |
| <b>Kanadischer Dollar</b>  |                                       |                   |                              |
| 2.688  | RioCan Real Estate Investment Trust   | 39.165            | 0,09                         |
|  | <b>Kanadischer Dollar insgesamt</b>   | <b>39.165</b>     | <b>0,09</b>                  |
| <b>Euro</b>  |                                       |                   |                              |
| 3.883  | Klepierre SA                          | 96.250            | 0,21                         |
|  | <b>Euro insgesamt</b>                 | <b>96.250</b>     | <b>0,21</b>                  |
| <b>Britisches Pfund</b>  |                                       |                   |                              |
| 9.274  | British Land Co Plc                   | 35.702            | 0,08                         |
| 12.788   | Land Securities Group Plc             | 93.354            | 0,20                         |
|  | <b>Britisches Pfund insgesamt</b>     | <b>129.056</b>    | <b>0,28</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>   |                                       |                   |                              |
| 9.251  | Host Hotels & Resorts Inc             | 155.694           | 0,34                         |
| 2.959  | Regency Centers Corp                  | 182.778           | 0,40                         |
| 2.672  | Simon Property Group Inc              | 308.562           | 0,67                         |

## Systematic Global Sustainable Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile   | Wertpapierbezeichnung       | Zeitwert US\$     | % des Nettovermögens |
|--|-----------------------------|-------------------|----------------------|
| <b>Immobilienaktiengesellschaften 2,35 % (31. Dezember 2022: 1,57 %) (Fortsetzung)</b> |                             |                   |                      |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |                             |                   |                      |
| 1.340  | VICI Properties Inc Class A | 42.116            | 0,09                 |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |                             | <b>689.150</b>    | <b>1,50</b>          |
| <b>Immobilienaktiengesellschaften insgesamt *</b>                                      |                             | <b>1.077.125</b>  | <b>2,35</b>          |
| <b>Anlagen insgesamt</b>   |                             | <b>45.815.320</b> | <b>99,40</b>         |

Devisenterminkontrakte 0,02 % (31. Dezember 2022: 0,26 %)

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>   |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 15.991 €  | 17.177 US\$         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 3         | 283                            | 0,00                 |
| 5.300 €   | 5.767 US\$          | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | 20                             | 0,00                 |
| 8.114 €   | 8.764 US\$          | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 8         | 94                             | 0,00                 |
| 4.648 US\$  | 4.189 €             | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | 75                             | 0,00                 |
| 27.460 US\$   | 24.889 €            | 20.07.2023       | UBS AG                      | 5         | 284                            | 0,00                 |
| 1.238.538 US\$  | 1.127.610 €         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 5         | 7.361                          | 0,02                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                             |           | <b>8.117</b>                   | <b>0,02</b>          |

|  | Zeitwert US\$     | % des Nettovermögens |
|--|-------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> | <b>45.823.437</b> | <b>99,42</b>         |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,03 %) (31. Dezember 2022: (0,19 %))

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 14.181 €   | 15.591 US\$         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 3         | (107)                           | (0,00)               |
| 813.926 €  | 892.487 US\$        | 20.07.2023       | UBS AG                      | 4         | (3.805)                         | (0,01)               |
| 842.697 €  | 926.609 US\$        | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 9         | (6.510)                         | (0,02)               |
| 15.793 US\$  | 14.529 €            | 20.07.2023       | UBS AG                      | 3         | (70)                            | (0,00)               |
| 29.479 US\$  | 27.318 €            | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 7         | (349)                           | (0,00)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                             |           | <b>(10.841)</b>                 | <b>(0,03)</b>        |

|   | Zeitwert US\$     | % des Nettovermögens |
|---|-------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(10.841)</b>   | <b>(0,03)</b>        |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>45.812.596</b> | <b>99,39</b>         |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>283.962</b>    | <b>0,61</b>          |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>46.096.558</b> | <b>100,00</b>        |

## Systematic Global Sustainable Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

| Portfolioanalyse  | US\$              | % des<br>Gesamtver-<br>mögens |
|---|-------------------|-------------------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 45.055.328        | 96,04                         |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden            | 759.992           | 1,62                          |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente   | (2.724)           | (0,01)                        |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>45.812.596</b> | <b>97,65</b>                  |

## Ultra Short Term Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital-<br>betrag  | Wertpapierbezeichnung  | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Schatzwechsel 0,97 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)</b>                                   |  |        |                       |                   |                              |
| <b>Euro</b>   |  |        |                       |                   |                              |
| 9.000.000   | Finland T-Bill   | 0,00 % | 13.02.2024            | 8.814.082         | 0,97                         |
| <b>Schatzwechsel insgesamt **</b>   |  |        |                       | <b>8.814.082</b>  | <b>0,97</b>                  |
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 9,13 % (31. Dezember 2022: 8,81 %)</b> |  |        |                       |                   |                              |
| <b>Euro</b>   |  |        |                       |                   |                              |
| 874.395   | Domi BV Series 2020-1 Class A  | 3,98 % | 15.04.2052            | 873.009           | 0,10                         |
| 1.500.000   | Domi BV Series 2020-2 Class B  | 4,82 % | 15.11.2052            | 1.491.679         | 0,16                         |
| 12.819.970  | Dutch Property Finance BV Series 2021-2 Class A                        | 3,94 % | 28.04.2059            | 12.758.215        | 1,41                         |
| 2.044.507   | Dutch Property Finance BV Series 2022-2 Class A                        | 4,14 % | 28.04.2062            | 2.040.889         | 0,23                         |
| 1.283.659   | European Residential Loan Securitisation 2019-NPL2 DAC Class A         | 6,44 % | 24.02.2058            | 1.267.678         | 0,14                         |
| 2.681.007   | Futura S.r.l. Series 2019-1 Class A                                    | 5,94 % | 31.07.2044            | 2.692.570         | 0,30                         |
| 2.986.962   | Gedesco Trade Receivables Designated Activity Co Series 2020-1 Class A | 4,56 % | 24.01.2026            | 2.240.221         | 0,25                         |
| 3.301.955   | Jubilee Place Retail Unit Trust LP Series 3 Class A                    | 4,03 % | 17.01.2059            | 3.296.404         | 0,36                         |
| 11.203.035  | MIRAVET Sarl Series 2019-1 Class A                                     | 4,17 % | 26.05.2065            | 11.106.935        | 1,23                         |
| 3.462.335   | MIRAVET Sarl Series 2020-1 Class A                                     | 4,27 % | 26.05.2065            | 3.434.328         | 0,38                         |
| 5.914.796   | Mulcair Securities No. 3 DAC Series 3 Class A                          | 4,16 % | 24.04.2065            | 5.832.455         | 0,64                         |
| 380.969   | Primrose Residential Series 2021-1 Class A                             | 4,19 % | 24.03.2061            | 378.364           | 0,04                         |
| 1.500.000   | Primrose Residential Series 2021-1 Class B                             | 4,79 % | 24.03.2061            | 1.473.864         | 0,16                         |
| 5.790.430   | Primrose Residential Series 2022-1 Class A                             | 4,44 % | 24.10.2061            | 5.746.069         | 0,63                         |
| 3.500.000   | Primrose Residential Series 2022-1 Class D                             | 5,84 % | 24.10.2061            | 3.184.207         | 0,35                         |
| 7.000.000   | Quarzo Series 2023-1 Class A1  | 4,48 % | 15.12.2039            | 7.012.264         | 0,77                         |
| 2.900.000   | RED & Black Auto Lease France 2 Series 2 Class A                       | 4,09 % | 27.06.2035            | 2.900.409         | 0,32                         |
| 610.473   | Retiro Mortgage Securities Series 1X Class A1                          | 5,00 % | 30.07.2075            | 605.182           | 0,07                         |
| 217.295   | Sabadell Consumo FDT Series 2 Class D                                  | 8,14 % | 24.12.2034            | 218.404           | 0,02                         |
| 2.316.354   | Shamrock Residential DAC Series 2022-1 Class A                         | 4,29 % | 24.01.2061            | 2.299.125         | 0,25                         |
| 1.300.000   | Shamrock Residential DAC Series 2022-1 Class C                         | 5,34 % | 24.01.2061            | 1.289.146         | 0,14                         |
| 3.113.011   | Shamrock Residential DAC Series 2023-1X Class A                        | 4,44 % | 24.06.2071            | 3.084.679         | 0,34                         |
| 2.500.000   | Shamrock Residential DAC Series 2023-1X Class C                        | 6,19 % | 24.06.2071            | 2.438.550         | 0,27                         |
| 1.014.086   | Tagus - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA Series 2019 Class A1 | 5,22 % | 12.05.2025            | 1.014.004         | 0,11                         |
| 3.000.000   | Tagus - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA Series 3 Class C     | 7,14 % | 23.06.2039            | 2.948.343         | 0,33                         |
| 1.201.986   | Warrington Residential 2022-1 DAC Series 2022-1 Class A1               | 5,14 % | 24.12.2056            | 1.141.904         | 0,13                         |
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) insgesamt **</b>                       |  |        |                       | <b>82.768.897</b> | <b>9,13</b>                  |
| <b>Unternehmensanleihen 77,93 % (31. Dezember 2022: 81,63 %)</b>                          |  |        |                       |                   |                              |
| <b>Euro</b>   |  |        |                       |                   |                              |
| 2.000.000   | AbbVie Inc*  | 1,25 % | 01.06.2024            | 1.947.629         | 0,21                         |
| 4.000.000   | AbbVie Inc*  | 1,50 % | 15.11.2023            | 3.965.148         | 0,44                         |
| 2.100.000   | ABN AMRO Bank NV*  | 3,75 % | 20.04.2025            | 2.082.140         | 0,23                         |
| 1.500.000   | Accor SA*  | 2,63 % | 29.12.2049            | 1.416.231         | 0,16                         |
| 100.000   | Afflelou SAS*  | 4,25 % | 19.05.2026            | 96.082            | 0,01                         |

## Ultra Short Term Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung  | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|-----------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 77,93 % (31. Dezember 2022: 81,63 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                 |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |  |        |                       |                 |                              |
| 3.837.000  | Akelius Residential Property AB*   | 3,88 % | 05.10.2078            | 3.821.291       | 0,42                         |
| 11.000.000   | ALD SA*  | 1,25 % | 02.03.2026            | 10.172.492      | 1,12                         |
| 2.600.000  | Allianz SE*  | 2,60 % | 29.12.2049            | 1.735.812       | 0,19                         |
| 3.000.000  | Allwyn International AS**  | 3,88 % | 15.02.2027            | 2.825.217       | 0,31                         |
| 1.000.000  | Altice France SA*  | 3,38 % | 15.01.2028            | 732.345         | 0,08                         |
| 9.000.000  | AMCO - Asset Management Co SpA**   | 1,38 % | 27.01.2025            | 8.573.445       | 0,95                         |
| 1.090.000  | AMCO - Asset Management Co SpA*  | 4,63 % | 06.02.2027            | 1.084.283       | 0,12                         |
| 5.100.000  | American Tower Corp*   | 0,40 % | 15.02.2027            | 4.425.913       | 0,49                         |
| 2.000.000  | American Tower Corp*   | 0,45 % | 15.01.2027            | 1.736.586       | 0,19                         |
| 700.000  | American Tower Corp*   | 1,95 % | 22.05.2026            | 651.845         | 0,07                         |
| 1.700.000  | Apollo Swedish Bidco AB**  | 8,59 % | 05.07.2029            | 1.649.119       | 0,18                         |
| 1.000.000  | ArcelorMittal SA*  | 4,88 % | 26.09.2026            | 1.020.779       | 0,11                         |
| 2.000.000  | Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc* | 2,00 % | 01.09.2028            | 1.668.888       | 0,18                         |
| 2.000.000  | Arena Luxembourg Finance Sarl*   | 1,88 % | 01.02.2028            | 1.649.060       | 0,18                         |
| 1.000.000  | Arion Banki HF*  | 7,25 % | 25.05.2026            | 996.062         | 0,11                         |
| 800.000  | Arkema SA*   | 1,50 % | 29.12.2049            | 709.127         | 0,08                         |
| 5.000.000  | Aroundtown SA*   | 0,38 % | 15.04.2027            | 3.597.930       | 0,40                         |
| 4.100.000  | Aroundtown SA*   | 1,63 % | 31.01.2028            | 2.901.890       | 0,32                         |
| 400.000  | Aroundtown SA*   | 2,13 % | 29.12.2049            | 136.760         | 0,01                         |
| 4.900.000  | Aroundtown SA*   | 3,38 % | 29.12.2049            | 2.077.545       | 0,23                         |
| 4.000.000  | Arval Service Lease SA*  | 0,00 % | 01.10.2025            | 3.616.353       | 0,40                         |
| 1.800.000  | Arval Service Lease SA*  | 4,13 % | 13.04.2026            | 1.783.917       | 0,20                         |
| 1.700.000  | Arval Service Lease SA*  | 4,25 % | 11.11.2025            | 1.688.256       | 0,19                         |
| 2.900.000  | Arval Service Lease SA*  | 4,63 % | 02.12.2024            | 2.911.861       | 0,32                         |
| 1.200.000  | Arval Service Lease SA*  | 4,75 % | 22.05.2027            | 1.211.639       | 0,13                         |
| 2.400.000  | Ashland Services BV**  | 2,00 % | 30.01.2028            | 2.044.716       | 0,23                         |
| 1.800.000  | AT&T Inc*  | 3,55 % | 18.11.2025            | 1.778.385       | 0,20                         |
| 10.900.000   | Athene Global Funding*   | 0,37 % | 10.09.2026            | 9.411.104       | 1,04                         |
| 9.000.000  | Athene Global Funding*   | 0,83 % | 08.01.2027            | 7.716.492       | 0,85                         |
| 5.000.000  | Athene Global Funding*   | 1,24 % | 08.04.2024            | 4.847.365       | 0,53                         |
| 2.000.000  | Athora Holding Ltd*  | 6,63 % | 16.06.2028            | 1.983.192       | 0,22                         |
| 2.400.000  | AusNet Services Holdings Pty Ltd*  | 1,63 % | 11.03.2081            | 2.049.000       | 0,23                         |
| 10.000.000   | Australia & New Zealand Banking Group Ltd*                                 | 3,44 % | 04.04.2025            | 9.910.390       | 1,09                         |
| 5.400.000  | Autostrade per l'Italia SpA*   | 2,00 % | 04.12.2028            | 4.727.155       | 0,52                         |
| 3.000.000  | Autostrade per l'Italia SpA*   | 5,88 % | 09.06.2024            | 3.048.468       | 0,34                         |
| 2.400.000  | Balder Finland OYJ*  | 1,00 % | 18.01.2027            | 1.809.593       | 0,20                         |
| 1.200.000  | Banco BPM SpA*   | 6,00 % | 14.06.2028            | 1.193.218       | 0,13                         |
| 1.700.000  | Banco de Sabadell SA*  | 2,63 % | 24.03.2026            | 1.617.234       | 0,18                         |
| 2.200.000  | Banco Santander SA*  | 0,10 % | 26.01.2025            | 2.146.461       | 0,24                         |
| 1.900.000  | Banco Santander SA*  | 3,75 % | 16.01.2026            | 1.872.097       | 0,21                         |

## Ultra Short Term Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                        | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|-----------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 77,93 % (31. Dezember 2022: 81,63 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                 |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |  |        |                       |                 |                              |
| 2.000.000  | Bank of America Corp*                        | 1,78 % | 04.05.2027            | 1.850.306       | 0,20                         |
| 15.000.000   | Bank of Nova Scotia*                         | 3,05 % | 31.10.2024            | 14.823.900      | 1,64                         |
| 4.700.000  | Banque Federative du Credit Mutuel SA*       | 0,01 % | 07.03.2025            | 4.376.654       | 0,48                         |
| 1.500.000  | Banque Federative du Credit Mutuel SA*       | 0,01 % | 11.05.2026            | 1.333.851       | 0,15                         |
| 11.800.000   | Banque Federative du Credit Mutuel SA*       | 3,07 % | 29.12.2049            | 9.180.966       | 1,01                         |
| 6.510.000  | Banque Federative du Credit Mutuel SA*       | 3,21 % | 29.12.2049            | 5.035.485       | 0,56                         |
| 2.900.000  | Banque Federative du Credit Mutuel SA*       | 3,88 % | 14.02.2028            | 2.859.713       | 0,32                         |
| 5.000.000  | Barclays Plc*                                | 0,75 % | 09.06.2025            | 4.813.215       | 0,53                         |
| 5.700.000  | Barclays Plc*                                | 2,89 % | 31.01.2027            | 5.415.633       | 0,60                         |
| 3.000.000  | Barclays Plc*                                | 3,38 % | 02.04.2025            | 2.965.410       | 0,33                         |
| 2.000.000  | Bayer Capital Corp BV*                       | 1,50 % | 26.06.2026            | 1.859.902       | 0,21                         |
| 1.850.000  | BCP V Modular Services Finance II Plc**      | 4,75 % | 30.11.2028            | 1.581.519       | 0,17                         |
| 7.000.000  | BNP Paribas SA*                              | 0,25 % | 13.04.2027            | 6.190.485       | 0,68                         |
| 4.000.000  | BPCE SA*                                     | 0,38 % | 02.02.2026            | 3.633.612       | 0,40                         |
| 6.600.000  | BPCE SA*                                     | 0,63 % | 28.04.2025            | 6.189.038       | 0,68                         |
| 1.800.000  | BPCE SA*                                     | 3,63 % | 17.04.2026            | 1.771.708       | 0,20                         |
| 1.300.000  | CA Auto Bank SpA*                            | 0,00 % | 16.04.2024            | 1.258.375       | 0,14                         |
| 2.000.000  | CA Auto Bank SpA*                            | 0,13 % | 16.11.2023            | 1.972.090       | 0,22                         |
| 2.000.000  | Caixa Central de Credito Agricola Mutuo CRL* | 8,38 % | 04.07.2027            | 2.001.390       | 0,22                         |
| 5.500.000  | Capital One Financial Corp*                  | 0,80 % | 12.06.2024            | 5.272.575       | 0,58                         |
| 200.000  | Celanese US Holdings LLC*                    | 2,13 % | 01.03.2027            | 179.273         | 0,02                         |
| 800.000  | Cellnex Telecom SA*                          | 1,75 % | 23.10.2030            | 647.058         | 0,07                         |
| 800.000  | Cirsa Finance International Sarl*            | 4,50 % | 15.03.2027            | 734.136         | 0,08                         |
| 8.000.000  | Citigroup Inc*                               | 1,25 % | 06.07.2026            | 7.488.168       | 0,83                         |
| 5.700.000  | Citigroup Inc*                               | 1,50 % | 24.07.2026            | 5.350.886       | 0,59                         |
| 4.000.000  | CK Hutchison Finance 16 II Ltd*              | 0,88 % | 03.10.2024            | 3.827.581       | 0,42                         |
| 8.284.000  | Commerzbank AG*                              | 0,10 % | 11.09.2025            | 7.621.454       | 0,84                         |
| 2.200.000  | Commerzbank AG*                              | 6,75 % | 05.10.2033            | 2.184.857       | 0,24                         |
| 6.600.000  | Credit Suisse AG*                            | 0,25 % | 05.01.2026            | 5.899.595       | 0,65                         |
| 2.000.000  | Credit Suisse AG*                            | 1,50 % | 10.04.2026            | 1.830.243       | 0,20                         |
| 2.000.000  | Credit Suisse AG*                            | 2,13 % | 31.05.2024            | 1.947.942       | 0,21                         |
| 100.000  | Cullinan Holdco Scsp**                       | 4,63 % | 15.10.2026            | 84.986          | 0,01                         |
| 10.000.000   | Danske Bank A/S*                             | 0,01 % | 10.11.2024            | 9.856.250       | 1,09                         |
| 700.000  | Deutsche Bank AG*                            | 1,00 % | 19.11.2025            | 661.198         | 0,07                         |
| 500.000  | Deutsche Lufthansa AG*                       | 3,50 % | 14.07.2029            | 453.983         | 0,05                         |
| 6.938.000  | Deutsche Postbank Funding Trust III*         | 3,13 % | 29.12.2049            | 4.864.544       | 0,54                         |
| 4.000.000  | Digital Euro Finco LLC*                      | 2,50 % | 16.01.2026            | 3.728.696       | 0,41                         |
| 4.906.000  | Digital Euro Finco LLC*                      | 2,63 % | 15.04.2024            | 4.800.207       | 0,53                         |
| 1.300.000  | doValue SpA*                                 | 3,38 % | 31.07.2026            | 1.097.167       | 0,12                         |
| 500.000  | doValue SpA**                                | 5,00 % | 04.08.2025            | 473.299         | 0,05                         |



## Ultra Short Term Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                         | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|-----------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 77,93 % (31. Dezember 2022: 81,63 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                 |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |   |        |                       |                 |                              |
| 1.800.000  | Dufry One BV*                                 | 3,38 % | 15.04.2028            | 1.598.743       | 0,18                         |
| 5.900.000  | easyJet FinCo BV*                             | 1,88 % | 03.03.2028            | 5.158.376       | 0,57                         |
| 1.400.000  | easyJet Plc*                                  | 0,88 % | 11.06.2025            | 1.315.474       | 0,15                         |
| 1.200.000  | Electricite de France SA*                     | 2,88 % | 29.12.2049            | 1.026.421       | 0,11                         |
| 1.500.000  | Electricite de France SA*                     | 4,00 % | 29.12.2049            | 1.459.213       | 0,16                         |
| 1.000.000  | Emeria SASU**                                 | 3,38 % | 31.03.2028            | 806.150         | 0,09                         |
| 200.000  | EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG*           | 1,38 % | 31.08.2081            | 159.877         | 0,02                         |
| 1.000.000  | EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG*           | 1,88 % | 29.06.2080            | 895.668         | 0,10                         |
| 1.000.000  | EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG*           | 2,13 % | 31.08.2081            | 714.867         | 0,08                         |
| 2.000.000  | Enel Finance International NV*                | 0,00 % | 28.05.2026            | 1.785.742       | 0,20                         |
| 1.500.000  | Enel SpA*                                     | 1,38 % | 29.12.2049            | 1.224.375       | 0,14                         |
| 1.000.000  | Energizer Gamma Acquisition BV**              | 3,50 % | 30.06.2029            | 808.831         | 0,09                         |
| 2.000.000  | Eni SpA*                                      | 3,38 % | 29.12.2049            | 1.687.244       | 0,19                         |
| 500.000  | Evonik Industries AG*                         | 1,38 % | 02.09.2081            | 416.462         | 0,05                         |
| 1.000.000  | Fastighets AB Balder*                         | 1,13 % | 29.01.2027            | 754.031         | 0,08                         |
| 4.000.000  | Fastighets AB Balder*                         | 1,88 % | 14.03.2025            | 3.548.043       | 0,39                         |
| 10.000.000   | Federation des Caisses Desjardins du Quebec*  | 2,88 % | 28.11.2024            | 9.840.140       | 1,09                         |
| 5.100.000  | Federation des Caisses Desjardins du Quebec*  | 3,25 % | 18.04.2028            | 5.012.826       | 0,55                         |
| 100.000  | Forvia*                                       | 2,63 % | 15.06.2025            | 95.562          | 0,01                         |
| 1.000.000  | Forvia*                                       | 2,75 % | 15.02.2027            | 908.166         | 0,10                         |
| 2.627.000  | Global Payments Inc*                          | 4,88 % | 17.03.2031            | 2.618.197       | 0,29                         |
| 10.800.000   | Goldman Sachs Group Inc*                      | 1,38 % | 15.05.2024            | 10.554.008      | 1,16                         |
| 4.800.000  | Grand City Properties SA*                     | 1,50 % | 29.12.2049            | 1.961.542       | 0,22                         |
| 500.000  | Grand City Properties SA*                     | 2,50 % | 29.12.2049            | 237.840         | 0,03                         |
| 800.000  | Gruenthal GmbH*                               | 3,63 % | 15.11.2026            | 754.896         | 0,08                         |
| 1.000.000  | Grupo Antolin-Irausa SA*                      | 3,50 % | 30.04.2028            | 733.125         | 0,08                         |
| 1.100.000  | Haleon Netherlands Capital BV*                | 1,25 % | 29.03.2026            | 1.021.662       | 0,11                         |
| 2.000.000  | Heathrow Funding Ltd*                         | 1,50 % | 12.10.2025            | 1.881.076       | 0,21                         |
| 6.000.000  | Heimstaden Bostad AB*                         | 1,13 % | 21.01.2026            | 4.826.988       | 0,53                         |
| 4.400.000  | Heimstaden Bostad AB*                         | 3,38 % | 29.12.2049            | 2.233.000       | 0,25                         |
| 3.600.000  | Heimstaden Bostad Treasury BV*                | 0,25 % | 13.10.2024            | 3.166.581       | 0,35                         |
| 5.300.000  | Heimstaden Bostad Treasury BV*                | 0,63 % | 24.07.2025            | 4.401.724       | 0,49                         |
| 8.500.000  | Holcim Finance Luxembourg SA*                 | 1,50 % | 06.04.2025            | 8.111.071       | 0,89                         |
| 406.000  | Holcim Finance Luxembourg SA*                 | 3,00 % | 29.12.2049            | 395.353         | 0,04                         |
| 1.800.000  | HSBC Holdings Plc*                            | 4,75 % | 10.03.2028            | 1.800.796       | 0,20                         |
| 200.000  | IHO Verwaltungs GmbH*                         | 8,75 % | 15.05.2028            | 206.722         | 0,02                         |
| 1.000.000  | Iliad Holding SASU**                          | 5,13 % | 15.10.2026            | 958.115         | 0,11                         |
| 2.000.000  | INEOS Finance Plc*                            | 2,88 % | 01.05.2026            | 1.838.738       | 0,20                         |
| 6.500.000  | ING Groep NV*                                 | 0,13 % | 29.11.2025            | 6.104.221       | 0,67                         |
| 2.700.000  | International Consolidated Airlines Group SA* | 3,75 % | 25.03.2029            | 2.362.500       | 0,26                         |

## Ultra Short Term Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung               | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|-------------------------------------|---------|-----------------------|-----------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 77,93 % (31. Dezember 2022: 81,63 %) (Fortsetzung)</b> |                                     |         |                       |                 |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |                                     |         |                       |                 |                              |
| 18.495.000   | Intesa Sanpaolo SpA**               | 2,13 %  | 26.05.2025            | 17.722.408      | 1,96                         |
| 1.500.000  | Intesa Sanpaolo SpA*                | 2,93 %  | 14.10.2030            | 1.247.257       | 0,14                         |
| 5.500.000  | Intesa Sanpaolo SpA**               | 5,00 %  | 08.03.2028            | 5.495.149       | 0,61                         |
| 6.100.000  | Investec Bank Plc*                  | 1,25 %  | 11.08.2026            | 5.364.053       | 0,59                         |
| 5.000.000  | Islandsbanki HF*                    | 0,75 %  | 25.03.2025            | 4.516.220       | 0,50                         |
| 700.000  | Islandsbanki HF*                    | 7,38 %  | 17.05.2026            | 704.053         | 0,08                         |
| 650.000  | Italmatch Chemicals SpA*            | 10,00 % | 06.02.2028            | 635.362         | 0,07                         |
| 2.000.000  | Jaguar Land Rover Automotive Plc*   | 4,50 %  | 15.07.2028            | 1.752.800       | 0,19                         |
| 3.600.000  | KBC Group NV*                       | 4,50 %  | 06.06.2026            | 3.578.908       | 0,39                         |
| 1.000.000  | Kleopatra Finco Sarl**              | 4,25 %  | 01.03.2026            | 838.150         | 0,09                         |
| 2.400.000  | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau*    | 0,00 %  | 15.06.2026            | 2.179.642       | 0,24                         |
| 4.000.000  | Landsbankinn HF*                    | 0,38 %  | 23.05.2025            | 3.574.804       | 0,39                         |
| 2.500.000  | Landsbankinn HF*                    | 0,50 %  | 20.05.2024            | 2.375.512       | 0,26                         |
| 12.000.000   | Landsbankinn HF*                    | 0,75 %  | 25.05.2026            | 10.226.028      | 1,13                         |
| 3.000.000  | LeasePlan Corp NV*                  | 0,25 %  | 23.02.2026            | 2.690.697       | 0,30                         |
| 1.700.000  | LeasePlan Corp NV*                  | 0,25 %  | 07.09.2026            | 1.496.479       | 0,17                         |
| 2.200.000  | Leasys SpA*                         | 4,38 %  | 07.12.2024            | 2.194.066       | 0,24                         |
| 10.000.000   | Lloyds Bank Plc*                    | 3,25 %  | 02.02.2026            | 9.848.440       | 1,09                         |
| 6.000.000  | Lloyds Banking Group Plc*           | 0,50 %  | 12.11.2025            | 5.674.932       | 0,63                         |
| 6.000.000  | Lloyds Banking Group Plc*           | 3,50 %  | 01.04.2026            | 5.871.408       | 0,65                         |
| 1.400.000  | Lorca Telecom Bondco SA*            | 4,00 %  | 18.09.2027            | 1.280.301       | 0,14                         |
| 200.000  | Loxam SAS*                          | 4,50 %  | 15.04.2027            | 179.161         | 0,02                         |
| 800.000  | Loxam SAS*                          | 6,38 %  | 15.05.2028            | 793.670         | 0,09                         |
| 1.280.000  | Maxeda DIY Holding BV**             | 5,88 %  | 01.10.2026            | 922.068         | 0,10                         |
| 2.200.000  | Merck KGaA*                         | 1,63 %  | 25.06.2079            | 2.096.050       | 0,23                         |
| 3.700.000  | Mitsubishi UFJ Financial Group Inc* | 3,27 %  | 19.09.2025            | 3.645.355       | 0,40                         |
| 1.500.000  | MMS USA Holdings Inc*               | 0,63 %  | 13.06.2025            | 1.402.753       | 0,15                         |
| 5.000.000  | Molson Coors Beverage Co*           | 1,25 %  | 15.07.2024            | 4.841.550       | 0,53                         |
| 11.500.000   | Morgan Stanley*                     | 1,88 %  | 27.04.2027            | 10.567.097      | 1,17                         |
| 3.000.000  | Mylan Inc*                          | 2,13 %  | 23.05.2025            | 2.869.116       | 0,32                         |
| 6.000.000  | Nationale-Niederlanden Bank NV*     | 1,00 %  | 25.09.2028            | 5.327.448       | 0,59                         |
| 1.200.000  | Nationwide Building Society*        | 3,25 %  | 05.09.2029            | 1.133.292       | 0,12                         |
| 5.000.000  | NatWest Group Plc*                  | 1,75 %  | 02.03.2026            | 4.748.692       | 0,52                         |
| 5.000.000  | NatWest Markets Plc*                | 0,13 %  | 12.11.2025            | 4.530.075       | 0,50                         |
| 2.000.000  | NatWest Markets Plc*                | 0,13 %  | 18.06.2026            | 1.766.534       | 0,19                         |
| 2.700.000  | NatWest Markets Plc*                | 2,00 %  | 27.08.2025            | 2.568.820       | 0,28                         |
| 2.000.000  | NGG Finance Plc*                    | 1,63 %  | 05.12.2079            | 1.895.890       | 0,21                         |
| 1.500.000  | Nordea Bank Abp*                    | 1,00 %  | 27.06.2029            | 1.433.038       | 0,16                         |
| 900.000  | Ontex Group NV*                     | 3,50 %  | 15.07.2026            | 794.385         | 0,09                         |
| 2.000.000  | Orano SA*                           | 3,38 %  | 23.04.2026            | 1.948.880       | 0,21                         |

## Ultra Short Term Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                          | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|-----------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 77,93 % (31. Dezember 2022: 81,63 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                 |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |  |        |                       |                 |                              |
| 1.000.000  | Paprec Holding SA*                             | 4,00 % | 31.03.2025            | 982.425         | 0,11                         |
| 500.000  | PCF GmbH*                                      | 4,75 % | 15.04.2026            | 386.602         | 0,04                         |
| 400.000  | PEU Finance Plc*                               | 7,25 % | 01.07.2028            | 400.895         | 0,04                         |
| 1.500.000  | Pinnacle Bidco Plc*                            | 5,50 % | 15.02.2025            | 1.445.625       | 0,16                         |
| 1.800.000  | Playtech Plc*                                  | 4,25 % | 07.03.2026            | 1.762.400       | 0,19                         |
| 2.200.000  | Playtech Plc*                                  | 5,88 % | 28.06.2028            | 2.194.500       | 0,24                         |
| 100.000  | PLT VII Finance Sarl**                         | 4,63 % | 05.01.2026            | 97.412          | 0,01                         |
| 2.100.000  | Prosus NV*                                     | 2,78 % | 19.01.2034            | 1.549.893       | 0,17                         |
| 2.000.000  | RCI Banque SA*                                 | 0,50 % | 15.09.2023            | 1.986.352       | 0,22                         |
| 1.700.000  | RCI Banque SA*                                 | 0,50 % | 14.07.2025            | 1.573.931       | 0,17                         |
| 1.800.000  | RCI Banque SA*                                 | 1,63 % | 11.04.2025            | 1.719.875       | 0,19                         |
| 1.500.000  | RCI Banque SA*                                 | 1,75 % | 10.04.2026            | 1.396.125       | 0,15                         |
| 3.000.000  | RCI Banque SA*                                 | 2,00 % | 11.07.2024            | 2.935.254       | 0,32                         |
| 1.500.000  | Realty Income Corp*                            | 5,13 % | 06.07.2034            | 1.500.008       | 0,17                         |
| 3.000.000  | Repsol International Finance BV*               | 2,50 % | 29.12.2049            | 2.619.863       | 0,29                         |
| 4.000.000  | Ryanair DAC*                                   | 0,88 % | 25.05.2026            | 3.653.200       | 0,40                         |
| 3.380.000  | Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB*           | 2,63 % | 29.12.2049            | 683.605         | 0,08                         |
| 5.000.000  | Santander UK Group Holdings Plc*               | 0,39 % | 28.02.2025            | 4.852.885       | 0,54                         |
| 500.000  | Sappi Papier Holding GmbH*                     | 3,63 % | 15.03.2028            | 440.325         | 0,05                         |
| 2.000.000  | Scania CV AB*                                  | 0,50 % | 06.10.2023            | 1.981.940       | 0,22                         |
| 1.900.000  | SELP Finance Sarl*                             | 3,75 % | 10.08.2027            | 1.780.954       | 0,20                         |
| 1.000.000  | Simon International Finance SCA*               | 1,25 % | 13.05.2025            | 938.844         | 0,10                         |
| 1.000.000  | Smurfit Kappa Acquisitions ULC*                | 2,88 % | 15.01.2026            | 966.018         | 0,11                         |
| 1.000.000  | Societe Generale SA*                           | 1,25 % | 15.02.2024            | 983.410         | 0,11                         |
| 2.000.000  | SoftBank Group Corp*                           | 2,13 % | 06.07.2024            | 1.935.000       | 0,21                         |
| 1.800.000  | SoftBank Group Corp*                           | 5,00 % | 15.04.2028            | 1.680.300       | 0,19                         |
| 3.000.000  | Solvay Finance SACA*                           | 5,43 % | 29.12.2049            | 3.001.875       | 0,33                         |
| 4.640.000  | Southern Co*                                   | 1,88 % | 15.09.2081            | 3.642.066       | 0,40                         |
| 15.000.000   | Sumitomo Mitsui Banking Corp*                  | 3,60 % | 16.02.2026            | 14.814.000      | 1,63                         |
| 710.000  | Summit Properties Ltd*                         | 2,00 % | 31.01.2025            | 651.421         | 0,07                         |
| 4.900.000  | Swedbank AB*                                   | 4,63 % | 30.05.2026            | 4.867.253       | 0,54                         |
| 1.200.000  | TDC Net A/S*                                   | 5,62 % | 06.02.2030            | 1.178.584       | 0,13                         |
| 2.100.000  | Telecom Italia SpA*                            | 6,88 % | 15.02.2028            | 2.096.661       | 0,23                         |
| 1.500.000  | Telefonica Europe BV*                          | 2,38 % | 29.12.2049            | 1.183.042       | 0,13                         |
| 200.000  | Tereos Finance Groupe I SA**                   | 4,75 % | 30.04.2027            | 190.262         | 0,02                         |
| 1.800.000  | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV* | 1,63 % | 15.10.2028            | 1.395.488       | 0,15                         |
| 1.800.000  | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV* | 7,38 % | 15.09.2029            | 1.838.232       | 0,20                         |
| 5.550.000  | Thames Water Utilities Finance Plc*            | 0,19 % | 23.10.2023            | 5.350.422       | 0,59                         |
| 1.500.000  | Thames Water Utilities Finance Plc*            | 4,00 % | 18.04.2027            | 1.354.972       | 0,15                         |
| 2.000.000  | Toronto-Dominion Bank*                         | 2,55 % | 03.08.2027            | 1.877.122       | 0,21                         |

## Ultra Short Term Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                  | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR    | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 77,93 % (31. Dezember 2022: 81,63 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                    |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |  |        |                       |                    |                              |
| 3.800.000  | TotalEnergies SE*                      | 2,00 % | 29.12.2049            | 3.319.718          | 0,37                         |
| 5.000.000  | UBS Group AG*                          | 0,25 % | 29.01.2026            | 4.610.660          | 0,51                         |
| 8.300.000  | UBS Group AG*                          | 1,25 % | 17.07.2025            | 7.947.507          | 0,88                         |
| 5.500.000  | UBS Group AG*                          | 2,13 % | 13.10.2026            | 5.124.033          | 0,57                         |
| 700.000  | UBS Group AG*                          | 3,25 % | 02.04.2026            | 674.872            | 0,07                         |
| 2.500.000  | Unibail-Rodamco-Westfield SE*          | 2,13 % | 29.12.2049            | 2.116.575          | 0,23                         |
| 3.500.000  | UniCredit SpA**                        | 1,20 % | 20.01.2026            | 3.315.074          | 0,37                         |
| 5.000.000  | UniCredit SpA*                         | 1,25 % | 16.06.2026            | 4.693.318          | 0,52                         |
| 5.896.000  | UniCredit SpA**                        | 2,20 % | 22.07.2027            | 5.448.883          | 0,60                         |
| 2.200.000  | UniCredit SpA**                        | 5,85 % | 15.11.2027            | 2.254.094          | 0,25                         |
| 1.200.000  | United Group BV**                      | 5,25 % | 01.02.2030            | 952.452            | 0,11                         |
| 8.300.000  | US Bancorp*                            | 0,85 % | 07.06.2024            | 7.968.299          | 0,88                         |
| 15.000.000   | Utah Acquisition Sub Inc*              | 2,25 % | 22.11.2024            | 14.540.685         | 1,60                         |
| 2.900.000  | Veolia Environnement SA*               | 2,50 % | 29.12.2049            | 2.402.946          | 0,27                         |
| 100.000  | Verisure Holding AB*                   | 7,13 % | 01.02.2028            | 100.575            | 0,01                         |
| 1.600.000  | Virgin Money UK Plc*                   | 2,88 % | 24.06.2025            | 1.550.618          | 0,17                         |
| 3.000.000  | Vivion Investments Sarl*               | 3,00 % | 08.08.2024            | 2.404.938          | 0,27                         |
| 2.600.000  | Vodafone Group Plc*                    | 3,00 % | 27.08.2080            | 2.101.141          | 0,23                         |
| 4.800.000  | Volkswagen Bank GmbH*                  | 2,50 % | 31.07.2026            | 4.548.019          | 0,50                         |
| 2.000.000  | Volkswagen Financial Services AG*      | 0,00 % | 12.02.2025            | 1.865.630          | 0,21                         |
| 3.200.000  | Volkswagen Financial Services AG*      | 0,25 % | 31.01.2025            | 3.000.954          | 0,33                         |
| 1.500.000  | Volkswagen International Finance NV*   | 3,75 % | 29.12.2049            | 1.308.712          | 0,14                         |
| 1.600.000  | Volkswagen International Finance NV*   | 3,88 % | 29.03.2026            | 1.577.191          | 0,17                         |
| 2.000.000  | VZ Vendor Financing II BV*             | 2,88 % | 15.01.2029            | 1.541.038          | 0,17                         |
| 10.000.000   | Westpac Banking Corp*                  | 3,46 % | 04.04.2025            | 9.911.170          | 1,09                         |
| 9.000.000  | Wizz Air Finance Co BV*                | 1,00 % | 19.01.2026            | 7.950.393          | 0,88                         |
| 1.000.000  | Wizz Air Finance Co BV*                | 1,35 % | 19.01.2024            | 979.115            | 0,11                         |
| 1.000.000  | ZF Finance GmbH*                       | 2,00 % | 06.05.2027            | 872.585            | 0,10                         |
| <b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>706.243.010</b> | <b>77,93</b>                 |
| <b>Staatsanleihen 7,25 % (31. Dezember 2022: 6,87 %)</b>                       |  |        |                       |                    |                              |
| <b>Euro</b>  |  |        |                       |                    |                              |
| 5.340.000  | Bank Gospodarstwa Krajowego*           | 3,00 % | 30.05.2029            | 4.957.122          | 0,55                         |
| 3.400.000  | Bank Gospodarstwa Krajowego*           | 4,00 % | 08.09.2027            | 3.360.808          | 0,37                         |
| 2.000.000  | Bank Gospodarstwa Krajowego*           | 5,13 % | 22.02.2033            | 2.077.372          | 0,23                         |
| 1.320.000  | Chile Government International Bond**  | 4,13 % | 05.07.2034            | 1.310.925          | 0,14                         |
| 2.000.000  | Croatia Government International Bond* | 2,88 % | 22.04.2032            | 1.882.846          | 0,21                         |
| 4.400.000  | Croatia Government International Bond* | 4,00 % | 14.06.2035            | 4.395.886          | 0,49                         |
| 1.240.000  | Estonia Government International Bond* | 4,00 % | 12.10.2032            | 1.275.625          | 0,14                         |
| 1.990.000  | European Stability Mechanism*          | 3,00 % | 23.08.2033            | 1.984.908          | 0,22                         |

## Ultra Short Term Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                    | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR    | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 7,25 % (31. Dezember 2022: 6,87 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                    |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |  |        |                       |                    |                              |
| 3.078.000  | European Union*                          | 3,38 % | 04.10.2038            | 3.117.377          | 0,34                         |
| 1.000.000  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*       | 0,25 % | 15.03.2028            | 852.700            | 0,09                         |
| 6.731.450  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**      | 1,30 % | 15.05.2028            | 6.605.343          | 0,73                         |
| 3.000.000  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**      | 1,75 % | 30.05.2024            | 2.944.401          | 0,33                         |
| 2.599.360  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**      | 3,10 % | 15.09.2026            | 2.724.953          | 0,30                         |
| 3.000.000  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*       | 3,40 % | 28.03.2025            | 2.977.142          | 0,33                         |
| 750.000  | Italy Government International Bond*     | 5,13 % | 31.07.2024            | 758.145            | 0,08                         |
| 2.205.000  | Kingdom of Belgium Government Bond*      | 3,30 % | 22.06.2054            | 2.158.938          | 0,24                         |
| 1.735.000  | Lithuania Government International Bond* | 3,88 % | 14.06.2033            | 1.748.148          | 0,19                         |
| 2.000.000  | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT*       | 3,50 % | 18.06.2038            | 2.001.770          | 0,22                         |
| 2.147.000  | Romanian Government International Bond*  | 1,75 % | 13.07.2030            | 1.641.414          | 0,18                         |
| 2.800.000  | Romanian Government International Bond*  | 2,00 % | 28.01.2032            | 2.062.768          | 0,23                         |
| 4.900.000  | Romanian Government International Bond*  | 3,62 % | 26.05.2030            | 4.305.777          | 0,48                         |
| 1.000.000  | Romanian Government International Bond*  | 3,88 % | 29.10.2035            | 794.837            | 0,09                         |
| 2.200.000  | Romanian Government International Bond*  | 6,63 % | 27.09.2029            | 2.287.296          | 0,25                         |
| 1.800.000  | Slovenia Government Bond*                | 1,50 % | 25.03.2035            | 1.451.932          | 0,16                         |
| 1.170.000  | Slovenia Government Bond*                | 3,63 % | 11.03.2033            | 1.208.990          | 0,13                         |
| 2.100.000  | Spain Government Bond*                   | 0,80 % | 30.07.2029            | 1.819.498          | 0,20                         |
| 1.850.000  | Spain Government Bond*                   | 3,15 % | 30.04.2033            | 1.813.279          | 0,20                         |
| 1.144.000  | Spain Government Bond*                   | 3,55 % | 31.10.2033            | 1.154.473          | 0,13                         |
| <b>Staatsanleihen insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>65.674.673</b>  | <b>7,25</b>                  |
| <b>Anlagen insgesamt</b>   |  |        |                       | <b>863.500.662</b> | <b>95,28</b>                 |

## Devisenterminkontrakte 0,07 % (31. Dezember 2022: 0,03 %)

| Geforderter<br>Betrag   | Zu zahlender<br>Betrag | Fälligkeits-<br>datum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn EUR | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|------------------------|-----------------------|-----------------------------|-----------|-------------------------------------|------------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i>   |                        |                       |                             |           |                                     |                              |
| 42.540 CHF  | 43.128 €               | 20.07.2023            | Goldman Sachs International | 1         | 492                                 | 0,00                         |
| 6.934.853 CHF   | 7.056.292 €            | 20.07.2023            | Westpac Banking Corp        | 6         | 54.599                              | 0,01                         |
| 35.432 €  | 34.387 CHF             | 20.07.2023            | Westpac Banking Corp        | 5         | 172                                 | 0,00                         |
| <i>Abgesicherte Klassen USD</i>   |                        |                       |                             |           |                                     |                              |
| 1.369.066 US\$  | 1.243.361 €            | 20.07.2023            | Goldman Sachs International | 1         | 10.536                              | 0,00                         |
| 94.495.738 US\$   | 86.031.644 €           | 20.07.2023            | Westpac Banking Corp        | 6         | 514.882                             | 0,06                         |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                        |                       |                             |           | <b>580.681</b>                      | <b>0,07</b>                  |

## Futures-Kontrakte 0,02 % (31. Dezember 2022: 1,14 %)

| Anzahl<br>Kontrakte | Beschreibung                    | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn EUR | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---------------------|---------------------------------|-------------------------------------|------------------------------|
| (69)                | Euro-BOBL Future September 2023 | 71.760                              | 0,01                         |
| 1                   | Euro-BTP Future September 2023  | 500                                 | 0,00                         |

## Ultra Short Term Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Futures-Kontrakte 0,02 % (31. Dezember 2022: 1,14 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte   | Beschreibung                    | Nicht realisierter Gewinn EUR | % des Nettovermögens |
|--|---------------------------------|-------------------------------|----------------------|
| (363)  | Euro-Bund Future September 2023 | 128.760                       | 0,01                 |
| (14)   | Euro-OAT Future September 2023  | 2.240                         | 0,00                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten *</b>  |                                 | <b>203.260</b>                | <b>0,02</b>          |
|  |                                 | Zeitwert EUR                  | % des Nettovermögens |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> |                                 | <b>864.284.603</b>            | <b>95,37</b>         |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (0,00 %) (31. Dezember 2022: (0,80 %))

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei          | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust EUR | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|----------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i>  |                     |                  |                      |           |                                |                      |
| 45.195 CHF   | 46.538 €            | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp | 3         | (195)                          | (0,00)               |
| 111.827 €  | 109.265 CHF         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp | 6         | (211)                          | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen USD</i>  |                     |                  |                      |           |                                |                      |
| 214.045 €  | 237.272 US\$        | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp | 2         | (3.267)                        | (0,00)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                      |           | <b>(3.673)</b>                 | <b>(0,00)</b>        |

### Futures-Kontrakte (0,09 %) (31. Dezember 2022: (0,21 %))

| Anzahl Kontrakte   | Beschreibung   | Nicht realisierter Verlust EUR | % des Nettovermögens |
|--|--|--------------------------------|----------------------|
| 290  | Euro-BOBL Call Option on Future August 2023, Strike Price EUR 116.25 | (14.031)                       | (0,00)               |
| (101)  | Euro-Buxl 30-Year Bond Future September 2023                         | (408.040)                      | (0,04)               |
| 949  | Euro-Schatz Future September 2023                                    | (416.840)                      | (0,05)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten *</b> |  | <b>(838.911)</b>               | <b>(0,09)</b>        |

### Credit-Default-Swap-Kontrakte (0,12 %) (31. Dezember 2022: (0,07 %))

| Nominalwert  | Fälligkeit | Gegenpartei                 | Referenzverbindlichkeit                                  | Zeitwert EUR       | % des Nettovermögens |
|--|------------|-----------------------------|--|--------------------|----------------------|
| EUR 26.500.000   | 20.06.2028 | ICE Clear U.S. <sup>1</sup> | Buying default protection on iTRAXX Europe Crossover S39 | (1.053.137)        | (0,12)               |
| <b>Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten insgesamt *</b> |            |                             |  | <b>(1.053.137)</b> | <b>(0,12)</b>        |

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

## Ultra Short Term Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Zinsswap-Kontrakte (0,13 %) (31. Dezember 2022: (0,21 %))

|  | Nominalwert | Fälligkeit | Gegenpartei                   | Erhalt/(Zahlung) <sup>#</sup> | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Verlust EUR | % des Nettovermögens |
|--|-------------|------------|-------------------------------|-------------------------------|-----------------|--------------------|--------------------------------|----------------------|
| EUR  | 30.200.000  | 05.05.2026 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 2,94 %          | 1D €STR            | (371.982)                      | (0,04)               |
| EUR  | 12.479.054  | 30.08.2032 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 2,22 %          | 6M EURIBOR         | (781.733)                      | (0,09)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Zinsswapkontrakten<sup>∞</sup></b> |             |            |                               |                               |                 |                    | <b>(1.153.715)</b>             | <b>(0,13)</b>        |

<sup>#</sup>Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.<sup>(Zahlung)</sup> – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

|   | Zeitwert EUR       | % des Nettovermögens |
|---|--------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(3.049.436)</b> | <b>(0,34)</b>        |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>861.235.167</b> | <b>95,03</b>         |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>45.018.828</b>  | <b>4,97</b>          |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>906.253.995</b> | <b>100,00</b>        |

| Portfolioanalyse  | EUR                | % des Gesamtvermögens |
|---|--------------------|-----------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 701.290.712        | 76,13                 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden            | 162.209.950        | 17,61                 |
| ± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden                          | (635.651)          | (0,07)                |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap                            | (1.629.844)        | (0,18)                |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>861.235.167</b> | <b>93,49</b>          |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der Anteile                               | Wertpapierbezeichnung                          | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|------------------|------------------------------|
| <b>Aktien 9,60 % (31. Dezember 2022: 4,32 %)</b> |  |                  |                              |
| <b>Euro</b>                                      |  |                  |                              |
| 80.000   | Epic Acquisition Corp                          | 890.256          | 0,04                         |
| 52.998   | European Healthcare Acquisition & Growth Co BV | 575.317          | 0,03                         |
| <b>Euro insgesamt</b>                            |  | <b>1.465.573</b> | <b>0,07</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>                                 |  |                  |                              |
| 2.600  | AbbVie Inc                                     | 350.298          | 0,01                         |
| 26.432   | Advanced Micro Devices Inc                     | 3.010.869        | 0,13                         |
| 6.184  | AECOM  | 523.723          | 0,02                         |
| 5.807  | AeroVironment Inc                              | 593.940          | 0,03                         |
| 154.179  | Akamai Technologies Inc                        | 13.856.067       | 0,61                         |
| 1.360  | Align Technology Inc                           | 480.950          | 0,02                         |
| 24.389   | Alliant Energy Corp                            | 1.279.935        | 0,06                         |
| 532.531  | American Airlines Group Inc                    | 9.553.606        | 0,42                         |
| 7.295  | Apple Inc                                      | 1.415.011        | 0,06                         |
| 1.706  | Applied Materials Inc                          | 246.585          | 0,01                         |
| 16.610   | AppLovin Corp Class A                          | 427.375          | 0,02                         |
| 6.536  | Axon Enterprise Inc                            | 1.275.304        | 0,06                         |
| 10.569   | Bath & Body Works Inc                          | 396.338          | 0,02                         |
| 8.010  | Best Buy Co Inc                                | 656.420          | 0,03                         |
| 338  | Biogen Inc                                     | 96.279           | 0,00                         |
| 3.564  | Boyd Gaming Corp                               | 247.235          | 0,01                         |
| 3.377  | Broadcom Inc                                   | 2.929.311        | 0,13                         |
| 242.160  | Carnival Corp                                  | 4.559.873        | 0,20                         |
| 254.323  | Ceridian HCM Holding Inc                       | 17.032.011       | 0,75                         |
| 7.875  | Chemours Co                                    | 290.509          | 0,01                         |
| 10.344   | CMS Energy Corp                                | 607.710          | 0,03                         |
| 16.233   | Confluent Inc Class A                          | 573.187          | 0,02                         |
| 24.813   | CONMED Corp                                    | 3.371.839        | 0,15                         |
| 19.721   | Devon Energy Corp                              | 953.313          | 0,04                         |
| 3.264  | Dick's Sporting Goods Inc                      | 431.468          | 0,02                         |
| 15.294   | DISH Network Corp Class A                      | 100.787          | 0,00                         |
| 1.955  | Eagle Materials Inc                            | 364.451          | 0,02                         |
| 48.043   | Envestnet Inc                                  | 2.851.352        | 0,12                         |
| 42.462   | FirstEnergy Corp                               | 1.650.923        | 0,07                         |
| 1.262  | Five Below Inc                                 | 248.033          | 0,01                         |
| 780  | Foot Locker Inc                                | 21.146           | 0,00                         |
| 88.772   | Ford Motor Co                                  | 1.343.120        | 0,06                         |
| 2.070  | Fortinet Inc                                   | 156.471          | 0,01                         |
| 3.091  | FTI Consulting Inc                             | 587.908          | 0,03                         |



## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile  | Wertpapierbezeichnung                | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Aktien 9,60% (31. Dezember 2022: 4,32 %) (Fortsetzung)</b> |                                      |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>                                |                                      |                  |                              |
| 43.021  | Guardant Health Inc                  | 1.540.152        | 0,07                         |
| 163.133   | Herbalife Ltd                        | 2.159.881        | 0,09                         |
| 11.450  | HP Inc                               | 351.630          | 0,01                         |
| 9.233   | Insmed Inc                           | 194.816          | 0,01                         |
| 80.136  | Insulet Corp                         | 23.106.414       | 1,01                         |
| 2.054   | InterDigital Inc                     | 198.314          | 0,01                         |
| 6.380   | ITT Inc                              | 594.680          | 0,03                         |
| 1.107   | Johnson & Johnson                    | 183.231          | 0,01                         |
| 3.184   | Kimberly-Clark Corp                  | 439.583          | 0,02                         |
| 11.095  | Kroger Co                            | 521.465          | 0,02                         |
| 1.554   | Lam Research Corp                    | 999.004          | 0,04                         |
| 26.351  | Lantheus Holdings Inc                | 2.211.376        | 0,10                         |
| 69.827  | Live Nation Entertainment Inc        | 6.361.938        | 0,28                         |
| 6.744   | Louisiana-Pacific Corp               | 505.665          | 0,02                         |
| 156.092   | Lyft Inc Class A                     | 1.496.922        | 0,07                         |
| 4.280   | LyondellBasell Industries NV Class A | 393.032          | 0,02                         |
| 56.669  | Marriott Vacations Worldwide Corp    | 6.954.420        | 0,30                         |
| 69.789  | Match Group Inc                      | 2.920.670        | 0,13                         |
| 346   | Meta Platforms Inc Class A           | 99.295           | 0,00                         |
| 480   | Micron Technology Inc                | 30.293           | 0,00                         |
| 574   | Microsoft Corp                       | 195.470          | 0,01                         |
| 278.376   | Middleby Corp                        | 41.152.324       | 1,80                         |
| 2.544   | Netflix Inc                          | 1.120.607        | 0,05                         |
| 56.074  | NextEra Energy Partners LP           | 3.288.179        | 0,14                         |
| 31.681  | Northern Oil & Gas Inc               | 1.087.292        | 0,05                         |
| 76.744  | Norwegian Cruise Line Holdings Ltd   | 1.670.717        | 0,07                         |
| 112.029   | Okta Inc Class A                     | 7.769.211        | 0,34                         |
| 39.819  | ON Semiconductor Corp                | 3.766.081        | 0,16                         |
| 11.513  | ONEOK Inc                            | 710.582          | 0,03                         |
| 18.531  | Ormat Technologies Inc               | 1.491.004        | 0,06                         |
| 37.469  | Palo Alto Networks Inc               | 9.573.704        | 0,42                         |
| 48.736  | Peabody Energy Corp                  | 1.055.622        | 0,05                         |
| 42.672  | PG&E Corp                            | 737.372          | 0,03                         |
| 1.173   | PPL Corp                             | 31.038           | 0,00                         |
| 3.565   | RH                                   | 1.174.988        | 0,05                         |
| 1.650   | S&P Global Inc                       | 661.469          | 0,03                         |
| 224   | Sarepta Therapeutics Inc             | 25.652           | 0,00                         |
| 26.879  | Shift4 Payments Inc Class A          | 1.825.353        | 0,08                         |
| 1.650   | Skechers USA Inc Class A             | 86.889           | 0,00                         |
| 1.320   | Skyworks Solutions Inc               | 146.111          | 0,01                         |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile   | Wertpapierbezeichnung                             |                       | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Aktien 9,60% (31. Dezember 2022: 4,32 %) (Fortsetzung)</b>            |   |                       |                    |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |                       |                    |                              |
| 26.292   | Southern Co                                       |                       | 1.847.013          | 0,08                         |
| 4.061  | Starbucks Corp                                    |                       | 402.283            | 0,02                         |
| 32.815   | Sunnova Energy International Inc                  |                       | 600.843            | 0,03                         |
| 1.890  | T Rowe Price Group Inc                            |                       | 211.718            | 0,01                         |
| 2.514  | Take-Two Interactive Software Inc                 |                       | 369.960            | 0,02                         |
| 7.560  | Targa Resources Corp                              |                       | 575.316            | 0,02                         |
| 10.880   | Tenet Healthcare Corp                             |                       | 885.414            | 0,04                         |
| 5.968  | T-Mobile US Inc                                   |                       | 828.955            | 0,04                         |
| 16.370   | Unum Group  |                       | 780.849            | 0,03                         |
| 2.205  | Valero Energy Corp                                |                       | 258.646            | 0,01                         |
| 4.807  | VeriSign Inc                                      |                       | 1.086.238          | 0,05                         |
| 18.910   | Viatis Inc  |                       | 188.722            | 0,01                         |
| 60.149   | Vishay Intertechnology Inc                        |                       | 1.768.381          | 0,08                         |
| 960  | Walmart Inc                                       |                       | 150.893            | 0,01                         |
| 41.771   | Wayfair Inc Class A                               |                       | 2.715.533          | 0,12                         |
| 3.644  | Westinghouse Air Brake Technologies Corp          |                       | 399.637            | 0,02                         |
| 5.530  | Williams Cos Inc                                  |                       | 180.444            | 0,01                         |
| 2.352  | Winnebago Industries Inc                          |                       | 156.855            | 0,01                         |
| 2.262  | Wolfspeed Inc                                     |                       | 125.745            | 0,01                         |
| 5.047  | Wynn Resorts Ltd                                  |                       | 533.014            | 0,02                         |
| 82.579   | ZTO Express Cayman Inc ADR                        |                       | 2.071.081          | 0,09                         |
|  | <b>US-Dollar insgesamt</b>                        |                       | <b>217.453.333</b> | <b>9,53</b>                  |
|  | <b>Aktien insgesamt *</b>                         |                       | <b>218.918.906</b> | <b>9,60</b>                  |
| <b>Immobilienaktiengesellschaften 0,01 % (31. Dezember 2022: 0,16 %)</b> |   |                       |                    |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |   |                       |                    |                              |
| 11.375   | Tanger Factory Outlet Centers Inc                 |                       | 251.046            | 0,01                         |
|  | <b>Immobilienaktiengesellschaften insgesamt *</b> |                       | <b>251.046</b>     | <b>0,01</b>                  |
| Anzahl der Anteile   | Wertpapierbezeichnung                             | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
| <b>Participatory Notes 0,01 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)</b>            |   |                       |                    |                              |
| <b>Euro</b>  |   |                       |                    |                              |
| 40.000   | Epic Acquisition Corp                             | 06.12.2026            | 2.182              | 0,00                         |
|  | <b>Euro insgesamt</b>                             |                       | <b>2.182</b>       | <b>0,00</b>                  |
| <b>Britisches Pfund</b>  |   |                       |                    |                              |
| 50.000   | New Energy One Acquisition Corp Plc               | 07.03.2027            | 15.892             | 0,00                         |
|  | <b>Britisches Pfund insgesamt</b>                 |                       | <b>15.892</b>      | <b>0,00</b>                  |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile   | Wertpapierbezeichnung               | Fälligkeitsdatum | Zeitwert US\$  | % des Nettovermögens |
|--|-------------------------------------|------------------|----------------|----------------------|
| <b>Participatory Notes 0,01% (31. Dezember 2022: 0,00 %) (Fortsetzung)</b> |                                     |                  |                |                      |
| <b>US-Dollar</b>   |                                     |                  |                |                      |
| 2.600  | Baskets-United States               | 18.08.2023       | 245.700        | 0,01                 |
| 19.500   | Goldman Sachs International         | 22.08.2023       | 195            | 0,00                 |
| 19.500   | Merrill Lynch International & Co CV | 18.08.2023       | 15.210         | 0,00                 |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |                                     |                  | <b>261.105</b> | <b>0,01</b>          |
| <b>Participatory Notes insgesamt **</b>                                    |                                     |                  | <b>279.179</b> | <b>0,01</b>          |

| Kapitalbetrag   | Wertpapierbezeichnung       | Kupon  | Fälligkeitsdatum | Zeitwert US\$        | % des Nettovermögens |
|---|-----------------------------|--------|------------------|----------------------|----------------------|
| <b>Schatzwechsel 46,28 % (31. Dezember 2022: 50,57 %)</b> |                             |        |                  |                      |                      |
| <b>US-Dollar</b>  |                             |        |                  |                      |                      |
| 125.000.000   | United States Treasury Bill | 0,00 % | 05.07.2023       | 124.965.964          | 5,48                 |
| 80.000.000  | United States Treasury Bill | 0,00 % | 01.08.2023       | 79.674.072           | 3,49                 |
| 80.000.000  | United States Treasury Bill | 0,00 % | 10.08.2023       | 79.567.011           | 3,49                 |
| 85.000.000  | United States Treasury Bill | 0,00 % | 17.08.2023       | 84.452.069           | 3,70                 |
| 80.000.000  | United States Treasury Bill | 0,00 % | 24.08.2023       | 79.402.000           | 3,48                 |
| 60.000.000  | United States Treasury Bill | 0,00 % | 31.08.2023       | 59.492.919           | 2,61                 |
| 110.000.000   | United States Treasury Bill | 0,00 % | 07.09.2023       | 108.965.450          | 4,78                 |
| 115.000.000   | United States Treasury Bill | 0,00 % | 19.09.2023       | 113.715.172          | 4,98                 |
| 100.000.000   | United States Treasury Bill | 0,00 % | 26.09.2023       | 98.788.711           | 4,33                 |
| 100.000.000   | United States Treasury Bill | 0,00 % | 03.10.2023       | 98.680.694           | 4,32                 |
| 130.000.000   | United States Treasury Bill | 0,00 % | 10.10.2023       | 128.153.065          | 5,62                 |
| <b>Schatzwechsel insgesamt **</b>                         |                             |        |                  | <b>1.055.857.127</b> | <b>46,28</b>         |

|   |                           |        |            |                   |             |
|---|---------------------------|--------|------------|-------------------|-------------|
| <b>Unternehmensanleihen 11,66 % (31. Dezember 2022: 5,16 %)</b> |                           |        |            |                   |             |
| <b>Euro</b>   |                           |        |            |                   |             |
| 2.600.000   | Banco Santander SA*       | 3,63 % | 29.12.2049 | 1.874.343         | 0,08        |
| 1.400.000   | HSBC Holdings Plc*        | 4,75 % | 29.12.2049 | 1.293.443         | 0,05        |
| 5.000.000   | Intesa Sanpaolo SpA*      | 6,38 % | 29.12.2049 | 4.745.681         | 0,21        |
| 7.800.000   | Societe Generale SA*      | 7,88 % | 29.12.2049 | 8.166.217         | 0,36        |
| 2.600.000   | UniCredit SpA*            | 4,45 % | 29.12.2049 | 2.236.761         | 0,10        |
| 13.400.000  | UniCredit SpA*            | 7,50 % | 29.12.2049 | 14.389.057        | 0,63        |
| 4.200.000   | Wendel SE*                | 2,63 % | 27.03.2026 | 4.488.723         | 0,20        |
| <b>Euro insgesamt</b>   |                           |        |            | <b>37.194.225</b> | <b>1,63</b> |
| <b>Britisches Pfund</b>   |                           |        |            |                   |             |
| 7.000.000   | Barclays Plc*             | 8,88 % | 29.12.2049 | 8.211.691         | 0,36        |
| 2.600.000   | Barclays Plc*             | 9,25 % | 29.12.2049 | 2.995.222         | 0,13        |
| 4.100.000   | Lloyds Banking Group Plc* | 7,88 % | 29.12.2049 | 4.626.031         | 0,20        |
| 2.140.000   | Lloyds Banking Group Plc* | 8,50 % | 29.12.2049 | 2.561.213         | 0,11        |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag  | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---|---------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 11,66 % (31. Dezember 2022: 5,16 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                   |                              |
| <b>Britisches Pfund</b>   |   |         |                       |                   |                              |
| 7.500.000   | Lloyds Banking Group Plc <sup>*</sup>                               | 8,50 %  | 29.12.2049            | 8.861.611         | 0,39                         |
| <b>Britisches Pfund insgesamt</b>   |   |         |                       | <b>27.255.768</b> | <b>1,19</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>  |   |         |                       |                   |                              |
| 4.000.000   | 2001 Cat RE Ltd <sup>**</sup>                                       | 17,93 % | 08.01.2024            | 3.933.000         | 0,17                         |
| 5.000.000   | Alamo Re Ltd <sup>**</sup>  | 13,78 % | 07.06.2026            | 4.913.375         | 0,22                         |
| 3.000.000   | Aquila Re I Ltd Series 2023-1 <sup>*</sup>                          | 10,52 % | 08.06.2026            | 2.993.850         | 0,13                         |
| 3.000.000   | Atlas Capital Reinsurance 2020 DAC <sup>**</sup>                    | 13,58 % | 10.06.2024            | 2.999.775         | 0,13                         |
| 2.250.000   | Atlas Capital Reinsurance 2022 Designated Activity Co <sup>**</sup> | 14,59 % | 06.06.2025            | 2.255.456         | 0,10                         |
| 2.250.000   | Blue Halo Re Ltd <sup>*</sup>                                       | 15,02 % | 24.02.2025            | 2.142.675         | 0,09                         |
| 3.000.000   | Bonanza RE Ltd <sup>**</sup>  | 13,52 % | 08.01.2026            | 2.976.000         | 0,13                         |
| 2.400.000   | Cape Lookout Re Ltd <sup>**</sup>                                   | 10,27 % | 28.03.2025            | 2.273.160         | 0,10                         |
| 5.250.000   | Cape Lookout Re Ltd <sup>**</sup>                                   | 11,77 % | 28.04.2026            | 5.302.106         | 0,23                         |
| 1.500.000   | Cosaint Re Pte Ltd <sup>**</sup>                                    | 14,78 % | 03.04.2024            | 1.223.437         | 0,05                         |
| 1.075.000   | Everglades Re II Ltd <sup>*</sup>                                   | 10,93 % | 14.05.2024            | 999.589           | 0,04                         |
| 5.750.000   | Finca RE Ltd <sup>**</sup>  | 13,02 % | 06.06.2025            | 5.739.363         | 0,25                         |
| 3.750.000   | Gateway Re II Ltd <sup>**</sup>                                     | 14,77 % | 27.04.2026            | 3.718.313         | 0,16                         |
| 3.750.000   | Gateway Re Ltd <sup>**</sup>  | 18,27 % | 24.02.2026            | 3.881.156         | 0,17                         |
| 3.000.000   | Herbie Re Ltd <sup>**</sup>   | 14,41 % | 08.07.2024            | 2.996.850         | 0,13                         |
| 2.000.000   | Herbie Re Ltd <sup>**</sup>   | 15,00 % | 08.01.2025            | 1.936.550         | 0,09                         |
| 1.500.000   | Herbie Re Ltd <sup>*</sup>  | 22,53 % | 06.06.2025            | 937.500           | 0,04                         |
| 5.125.000   | Hestia Re Ltd <sup>**</sup>   | 14,78 % | 22.04.2025            | 4.432.356         | 0,19                         |
| 4.000.000   | Hestia Re Ltd <sup>**</sup>   | 15,03 % | 07.04.2026            | 3.992.300         | 0,18                         |
| 11.200.000  | HSBC Holdings Plc <sup>**</sup>                                     | 8,00 %  | 29.12.2049            | 11.146.855        | 0,49                         |
| 9.200.000   | ING Groep NV <sup>**</sup>  | 7,50 %  | 29.12.2049            | 8.469.621         | 0,37                         |
| 4.800.000   | Kilimanjaro III Re Ltd <sup>**</sup>                                | 5,25 %  | 25.06.2025            | 4.758.480         | 0,21                         |
| 5.200.000   | L&F Co Ltd <sup>*</sup>   | 2,50 %  | 26.04.2030            | 4.478.500         | 0,20                         |
| 5.500.000   | Lightning Re Series 2023-1 <sup>**</sup>                            | 16,32 % | 31.03.2026            | 5.665.413         | 0,25                         |
| 1.300.000   | Lloyds Banking Group Plc <sup>**</sup>                              | 7,50 %  | 29.12.2049            | 1.242.995         | 0,05                         |
| 2.900.000   | Long Point Re IV Ltd <sup>**</sup>                                  | 9,53 %  | 01.06.2026            | 2.883.978         | 0,13                         |
| 1.900.000   | Matterhorn Re Ltd <sup>**</sup>                                     | 10,84 % | 08.12.2025            | 1.701.735         | 0,07                         |
| 1.500.000   | MetroCat Re Ltd <sup>**</sup>                                       | 5,75 %  | 08.05.2026            | 1.471.763         | 0,06                         |
| 4.420.000   | Montoya Re Ltd <sup>*</sup>   | 12,03 % | 07.04.2025            | 4.477.792         | 0,20                         |
| 5.100.000   | Mystic Re IV Ltd <sup>*</sup>                                       | 15,02 % | 08.01.2024            | 5.028.600         | 0,22                         |
| 5.750.000   | Northshore Re II Ltd <sup>*</sup>                                   | 11,03 % | 08.01.2024            | 5.691.494         | 0,25                         |
| 1.500.000   | Pelican IV Re Ltd <sup>**</sup>                                     | 10,62 % | 07.05.2024            | 26.362            | 0,00                         |
| 5.000.000   | Purple Re Ltd <sup>**</sup>   | 17,52 % | 24.04.2026            | 5.015.750         | 0,22                         |
| 4.000.000   | Residential Reinsurance 2021 Ltd <sup>*</sup>                       | 7,82 %  | 06.06.2025            | 3.684.000         | 0,16                         |
| 3.185.000   | Residential Reinsurance 2021 Ltd <sup>*</sup>                       | 8,91 %  | 06.06.2025            | 2.917.460         | 0,13                         |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag  | Wertpapierbezeichnung                 | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$     | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---------------------------------------|---------|-----------------------|----------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 11,66 % (31. Dezember 2022: 5,16 %) (Fortsetzung)</b> |                                       |         |                       |                      |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>  |                                       |         |                       |                      |                              |
| 2.425.000   | Residential Reinsurance 2021 Ltd*     | 10,54 % | 06.06.2025            | 2.140.123            | 0,09                         |
| 1.500.000   | Residential Reinsurance 2021 Ltd*     | 15,23 % | 06.06.2025            | 1.293.112            | 0,06                         |
| 1.500.000   | Residential Reinsurance 2022 Ltd**    | 10,57 % | 06.06.2026            | 1.335.600            | 0,06                         |
| 3.000.000   | Residential Reinsurance 2022 Ltd**    | 15,32 % | 06.12.2026            | 3.018.975            | 0,13                         |
| 2.050.000   | Sanders Re III Ltd**                  | 11,57 % | 07.04.2027            | 2.101.609            | 0,09                         |
| 3.000.000   | Sanders Re III Ltd**                  | 15,50 % | 07.04.2027            | 2.974.575            | 0,13                         |
| 3.500.000   | Sanders Re III Ltd*                   | 17,07 % | 07.04.2026            | 3.292.275            | 0,14                         |
| 11.000.000  | SK Hynix Inc*                         | 1,75 %  | 11.04.2030            | 13.472.250           | 0,59                         |
| 3.250.000   | Sussex Capital UK Pcc Ltd**           | 13,66 % | 08.01.2025            | 3.120.731            | 0,14                         |
| 4.750.000   | Titania RE Ltd**                      | 17,53 % | 27.02.2026            | 5.002.225            | 0,22                         |
| 4.250.000   | Topanga Re Ltd**                      | 10,27 % | 08.01.2026            | 3.893.000            | 0,17                         |
| 1.500.000   | Ursa Re II Ltd**                      | 9,22 %  | 07.12.2023            | 1.494.112            | 0,07                         |
| 2.000.000   | Ursa Re II Ltd**                      | 10,28 % | 16.06.2025            | 1.985.000            | 0,09                         |
| 3.000.000   | Ursa Re II Ltd**                      | 12,28 % | 06.12.2025            | 3.128.025            | 0,14                         |
| 2.250.000   | Vista RE Ltd**                        | 11,63 % | 21.05.2024            | 2.188.744            | 0,10                         |
| 23.000.000  | ZTO Express Cayman Inc**              | 1,50 %  | 01.09.2027            | 22.942.500           | 1,01                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>  |                                       |         |                       | <b>201.690.465</b>   | <b>8,84</b>                  |
| <b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>   |                                       |         |                       | <b>266.140.458</b>   | <b>11,66</b>                 |
| <b>Staatsanleihen 0,93 % (31. Dezember 2022: 0,13 %)</b>                      |                                       |         |                       |                      |                              |
| <b>US-Dollar</b>  |                                       |         |                       |                      |                              |
| 19.700.000  | Ukraine Government International Bond | 7,75 %  | 01.08.2041            | 7.777.166            | 0,34                         |
| 12.960.000  | Ukraine Government International Bond | 7,38 %  | 25.09.2034            | 3.028.169            | 0,13                         |
| 43.200.000  | Ukraine Government International Bond | 7,75 %  | 01.09.2029            | 10.463.861           | 0,46                         |
| <b>Staatsanleihen insgesamt *</b>   |                                       |         |                       | <b>21.269.196</b>    | <b>0,93</b>                  |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  |                                       |         |                       | <b>1.562.715.912</b> | <b>68,49</b>                 |

## Devisenterminkontrakte 4,02 % (31. Dezember 2022: 6,78 %)

| Geforderter<br>Betrag | Zu zahlender<br>Betrag | Fälligkeits-<br>datum | Gegenpartei         | Kontrakte | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|-----------------------|------------------------|-----------------------|---------------------|-----------|--------------------------------------|------------------------------|
| 200.000 AUD           | 18.949.880 ¥           | 20.09.2023            | Barclays Bank Plc   | 1         | 698                                  | 0,00                         |
| 15.765.000 AUD        | 1.480.328.368 ¥        | 20.09.2023            | Citibank NA         | 4         | 148.884                              | 0,02                         |
| 14.785.000 AUD        | 1.387.262.763 ¥        | 20.09.2023            | Deutsche Bank AG    | 4         | 146.941                              | 0,02                         |
| 2.874.094 AUD         | 1.750.000 €            | 12.07.2023            | JPMorgan Chase Bank | 4         | 3.632                                | 0,00                         |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Devisenterminkontrakte 4,02 % (31. Dezember 2022: 6,78 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 137.079.130 AUD    | 12.652.592.800 ¥    | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 8         | 3.633.918                      | 0,17                 |
| 718.376 AUD        | 375.000 £           | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 1.505                          | 0,00                 |
| 600.000 AUD        | 649.794 NZD         | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 3         | 1.388                          | 0,00                 |
| 510.000 AUD        | 48.453.728 ¥        | 20.09.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 860                            | 0,00                 |
| 36.300.000 AUD     | 23.995.406 US\$     | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | 172.403                        | 0,01                 |
| 2.920.000 AUD      | 277.427.317 ¥       | 20.09.2023       | State Street Bank and Trust Co | 9         | 4.879                          | 0,00                 |
| 190.000 AUD        | 18.070.216 ¥        | 20.09.2023       | UBS AG                         | 1         | 189                            | 0,00                 |
| 66.569.200 BRL     | 13.505.719 US\$     | 20.09.2023       | BNP Paribas                    | 4         | 101.345                        | 0,00                 |
| 34.890.800 BRL     | 7.072.650 US\$      | 20.09.2023       | Citibank NA                    | 2         | 59.196                         | 0,00                 |
| 2.080.000 BRL      | 422.893 US\$        | 20.09.2023       | Deutsche Bank AG               | 2         | 2.269                          | 0,00                 |
| 56.497.711 BRL     | 11.283.218 US\$     | 05.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 56        | 428.576                        | 0,01                 |
| 13.680.427 BRL     | 2.800.000 US\$      | 02.08.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 3         | 20.806                         | 0,00                 |
| 330.000 BRL        | 67.258 US\$         | 20.09.2023       | Morgan Stanley                 | 1         | 196                            | 0,00                 |
| 1.630.000 BRL      | 330.835 US\$        | 20.09.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 2.344                          | 0,00                 |
| 310.000 CAD        | 233.589 US\$        | 20.09.2023       | Barclays Bank Plc              | 1         | 967                            | 0,00                 |
| 1.070.000 CAD      | 807.916 US\$        | 20.09.2023       | BNP Paribas                    | 2         | 1.683                          | 0,00                 |
| 1.140.000 CAD      | 860.474 US\$        | 20.09.2023       | Citibank NA                    | 3         | 2.088                          | 0,00                 |
| 1.480.000 CAD      | 1.119.185 US\$      | 20.09.2023       | Deutsche Bank AG               | 3         | 632                            | 0,00                 |
| 5.444.405 CAD      | 3.750.000 €         | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 4         | 22.238                         | 0,00                 |
| 43.800.000 CAD     | 4.638.213.732 ¥     | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 11        | 979.917                        | 0,04                 |
| 5.517.118 CAD      | 6.200.000 AUD       | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 7         | 41.962                         | 0,00                 |
| 63.489.175 CAD     | 47.008.101 US\$     | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 5         | 976.561                        | 0,04                 |
| 510.000 CAD        | 384.568 US\$        | 20.09.2023       | Morgan Stanley                 | 1         | 1.316                          | 0,00                 |
| 160.000 CAD        | 120.232 US\$        | 20.09.2023       | Royal Bank Of Canada           | 1         | 829                            | 0,00                 |
| 480.000 CAD        | 362.716 US\$        | 20.09.2023       | State Street Bank and Trust Co | 2         | 469                            | 0,00                 |
| 7.390.000 CAD      | 5.573.931 US\$      | 20.09.2023       | UBS AG                         | 3         | 17.593                         | 0,00                 |
| 520.000 CHF        | 585.924 US\$        | 20.09.2023       | Citibank NA                    | 2         | 133                            | 0,00                 |
| 610.000 CHF        | 686.740 US\$        | 20.09.2023       | Deutsche Bank AG               | 1         | 751                            | 0,00                 |
| 4.841.981 CHF      | 4.250.000 £         | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 4         | 12.421                         | 0,00                 |
| 36.875.000 CHF     | 40.900.140 US\$     | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 7         | 345.449                        | 0,01                 |
| 250.000 CHF        | 39.619.345 ¥        | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 5.231                          | 0,00                 |
| 1.954.602 CHF      | 2.000.000 €         | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 3         | 3.547                          | 0,00                 |
| 10.800.000 CHF     | 12.155.783 US\$     | 20.09.2023       | State Street Bank and Trust Co | 14        | 16.178                         | 0,00                 |
| 620.000 CHF        | 697.450 US\$        | 20.09.2023       | UBS AG                         | 3         | 1.312                          | 0,00                 |
| 484.493.560 CLP    | 600.000 US\$        | 10.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | 3.636                          | 0,00                 |
| 484.377.308 CLP    | 600.000 US\$        | 17.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 2.881                          | 0,00                 |
| 322.845.200 CLP    | 400.000 US\$        | 05.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 4         | 2.475                          | 0,00                 |
| 1.857.281.875 CLP  | 2.300.000 US\$      | 03.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 6         | 15.380                         | 0,00                 |
| 403.109.550 CLP    | 500.000 US\$        | 31.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | 644                            | 0,00                 |
| 80.552.340 CLP     | 100.000 US\$        | 24.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 151                            | 0,00                 |
| 1.537.663.310 CLP  | 1.900.000 US\$      | 14.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | 14.745                         | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Devisenterminkontrakte 4,02 % (31. Dezember 2022: 6,78 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 5.106.785.000 CLP  | 6.299.385 US\$      | 20.09.2023       | Morgan Stanley                 | 2         | 6.547                          | 0,00                 |
| 1.786.562.559 COP  | 425.286 US\$        | 05.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | 2.554                          | 0,00                 |
| 428.276.897 COP    | 100.000 US\$        | 10.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 2.403                          | 0,00                 |
| 2.108.424.456 COP  | 500.000 US\$        | 17.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 2.906                          | 0,00                 |
| 421.049.000 COP    | 100.000 US\$        | 24.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 175                            | 0,00                 |
| 104.860.000 CZK    | 4.750.773 US\$      | 20.09.2023       | BNP Paribas                    | 5         | 48.083                         | 0,00                 |
| 133.110.000 CZK    | 6.057.399 US\$      | 20.09.2023       | Citibank NA                    | 12        | 34.302                         | 0,00                 |
| 4.412.510 CZK      | 200.000 US\$        | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | 2.555                          | 0,00                 |
| 801.999.993 EGP    | 19.656.863 US\$     | 20.03.2024       | Morgan Stanley                 | 2         | 1.168.146                      | 0,06                 |
| 4.380.000 €        | 121.483.917 TRY     | 20.09.2023       | Barclays Bank Plc              | 5         | 305.983                        | 0,00                 |
| 1.600.000 €        | 1.744.708 US\$      | 20.09.2023       | Citibank NA                    | 1         | 7.768                          | 0,00                 |
| 3.625.000 €        | 3.519.249 CHF       | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 5         | 19.817                         | 0,00                 |
| 6.750.000 €        | 78.482.857 SEK      | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 3         | 98.464                         | 0,00                 |
| 3.140.000 €        | 86.601.792 TRY      | 20.09.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 3         | 237.453                        | 0,01                 |
| 9.125.000 €        | 13.094.737 CAD      | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 6         | 61.763                         | 0,00                 |
| 5.500.000 €        | 8.892.389 AUD       | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 9         | 82.113                         | 0,00                 |
| 101.900.000 €      | 15.391.212.366 ¥    | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 15        | 4.611.686                      | 0,21                 |
| 875.000 €          | 10.143.226 NOK      | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 7.957                          | 0,00                 |
| 8.100.000 €        | 6.920.999 £         | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 3         | 40.663                         | 0,00                 |
| 100.000 €          | 37.093.111 HUF      | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 855                            | 0,00                 |
| 100.000 €          | 443.300 PLN         | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 66                             | 0,00                 |
| 94.125.000 €       | 101.610.369 US\$    | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 4         | 1.113.996                      | 0,05                 |
| 4.400.000 €        | 4.796.736 US\$      | 20.09.2023       | State Street Bank and Trust Co | 9         | 22.574                         | 0,00                 |
| 3.270.000 €        | 3.561.647 US\$      | 20.09.2023       | UBS AG                         | 3         | 19.978                         | 0,00                 |
| 660.000 €          | 18.550.957 TRY      | 20.09.2023       | UBS AG                         | 1         | 37.043                         | 0,00                 |
| 470.000 £          | 596.785 US\$        | 20.09.2023       | Barclays Bank Plc              | 3         | 871                            | 0,00                 |
| 870.000 £          | 1.099.467 US\$      | 20.09.2023       | Citibank NA                    | 4         | 6.830                          | 0,00                 |
| 500.000 £          | 633.847 US\$        | 20.09.2023       | Deutsche Bank AG               | 4         | 1.957                          | 0,00                 |
| 20.160.000 £       | 24.535.526 US\$     | 15.09.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 1.100.445                      | 0,05                 |
| 40.003.343 £       | 46.300.000 €        | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 5         | 330.266                        | 0,02                 |
| 10.375.000 £       | 11.709.515 CHF      | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 5         | 93.405                         | 0,00                 |
| 7.750.000 £        | 14.650.799 AUD      | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 9         | 99.151                         | 0,00                 |
| 9.792.000 £        | 12.004.502 US\$     | 15.09.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 447.255                        | 0,02                 |
| 22.000.000 £       | 3.876.900.212 ¥     | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 14        | 1.119.794                      | 0,05                 |
| 63.375.000 £       | 79.470.587 US\$     | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 9         | 1.104.442                      | 0,05                 |
| 22.280.000 £       | 28.321.533 US\$     | 20.09.2023       | Royal Bank of Scotland         | 2         | 9.888                          | 0,00                 |
| 440.000 £          | 557.501 US\$        | 20.09.2023       | State Street Bank and Trust Co | 5         | 2.007                          | 0,00                 |
| 2.316.200.700 HUF  | 6.576.958 US\$      | 20.09.2023       | Barclays Bank Plc              | 2         | 68.578                         | 0,00                 |
| 225.207.582 HUF    | 600.000 €           | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 2.603                          | 0,00                 |
| 593.190.208 HUF    | 1.700.000 US\$      | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | 31.622                         | 0,00                 |
| 2.386.388.600 HUF  | 6.787.002 US\$      | 20.09.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | 59.913                         | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Devisenterminkontrakte 4,02 % (31. Dezember 2022: 6,78 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 2.316.200.700 HUF  | 6.589.682 US\$      | 20.09.2023       | Morgan Stanley                 | 2         | 55.853                         | 0,00                 |
| 585.510.000 HUF    | 1.673.893 US\$      | 20.09.2023       | UBS AG                         | 3         | 6.025                          | 0,00                 |
| 632.160.000 INR    | 7.668.122 US\$      | 20.09.2023       | Barclays Bank Plc              | 4         | 15.454                         | 0,00                 |
| 446.790.000 INR    | 5.421.228 US\$      | 20.09.2023       | BNP Paribas                    | 3         | 9.272                          | 0,00                 |
| 137.680.000 INR    | 1.671.502 US\$      | 20.09.2023       | Citibank NA                    | 4         | 1.926                          | 0,00                 |
| 8.237.856 INR      | 100.000 US\$        | 06.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 410                            | 0,00                 |
| 24.780.717 INR     | 300.000 US\$        | 10.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | 1.959                          | 0,00                 |
| 33.021.323 INR     | 400.000 US\$        | 05.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 3         | 2.521                          | 0,00                 |
| 16.508.712 INR     | 200.000 US\$        | 13.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 1.126                          | 0,00                 |
| 8.216.456 INR      | 100.000 US\$        | 07.08.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 13                             | 0,00                 |
| 16.502.312 INR     | 200.000 US\$        | 14.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 1.041                          | 0,00                 |
| 8.279.056 INR      | 100.000 US\$        | 03.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 919                            | 0,00                 |
| 8.273.256 INR      | 100.000 US\$        | 07.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 834                            | 0,00                 |
| 16.458.512 INR     | 200.000 US\$        | 17.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | 486                            | 0,00                 |
| 32.853.800 INR     | 400.000 US\$        | 24.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 101                            | 0,00                 |
| 16.451.912 INR     | 200.000 US\$        | 20.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | 384                            | 0,00                 |
| 80.210.000 INR     | 973.541 US\$        | 20.09.2023       | Morgan Stanley                 | 2         | 1.370                          | 0,00                 |
| 62.446.914 ¥       | 650.000 AUD         | 20.09.2023       | Citibank NA                    | 3         | 3.752                          | 0,00                 |
| 98.754.398 ¥       | 1.030.000 AUD       | 20.09.2023       | Deutsche Bank AG               | 3         | 4.545                          | 0,00                 |
| 140.053.374 ¥      | 1.460.000 AUD       | 20.09.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 4         | 6.941                          | 0,00                 |
| 70.859.280 ¥       | 800.000 NZD         | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 665                            | 0,00                 |
| 1.339.282.219 ¥    | 13.800.000 AUD      | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | 87.974                         | 0,01                 |
| 62.990.000 ¥       | 440.406 US\$        | 20.09.2023       | State Street Bank and Trust Co | 2         | 771                            | 0,00                 |
| 131.880.254 KRW    | 100.000 US\$        | 05.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 87                             | 0,00                 |
| 120.292.000 MXN    | 6.871.002 US\$      | 20.09.2023       | Barclays Bank Plc              | 2         | 38.289                         | 0,00                 |
| 116.754.000 MXN    | 6.685.887 US\$      | 20.09.2023       | BNP Paribas                    | 2         | 20.190                         | 0,00                 |
| 112.884.000 MXN    | 6.462.531 US\$      | 20.09.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 3         | 21.263                         | 0,00                 |
| 445.233.565 MXN    | 25.572.322 US\$     | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 11        | 353.141                        | 0,01                 |
| 2.060.000 NOK      | 192.451 US\$        | 20.09.2023       | Citibank NA                    | 1         | 357                            | 0,00                 |
| 10.345.117 NOK     | 875.000 €           | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 3         | 10.892                         | 0,00                 |
| 20.655.923 NOK     | 1.900.000 US\$      | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 3         | 28.461                         | 0,00                 |
| 4.000.000 NOK      | 3.986.922 SEK       | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 5         | 4.218                          | 0,00                 |
| 20.400.000 NZD     | 1.734.516.240 ¥     | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 8         | 484.449                        | 0,02                 |
| 17.113.875 NZD     | 10.336.511 US\$     | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 5         | 147.864                        | 0,01                 |
| 2.389.829 NZD      | 2.177.374 AUD       | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 6         | 14.415                         | 0,00                 |
| 97.020.000 PHP     | 1.742.634 US\$      | 20.09.2023       | BNP Paribas                    | 3         | 8.084                          | 0,00                 |
| 13.000.000 PHP     | 233.247 US\$        | 20.09.2023       | Citibank NA                    | 1         | 1.337                          | 0,00                 |
| 842.400.000 PHP    | 15.000.000 US\$     | 17.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 229.292                        | 0,01                 |
| 842.700.000 PHP    | 15.000.000 US\$     | 18.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 234.470                        | 0,01                 |
| 842.700.000 PHP    | 15.000.000 US\$     | 17.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 234.715                        | 0,01                 |
| 22.070.000 PHP     | 394.361 US\$        | 20.09.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 3.891                          | 0,00                 |



## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Devisenterminkontrakte 4,02 % (31. Dezember 2022: 6,78 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 298.880.000 PHP    | 5.324.434 US\$      | 20.09.2023       | UBS AG                         | 3         | 68.829                         | 0,00                 |
| 66.760.000 PLN     | 14.844.081 €        | 20.09.2023       | BNP Paribas                    | 2         | 109.444                        | 0,00                 |
| 54.570.000 PLN     | 13.200.790 US\$     | 20.09.2023       | BNP Paribas                    | 6         | 178.612                        | 0,01                 |
| 50.490.000 PLN     | 12.186.708 US\$     | 20.09.2023       | Citibank NA                    | 3         | 192.363                        | 0,02                 |
| 6.765.677 PLN      | 1.500.000 €         | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 4         | 27.593                         | 0,00                 |
| 7.516.163 PLN      | 1.800.000 US\$      | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 4         | 49.286                         | 0,00                 |
| 8.833.228 PLN      | 2.168.994 US\$      | 24.07.2023       | Morgan Stanley                 | 2         | 2.800                          | 0,00                 |
| 2.780.000 PLN      | 618.978 €           | 20.09.2023       | Morgan Stanley                 | 4         | 3.632                          | 0,00                 |
| 760.000 PLN        | 186.032 US\$        | 20.09.2023       | Morgan Stanley                 | 1         | 303                            | 0,00                 |
| 66.760.000 PLN     | 14.830.803 €        | 20.09.2023       | Royal Bank Of Canada           | 2         | 123.987                        | 0,00                 |
| 1.540.000 PLN      | 342.597 €           | 20.09.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 2.329                          | 0,00                 |
| 2.440.000 PLN      | 590.369 US\$        | 20.09.2023       | UBS AG                         | 3         | 7.867                          | 0,00                 |
| 15.210.463 SEK     | 1.400.000 US\$      | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 3         | 8.627                          | 0,00                 |
| 8.847.134 SEK      | 750.000 €           | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | 804                            | 0,00                 |
| 10.040.000 THB     | 283.550 US\$        | 20.09.2023       | BNP Paribas                    | 1         | 1.813                          | 0,00                 |
| 105.015 US\$       | 510.000 BRL         | 20.09.2023       | Barclays Bank Plc              | 3         | 768                            | 0,00                 |
| 2.366.262 US\$     | 3.850.000 NZD       | 20.09.2023       | Barclays Bank Plc              | 3         | 8.326                          | 0,00                 |
| 470.671 US\$       | 700.000 AUD         | 20.09.2023       | Barclays Bank Plc              | 1         | 3.694                          | 0,00                 |
| 29.833.619 US\$    | 4.100.510.000 ¥     | 20.09.2023       | Barclays Bank Plc              | 8         | 1.113.960                      | 0,05                 |
| 7.638.067 US\$     | 81.335.000 SEK      | 20.09.2023       | Barclays Bank Plc              | 2         | 79.801                         | 0,00                 |
| 4.431.512 US\$     | 112.690.000 TRY     | 20.09.2023       | Barclays Bank Plc              | 4         | 265.214                        | 0,01                 |
| 413.081 US\$       | 14.510.000 THB      | 20.09.2023       | BNP Paribas                    | 1         | 670                            | 0,00                 |
| 141.476 US\$       | 2.660.000 ZAR       | 20.09.2023       | BNP Paribas                    | 1         | 1.786                          | 0,00                 |
| 475.492 US\$       | 2.310.000 BRL       | 20.09.2023       | BNP Paribas                    | 2         | 3.317                          | 0,00                 |
| 260.967 US\$       | 390.000 AUD         | 20.09.2023       | BNP Paribas                    | 1         | 794                            | 0,00                 |
| 216.576 US\$       | 170.000 £           | 20.09.2023       | BNP Paribas                    | 1         | 402                            | 0,00                 |
| 454.860 US\$       | 1.840.000 PLN       | 20.09.2023       | BNP Paribas                    | 3         | 3.731                          | 0,00                 |
| 3.019.643 US\$     | 4.070.000 SGD       | 20.09.2023       | BNP Paribas                    | 2         | 3.354                          | 0,00                 |
| 2.232.554 US\$     | 48.590.000 CZK      | 20.09.2023       | BNP Paribas                    | 1         | 8.862                          | 0,00                 |
| 160.209 US\$       | 22.790.000 ¥        | 20.09.2023       | BNP Paribas                    | 1         | 589                            | 0,00                 |
| 5.405.572 US\$     | 7.002.430.000 KRW   | 20.09.2023       | BNP Paribas                    | 7         | 68.218                         | 0,00                 |
| 1.348.607 US\$     | 14.430.000 SEK      | 20.09.2023       | Citibank NA                    | 8         | 7.661                          | 0,00                 |
| 6.305.288 US\$     | 66.605.000 NOK      | 20.09.2023       | Citibank NA                    | 3         | 71.327                         | 0,00                 |
| 30.048.588 US\$    | 40.370.000 SGD      | 20.09.2023       | Citibank NA                    | 14        | 130.258                        | 0,01                 |
| 233.168 US\$       | 380.000 NZD         | 20.09.2023       | Citibank NA                    | 1         | 436                            | 0,00                 |
| 70.803 US\$        | 57.020.000 CLP      | 20.09.2023       | Citibank NA                    | 1         | 394                            | 0,00                 |
| 14.108.554 US\$    | 484.950.000 THB     | 20.09.2023       | Citibank NA                    | 5         | 325.040                        | 0,01                 |
| 846.063 US\$       | 118.970.000 ¥       | 20.09.2023       | Citibank NA                    | 3         | 12.806                         | 0,00                 |
| 3.834.827 US\$     | 5.710.000 AUD       | 20.09.2023       | Citibank NA                    | 10        | 25.629                         | 0,00                 |
| 492.407 US\$       | 1.780.000 ILS       | 20.09.2023       | Citibank NA                    | 1         | 11.347                         | 0,00                 |
| 326.259 US\$       | 425.200.000 KRW     | 20.09.2023       | Citibank NA                    | 1         | 2.165                          | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Devisenterminkontrakte 4,02 % (31. Dezember 2022: 6,78 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 750.256 US\$       | 590.000 £           | 20.09.2023       | Citibank NA                 | 1         | 8                              | 0,00                 |
| 10.175.509 US\$    | 189.540.000 ZAR     | 20.09.2023       | Citibank NA                 | 2         | 221.795                        | 0,02                 |
| 1.762.621 US\$     | 6.440.000 ILS       | 20.09.2023       | Deutsche Bank AG            | 4         | 22.158                         | 0,00                 |
| 9.336.071 US\$     | 15.000.000 NZD      | 20.09.2023       | Deutsche Bank AG            | 2         | 149.307                        | 0,01                 |
| 168.297 US\$       | 3.170.000 ZAR       | 20.09.2023       | Deutsche Bank AG            | 1         | 1.824                          | 0,00                 |
| 28.645 US\$        | 23.020.000 CLP      | 20.09.2023       | Deutsche Bank AG            | 1         | 220                            | 0,00                 |
| 513.049 US\$       | 760.000 AUD         | 20.09.2023       | Deutsche Bank AG            | 2         | 6.046                          | 0,00                 |
| 1.162.744 US\$     | 40.430.000 THB      | 20.09.2023       | Deutsche Bank AG            | 3         | 13.620                         | 0,00                 |
| 384.971 US\$       | 53.300.000 ¥        | 20.09.2023       | Deutsche Bank AG            | 1         | 11.662                         | 0,00                 |
| 440.473 US\$       | 7.650.000 MXN       | 20.09.2023       | Deutsche Bank AG            | 1         | 1.075                          | 0,00                 |
| 51.002 US\$        | 40.000 £            | 20.09.2023       | Deutsche Bank AG            | 1         | 138                            | 0,00                 |
| 219.099 US\$       | 200.000 €           | 20.09.2023       | Deutsche Bank AG            | 1         | 40                             | 0,00                 |
| 14.400.000 US\$    | 8.791.200.000 NGN   | 06.11.2023       | Goldman Sachs International | 2         | 3.564.503                      | 0,16                 |
| 14.400.000 US\$    | 7.718.400.000 NGN   | 07.08.2023       | Goldman Sachs International | 1         | 4.460.013                      | 0,20                 |
| 28.677.485 US\$    | 38.495.423 SGD      | 17.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | 219.884                        | 0,01                 |
| 2.100.000 US\$     | 1.852.064 CHF       | 29.09.2023       | Goldman Sachs International | 1         | 10.632                         | 0,00                 |
| 3.191.432 US\$     | 25.000.000 HKD      | 07.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | 1.214                          | 0,00                 |
| 18.000.000 US\$    | 551.970.000 TWD     | 27.12.2023       | Goldman Sachs International | 1         | 66.653                         | 0,00                 |
| 24.021.792 US\$    | 21.600.000 €        | 29.09.2023       | Goldman Sachs International | 5         | 352.479                        | 0,02                 |
| 16.212.360 US\$    | 2.250.000.000 ¥     | 07.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | 640.596                        | 0,03                 |
| 700.000 US\$       | 889.630.575 KRW     | 17.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 5         | 24.385                         | 0,00                 |
| 263.269 US\$       | 4.960.000 ZAR       | 20.09.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 2.794                          | 0,00                 |
| 2.000.000 US\$     | 2.562.132.435 KRW   | 20.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 8         | 53.936                         | 0,00                 |
| 100.000 US\$       | 130.012.521 KRW     | 21.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 1.244                          | 0,00                 |
| 822.222 US\$       | 15.437.414 ZAR      | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 4         | 5.595                          | 0,00                 |
| 16.133.956 US\$    | 21.300.000 CAD      | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 4         | 35.569                         | 0,00                 |
| 100.000 US\$       | 405.258 PLN         | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 290                            | 0,00                 |
| 100.000 US\$       | 3.074.988 TWD       | 21.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 1.326                          | 0,00                 |
| 4.000.000 US\$     | 5.173.442.394 KRW   | 24.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 8         | 69.730                         | 0,00                 |
| 257.331 US\$       | 420.000 NZD         | 20.09.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 102                            | 0,00                 |
| 100.000 US\$       | 3.076.667 TWD       | 20.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 1.273                          | 0,00                 |
| 100.000 US\$       | 419.364.088 COP     | 31.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 479                            | 0,00                 |
| 100.000 US\$       | 3.063.514 TWD       | 14.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 1.699                          | 0,00                 |
| 200.000 US\$       | 6.133.838 TWD       | 07.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 3.089                          | 0,00                 |
| 400.000 US\$       | 12.269.777 TWD      | 03.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 3         | 6.037                          | 0,00                 |
| 12.088.071 US\$    | 293.443.915 TRY     | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 7         | 849.997                        | 0,05                 |
| 3.300.000 US\$     | 82.858.779 TRY      | 13.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 127.631                        | 0,01                 |
| 2.958.190 US\$     | 4.799.816 NZD       | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 6         | 17.707                         | 0,00                 |
| 8.400.298 US\$     | 7.500.000 CHF       | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 2         | 11.366                         | 0,00                 |
| 1.700.000 US\$     | 2.292.921 SGD       | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 4         | 5.300                          | 0,00                 |
| 800.000 US\$       | 24.494.400 TWD      | 17.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 14.017                         | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Devisenterminkontrakte 4,02 % (31. Dezember 2022: 6,78 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 5.400.000 US\$     | 6.943.702.052 KRW   | 10.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 7         | 128.666                        | 0,01                 |
| 100.000 US\$       | 129.904.521 KRW     | 14.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 1.361                          | 0,00                 |
| 100.991 US\$       | 8.279.087 INR       | 03.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 2         | 71                             | 0,00                 |
| 887.844 US\$       | 3.170.000 ILS       | 20.09.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 31.126                         | 0,00                 |
| 207.347.288 US\$   | 29.037.500.047 ¥    | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 9         | 6.236.442                      | 0,29                 |
| 1.700.000 US\$     | 2.231.549.920 KRW   | 03.08.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 11        | 3.837                          | 0,00                 |
| 300.000 US\$       | 390.188.737 KRW     | 31.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 2         | 3.469                          | 0,00                 |
| 400.000 US\$       | 135.988.606 HUF     | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 3         | 3.026                          | 0,00                 |
| 100.000 US\$       | 80.459.000 CLP      | 31.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 73                             | 0,00                 |
| 300.000 US\$       | 240.747.990 CLP     | 17.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 353                            | 0,00                 |
| 2.300.000 US\$     | 11.022.969 BRL      | 05.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 14        | 14.972                         | 0,00                 |
| 900.000 US\$       | 716.410.903 CLP     | 10.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 2         | 7.415                          | 0,00                 |
| 176.300.000 US\$   | 1.251.258.980 CNY   | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 12        | 4.208.652                      | 0,18                 |
| 99.488.826 US\$    | 90.750.000 €        | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 5         | 447.805                        | 0,02                 |
| 200.000 US\$       | 834.398.210 COP     | 24.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 1.483                          | 0,00                 |
| 300.000 US\$       | 6.526.206 CZK       | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 2         | 416                            | 0,00                 |
| 30.390.159 US\$    | 45.239.785 AUD      | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 7         | 270.423                        | 0,01                 |
| 30.416.622 US\$    | 23.812.500 £        | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 6         | 141.390                        | 0,01                 |
| 100.000 US\$       | 417.800.000 COP     | 17.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 345                            | 0,00                 |
| 100.000 US\$       | 8.194.031 INR       | 06.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 124                            | 0,00                 |
| 300.000 US\$       | 24.609.994 INR      | 10.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 121                            | 0,00                 |
| 7.612.948 US\$     | 130.500.000 MXN     | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 4         | 14.075                         | 0,00                 |
| 200.000 US\$       | 16.415.583 INR      | 13.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 9                              | 0,00                 |
| 1.564.716 US\$     | 27.180.000 MXN      | 20.09.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 2         | 3.560                          | 0,00                 |
| 800.000 US\$       | 1.039.108.179 KRW   | 13.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 11.024                         | 0,00                 |
| 2.100.000 US\$     | 2.733.712.563 KRW   | 27.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 7         | 22.883                         | 0,00                 |
| 7.500.000 US\$     | 9.536.911.433 KRW   | 07.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 2         | 261.318                        | 0,02                 |
| 300.000 US\$       | 386.631.204 KRW     | 26.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 2         | 6.246                          | 0,00                 |
| 4.000.000 US\$     | 5.208.673.334 KRW   | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 13        | 45.346                         | 0,00                 |
| 300.000 US\$       | 391.937.779 KRW     | 28.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 2         | 2.185                          | 0,00                 |
| 18.000.000 US\$    | 550.800.000 TWD     | 28.12.2023       | Merrill Lynch International | 1         | 102.866                        | 0,01                 |
| 6.418.115 US\$     | 5.000.000 £         | 20.09.2023       | Morgan Stanley              | 1         | 60.076                         | 0,00                 |
| 11.754.894 US\$    | 124.815.000 SEK     | 20.09.2023       | Morgan Stanley              | 6         | 156.137                        | 0,01                 |
| 3.738.611 US\$     | 3.300.000 CHF       | 20.09.2023       | Morgan Stanley              | 1         | 19.400                         | 0,00                 |
| 378.889 US\$       | 7.120.000 ZAR       | 20.09.2023       | Morgan Stanley              | 2         | 4.981                          | 0,00                 |
| 3.726.522 US\$     | 13.277.970 ILS      | 21.07.2023       | Morgan Stanley              | 1         | 146.947                        | 0,01                 |
| 707.714 US\$       | 246.290.000 HUF     | 20.09.2023       | Morgan Stanley              | 2         | 1.070                          | 0,00                 |
| 706.195 US\$       | 5.000.000 CNY       | 20.09.2023       | Morgan Stanley              | 1         | 12.672                         | 0,00                 |
| 1.338.846 US\$     | 1.700.000.000 KRW   | 20.09.2023       | Morgan Stanley              | 1         | 43.081                         | 0,00                 |
| 1.488.903 US\$     | 1.917.390.000 KRW   | 20.09.2023       | Royal Bank Of Canada        | 2         | 27.440                         | 0,00                 |
| 3.203.072 US\$     | 4.310.000 SGD       | 20.09.2023       | Royal Bank of Scotland      | 2         | 8.918                          | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Devisenterminkontrakte 4,02 % (31. Dezember 2022: 6,78 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag              | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 2.967.211 US\$                  | 3.845.930.000 KRW   | 20.09.2023       | Royal Bank of Scotland         | 4         | 35.786                         | 0,00                 |
| 140.646 US\$                    | 110.000 £           | 20.09.2023       | State Street Bank and Trust Co | 2         | 770                            | 0,00                 |
| 2.332.538 US\$                  | 3.480.000 AUD       | 20.09.2023       | State Street Bank and Trust Co | 4         | 10.994                         | 0,00                 |
| 739.856 US\$                    | 3.600.000 BRL       | 20.09.2023       | State Street Bank and Trust Co | 4         | 3.999                          | 0,00                 |
| 50.597 US\$                     | 880.000 MXN         | 20.09.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 51                             | 0,00                 |
| 1.048.526 US\$                  | 1.364.290.000 KRW   | 20.09.2023       | State Street Bank and Trust Co | 3         | 8.645                          | 0,00                 |
| 1.743.183 US\$                  | 1.590.000 €         | 20.09.2023       | State Street Bank and Trust Co | 3         | 1.661                          | 0,00                 |
| 355.965 US\$                    | 3.800.000 SEK       | 20.09.2023       | State Street Bank and Trust Co | 2         | 2.840                          | 0,00                 |
| 631.442 US\$                    | 88.400.000 ¥        | 20.09.2023       | State Street Bank and Trust Co | 5         | 12.294                         | 0,00                 |
| 1.341.233 US\$                  | 1.724.580.000 KRW   | 20.09.2023       | UBS AG                         | 5         | 26.733                         | 0,00                 |
| 212.493 US\$                    | 17.480.000 INR      | 20.09.2023       | UBS AG                         | 1         | 33                             | 0,00                 |
| 175.164 US\$                    | 24.160.000 ¥        | 20.09.2023       | UBS AG                         | 1         | 5.949                          | 0,00                 |
| 2.582.424 US\$                  | 65.750.000 TRY      | 20.09.2023       | UBS AG                         | 4         | 151.559                        | 0,01                 |
| 364.938 US\$                    | 3.910.000 SEK       | 20.09.2023       | UBS AG                         | 2         | 1.591                          | 0,00                 |
| 225.631 US\$                    | 200.000 CHF         | 20.09.2023       | UBS AG                         | 1         | 224                            | 0,00                 |
| 510.462 US\$                    | 176.910.000 HUF     | 20.09.2023       | UBS AG                         | 1         | 2.881                          | 0,00                 |
| 3.472.994 US\$                  | 12.560.000 ILS      | 20.09.2023       | UBS AG                         | 2         | 78.553                         | 0,00                 |
| 5.933.579 US\$                  | 62.675.000 NOK      | 20.09.2023       | UBS AG                         | 2         | 67.450                         | 0,00                 |
| 66.059 US\$                     | 60.000 €            | 20.09.2023       | UBS AG                         | 1         | 341                            | 0,00                 |
| 216.762 US\$                    | 4.070.000 ZAR       | 20.09.2023       | UBS AG                         | 1         | 3.025                          | 0,00                 |
| 21.349.815 ZAR                  | 1.100.000 US\$      | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 3         | 29.388                         | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i> |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 27.681 CHF                      | 30.873 US\$         | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 117                            | 0,00                 |
| 5.744.122 CHF                   | 6.419.493 US\$      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 5         | 11.419                         | 0,00                 |
| 1.844.170 US\$                  | 1.637.743 CHF       | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 12        | 10.613                         | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 418.994 €                       | 448.753 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 8.725                          | 0,00                 |
| 9.967 €                         | 10.753 US\$         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 11        | 128                            | 0,00                 |
| 368.657 US\$                    | 336.120 €           | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 1.665                          | 0,00                 |
| 2.263.673 US\$                  | 2.052.001 €         | 20.07.2023       | UBS AG                         | 4         | 23.198                         | 0,00                 |
| 105.422.006 US\$                | 95.744.566 €        | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 40        | 883.447                        | 0,04                 |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 9.358.393 £                     | 11.636.460 US\$     | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 262.626                        | 0,01                 |
| 19.922.607 £                    | 24.940.604 US\$     | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 390.755                        | 0,02                 |
| 861.695.671 £                   | 1.075.594.388 US\$  | 20.07.2023       | UBS AG                         | 2         | 20.041.447                     | 0,88                 |
| 885.491.231 £                   | 1.104.377.377 US\$  | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 43        | 21.514.227                     | 0,94                 |
| 13.076.012 US\$                 | 10.256.937 £        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 34.438                         | 0,00                 |
| 9.874.719 US\$                  | 7.745.286 £         | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 26.680                         | 0,00                 |
| 30.340.785 US\$                 | 23.778.067 £        | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 5         | 107.255                        | 0,01                 |
| <i>Abgesicherte Klassen JPY</i> |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 207.857 US\$                    | 28.913.819 ¥        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | 7.329                          | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 4,02 % (31. Dezember 2022: 6,78 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen JPY (Fortsetzung)</i>                                    |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 470.558 US\$   | 64.321.261 ¥        | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 3         | 24.465                         | 0,00                 |
| 332.519 US\$   | 46.595.378 ¥        | 20.07.2023       | UBS AG                         | 2         | 9.361                          | 0,00                 |
| 236.365 US\$   | 31.237.798 ¥        | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 1         | 19.718                         | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>  |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 4.000 SGD  | 2.957 US\$          | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 1         | 1                              | 0,00                 |
| 239 US\$   | 320 SGD             | 20.07.2023       | UBS AG                         | 2         | 3                              | 0,00                 |
| 30.144 US\$  | 40.175 SGD          | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 6         | 442                            | 0,00                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>en</sup></b> |                     |                  |                                |           | <b>91.836.753</b>              | <b>4,02</b>          |

### Futures-Kontrakte 2,66 % (31. Dezember 2022: 1,30 %)

| Anzahl Kontrakte | Beschreibung  | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|------------------|---|--------------------------------|----------------------|
| (2.747)          | 1 Month SOFR Future November 2023                           | 1.769.630                      | 0,08                 |
| 1                | 10-Year Mini Japanese Government Bond Future September 2023 | 214                            | 0,00                 |
| (208)            | 3 Month SOFR Future December 2024                           | 242.900                        | 0,01                 |
| (95)             | 3 Month SOFR Future December 2025                           | 52.987                         | 0,00                 |
| (662)            | 3 Month SOFR Future June 2024                               | 318.071                        | 0,01                 |
| (122)            | 3 Month SOFR Future June 2025                               | 106.950                        | 0,01                 |
| (1.702)          | 3 Month SOFR Future March 2024                              | 1.279.417                      | 0,06                 |
| (229)            | 3 Month SOFR Future March 2025                              | 236.975                        | 0,01                 |
| (253)            | 3 Month SOFR Future March 2026                              | 128.975                        | 0,01                 |
| (247)            | 3 Month SOFR Future March 2027                              | 57.225                         | 0,00                 |
| (984)            | 3 Month SOFR Future September 2024                          | 743.322                        | 0,03                 |
| (238)            | 3 Month SOFR Future September 2025                          | 185.162                        | 0,01                 |
| 500              | 3 Month SONIA Future August 2023                            | 926.474                        | 0,04                 |
| 500              | 3 Month SONIA Future August 2023                            | 615.375                        | 0,03                 |
| (1.000)          | 3 Month SONIA Future August 2023                            | 15.929                         | 0,00                 |
| (816)            | 3 Month SONIA Future December 2023                          | 1.987.482                      | 0,09                 |
| (173)            | 3 Month SONIA Future December 2024                          | 775.362                        | 0,03                 |
| (110)            | 3 Month SONIA Future December 2025                          | 166.102                        | 0,01                 |
| (548)            | 3 Month SONIA Future June 2024                              | 1.112.154                      | 0,05                 |
| (99)             | 3 Month SONIA Future June 2025                              | 230.257                        | 0,01                 |
| (1.375)          | 3 Month SONIA Future March 2024                             | 5.070.816                      | 0,22                 |
| (663)            | 3 Month SONIA Future March 2025                             | 1.838.277                      | 0,08                 |
| (247)            | 3 Month SONIA Future March 2026                             | 583.327                        | 0,03                 |
| (499)            | 3 Month SONIA Future September 2024                         | 1.302.651                      | 0,06                 |
| (218)            | 3 Month SONIA Future September 2025                         | 658.210                        | 0,03                 |
| (2.416)          | 30 Day Federal Funds Future August 2023                     | 166.784                        | 0,01                 |
| 1.144            | 30 Day Federal Funds Future July 2023                       | 51.087                         | 0,00                 |
| (185)            | 3-Month Euro EURIBOR Future December 2023                   | 91.000                         | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Futures-Kontrakte 2,66 % (31. Dezember 2022: 1,30 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte | Beschreibung   | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|------------------|--|--------------------------------|----------------------|
| (265)            | 3-Month Euro EURIBOR Future December 2024                | 165.259                        | 0,01                 |
| (68)             | 3-Month Euro EURIBOR Future December 2025                | 5.837                          | 0,00                 |
| (418)            | 3-Month Euro EURIBOR Future June 2024                    | 336.342                        | 0,02                 |
| (2.000)          | 3-Month Euro EURIBOR Future September 2023               | 753.102                        | 0,03                 |
| (48)             | 3-Month Euro EURIBOR Future September 2024               | 22.099                         | 0,00                 |
| (1.192)          | 90-Day Bank Bill Future December 2023                    | 681.370                        | 0,03                 |
| (591)            | 90-Day Bank Bill Future June 2024                        | 462.074                        | 0,02                 |
| (999)            | 90-Day Bank Bill Future March 2024                       | 747.638                        | 0,03                 |
| (911)            | 90-Day Bank Bill Future September 2023                   | 617.410                        | 0,03                 |
| (1)              | 90-Day Bank Bill Future September 2024                   | 80                             | 0,00                 |
| (909)            | Australian Dollar Currency Future September 2023         | 2.450.567                      | 0,11                 |
| (222)            | Australian Government Bond 10-Year Future September 2023 | 88.202                         | 0,00                 |
| (738)            | Australian Government Bond 3-Year Future September 2023  | 273.660                        | 0,01                 |
| (582)            | Bankers Acceptance Future December 2023                  | 26.223                         | 0,00                 |
| (5)              | Bankers Acceptance Future December 2024                  | 1.322                          | 0,00                 |
| (330)            | Bankers Acceptance Future June 2024                      | 51.370                         | 0,00                 |
| (1.140)          | Bankers Acceptance Future March 2024                     | 517.051                        | 0,02                 |
| (1.313)          | Bankers Acceptance Future September 2023                 | 518.931                        | 0,02                 |
| (153)            | Bankers Acceptance Future September 2024                 | 39.486                         | 0,00                 |
| 151              | CAC40 Index Future July 2023                             | 136.661                        | 0,01                 |
| 2.183            | Canadian 10-Year Bond Future September 2023              | 1.616.807                      | 0,07                 |
| (1.159)          | Canadian Dollar Currency Future September 2023           | 378.362                        | 0,02                 |
| (274)            | CBOE VIX Index Future August 2023                        | 295.008                        | 0,01                 |
| (703)            | CBOE VIX Index Future July 2023                          | 1.159.737                      | 0,05                 |
| (1)              | CBOE VIX Mini Index Future July 2023                     | 172                            | 0,00                 |
| 1                | Chinese Yuan Renminbi Currency Future September 2023     | 2.000                          | 0,00                 |
| 58               | DAX Index Future September 2023                          | 474.871                        | 0,02                 |
| 6                | DJIA Micro E-mini Future September 2023                  | 414                            | 0,00                 |
| 36               | DJIA Mini E-CBOT Future September 2023                   | 22.410                         | 0,00                 |
| 1                | E-mini Health Care Future September 2023                 | 2.700                          | 0,00                 |
| 1                | E-mini Industrial Future September 2023                  | 2.860                          | 0,00                 |
| 90               | E-mini Russell 2000 Index Future September 2023          | 70.335                         | 0,01                 |
| 3                | E-mini Russell 2000 Index Future September 2023          | 167                            | 0,00                 |
| 315              | Euro Stoxx 50 Dividend Index Future December 2024        | 75.509                         | 0,01                 |
| 1.043            | Euro Stoxx 50 Future September 2023                      | 479.809                        | 0,02                 |
| 916              | Euro STOXX Bank Index Future September 2023              | 99.222                         | 0,00                 |
| 1                | Euro/Japanese Yen Currency Future September 2023         | 5.397                          | 0,00                 |
| (2.081)          | Euro-BOBL Future September 2023                          | 1.782.389                      | 0,08                 |
| (876)            | Euro-Bund Future September 2023                          | 642.535                        | 0,03                 |
| (251)            | Euro-OAT Future September 2023                           | 17.423                         | 0,00                 |
| (551)            | Euro-Schatz Future September 2023                        | 258.845                        | 0,01                 |
| 961              | FTSE 100 Index Future September 2023                     | 559.805                        | 0,02                 |
| (46)             | FTSE/JSE Top 40 Index Future September 2023              | 3.169                          | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Futures-Kontrakte 2,66 % (31. Dezember 2022: 1,30 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte  | Beschreibung  | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---|--------------------------------|----------------------|
| 11  | FTSE/MIB Index Future September 2023                                      | 36.428                         | 0,00                 |
| 4   | FTSE/MIB Index Future September 2023                                      | 1.595                          | 0,00                 |
| (62)  | Hang Seng China Enterprises Index Future July 2023                        | 26.906                         | 0,00                 |
| (22)  | Hang Seng Index Future July 2023  | 31.302                         | 0,00                 |
| 2   | IBEX 35 Index Future July 2023  | 76                             | 0,00                 |
| (354)   | Japan Government 10-Year Bond (OSE) Future September 2023                 | 524.648                        | 0,02                 |
| (1.531)   | Japanese Yen Currency Future September 2023                               | 2.321.874                      | 0,10                 |
| (6)   | Mexican Peso Currency Future September 2023                               | 430                            | 0,00                 |
| 5   | Mini- TOPIX Index Future September 2023                                   | 405                            | 0,00                 |
| (8)   | Mini-Hang Seng Index Future July 2023                                     | 1.779                          | 0,00                 |
| 9   | MSCI EAFE Index Future September 2023                                     | 810                            | 0,00                 |
| (253)   | MSCI Emerging Markets Index Future September 2023                         | 130.110                        | 0,01                 |
| 2   | NASD 100 Micro E-mini Future September 2023                               | 1.632                          | 0,00                 |
| 120   | Nasdaq 100 E-mini Future September 2023                                   | 746.962                        | 0,03                 |
| 1.318   | New Zealand Dollar Currency Future September 2023                         | 430.783                        | 0,02                 |
| 61  | Nikkei 225 (CME) Future September 2023                                    | 342.550                        | 0,02                 |
| 804   | Nikkei 225 Mini Future September 2023                                     | 404.120                        | 0,02                 |
| 13  | Norwegian Krone Currency Future September 2023                            | 11.473                         | 0,00                 |
| 1   | NYSE FANG+ Index Future September 2023                                    | 1.300                          | 0,00                 |
| 494   | OMXS30 Index Future July 2023   | 38.387                         | 0,00                 |
| 777   | S&P 500 E-mini Future September 2023                                      | 4.320.637                      | 0,19                 |
| 8   | S&P 500 Micro E-mini Future September 2023                                | 3.379                          | 0,00                 |
| 50  | S&P/TSX 60 Index Future September 2023                                    | 90.701                         | 0,00                 |
| 86  | SGX FTSE Taiwan Future July 2023  | 20.550                         | 0,00                 |
| 249   | SGX Nifty 50 Future July 2023   | 205.337                        | 0,01                 |
| (384)   | Short-Term Euro-BTP Future September 2023                                 | 122.334                        | 0,01                 |
| 643   | SPI 200 Index Future September 2023                                       | 1.097.673                      | 0,05                 |
| 8   | STOXX Europe 600 Index Future September 2023                              | 595                            | 0,00                 |
| 7   | Swedish Krona Currency Future September 2023                              | 7.288                          | 0,00                 |
| 190   | TOPIX Index Future September 2023   | 663.127                        | 0,03                 |
| 84  | Turkish Lira Currency Future August 2023                                  | 6.978                          | 0,00                 |
| (569)   | United Kingdom Long Gilt Future September 2023                            | 621.683                        | 0,03                 |
| 23  | United States Dollar/Chinese Yuan Renminbi Currency Future September 2023 | 27.546                         | 0,00                 |
| (1.922)   | US Treasury 10-Year Note (CBT) Future September 2023                      | 2.869.973                      | 0,13                 |
| (178)   | US Treasury 2-Year Note (CBT) Future September 2023                       | 311.651                        | 0,01                 |
| (7.041)   | US Treasury 5-Year Note (CBT) Future September 2023                       | 8.107.707                      | 0,36                 |
| (735)   | US Treasury Long Bond (CBT) Future September 2023                         | 105.188                        | 0,00                 |
| 11  | US Treasury Ultra Bond (CBT) Future September 2023                        | 1.375                          | 0,00                 |
| 203   | Yen Denominated Nikkei Future September 2023                              | 159.479                        | 0,01                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten *</b> |   | <b>60.354.516</b>              | <b>2,66</b>          |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

**Verkaufte Optionskontrakte 10,74 % (31. Dezember 2022: 6,48 %)**

| Anzahl Kontrakte/<br>Nominalwert | Fällig-<br>keit | Art  | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|----------------------------------|-----------------|--|------------------|------------------------------|
| <b>Kaufoptionen</b>              |                 |  |                  |                              |
| 29                               | 19.01.2024      | AbbVie Inc, Strike Price \$155.00 ±  | 4.742            | 0,00                         |
| 24                               | 19.01.2024      | AbbVie Inc, Strike Price \$170.00 ±  | 960              | 0,00                         |
| 26                               | 19.01.2024      | AbbVie Inc, Strike Price \$175.00 ±  | 546              | 0,00                         |
| 24                               | 19.01.2024      | AbbVie Inc, Strike Price \$190.00 ±  | 972              | 0,00                         |
| 2.500.000 USD                    | 19.01.2024      | Absolute Dispersion Basket, strike price 17.00% ±                            | 8.425            | 0,00                         |
| 4.000.000 USD                    | 15.03.2024      | Absolute Dispersion Basket, strike price 17.00% ±                            | 28.384           | 0,00                         |
| 5.000.000 USD                    | 20.12.2024      | Absolute Dispersion Basket, strike price 28.00% ±                            | 82.890           | 0,01                         |
| 7.500.000 EUR                    | 28.03.2024      | Absolute Dispersion Basket, strike price 20.00% ±                            | 38.409           | 0,00                         |
| 1.000.000 EUR                    | 20.12.2024      | Absolute Dispersion Basket, strike price 32.00% ±                            | 8.993            | 0,00                         |
| 10                               | 19.01.2024      | Adobe Inc, Strike Price \$410.00 ±   | 104.025          | 0,01                         |
| 9                                | 19.01.2024      | Adobe Inc, Strike Price \$450.00 ±   | 68.197           | 0,00                         |
| 32                               | 15.09.2023      | Advanced Micro Devices Inc, Strike Price \$105.00 ±                          | 47.360           | 0,00                         |
| 27                               | 19.01.2024      | Advanced Micro Devices Inc, Strike Price \$120.00 ±                          | 36.855           | 0,00                         |
| 23                               | 19.01.2024      | Advanced Micro Devices Inc, Strike Price \$130.00 ±                          | 23.345           | 0,00                         |
| 35                               | 15.09.2023      | Advanced Micro Devices Inc, Strike Price \$95.00 ±                           | 77.437           | 0,01                         |
| 46                               | 19.01.2024      | AeroVironment Inc, Strike Price \$105.00 ±                                   | 48.300           | 0,00                         |
| 38                               | 19.01.2024      | AeroVironment Inc, Strike Price \$115.00 ±                                   | 30.780           | 0,00                         |
| 500.000.000 JPY                  | 22.04.2027      | Aica Kogyo Co Ltd, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 60bps. ∞ | 316.681          | 0,02                         |
| 53.892                           | 15.08.2025      | Akamai Technologies Inc, Strike Price \$104.07 ∞                             | 668.361          | 0,03                         |
| 125.000                          | 15.08.2025      | Akamai Technologies Inc, Strike Price \$150.00 ∞                             | 381.221          | 0,02                         |
| 11                               | 19.01.2024      | Align Technology Inc, Strike Price \$310.00 ±                                | 79.310           | 0,01                         |
| 10                               | 19.01.2024      | Align Technology Inc, Strike Price \$340.00 ±                                | 54.800           | 0,00                         |
| 32                               | 19.01.2024      | AmerisourceBergen Corp, Strike Price \$195.00 ±                              | 36.000           | 0,00                         |
| 27                               | 19.01.2024      | AmerisourceBergen Corp, Strike Price \$210.00 ±                              | 12.420           | 0,00                         |
| 900.000.000 JPY                  | 05.09.2024      | Anair, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 52bps. ∞             | 36.915           | 0,00                         |
| 170.000.000 JPY                  | 20.08.2024      | Anair, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 55bps. ∞             | 7.096            | 0,00                         |
| 27                               | 19.01.2024      | Analog Devices Inc, Strike Price \$210.00 ±                                  | 25.920           | 0,00                         |
| 24                               | 19.01.2024      | Analog Devices Inc, Strike Price \$230.00 ±                                  | 9.600            | 0,00                         |
| 46.946                           | 19.01.2024      | Apellis Pharmaceuticals Inc, Strike Price \$42.97 ∞                          | 2.359.541        | 0,11                         |
| 400.000                          | 19.01.2024      | Apellis Pharmaceuticals Inc, Strike Price \$50.50 ∞                          | 17.404.407       | 0,76                         |
| 32                               | 19.01.2024      | Apple Inc, Strike Price \$175.00 ±   | 88.880           | 0,01                         |
| 94                               | 19.01.2024      | Apple Inc, Strike Price \$195.00 ±   | 135.830          | 0,01                         |
| 85                               | 19.01.2024      | Apple Inc, Strike Price \$205.00 ±   | 74.588           | 0,01                         |
| 26                               | 19.01.2024      | Apple Inc, Strike Price \$220.00 ±   | 10.140           | 0,00                         |
| 26                               | 15.09.2023      | Applied Materials Inc, Strike Price \$130.00 ±                               | 48.295           | 0,00                         |
| 51                               | 19.01.2024      | Applied Materials Inc, Strike Price \$130.00 ±                               | 127.500          | 0,01                         |
| 24                               | 15.09.2023      | Applied Materials Inc, Strike Price \$140.00 ±                               | 27.960           | 0,00                         |
| 45                               | 19.01.2024      | Applied Materials Inc, Strike Price \$145.00 ±                               | 72.225           | 0,00                         |
| 75.133                           | 17.11.2023      | AppLovin Corp, Strike Price \$13.76 ∞  | 942.448          | 0,04                         |
| 300.000                          | 17.11.2023      | AppLovin Corp, Strike Price \$18.00 ∞  | 2.696.577        | 0,12                         |



## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Verkaufte Optionskontrakte 10,74 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/<br>Nominalwert   | Fällig-<br>keit | Art   | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------------------------------|-----------------|---|------------------|------------------------------|
| <b>Kaufsoptionen (Fortsetzung)</b> |                 |   |                  |                              |
| 23                                 | 19.01.2024      | Autodesk Inc, Strike Price \$230.00 ±                 | 25.760           | 0,00                         |
| 11                                 | 19.01.2024      | Autodesk Inc, Strike Price \$250.00 ±                 | 6.545            | 0,00                         |
| 18                                 | 19.01.2024      | Autodesk Inc, Strike Price \$260.00 ±                 | 7.650            | 0,00                         |
| 10                                 | 19.01.2024      | Autodesk Inc, Strike Price \$270.00 ±                 | 2.975            | 0,00                         |
| 23                                 | 19.01.2024      | Axon Enterprise Inc, Strike Price \$220.00 ±          | 30.015           | 0,00                         |
| 19                                 | 19.01.2024      | Axon Enterprise Inc, Strike Price \$240.00 ±          | 14.535           | 0,00                         |
| 110                                | 19.01.2024      | Bath & Body Works Inc, Strike Price \$42.50 ±         | 31.075           | 0,00                         |
| 89                                 | 19.01.2024      | Bath & Body Works Inc, Strike Price \$47.50 ±         | 13.573           | 0,00                         |
| 26                                 | 19.01.2024      | Best Buy Co Inc, Strike Price \$105.00 ±              | 2.496            | 0,00                         |
| 48                                 | 19.01.2024      | Best Buy Co Inc, Strike Price \$80.00 ±               | 40.560           | 0,00                         |
| 58                                 | 19.01.2024      | Best Buy Co Inc, Strike Price \$85.00 ±               | 33.785           | 0,00                         |
| 101                                | 19.01.2024      | Best Buy Co Inc, Strike Price \$87.50 ±               | 48.480           | 0,00                         |
| 50                                 | 19.01.2024      | Best Buy Co Inc, Strike Price \$92.50 ±               | 15.750           | 0,00                         |
| 77                                 | 19.01.2024      | Best Buy Co Inc, Strike Price \$95.00 ±               | 19.134           | 0,00                         |
| 67                                 | 19.01.2024      | Boyd Gaming Corp, Strike Price \$75.00 ±              | 24.120           | 0,00                         |
| 59                                 | 19.01.2024      | Boyd Gaming Corp, Strike Price \$80.00 ±              | 11.948           | 0,00                         |
| 6                                  | 15.09.2023      | Broadcom Inc, Strike Price \$660.00 ±                 | 130.560          | 0,01                         |
| 6                                  | 19.01.2024      | Broadcom Inc, Strike Price \$680.00 ±                 | 128.670          | 0,01                         |
| 5                                  | 15.09.2023      | Broadcom Inc, Strike Price \$720.00 ±                 | 81.225           | 0,01                         |
| 5                                  | 19.01.2024      | Broadcom Inc, Strike Price \$760.00 ±                 | 75.800           | 0,01                         |
| 53                                 | 19.01.2024      | Cardinal Health Inc, Strike Price \$105.00 ±          | 13.913           | 0,00                         |
| 63                                 | 19.01.2024      | Cardinal Health Inc, Strike Price \$95.00 ±           | 42.840           | 0,00                         |
| 166                                | 05.07.2023      | CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,550.00 ±         | 2.490            | 0,00                         |
| 126.665                            | 19.01.2024      | Ceridian HCM Holding Inc, Strike Price \$105.13 ∞     | 81.705           | 0,00                         |
| 450.000                            | 19.01.2024      | Ceridian HCM Holding Inc, Strike Price \$133.33 ∞     | 97.199           | 0,01                         |
| 182                                | 19.01.2024      | Chemours Co, Strike Price \$31.00 ±                   | 143.780          | 0,01                         |
| 4                                  | 19.01.2024      | Chipotle Mexican Grill Inc, Strike Price \$2,250.00 ± | 56.560           | 0,00                         |
| 4                                  | 19.01.2024      | Chipotle Mexican Grill Inc, Strike Price \$2,270.00 ± | 52.580           | 0,00                         |
| 3                                  | 19.01.2024      | Chipotle Mexican Grill Inc, Strike Price \$2,460.00 ± | 19.755           | 0,00                         |
| 4                                  | 19.01.2024      | Chipotle Mexican Grill Inc, Strike Price \$2,480.00 ± | 24.980           | 0,00                         |
| 116                                | 19.01.2024      | Cleveland-Cliffs Inc, Strike Price \$22.00 ±          | 7.714            | 0,00                         |
| 103                                | 19.01.2024      | Cleveland-Cliffs Inc, Strike Price \$25.00 ±          | 3.296            | 0,00                         |
| 117.000                            | 20.11.2026      | Confluent Inc, Strike Price \$138.02 ∞                | 496.817          | 0,02                         |
| 117.000                            | 18.12.2026      | Confluent Inc, Strike Price \$138.02 ∞                | 523.133          | 0,02                         |
| 116.000                            | 15.01.2027      | Confluent Inc, Strike Price \$138.02 ∞                | 537.764          | 0,03                         |
| 11.700                             | 20.11.2026      | Confluent Inc, Strike Price \$76.14 ∞                 | 97.886           | 0,01                         |
| 11.700                             | 18.12.2026      | Confluent Inc, Strike Price \$76.28 ∞                 | 100.423          | 0,01                         |
| 11.600                             | 15.01.2027      | Confluent Inc, Strike Price \$76.41 ∞                 | 101.710          | 0,01                         |
| 60.469                             | 15.01.2027      | Conmed Corp, Strike Price \$110.88 ∞                  | 3.237.283        | 0,14                         |
| 10.078                             | 19.01.2027      | Conmed Corp, Strike Price \$110.88 ∞                  | 540.208          | 0,03                         |
| 210.000                            | 15.01.2027      | Conmed Corp, Strike Price \$249.05 ∞                  | 2.546.010        | 0,12                         |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Verkaufte Optionskontrakte 10,74 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/<br>Nominalwert   | Fällig-<br>keit | Art  | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------------------------------|-----------------|--|------------------|------------------------------|
| <b>Kaufsoptionen (Fortsetzung)</b> |                 |  |                  |                              |
| 439                                | 19.01.2024      | Coty Inc, Strike Price \$13.00 ±   | 49.168           | 0,00                         |
| 408                                | 19.01.2024      | Coty Inc, Strike Price \$14.00 ±   | 30.396           | 0,00                         |
| 28                                 | 19.01.2024      | CVS Caremark Corp, Strike Price \$105.00 ±   | 280              | 0,00                         |
| 30                                 | 19.01.2024      | CVS Caremark Corp, Strike Price \$97.50 ±  | 570              | 0,00                         |
| 2.173.493                          | 20.12.2024      | Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR21.13 ∞   | 2.901.570        | 0,13                         |
| 2.173.493                          | 21.03.2025      | Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR21.13 ∞   | 3.335.318        | 0,15                         |
| 2.173.493                          | 20.12.2024      | Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR21.97 ∞   | 2.126.235        | 0,09                         |
| 2.173.493                          | 21.03.2025      | Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR21.97 ∞   | 2.534.223        | 0,11                         |
| 57                                 | 19.01.2024      | Devon Energy Corp, Strike Price \$55.00 ±  | 15.048           | 0,00                         |
| 128                                | 19.01.2024      | Devon Energy Corp, Strike Price \$65.00 ±  | 10.688           | 0,00                         |
| 35                                 | 19.01.2024      | Devon Energy Corp, Strike Price \$75.00 ±  | 945              | 0,00                         |
| 144                                | 19.01.2024      | Devon Energy Corp, Strike Price \$60.00 ±  | 21.456           | 0,00                         |
| 35                                 | 19.01.2024      | Dexcom Inc, Strike Price \$140.00 ±  | 34.650           | 0,00                         |
| 28                                 | 19.01.2024      | Dexcom Inc, Strike Price \$152.50 ±  | 16.100           | 0,00                         |
| 26                                 | 19.01.2024      | Dick's Sporting Goods Inc, Strike Price \$135.00 ±   | 33.540           | 0,00                         |
| 54                                 | 19.01.2024      | Dick's Sporting Goods Inc, Strike Price \$150.00 ±   | 38.340           | 0,00                         |
| 28                                 | 19.01.2024      | Dick's Sporting Goods Inc, Strike Price \$165.00 ±   | 9.800            | 0,00                         |
| 23                                 | 19.01.2024      | Dollar Tree Inc, Strike Price \$170.00 ±   | 9.718            | 0,00                         |
| 20                                 | 19.01.2024      | Dollar Tree Inc, Strike Price \$185.00 ±   | 3.770            | 0,00                         |
| 19                                 | 19.01.2024      | Domino's Pizza Inc, Strike Price \$340.00 ±  | 56.525           | 0,00                         |
| 2.000.000                          | 15.12.2023      | Dual digital option: Euro STOXX 50 Index and EUR/USD spot rate, Down and In Strike Price EUR 3,955.28 and 1.03 ∞ | 50.600           | 0,00                         |
| 31                                 | 19.01.2024      | Eagle Materials Inc, Strike Price \$190.00 ±   | 43.865           | 0,00                         |
| 25                                 | 19.01.2024      | Eagle Materials Inc, Strike Price \$210.00 ±   | 15.000           | 0,00                         |
| 110.000                            | 17.09.2027      | Envestnet Inc, Strike Price \$110.74 ∞   | 918.435          | 0,04                         |
| 110.000                            | 15.10.2027      | Envestnet Inc, Strike Price \$110.74 ∞   | 943.000          | 0,04                         |
| 110.000                            | 19.11.2027      | Envestnet Inc, Strike Price \$110.74 ∞   | 973.764          | 0,04                         |
| 92.400                             | 15.10.2027      | Envestnet Inc, Strike Price \$72.69 ∞  | 1.614.637        | 0,07                         |
| 58                                 | 19.01.2024      | Etsy Inc, Strike Price \$100.00 ±  | 44.805           | 0,00                         |
| 1.716                              | 15.09.2023      | Euro STOXX 50 Index, Strike Price EUR4,600.00 ±  | 481.144          | 0,02                         |
| 90.000                             | 15.09.2023      | Euro STOXX Bank Index, Strike Price EUR105.00 ±  | 9.404            | 0,00                         |
| 105.000                            | 15.09.2023      | Euro STOXX Bank Index, Strike Price EUR105.00 ∞  | 22.911           | 0,00                         |
| 130.000.000 EUR                    | 17.07.2023      | Euro/United States Dollar Currency Option, Strike Price EUR1.11 ∞  | 147.251          | 0,01                         |
| 222.000.000 EUR                    | 31.07.2023      | Euro/United States Dollar Currency Option, Strike Price EUR1.14 ∞  | 43.488           | 0,00                         |
| 54.000.000 EUR                     | 13.09.2023      | Euro/United States Dollar Currency Option, Strike Price EUR1.15 ∞  | 36.366           | 0,00                         |
| 200.000.000 JPY                    | 18.03.2024      | Fancl Corp, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 50bps. ∞                                  | 3.040            | 0,00                         |
| 16                                 | 19.01.2024      | FedEx Corp, Strike Price \$240.00 ±  | 42.440           | 0,00                         |
| 25                                 | 19.01.2024      | FedEx Corp, Strike Price \$250.00 ±  | 51.688           | 0,00                         |
| 15                                 | 19.01.2024      | FedEx Corp, Strike Price \$260.00 ±  | 23.625           | 0,00                         |
| 24                                 | 19.01.2024      | Five Below Inc, Strike Price \$210.00 ±  | 38.400           | 0,00                         |
| 21                                 | 19.01.2024      | Five Below Inc, Strike Price \$230.00 ±  | 18.690           | 0,00                         |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Verkaufte Optionskontrakte 10,74 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/<br>Nominalwert   | Fällig-<br>keit | Art  | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------------------------------|-----------------|--|------------------|------------------------------|
| <b>Kaufsoptionen (Fortsetzung)</b> |                 |  |                  |                              |
| 52                                 | 19.01.2024      | Foot Locker Inc, Strike Price \$50.00 ±  | 650              | 0,00                         |
| 47                                 | 19.01.2024      | Foot Locker Inc, Strike Price \$55.00 ±  | 0                | 0,00                         |
| 46                                 | 19.01.2024      | Fortinet Inc, Strike Price \$75.00 ±   | 40.020           | 0,00                         |
| 39                                 | 19.01.2024      | Fortinet Inc, Strike Price \$82.00 ±   | 21.060           | 0,00                         |
| 107                                | 19.01.2024      | Freeport-McMoRan Inc, Strike Price \$43.00 ±   | 36.380           | 0,00                         |
| 89                                 | 19.01.2024      | Freeport-McMoRan Inc, Strike Price \$47.00 ±   | 18.824           | 0,00                         |
| 800.000.000 JPY                    | 08.06.2026      | GMO Payment Gateway Inc, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 70bps. ∞ | 173.728          | 0,01                         |
| 29.267                             | 19.01.2024      | Guardant Health Inc, Strike Price \$107.62 ∞   | 1.659            | 0,00                         |
| 200.000                            | 19.01.2024      | Guardant Health Inc, Strike Price \$126.14 ∞   | 5.377            | 0,00                         |
| 27                                 | 19.01.2024      | Hess Corp, Strike Price \$140.00 ±   | 33.885           | 0,00                         |
| 35                                 | 19.01.2024      | Hess Corp, Strike Price \$145.00 ±   | 36.225           | 0,00                         |
| 25                                 | 19.01.2024      | Hess Corp, Strike Price \$150.00 ±   | 21.000           | 0,00                         |
| 27                                 | 19.01.2024      | Hess Corp, Strike Price \$160.00 ±   | 14.445           | 0,00                         |
| 600.000.000 JPY                    | 05.09.2024      | Hosele Corp, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 75bps. ∞                       | 98.552           | 0,01                         |
| 105                                | 19.01.2024      | HP Inc, Strike Price \$34.00 ±   | 12.653           | 0,00                         |
| 88                                 | 19.01.2024      | HP Inc, Strike Price \$37.00 ±   | 4.400            | 0,00                         |
| 10.659                             | 17.07.2026      | Insulet Corp, Strike Price \$321.48 ∞  | 774.007          | 0,04                         |
| 50.000                             | 17.07.2026      | Insulet Corp, Strike Price \$335.00 ∞  | 3.369.767        | 0,15                         |
| 42                                 | 19.01.2024      | ITT Inc, Strike Price \$90.00 ±  | 40.740           | 0,00                         |
| 36                                 | 19.01.2024      | ITT Inc, Strike Price \$95.00 ±  | 23.940           | 0,00                         |
| 1.070.000.000 JPY                  | 20.12.2024      | Koei Tecmo Holdings Co Ltd, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 60bps. ∞        | 514.516          | 0,02                         |
| 70                                 | 13.07.2023      | KOSPI 200 Index, Strike Price KRW350.00 ±  | 2.523            | 0,00                         |
| 8                                  | 13.07.2023      | KOSPI 200 Index, Strike Price KRW355.00 ±  | 76               | 0,00                         |
| 112                                | 10.08.2023      | KOSPI 200 Index, Strike Price KRW355.00 ±  | 17.425           | 0,00                         |
| 14                                 | 10.08.2023      | KOSPI 200 Index, Strike Price KRW357.50 ±  | 1.514            | 0,00                         |
| 43                                 | 10.08.2023      | KOSPI 200 Index, Strike Price KRW360.00 ±  | 3.182            | 0,00                         |
| 61                                 | 19.01.2024      | Kroger Co, Strike Price \$50.00 ±  | 12.993           | 0,00                         |
| 260                                | 19.01.2024      | Kroger Co, Strike Price \$55.00 ±  | 19.630           | 0,00                         |
| 73                                 | 19.01.2024      | Kroger Co, Strike Price \$60.00 ±  | 1.715            | 0,00                         |
| 200.000.000 JPY                    | 15.01.2026      | Kyoritsu Maintenance, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 105bps. ∞   | 383.885          | 0,02                         |
| 350.000.000 JPY                    | 13.01.2026      | Kyoritsu Maintenance, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 110bps. ∞             | 666.491          | 0,03                         |
| 2.274                              | 11.01.2024      | L&F Co Ltd, Strike Price KRW253,500.00 ∞   | 67.578           | 0,00                         |
| 5.180                              | 11.01.2024      | L&F Co Ltd, Strike Price KRW289,775.90 ∞   | 106.716          | 0,01                         |
| 7                                  | 19.01.2024      | Lam Research Corp, Strike Price \$550.00 ±   | 93.012           | 0,01                         |
| 10                                 | 19.01.2024      | Lam Research Corp, Strike Price \$560.00 ±   | 125.325          | 0,01                         |
| 6                                  | 19.01.2024      | Lam Research Corp, Strike Price \$590.00 ±   | 63.390           | 0,00                         |
| 9                                  | 19.01.2024      | Lam Research Corp, Strike Price \$610.00 ±   | 83.790           | 0,01                         |
| 74                                 | 19.01.2024      | Las Vegas Sands Corp, Strike Price \$65.00 ±   | 24.420           | 0,00                         |
| 64                                 | 19.01.2024      | Las Vegas Sands Corp, Strike Price \$70.00 ±   | 12.032           | 0,00                         |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Verkaufte Optionskontrakte 10,74 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/<br>Nominalwert   | Fällig-<br>keit | Art  | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------------------------------|-----------------|--|------------------|------------------------------|
| <b>Kaufsoptionen (Fortsetzung)</b> |                 |  |                  |                              |
| 12.952                             | 15.12.2028      | Live Nation Entertainment Inc, Strike Price \$101.56 <sup>∞</sup>                              | 434.304          | 0,02                         |
| 80.000                             | 15.12.2028      | Live Nation Entertainment Inc, Strike Price \$145.00 <sup>∞</sup>                              | 1.688.245        | 0,08                         |
| 52                                 | 19.01.2024      | Louisiana-Pacific Corp, Strike Price \$65.00 <sup>±</sup>                                      | 71.760           | 0,00                         |
| 45                                 | 19.01.2024      | Louisiana-Pacific Corp, Strike Price \$70.00 <sup>±</sup>                                      | 47.250           | 0,00                         |
| 62                                 | 19.01.2024      | Louisiana-Pacific Corp, Strike Price \$75.00 <sup>±</sup>                                      | 46.500           | 0,00                         |
| 52                                 | 19.01.2024      | Louisiana-Pacific Corp, Strike Price \$82.50 <sup>±</sup>                                      | 22.360           | 0,00                         |
| 14                                 | 19.01.2024      | Lululemon Athletica Inc, Strike Price \$410.00 <sup>±</sup>                                    | 34.965           | 0,00                         |
| 12                                 | 19.01.2024      | Lululemon Athletica Inc, Strike Price \$450.00 <sup>±</sup>                                    | 14.670           | 0,00                         |
| 5.652                              | 19.01.2024      | Lyft Inc, Strike Price \$32.50 <sup>±</sup>  | 42.390           | 0,00                         |
| 601                                | 19.01.2024      | Lyft Inc, Strike Price \$40.00 <sup>±</sup>  | 2.704            | 0,00                         |
| 168.821                            | 19.01.2024      | Lyft Inc, Strike Price \$41.56 <sup>∞</sup>  | 5.827            | 0,00                         |
| 800.000                            | 19.01.2024      | Lyft Inc, Strike Price \$48.73 <sup>∞</sup>  | 18.751           | 0,00                         |
| 214.527                            | 19.01.2024      | Lyft Inc, Strike Price \$56.35 <sup>∞</sup>  | 3.592            | 0,00                         |
| 999.820                            | 19.01.2024      | Lyft Inc, Strike Price \$60.00 <sup>∞</sup>  | 14.553           | 0,00                         |
| 35                                 | 15.09.2023      | LyondellBasell Industries NV, Strike Price \$105.00 <sup>±</sup>                               | 1.312            | 0,00                         |
| 32                                 | 15.09.2023      | LyondellBasell Industries NV, Strike Price \$115.00 <sup>±</sup>                               | 160              | 0,00                         |
| 54                                 | 19.01.2024      | LyondellBasell Industries NV, Strike Price \$99.80 <sup>±</sup>                                | 17.010           | 0,00                         |
| 49                                 | 19.01.2024      | LyondellBasell Industries NV, Strike Price \$109.80 <sup>±</sup>                               | 4.777            | 0,00                         |
| 177                                | 19.01.2024      | Marathon Oil Corp, Strike Price \$25.00 <sup>±</sup>   | 34.250           | 0,00                         |
| 153                                | 19.01.2024      | Marathon Oil Corp, Strike Price \$27.00 <sup>±</sup>   | 19.431           | 0,00                         |
| 77.370                             | 19.01.2024      | Marriott Vacations Worldwide Corp, Strike Price \$151.20 <sup>∞</sup>                          | 165.431          | 0,01                         |
| 278.850                            | 19.01.2024      | Marriott Vacations Worldwide Corp, Strike Price \$195.43 <sup>∞</sup>                          | 62.172           | 0,00                         |
| 2.114                              | 19.01.2024      | Match Group Inc, Strike Price \$110.00 <sup>±</sup>  | 17.969           | 0,00                         |
| 76.632                             | 19.01.2024      | Match Group Inc, Strike Price \$125.67 <sup>∞</sup>  | 1.006            | 0,00                         |
| 124.502                            | 19.01.2024      | Match Group Inc, Strike Price \$132.97 <sup>∞</sup>  | 1.208            | 0,00                         |
| 200                                | 19.01.2024      | Match Group Inc, Strike Price \$140.00 <sup>±</sup>  | 2.300            | 0,00                         |
| 1.157                              | 19.01.2024      | Match Group Inc, Strike Price \$145.00 <sup>±</sup>  | 5.785            | 0,00                         |
| 103.560                            | 19.01.2024      | Match Group Inc, Strike Price \$163.96 <sup>∞</sup>  | 349              | 0,00                         |
| (132)                              | 19.01.2024      | Match Group Inc, Strike Price \$170.00 <sup>±</sup>  | 0                | 0,00                         |
| 240.000                            | 19.01.2024      | Match Group Inc, Strike Price \$171.93 <sup>∞</sup>  | 645              | 0,00                         |
| 400.000                            | 19.01.2024      | Match Group Inc, Strike Price \$181.99 <sup>∞</sup>  | 824              | 0,00                         |
| (238)                              | 19.01.2024      | Match Group Inc, Strike Price \$220.00 <sup>±</sup>  | 0                | 0,00                         |
| 350.000                            | 19.01.2024      | Match Group Inc, Strike Price \$224.97 <sup>∞</sup>  | 282              | 0,00                         |
| 530.000.000 JPY                    | 29.01.2025      | Menicon Co Ltd, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 50bps. <sup>∞</sup> | 60.326           | 0,00                         |
| 18                                 | 17.11.2023      | Meta Platforms Inc, Strike Price \$185.00 <sup>±</sup>   | 194.040          | 0,01                         |
| 17                                 | 19.01.2024      | Meta Platforms Inc, Strike Price \$300.00 <sup>±</sup>   | 50.490           | 0,00                         |
| 14                                 | 19.01.2024      | Meta Platforms Inc, Strike Price \$330.00 <sup>±</sup>   | 25.760           | 0,00                         |
| 58                                 | 19.01.2024      | Micron Technology Inc, Strike Price \$67.50 <sup>±</sup>                                       | 32.480           | 0,00                         |
| 52                                 | 19.01.2024      | Micron Technology Inc, Strike Price \$75.00 <sup>±</sup>                                       | 16.640           | 0,00                         |
| 17                                 | 19.01.2024      | Microsoft Corp, Strike Price \$370.00 <sup>±</sup>   | 26.775           | 0,00                         |
| 14                                 | 19.01.2024      | Microsoft Corp, Strike Price \$405.00 <sup>±</sup>   | 9.310            | 0,00                         |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Verkaufte Optionskontrakte 10,74 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/<br>Nominalwert   | Fällig-<br>keit | Art  | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------------------------------|-----------------|--|------------------|------------------------------|
| <b>Kaufsoptionen (Fortsetzung)</b> |                 |  |                  |                              |
| 45.713                             | 18.07.2025      | Middleby Corp, Strike Price \$150.83 <sup>∞</sup>  | 1.415.116        | 0,06                         |
| 112.500                            | 18.07.2025      | Middleby Corp, Strike Price \$210.00 <sup>∞</sup>  | 1.130.542        | 0,05                         |
| 1.020.000.000 JPY                  | 12.11.2024      | Nagoya, Asset Swapped Convertible Option, recall spread:<br>TONA plus 38bps. <sup>∞</sup>    | 85.607           | 0,01                         |
| 1.000.000.000 JPY                  | 11.12.2024      | Nagoya, Asset Swapped Convertible Option, recall spread:<br>50bps. <sup>∞</sup>              | 92.830           | 0,01                         |
| 370.000.000 JPY                    | 27.11.2024      | Nagoya, Asset Swapped Convertible Option, recall spread:<br>60bps. <sup>∞</sup>              | 37.420           | 0,00                         |
| 22                                 | 15.12.2023      | nCino Inc, Strike Price \$25.00 <sup>±</sup>   | 15.620           | 0,00                         |
| 206                                | 08.09.2023      | Nikkei 225 Index, Strike Price JPY29,750.00 <sup>±</sup>                                     | 5.116.685        | 0,23                         |
| 3                                  | 14.07.2023      | Nikkei 225 Index, Strike Price JPY31,375.00 <sup>±</sup>                                     | 38.503           | 0,00                         |
| 1                                  | 14.07.2023      | Nikkei 225 Index, Strike Price JPY33,375.00 <sup>±</sup>                                     | 2.525            | 0,00                         |
| 6                                  | 14.07.2023      | Nikkei 225 Index, Strike Price JPY33,500.00 <sup>±</sup>                                     | 13.492           | 0,00                         |
| 1.200.000.000 JPY                  | 04.10.2024      | Nippon 24, Asset Swapped Convertible Option, recall spread:<br>TONA plus 55bps. <sup>∞</sup> | 2.160.458        | 0,10                         |
| 1.200.000.000 JPY                  | 05.10.2026      | Nippon 26, Asset Swapped Convertible Option, recall spread:<br>TONA plus 65bps. <sup>∞</sup> | 2.399.304        | 0,11                         |
| 11                                 | 19.01.2024      | NVIDIA Corp, Strike Price \$340.00 <sup>±</sup>  | 122.018          | 0,01                         |
| 9                                  | 19.01.2024      | NVIDIA Corp, Strike Price \$370.00 <sup>±</sup>  | 82.170           | 0,01                         |
| 2.986                              | 19.01.2024      | Okta Inc, Strike Price \$170.00 <sup>±</sup>   | 64.199           | 0,00                         |
| 49.339                             | 19.01.2024      | Okta Inc, Strike Price \$220.35 <sup>∞</sup>   | 2.933            | 0,00                         |
| 64.205                             | 19.01.2024      | Okta Inc, Strike Price \$222.80 <sup>∞</sup>   | 3.645            | 0,00                         |
| 200.000                            | 19.01.2024      | Okta Inc, Strike Price \$258.28 <sup>∞</sup>   | 6.272            | 0,00                         |
| 250.000                            | 19.01.2024      | Okta Inc, Strike Price \$260.83 <sup>∞</sup>   | 7.546            | 0,00                         |
| 30                                 | 19.01.2024      | ON Semiconductor Corp, Strike Price \$100.00 <sup>±</sup>                                    | 30.225           | 0,00                         |
| 446.500                            | 29.06.2029      | ON Semiconductor Corp, Strike Price \$156.78 <sup>∞</sup>                                    | 13.118.976       | 0,58                         |
| 446.500                            | 06.07.2029      | ON Semiconductor Corp, Strike Price \$156.78 <sup>∞</sup>                                    | 13.158.235       | 0,58                         |
| 151.810                            | 28.02.2024      | ON Semiconductor Corp, Strike Price \$82.83 <sup>∞</sup>                                     | 3.166.199        | 0,14                         |
| 36                                 | 19.01.2024      | ON Semiconductor Corp, Strike Price \$90.00 <sup>±</sup>                                     | 54.360           | 0,00                         |
| 77                                 | 19.01.2024      | ONEOK Inc, Strike Price \$67.50 <sup>±</sup>   | 13.860           | 0,00                         |
| 68                                 | 19.01.2024      | ONEOK Inc, Strike Price \$72.50 <sup>±</sup>   | 4.930            | 0,00                         |
| 75.000                             | 21.11.2025      | Palo Alto Networks Inc, Strike Price \$193.96 <sup>∞</sup>                                   | 7.595.239        | 0,33                         |
| 2.500.000.000 JPY                  | 24.02.2028      | Park24 Co Ltd, Asset Swapped Convertible Option, recall<br>spread: 228bps. <sup>∞</sup>      | 2.372.240        | 0,11                         |
| 206                                | 19.01.2024      | PG&E Corp, Strike Price \$18.00 <sup>±</sup>   | 23.999           | 0,00                         |
| 922                                | 19.01.2024      | PG&E Corp, Strike Price \$19.00 <sup>±</sup>   | 67.767           | 0,00                         |
| 167                                | 19.01.2024      | PG&E Corp, Strike Price \$20.00 <sup>±</sup>   | 6.931            | 0,00                         |
| 508                                | 19.01.2024      | PG&E Corp, Strike Price \$21.00 <sup>±</sup>   | 15.494           | 0,00                         |
| 25                                 | 19.01.2024      | Pioneer Natural Resources Co, Strike Price \$250.00 <sup>±</sup>                             | 12.375           | 0,00                         |
| 23                                 | 19.01.2024      | Pioneer Natural Resources Co, Strike Price \$270.00 <sup>±</sup>                             | 5.232            | 0,00                         |
| 625.000 USD                        | 15.12.2023      | Pound Sterling/United States Dollar Currency Option, Strike Price \$1.20 <sup>∞</sup>        | 77.277           | 0,01                         |
| 108.000.000 GBP                    | 13.09.2023      | Pound Sterling/United States Dollar Currency Option, Strike Price GBP1.30 <sup>∞</sup>       | 791.122          | 0,04                         |
| 46                                 | 19.01.2024      | Qorvo Inc, Strike Price \$110.00 <sup>±</sup>  | 34.730           | 0,00                         |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Verkaufte Optionskontrakte 10,74 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/<br>Nominalwert   | Fällig-<br>keit | Art   | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------------------------------|-----------------|---|------------------|------------------------------|
| <b>Kaufsoptionen (Fortsetzung)</b> |                 |   |                  |                              |
| 39                                 | 19.01.2024      | Qorvo Inc, Strike Price \$120.00 ±  | 16.380           | 0,00                         |
| 151                                | 19.01.2024      | Range Resources Corp, Strike Price \$29.00 ±  | 61.910           | 0,00                         |
| 132                                | 19.01.2024      | Range Resources Corp, Strike Price \$31.00 ±  | 41.580           | 0,00                         |
| 250.000.000 JPY                    | 17.11.2027      | Relo Group Inc, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 87bps. ∞ | 36.802           | 0,00                         |
| 35                                 | 19.01.2024      | RH, Strike Price \$280.00 ±   | 257.075          | 0,01                         |
| 17                                 | 19.01.2024      | RH, Strike Price \$300.00 ±   | 104.550          | 0,01                         |
| 11                                 | 19.01.2024      | RH, Strike Price \$310.00 ±   | 61.215           | 0,00                         |
| 14                                 | 19.01.2024      | RH, Strike Price \$330.00 ±   | 62.230           | 0,00                         |
| 1.000.000 USD                      | 18.10.2023      | S&P 500 Index, double No-Touch Barrier between \$3,700 & \$4,500 ∞                  | 36.156           | 0,00                         |
| 1.000.000 USD                      | 15.12.2023      | S&P 500 Index, double No-Touch Barrier between \$3,600 & \$4,500 ∞                  | 33.172           | 0,00                         |
| 203                                | 15.09.2023      | S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$4,325.00 ±                                    | 2.139.113        | 0,10                         |
| 40                                 | 21.07.2023      | S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$4,350.00 ±                                    | 296.000          | 0,01                         |
| 43                                 | 15.09.2023      | S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$4,350.00 ±                                    | 410.113          | 0,02                         |
| 450                                | 15.09.2023      | S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$4,500.00 ±                                    | 1.951.875        | 0,09                         |
| 50                                 | 15.12.2023      | S&P 500 Index, Strike Price \$4,250.00 ±  | 1.797.750        | 0,08                         |
| 50                                 | 15.09.2023      | S&P 500 Index, Strike Price \$4,600.00 ±  | 202.000          | 0,01                         |
| 25                                 | 19.01.2024      | S&P 500 Index, Strike Price \$4,650.00 ±  | 305.875          | 0,02                         |
| 48.561                             | 19.01.2024      | Sarepta Therapeutics Inc, Strike Price \$82.73 ∞                                    | 2.109.291        | 0,09                         |
| 400.000                            | 19.01.2024      | Sarepta Therapeutics Inc, Strike Price \$96.97 ∞                                    | 13.984.193       | 0,61                         |
| 17                                 | 21.07.2023      | SBA Communications Corp, Strike Price \$230.00 ±                                    | 11.985           | 0,00                         |
| 1.150.000.000 JPY                  | 25.07.2025      | SBI Group, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 110bps. ∞               | 865.920          | 0,04                         |
| 1.200.000.000 JPY                  | 11.07.2025      | SBI Group, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 148bps. ∞               | 963.804          | 0,04                         |
| 1.000.000.000 JPY                  | 25.07.2025      | SBI Group, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 148bps. ∞               | 807.144          | 0,04                         |
| 58.277                             | 21.01.2028      | Semtech Corp, Strike Price \$41.74 ∞  | 591.021          | 0,03                         |
| 400.000                            | 21.01.2028      | Semtech Corp, Strike Price \$51.00 ∞  | 3.407.592        | 0,15                         |
| 11                                 | 19.01.2024      | ServiceNow Inc, Strike Price \$480.00 ±   | 127.875          | 0,01                         |
| 10                                 | 19.01.2024      | ServiceNow Inc, Strike Price \$530.00 ±   | 82.700           | 0,01                         |
| 24                                 | 19.01.2024      | Sherwin-Williams Co, Strike Price \$260.00 ±  | 58.920           | 0,00                         |
| 22                                 | 19.01.2024      | Sherwin-Williams Co, Strike Price \$280.00 ±  | 31.130           | 0,00                         |
| 1.050                              | 21.06.2024      | Shift4 Payments Inc, Strike Price \$120.40 ∞  | 257.242          | 0,01                         |
| 1.050                              | 19.07.2024      | Shift4 Payments Inc, Strike Price \$120.40 ∞  | 292.877          | 0,01                         |
| 1.050                              | 16.08.2024      | Shift4 Payments Inc, Strike Price \$120.40 ∞  | 329.025          | 0,02                         |
| 126                                | 21.07.2023      | Shift4 Payments Inc, Strike Price \$80.00 ±   | 3.465            | 0,00                         |
| 48.585                             | 11.01.2024      | SK Hynix Inc, Strike Price KRW88,200.00 ∞   | 1.100.294        | 0,05                         |
| 88                                 | 19.01.2024      | Skechers USA Inc, Strike Price \$55.00 ±  | 43.560           | 0,00                         |
| 74                                 | 19.01.2024      | Skechers USA Inc, Strike Price \$60.00 ±  | 22.015           | 0,00                         |
| 40                                 | 19.01.2024      | Skyworks Solutions Inc, Strike Price \$130.00 ±                                     | 15.400           | 0,00                         |
| 37                                 | 19.01.2024      | Skyworks Solutions Inc, Strike Price \$140.00 ±                                     | 7.492            | 0,00                         |
| 894.454                            | 28.02.2030      | Stem Inc, Strike Price \$11.18 ∞  | 3.054.458        | 0,14                         |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Verkaufte Optionskontrakte 10,74 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/<br>Nominalwert   | Fällig-<br>keit | Art   | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------------------------------|-----------------|---|------------------|------------------------------|
| <b>Kaufsoptionen (Fortsetzung)</b> |                 |   |                  |                              |
| 89.445                             | 01.04.2024      | Stem Inc, Strike Price \$5.87 <sup>∞</sup>  | 145.764          | 0,01                         |
| 67.492                             | 19.01.2024      | Sunnova Energy International Inc, Strike Price \$37.85 <sup>∞</sup>                             | 24.724           | 0,00                         |
| 400.000                            | 19.01.2024      | Sunnova Energy International Inc, Strike Price \$48.06 <sup>∞</sup>                             | 60.143           | 0,00                         |
| 50                                 | 19.01.2024      | T Rowe Price Group Inc, Strike Price \$120.00 <sup>±</sup>                                      | 26.500           | 0,00                         |
| 44                                 | 19.01.2024      | T Rowe Price Group Inc, Strike Price \$135.00 <sup>±</sup>                                      | 6.710            | 0,00                         |
| 17                                 | 19.07.2023      | Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD17,000.00 <sup>±</sup>                             | 2.948            | 0,00                         |
| 24                                 | 19.01.2024      | Take-Two Interactive Software Inc, Strike Price \$150.00 <sup>±</sup>                           | 30.840           | 0,00                         |
| 34                                 | 19.01.2024      | Take-Two Interactive Software Inc, Strike Price \$155.00 <sup>±</sup>                           | 35.360           | 0,00                         |
| 20                                 | 19.01.2024      | Take-Two Interactive Software Inc, Strike Price \$165.00 <sup>±</sup>                           | 12.900           | 0,00                         |
| 27                                 | 19.01.2024      | Take-Two Interactive Software Inc, Strike Price \$170.00 <sup>±</sup>                           | 13.365           | 0,00                         |
| 217                                | 19.01.2024      | Tanger Factory Outlet Centers Inc, Strike Price \$24.00 <sup>±</sup>                            | 19.530           | 0,00                         |
| 185                                | 19.01.2024      | Tanger Factory Outlet Centers Inc, Strike Price \$26.00 <sup>±</sup>                            | 6.475            | 0,00                         |
| 122                                | 19.01.2024      | Targa Resources Corp, Strike Price \$77.50 <sup>±</sup>   | 72.590           | 0,01                         |
| 39                                 | 19.01.2024      | Targa Resources Corp, Strike Price \$85.00 <sup>±</sup>   | 11.603           | 0,00                         |
| 120                                | 19.01.2024      | Tenet Healthcare Corp, Strike Price \$75.00 <sup>±</sup>  | 161.400          | 0,01                         |
| 34                                 | 19.01.2024      | Tenet Healthcare Corp, Strike Price \$85.00 <sup>±</sup>  | 23.970           | 0,00                         |
| 28                                 | 19.01.2024      | Texas Instruments Inc, Strike Price \$200.00 <sup>±</sup>                                       | 14.700           | 0,00                         |
| 26                                 | 19.01.2024      | Texas Instruments Inc, Strike Price \$220.00 <sup>±</sup>                                       | 4.134            | 0,00                         |
| 480.000                            | 21.06.2024      | T-Mobile US Inc, Strike Price \$161.65 <sup>∞</sup>   | 3.068.783        | 0,14                         |
| 390.000.000 JPY                    | 16.06.2028      | Toho Holdings Co Ltd, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 75bps. <sup>∞</sup>      | 297.691          | 0,01                         |
| 520.000.000 JPY                    | 04.09.2026      | Tokyu Corp, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 100bps. <sup>∞</sup>               | 216.204          | 0,01                         |
| 440.000.000 JPY                    | 29.09.2028      | Tokyu Corp, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 85bps. <sup>∞</sup>                | 211.974          | 0,01                         |
| 23                                 | 19.01.2024      | Tractor Supply Co, Strike Price \$250.00 <sup>±</sup>   | 15.295           | 0,00                         |
| 20                                 | 19.01.2024      | Tractor Supply Co, Strike Price \$280.00 <sup>±</sup>   | 3.300            | 0,00                         |
| 950.000.000 JPY                    | 13.11.2026      | Transcosmos Inc, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 45bps. <sup>∞</sup> | 319.625          | 0,02                         |
| 7                                  | 15.09.2023      | Ulta Beauty Inc, Strike Price \$570.00 <sup>±</sup>   | 1.242            | 0,00                         |
| 7                                  | 19.01.2024      | Ulta Beauty Inc, Strike Price \$580.00 <sup>±</sup>   | 6.160            | 0,00                         |
| 11                                 | 19.01.2024      | Ulta Beauty Inc, Strike Price \$600.00 <sup>±</sup>   | 6.765            | 0,00                         |
| 6                                  | 15.09.2023      | Ulta Beauty Inc, Strike Price \$620.00 <sup>±</sup>   | 435              | 0,00                         |
| 7                                  | 19.01.2024      | Ulta Beauty Inc, Strike Price \$620.00 <sup>±</sup>   | 2.940            | 0,00                         |
| 9                                  | 19.01.2024      | Ulta Beauty Inc, Strike Price \$660.00 <sup>±</sup>   | 1.845            | 0,00                         |
| 300.000.000 USD                    | 18.04.2024      | United States Dollar/Hong Kong Dollar Currency Option, Strike Price \$7.85 <sup>∞</sup>         | 336.000          | 0,02                         |
| 120                                | 19.01.2024      | United States Steel Corp, Strike Price \$24.00 <sup>±</sup>                                     | 46.500           | 0,00                         |
| 104                                | 19.01.2024      | United States Steel Corp, Strike Price \$26.00 <sup>±</sup>                                     | 29.952           | 0,00                         |
| 39                                 | 19.01.2024      | Valero Energy Corp, Strike Price \$125.00 <sup>±</sup>  | 33.443           | 0,00                         |
| 33                                 | 19.01.2024      | Valero Energy Corp, Strike Price \$135.00 <sup>±</sup>  | 17.408           | 0,00                         |
| 1.650                              | 05.07.2023      | VIX Index, Strike Price \$21.00 <sup>±</sup>  | 4.950            | 0,00                         |
| 1.250                              | 05.07.2023      | VIX Index, Strike Price \$24.00 <sup>±</sup>  | 2.500            | 0,00                         |
| 29                                 | 19.01.2024      | Walmart Inc, Strike Price \$160.00 <sup>±</sup>   | 22.837           | 0,00                         |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Verkaufte Optionskontrakte 10,74 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/<br>Nominalwert   | Fällig-<br>keit | Art   | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------------------------------|-----------------|---|------------------|------------------------------|
| <b>Kaufsoptionen (Fortsetzung)</b> |                 |   |                  |                              |
| 27                                 | 19.01.2024      | Walmart Inc, Strike Price \$175.00 ±  | 5.535            | 0,00                         |
| 513                                | 19.01.2024      | Wayfair Inc, Strike Price \$195.00 ±  | 45.657           | 0,00                         |
| 41.564                             | 19.01.2024      | Wayfair Inc, Strike Price \$210.42 ∞  | 34.325           | 0,00                         |
| 37.717                             | 19.01.2024      | Wayfair Inc, Strike Price \$252.89 ∞  | 20.125           | 0,00                         |
| 49.550                             | 19.01.2024      | Wayfair Inc, Strike Price \$253.24 ∞  | 25.144           | 0,00                         |
| 20.000                             | 09.01.2024      | Wayfair Inc, Strike Price \$267.94 ∞  | 8.916            | 0,00                         |
| 160.000                            | 19.01.2024      | Wayfair Inc, Strike Price \$267.94 ∞  | 74.776           | 0,01                         |
| 160.000                            | 19.01.2024      | Wayfair Inc, Strike Price \$322.19 ∞  | 49.749           | 0,00                         |
| 200.000                            | 19.01.2024      | Wayfair Inc, Strike Price \$323.74 ∞  | 61.549           | 0,00                         |
| 114.629                            | 13.05.2024      | Wayfair Inc, Strike Price \$38.47 ∞   | 3.769.217        | 0,17                         |
| 818.777                            | 25.10.2028      | Wayfair Inc, Strike Price \$73.28 ∞   | 32.701.525       | 1,43                         |
| 73                                 | 15.09.2023      | Wells Fargo & Co, Strike Price \$52.50 ±  | 547              | 0,00                         |
| 70                                 | 15.09.2023      | Wells Fargo & Co, Strike Price \$55.00 ±  | 315              | 0,00                         |
| 87                                 | 19.01.2024      | Winnebago Industries Inc, Strike Price \$65.00 ±                                  | 80.040           | 0,01                         |
| 81                                 | 19.01.2024      | Winnebago Industries Inc, Strike Price \$70.00 ±                                  | 54.675           | 0,00                         |
| 21.739                             | 19.10.2029      | Wolfspeed Inc, Strike Price \$107.31 ∞  | 548.929          | 0,03                         |
| 120.000                            | 19.10.2029      | Wolfspeed Inc, Strike Price \$200.00 ∞  | 1.743.078        | 0,08                         |
| 42                                 | 19.01.2024      | Wyndham Worldwide Corp, Strike Price \$115.00 ±                                   | 33.180           | 0,00                         |
| 42                                 | 19.01.2024      | Wyndham Worldwide Corp, Strike Price \$120.00 ±                                   | 25.515           | 0,00                         |
| 73                                 | 19.01.2024      | Wyndham Worldwide Corp, Strike Price \$130.00 ±                                   | 24.820           | 0,00                         |
| 170.000.000 JPY                    | 20.06.2024      | Yaoko Co Ltd, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 50bps. ∞           | 241.561          | 0,01                         |
| 500.000.000 JPY                    | 21.05.2024      | Yaoko Co Ltd, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 55bps. ∞ | 711.267          | 0,03                         |
| <b>Verkaufsoptionen</b>            |                 |   |                  |                              |
| 1.000                              | 11.08.2023      | 3 Month SOFR Future, Strike Price \$93.13 ±                                       | 6.250            | 0,00                         |
| 2.000                              | 11.08.2023      | 3 Month SOFR Future, Strike Price \$94.25 ±                                       | 25.000           | 0,00                         |
| 367                                | 15.09.2023      | 3 Month SOFR Future, Strike Price \$94.50 ±                                       | 57.344           | 0,00                         |
| 2.000                              | 11.08.2023      | 3 Month SOFR Future, Strike Price \$94.75 ±                                       | 1.025.000        | 0,05                         |
| 375                                | 15.09.2023      | 3 Month SOFR Future, Strike Price \$95.25 ±                                       | 646.875          | 0,03                         |
| 66                                 | 19.01.2024      | AbbVie Inc, Strike Price \$100.00 ±   | 7.293            | 0,00                         |
| 42                                 | 19.01.2024      | AbbVie Inc, Strike Price \$110.00 ±   | 8.526            | 0,00                         |
| 47                                 | 19.01.2024      | AbbVie Inc, Strike Price \$120.00 ±   | 16.450           | 0,00                         |
| 34                                 | 19.01.2024      | AbbVie Inc, Strike Price \$135.00 ±   | 28.390           | 0,00                         |
| 32                                 | 19.01.2024      | AbbVie Inc, Strike Price \$145.00 ±   | 47.760           | 0,00                         |
| 29                                 | 19.01.2024      | AbbVie Inc, Strike Price \$160.00 ±   | 76.922           | 0,01                         |
| 102                                | 19.01.2024      | AbbVie Inc, Strike Price \$80.00 ±  | 3.723            | 0,00                         |
| 15                                 | 19.01.2024      | Adobe Inc, Strike Price \$260.00 ±  | 1.687            | 0,00                         |



## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Verkaufte Optionskontrakte 10,74 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/<br>Nominalwert      | Fällig-<br>keit | Art   | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---------------------------------------|-----------------|---|------------------|------------------------------|
| <b>Verkaufsoptionen (Fortsetzung)</b> |                 |   |                  |                              |
| 12                                    | 19.01.2024      | Adobe Inc, Strike Price \$320.00 ±                  | 3.780            | 0,00                         |
| 11                                    | 19.01.2024      | Adobe Inc, Strike Price \$370.00 ±                  | 7.865            | 0,00                         |
| 31                                    | 19.01.2024      | Advanced Micro Devices Inc, Strike Price \$110.00 ± | 34.953           | 0,00                         |
| 56                                    | 15.09.2023      | Advanced Micro Devices Inc, Strike Price \$60.00 ±  | 644              | 0,00                         |
| 105                                   | 19.01.2024      | Advanced Micro Devices Inc, Strike Price \$60.00 ±  | 6.405            | 0,00                         |
| 45                                    | 15.09.2023      | Advanced Micro Devices Inc, Strike Price \$75.00 ±  | 1.597            | 0,00                         |
| 67                                    | 19.01.2024      | Advanced Micro Devices Inc, Strike Price \$75.00 ±  | 11.357           | 0,00                         |
| 39                                    | 15.09.2023      | Advanced Micro Devices Inc, Strike Price \$85.00 ±  | 3.334            | 0,00                         |
| 47                                    | 19.01.2024      | Advanced Micro Devices Inc, Strike Price \$90.00 ±  | 19.858           | 0,00                         |
| 77                                    | 19.01.2024      | AeroVironment Inc, Strike Price \$80.00 ±           | 22.330           | 0,00                         |
| 55                                    | 19.01.2024      | AeroVironment Inc, Strike Price \$95.00 ±           | 40.700           | 0,00                         |
| 750                                   | 19.01.2024      | Akamai Technologies Inc, Strike Price \$65.00 ±     | 78.750           | 0,01                         |
| 40                                    | 19.01.2024      | Align Technology Inc, Strike Price \$155.00 ±       | 9.700            | 0,00                         |
| 25                                    | 19.01.2024      | Align Technology Inc, Strike Price \$200.00 ±       | 10.188           | 0,00                         |
| 18                                    | 19.01.2024      | Align Technology Inc, Strike Price \$240.00 ±       | 11.790           | 0,00                         |
| 15                                    | 19.01.2024      | Align Technology Inc, Strike Price \$280.00 ±       | 21.375           | 0,00                         |
| 2.653                                 | 20.10.2023      | Alliant Energy Corp, Strike Price \$37.50 ±         | 291.830          | 0,01                         |
| 4.165                                 | 15.09.2023      | American Airlines Group Inc, Strike Price \$10.00 ± | 18.742           | 0,00                         |
| 1.313                                 | 17.11.2023      | American Airlines Group Inc, Strike Price \$10.00 ± | 16.412           | 0,00                         |
| 14.645                                | 19.01.2024      | American Airlines Group Inc, Strike Price \$10.00 ± | 285.578          | 0,01                         |
| 52                                    | 19.01.2024      | AmerisourceBergen Corp, Strike Price \$150.00 ±     | 5.980            | 0,00                         |
| 36                                    | 19.01.2024      | AmerisourceBergen Corp, Strike Price \$180.00 ±     | 14.220           | 0,00                         |
| 3.186                                 | 15.09.2023      | ams AG, Strike Price CHF3.60 ±                      | 58.759           | 0,00                         |
| 44.508                                | 15.03.2024      | ams AG, Strike Price CHF3.60 ±                      | 2.064.586        | 0,09                         |
| 2.448                                 | 15.09.2023      | ams AG, Strike Price CHF4.40 ±                      | 51.989           | 0,00                         |
| 1.009                                 | 15.12.2023      | ams AG, Strike Price CHF4.40 ±                      | 49.060           | 0,00                         |
| 11.883                                | 15.09.2023      | ams AG, Strike Price CHF4.80 ±                      | 245.722          | 0,01                         |
| 2.600                                 | 15.03.2024      | ams AG, Strike Price CHF4.80 ±                      | 207.791          | 0,01                         |
| 43                                    | 19.01.2024      | Analog Devices Inc, Strike Price \$130.00 ±         | 3.870            | 0,00                         |
| 35                                    | 19.01.2024      | Analog Devices Inc, Strike Price \$160.00 ±         | 11.725           | 0,00                         |
| 30                                    | 19.01.2024      | Analog Devices Inc, Strike Price \$190.00 ±         | 32.700           | 0,00                         |
| 217                                   | 19.01.2024      | Apple Inc, Strike Price \$105.00 ±                  | 5.534            | 0,00                         |
| 48                                    | 19.01.2024      | Apple Inc, Strike Price \$115.00 ±                  | 1.608            | 0,00                         |
| 154                                   | 19.01.2024      | Apple Inc, Strike Price \$125.00 ±                  | 9.394            | 0,00                         |
| 69                                    | 19.01.2024      | Apple Inc, Strike Price \$130.00 ±                  | 4.934            | 0,00                         |
| 41                                    | 19.01.2024      | Apple Inc, Strike Price \$135.00 ±                  | 3.423            | 0,00                         |
| 105                                   | 19.01.2024      | Apple Inc, Strike Price \$150.00 ±                  | 16.433           | 0,00                         |
| 50                                    | 19.01.2024      | Apple Inc, Strike Price \$155.00 ±                  | 9.750            | 0,00                         |
| 35                                    | 19.01.2024      | Apple Inc, Strike Price \$160.00 ±                  | 8.627            | 0,00                         |
| 74                                    | 19.01.2024      | Apple Inc, Strike Price \$180.00 ±                  | 44.030           | 0,00                         |
| 34                                    | 19.01.2024      | Apple Inc, Strike Price \$185.00 ±                  | 24.735           | 0,00                         |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Verkaufte Optionskontrakte 10,74 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/<br>Nominalwert      | Fällig-<br>keit | Art  | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---------------------------------------|-----------------|--|------------------|------------------------------|
| <b>Verkaufsoptionen (Fortsetzung)</b> |                 |  |                  |                              |
| 34                                    | 15.09.2023      | Applied Materials Inc, Strike Price \$100.00 ±             | 816              | 0,00                         |
| 65                                    | 19.01.2024      | Applied Materials Inc, Strike Price \$100.00 ±             | 11.375           | 0,00                         |
| 29                                    | 15.09.2023      | Applied Materials Inc, Strike Price \$120.00 ±             | 3.929            | 0,00                         |
| 54                                    | 19.01.2024      | Applied Materials Inc, Strike Price \$120.00 ±             | 25.650           | 0,00                         |
| 79                                    | 19.01.2024      | Applied Materials Inc, Strike Price \$82.50 ±              | 5.095            | 0,00                         |
| 40                                    | 15.09.2023      | Applied Materials Inc, Strike Price \$85.00 ±              | 320              | 0,00                         |
| 700                                   | 18.08.2023      | AppLovin Corp, Strike Price \$10.00 ±                      | 0                | 0,00                         |
| 52                                    | 19.01.2024      | Autodesk Inc, Strike Price \$150.00 ±                      | 14.820           | 0,00                         |
| 17                                    | 19.01.2024      | Autodesk Inc, Strike Price \$160.00 ±                      | 6.885            | 0,00                         |
| 36                                    | 19.01.2024      | Autodesk Inc, Strike Price \$180.00 ±                      | 28.800           | 0,00                         |
| 14                                    | 19.01.2024      | Autodesk Inc, Strike Price \$195.00 ±                      | 17.710           | 0,00                         |
| 27                                    | 19.01.2024      | Autodesk Inc, Strike Price \$210.00 ±                      | 51.840           | 0,00                         |
| 12                                    | 19.01.2024      | Autodesk Inc, Strike Price \$230.00 ±                      | 37.500           | 0,00                         |
| 55                                    | 19.01.2024      | Axon Enterprise Inc, Strike Price \$140.00 ±               | 20.900           | 0,00                         |
| 37                                    | 19.01.2024      | Axon Enterprise Inc, Strike Price \$170.00 ±               | 34.965           | 0,00                         |
| 28                                    | 19.01.2024      | Axon Enterprise Inc, Strike Price \$200.00 ±               | 57.400           | 0,00                         |
| 11.800                                | 15.09.2023      | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Strike Price EUR3.20 ± | 0                | 0,00                         |
| 10.965                                | 21.06.2024      | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Strike Price EUR3.60 ± | 107.665          | 0,01                         |
| 7.200                                 | 15.12.2023      | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Strike Price EUR4.30 ± | 47.131           | 0,00                         |
| 950                                   | 15.09.2023      | Banco BPM SpA, Strike Price EUR2.20 ±                      | 12.023           | 0,00                         |
| 3.115                                 | 15.03.2024      | Banco BPM SpA, Strike Price EUR2.50 ±                      | 161.767          | 0,01                         |
| 7.800                                 | 21.06.2024      | Banco Santander SA, Strike Price EUR2.20 ±                 | 17.020           | 0,00                         |
| 7.930                                 | 15.12.2023      | Barclays Plc, Strike Price GBP130.00 ±                     | 378.068          | 0,02                         |
| 756                                   | 15.09.2023      | Basic-Fit NV, Strike Price EUR18.00 ±                      | 7.836            | 0,00                         |
| 261                                   | 19.01.2024      | Bath & Body Works Inc, Strike Price \$27.50 ±              | 28.710           | 0,00                         |
| 187                                   | 19.01.2024      | Bath & Body Works Inc, Strike Price \$32.50 ±              | 43.478           | 0,00                         |
| 124                                   | 19.01.2024      | Bath & Body Works Inc, Strike Price \$40.00 ±              | 69.440           | 0,00                         |
| 77                                    | 19.01.2024      | Best Buy Co Inc, Strike Price \$50.00 ±                    | 3.349            | 0,00                         |
| 278                                   | 19.01.2024      | Best Buy Co Inc, Strike Price \$55.00 ±                    | 19.321           | 0,00                         |
| 45                                    | 19.01.2024      | Best Buy Co Inc, Strike Price \$60.00 ±                    | 4.905            | 0,00                         |
| 62                                    | 19.01.2024      | Best Buy Co Inc, Strike Price \$62.50 ±                    | 8.494            | 0,00                         |
| 98                                    | 19.01.2024      | Best Buy Co Inc, Strike Price \$65.00 ±                    | 16.758           | 0,00                         |
| 94                                    | 19.01.2024      | Best Buy Co Inc, Strike Price \$67.50 ±                    | 19.928           | 0,00                         |
| 88                                    | 19.01.2024      | Best Buy Co Inc, Strike Price \$75.00 ±                    | 34.760           | 0,00                         |
| 142                                   | 19.01.2024      | Best Buy Co Inc, Strike Price \$77.50 ±                    | 68.870           | 0,00                         |
| 31                                    | 19.01.2024      | Best Buy Co Inc, Strike Price \$87.50 ±                    | 29.837           | 0,00                         |
| 624                                   | 15.03.2024      | BNP Paribas SA, Strike Price EUR35.00 ±                    | 30.635           | 0,00                         |
| 2.530                                 | 15.12.2023      | BNP Paribas SA, Strike Price EUR40.00 ±                    | 115.930          | 0,01                         |
| 147                                   | 19.01.2024      | Boyd Gaming Corp, Strike Price \$50.00 ±                   | 16.538           | 0,00                         |
| 102                                   | 19.01.2024      | Boyd Gaming Corp, Strike Price \$60.00 ±                   | 20.910           | 0,00                         |
| 76                                    | 19.01.2024      | Boyd Gaming Corp, Strike Price \$70.00 ±                   | 44.080           | 0,00                         |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Verkaufte Optionskontrakte 10,74 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/<br>Nominalwert      | Fällig-<br>keit | Art   | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---------------------------------------|-----------------|---|------------------|------------------------------|
| <b>Verkaufsoptionen (Fortsetzung)</b> |                 |   |                  |                              |
| 9                                     | 15.09.2023      | Broadcom Inc, Strike Price \$420.00 ±                 | 270              | 0,00                         |
| 9                                     | 19.01.2024      | Broadcom Inc, Strike Price \$440.00 ±                 | 1.192            | 0,00                         |
| 8                                     | 15.09.2023      | Broadcom Inc, Strike Price \$500.00 ±                 | 200              | 0,00                         |
| 8                                     | 19.01.2024      | Broadcom Inc, Strike Price \$530.00 ±                 | 2.920            | 0,00                         |
| 6                                     | 15.09.2023      | Broadcom Inc, Strike Price \$590.00 ±                 | 630              | 0,00                         |
| 6                                     | 19.01.2024      | Broadcom Inc, Strike Price \$630.00 ±                 | 5.880            | 0,00                         |
| 159                                   | 19.01.2024      | Cardinal Health Inc, Strike Price \$60.00 ±           | 5.168            | 0,00                         |
| 103                                   | 19.01.2024      | Cardinal Health Inc, Strike Price \$75.00 ±           | 8.755            | 0,00                         |
| 75                                    | 19.01.2024      | Cardinal Health Inc, Strike Price \$87.50 ±           | 21.375           | 0,00                         |
| 318                                   | 19.01.2024      | Carnival Corp, Strike Price \$11.00 ±                 | 10.494           | 0,00                         |
| 11.995                                | 15.09.2023      | Carnival Corp, Strike Price \$6.00 ±                  | 11.995           | 0,00                         |
| 50.000                                | 20.09.2023      | CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$18.00 **           | 21.504           | 0,00                         |
| 166                                   | 05.07.2023      | CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,135.00 ±         | 4.980            | 0,00                         |
| 194                                   | 04.08.2023      | CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,300.00 ±         | 368.600          | 0,02                         |
| 387                                   | 15.12.2023      | Cellnex Telecom SA, Strike Price EUR26.00 ±           | 8.233            | 0,00                         |
| 1.850                                 | 15.09.2023      | Ceridian HCM Holding Inc, Strike Price \$55.00 ±      | 157.250          | 0,01                         |
| 1.555                                 | 15.09.2023      | Ceridian HCM Holding Inc, Strike Price \$70.00 ±      | 886.350          | 0,04                         |
| 284                                   | 19.01.2024      | Chemours Co, Strike Price \$20.00 ±                   | 19.880           | 0,00                         |
| 236                                   | 19.01.2024      | Chemours Co, Strike Price \$24.00 ±                   | 30.680           | 0,00                         |
| 203                                   | 19.01.2024      | Chemours Co, Strike Price \$28.00 ±                   | 20.300           | 0,00                         |
| 9                                     | 19.01.2024      | Chipotle Mexican Grill Inc, Strike Price \$1,120.00 ± | 2.273            | 0,00                         |
| 6                                     | 19.01.2024      | Chipotle Mexican Grill Inc, Strike Price \$1,430.00 ± | 5.460            | 0,00                         |
| 7                                     | 19.01.2024      | Chipotle Mexican Grill Inc, Strike Price \$1,440.00 ± | 6.405            | 0,00                         |
| 5                                     | 19.01.2024      | Chipotle Mexican Grill Inc, Strike Price \$1,740.00 ± | 15.900           | 0,00                         |
| 5                                     | 19.01.2024      | Chipotle Mexican Grill Inc, Strike Price \$1,750.00 ± | 17.225           | 0,00                         |
| 4                                     | 19.01.2024      | Chipotle Mexican Grill Inc, Strike Price \$2,050.00 ± | 40.540           | 0,00                         |
| 4                                     | 19.01.2024      | Chipotle Mexican Grill Inc, Strike Price \$2,060.00 ± | 41.620           | 0,00                         |
| 171                                   | 19.01.2024      | Cleveland-Cliffs Inc, Strike Price \$15.00 ±          | 20.092           | 0,00                         |
| 142                                   | 19.01.2024      | Cleveland-Cliffs Inc, Strike Price \$18.00 ±          | 36.565           | 0,00                         |
| 128                                   | 19.01.2024      | Cleveland-Cliffs Inc, Strike Price \$20.00 ±          | 49.920           | 0,00                         |
| 610                                   | 15.12.2023      | CMS Energy Corp, Strike Price \$45.00 ±               | 0                | 0,00                         |
| 580                                   | 21.07.2023      | Confluent Inc, Strike Price \$17.50 ±                 | 0                | 0,00                         |
| 735                                   | 15.12.2023      | CONMED Corp, Strike Price \$85.00 ±                   | 180.075          | 0,01                         |
| 571                                   | 19.01.2024      | Coty Inc, Strike Price \$10.00 ±                      | 23.125           | 0,00                         |
| 475                                   | 19.01.2024      | Coty Inc, Strike Price \$12.00 ±                      | 47.737           | 0,00                         |
| 714                                   | 19.01.2024      | Coty Inc, Strike Price \$8.00 ±                       | 11.781           | 0,00                         |
| 15.000                                | 15.09.2023      | Crédit Agricole SA, Strike Price EUR6.00 ±            | 16.365           | 0,00                         |
| 31.960                                | 15.12.2023      | Crédit Agricole SA, Strike Price EUR6.00 ±            | 122.039          | 0,01                         |
| 1.147                                 | 21.06.2024      | Crédit Agricole SA, Strike Price EUR6.00 ±            | 16.894           | 0,00                         |
| 45                                    | 19.01.2024      | CVS Caremark Corp, Strike Price \$65.00 ±             | 13.725           | 0,00                         |
| 39                                    | 19.01.2024      | CVS Caremark Corp, Strike Price \$75.00 ±             | 31.200           | 0,00                         |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Verkaufte Optionskontrakte 10,74 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/<br>Nominalwert      | Fällig-<br>keit | Art  | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---------------------------------------|-----------------|--|------------------|------------------------------|
| <b>Verkaufsoptionen (Fortsetzung)</b> |                 |  |                  |                              |
| 33                                    | 19.01.2024      | CVS Caremark Corp, Strike Price \$90.00 ±          | 70.042           | 0,00                         |
| 587                                   | 15.03.2024      | Davide Campari-Milano NV, Strike Price EUR8.60 ±   | 25.104           | 0,00                         |
| 7.560                                 | 21.06.2024      | Deutsche Bank AG, Strike Price EUR5.60 ±           | 230.943          | 0,01                         |
| 26.275                                | 15.03.2024      | Deutsche Lufthansa AG, Strike Price EUR6.40 ±      | 544.654          | 0,03                         |
| 2.600                                 | 15.12.2023      | Deutsche Lufthansa AG, Strike Price EUR6.80 ±      | 38.294           | 0,00                         |
| 8.350                                 | 15.12.2023      | Deutsche Lufthansa AG, Strike Price EUR8.00 ±      | 355.284          | 0,02                         |
| 14.281                                | 15.12.2023      | Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR12.00 ±       | 109.064          | 0,01                         |
| 1.395.000                             | 20.12.2024      | Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR15.50 ∞       | 779.336          | 0,04                         |
| 1.395.000                             | 21.03.2025      | Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR15.50 ∞       | 843.131          | 0,04                         |
| 231                                   | 19.01.2024      | Devon Energy Corp, Strike Price \$27.00 ±          | 8.778            | 0,00                         |
| 137                                   | 19.01.2024      | Devon Energy Corp, Strike Price \$35.00 ±          | 15.276           | 0,00                         |
| 155                                   | 19.01.2024      | Devon Energy Corp, Strike Price \$37.00 ±          | 22.320           | 0,00                         |
| 158                                   | 19.01.2024      | Devon Energy Corp, Strike Price \$42.00 ±          | 41.633           | 0,00                         |
| 128                                   | 19.01.2024      | Devon Energy Corp, Strike Price \$45.00 ±          | 47.040           | 0,00                         |
| 119                                   | 19.01.2024      | Devon Energy Corp, Strike Price \$50.00 ±          | 71.697           | 0,00                         |
| 105                                   | 19.01.2024      | Devon Energy Corp, Strike Price \$55.00 ±          | 96.075           | 0,01                         |
| 44                                    | 19.01.2024      | Devon Energy Corp, Strike Price \$60.00 ±          | 57.420           | 0,00                         |
| 57                                    | 19.01.2024      | Dexcom Inc, Strike Price \$107.50 ±                | 26.505           | 0,00                         |
| 41                                    | 19.01.2024      | Dexcom Inc, Strike Price \$127.50 ±                | 47.560           | 0,00                         |
| 81                                    | 19.01.2024      | Dexcom Inc, Strike Price \$90.00 ±                 | 15.998           | 0,00                         |
| 41                                    | 19.01.2024      | Dick's Sporting Goods Inc, Strike Price \$105.00 ± | 15.990           | 0,00                         |
| 55                                    | 19.01.2024      | Dick's Sporting Goods Inc, Strike Price \$115.00 ± | 34.375           | 0,00                         |
| 29                                    | 19.01.2024      | Dick's Sporting Goods Inc, Strike Price \$125.00 ± | 27.550           | 0,00                         |
| 40                                    | 19.01.2024      | Dick's Sporting Goods Inc, Strike Price \$135.00 ± | 55.600           | 0,00                         |
| 88                                    | 19.01.2024      | Dick's Sporting Goods Inc, Strike Price \$70.00 ±  | 5.500            | 0,00                         |
| 60                                    | 19.01.2024      | Dick's Sporting Goods Inc, Strike Price \$85.00 ±  | 8.550            | 0,00                         |
| 79                                    | 19.01.2024      | Dick's Sporting Goods Inc, Strike Price \$95.00 ±  | 18.960           | 0,00                         |
| 51                                    | 19.01.2024      | Dollar Tree Inc, Strike Price \$110.00 ±           | 10.430           | 0,00                         |
| 35                                    | 19.01.2024      | Dollar Tree Inc, Strike Price \$135.00 ±           | 24.588           | 0,00                         |
| 27                                    | 19.01.2024      | Dollar Tree Inc, Strike Price \$155.00 ±           | 43.943           | 0,00                         |
| 84                                    | 19.01.2024      | Dollar Tree Inc, Strike Price \$85.00 ±            | 4.788            | 0,00                         |
| 28                                    | 19.01.2024      | Domino's Pizza Inc, Strike Price \$220.00 ±        | 5.320            | 0,00                         |
| 25                                    | 19.01.2024      | Domino's Pizza Inc, Strike Price \$260.00 ±        | 12.125           | 0,00                         |
| 21                                    | 19.01.2024      | Domino's Pizza Inc, Strike Price \$310.00 ±        | 29.085           | 0,00                         |
| 74                                    | 19.01.2024      | Eagle Materials Inc, Strike Price \$120.00 ±       | 7.955            | 0,00                         |
| 51                                    | 19.01.2024      | Eagle Materials Inc, Strike Price \$145.00 ±       | 10.455           | 0,00                         |
| 34                                    | 19.01.2024      | Eagle Materials Inc, Strike Price \$175.00 ±       | 23.460           | 0,00                         |
| 1.765                                 | 18.08.2023      | Envestnet Inc, Strike Price \$45.00 ±              | 101.488          | 0,01                         |
| 89                                    | 19.01.2024      | Etsy Inc, Strike Price \$65.00 ±                   | 36.713           | 0,00                         |
| 72                                    | 19.01.2024      | Etsy Inc, Strike Price \$80.00 ±                   | 66.600           | 0,00                         |
| 60                                    | 19.01.2024      | Etsy Inc, Strike Price \$95.00 ±                   | 104.400          | 0,01                         |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Verkaufte Optionskontrakte 10,74 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/<br>Nominalwert      | Fällig-<br>keit | Art  | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---------------------------------------|-----------------|--|------------------|------------------------------|
| <b>Verkaufsoptionen (Fortsetzung)</b> |                 |  |                  |                              |
| 35.000                                | 20.12.2024      | Euro STOXX 50 Index, Strike Price EUR3,200.00 <sup>∞</sup>   | 1.161.284        | 0,05                         |
| 7.000                                 | 21.07.2023      | Euro STOXX 50 Index, Strike Price EUR4,000.00 <sup>∞</sup>   | 8.760            | 0,00                         |
| 1.056                                 | 21.07.2023      | Euro STOXX 50 Index, Strike Price EUR4,175.00 <sup>±</sup>   | 74.886           | 0,01                         |
| 1.144                                 | 15.09.2023      | Euro STOXX 50 Index, Strike Price EUR4,300.00 <sup>±</sup>   | 746.366          | 0,03                         |
| 50.000                                | 20.09.2023      | Euro STOXX 50 Volatility Index with a knock-out term on Euro STOXX 50 Index at EUR 4,400, Strike Price EUR19.00 <sup>∞</sup> | 65.089           | 0,00                         |
| 460                                   | 21.07.2023      | Euro STOXX Banks Index, Strike Price EUR95.00 <sup>±</sup>   | 2.509            | 0,00                         |
| 25                                    | 19.01.2024      | FedEx Corp, Strike Price \$155.00 <sup>±</sup>   | 2.300            | 0,00                         |
| 39                                    | 19.01.2024      | FedEx Corp, Strike Price \$160.00 <sup>±</sup>   | 4.310            | 0,00                         |
| 21                                    | 19.01.2024      | FedEx Corp, Strike Price \$185.00 <sup>±</sup>   | 5.628            | 0,00                         |
| 34                                    | 19.01.2024      | FedEx Corp, Strike Price \$190.00 <sup>±</sup>   | 10.795           | 0,00                         |
| 18                                    | 19.01.2024      | FedEx Corp, Strike Price \$220.00 <sup>±</sup>   | 14.355           | 0,00                         |
| 28                                    | 19.01.2024      | FedEx Corp, Strike Price \$230.00 <sup>±</sup>   | 29.960           | 0,00                         |
| 3.829                                 | 19.01.2024      | FirstEnergy Corp, Strike Price \$28.00 <sup>±</sup>  | 105.297          | 0,01                         |
| 56                                    | 19.01.2024      | Five Below Inc, Strike Price \$135.00 <sup>±</sup>   | 9.380            | 0,00                         |
| 39                                    | 19.01.2024      | Five Below Inc, Strike Price \$165.00 <sup>±</sup>   | 26.130           | 0,00                         |
| 29                                    | 19.01.2024      | Five Below Inc, Strike Price \$195.00 <sup>±</sup>   | 47.705           | 0,00                         |
| 80                                    | 19.01.2024      | Foot Locker Inc, Strike Price \$32.50 <sup>±</sup>   | 56.000           | 0,00                         |
| 69                                    | 19.01.2024      | Foot Locker Inc, Strike Price \$37.50 <sup>±</sup>   | 76.590           | 0,01                         |
| 58                                    | 19.01.2024      | Foot Locker Inc, Strike Price \$45.00 <sup>±</sup>   | 106.430          | 0,01                         |
| 183                                   | 19.01.2024      | Fortinet Inc, Strike Price \$37.00 <sup>±</sup>  | 7.320            | 0,00                         |
| 110                                   | 19.01.2024      | Fortinet Inc, Strike Price \$48.00 <sup>±</sup>  | 6.050            | 0,00                         |
| 75                                    | 19.01.2024      | Fortinet Inc, Strike Price \$58.00 <sup>±</sup>  | 10.313           | 0,00                         |
| 56                                    | 19.01.2024      | Fortinet Inc, Strike Price \$68.00 <sup>±</sup>  | 19.040           | 0,00                         |
| 250                                   | 19.01.2024      | Freeport-McMoRan Inc, Strike Price \$28.00 <sup>±</sup>  | 14.875           | 0,00                         |
| 170                                   | 19.01.2024      | Freeport-McMoRan Inc, Strike Price \$34.00 <sup>±</sup>  | 29.495           | 0,00                         |
| 130                                   | 19.01.2024      | Freeport-McMoRan Inc, Strike Price \$39.00 <sup>±</sup>  | 45.825           | 0,00                         |
| 92                                    | 19.01.2024      | Hess Corp, Strike Price \$110.00 <sup>±</sup>  | 32.200           | 0,00                         |
| 30                                    | 19.01.2024      | Hess Corp, Strike Price \$125.00 <sup>±</sup>  | 21.750           | 0,00                         |
| 42                                    | 19.01.2024      | Hess Corp, Strike Price \$130.00 <sup>±</sup>  | 38.010           | 0,00                         |
| 42                                    | 19.01.2024      | Hess Corp, Strike Price \$90.00 <sup>±</sup>   | 4.935            | 0,00                         |
| 81                                    | 19.01.2024      | Hess Corp, Strike Price \$92.50 <sup>±</sup>   | 11.138           | 0,00                         |
| 369                                   | 19.01.2024      | HP Inc, Strike Price \$18.00 <sup>±</sup>  | 3.875            | 0,00                         |
| 270                                   | 19.01.2024      | HP Inc, Strike Price \$21.00 <sup>±</sup>  | 6.075            | 0,00                         |
| 178                                   | 19.01.2024      | HP Inc, Strike Price \$26.00 <sup>±</sup>  | 14.062           | 0,00                         |
| 126                                   | 19.01.2024      | HP Inc, Strike Price \$31.00 <sup>±</sup>  | 30.051           | 0,00                         |
| 3.060                                 | 15.12.2023      | HSBC Holdings Plc, Strike Price GBP400.00 <sup>±</sup>   | 97.258           | 0,01                         |
| 7.343                                 | 15.09.2023      | Idorsia Ltd, Strike Price CHF6.80 <sup>±</sup>   | 886.429          | 0,04                         |
| 13.529                                | 21.06.2024      | ING Groep NV, Strike Price EUR5.96 <sup>±</sup>  | 536.679          | 0,03                         |
| 38                                    | 18.08.2023      | Insmed Inc, Strike Price \$15.00 <sup>±</sup>  | 1.520            | 0,00                         |
| 505                                   | 15.12.2023      | Insmed Inc, Strike Price \$15.00 <sup>±</sup>  | 58.075           | 0,00                         |
| 76                                    | 15.12.2023      | Insulet Corp, Strike Price \$195.00 <sup>±</sup>   | 15.010           | 0,00                         |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Verkaufte Optionskontrakte 10,74 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/<br>Nominalwert      | Fällig-<br>keit | Art  | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---------------------------------------|-----------------|--|------------------|------------------------------|
| <b>Verkaufsoptionen (Fortsetzung)</b> |                 |  |                  |                              |
| 233                                   | 15.12.2023      | InterDigital Inc, Strike Price \$57.50 ±                               | 9.903            | 0,00                         |
| 4.827                                 | 15.09.2023      | International Consolidated Airlines Group SA, Strike Price GBP100.00 ± | 15.342           | 0,00                         |
| 714                                   | 15.09.2023      | International Consolidated Airlines Group SA, Strike Price GBP120.00 ± | 31.771           | 0,00                         |
| 3.700                                 | 15.09.2023      | Intesa Sanpaolo SpA, Strike Price EUR1.25 ±                            | 24.624           | 0,00                         |
| 12.700                                | 15.09.2023      | Intesa Sanpaolo SpA, Strike Price EUR1.30 ±                            | 152.413          | 0,01                         |
| 2.230                                 | 15.09.2023      | Intesa Sanpaolo SpA, Strike Price EUR1.35 ±                            | 15.327           | 0,00                         |
| 162                                   | 19.01.2024      | ITT Inc, Strike Price \$45.00 ±  | 2.430            | 0,00                         |
| 111                                   | 19.01.2024      | ITT Inc, Strike Price \$55.00 ±  | 2.220            | 0,00                         |
| 68                                    | 19.01.2024      | ITT Inc, Strike Price \$70.00 ±  | 6.120            | 0,00                         |
| 52                                    | 19.01.2024      | ITT Inc, Strike Price \$80.00 ±  | 10.270           | 0,00                         |
| 4.047                                 | 15.09.2023      | Just Eat Takeaway.com NV, Strike Price EUR12.00 ±                      | 315.692          | 0,02                         |
| 9.553                                 | 15.09.2023      | Just Eat Takeaway.com NV, Strike Price EUR9.00 ±                       | 328.303          | 0,02                         |
| 3.312.169                             | 15.12.2023      | Kingsoft Corp Ltd, Strike Price HKD19.80 ∞                             | 184.712          | 0,01                         |
| 13                                    | 13.07.2023      | KOSPI 200 Index, Strike Price KRW342.50 ±                              | 12.826           | 0,00                         |
| 101                                   | 19.01.2024      | Kroger Co, Strike Price \$30.00 ±                                      | 1.414            | 0,00                         |
| 207                                   | 19.01.2024      | Kroger Co, Strike Price \$33.00 ±                                      | 4.658            | 0,00                         |
| 125                                   | 19.01.2024      | Kroger Co, Strike Price \$35.00 ±                                      | 4.187            | 0,00                         |
| 80                                    | 19.01.2024      | Kroger Co, Strike Price \$38.00 ±                                      | 4.680            | 0,00                         |
| 166                                   | 19.01.2024      | Kroger Co, Strike Price \$41.00 ±                                      | 17.015           | 0,00                         |
| 104                                   | 19.01.2024      | Kroger Co, Strike Price \$42.00 ±                                      | 12.740           | 0,00                         |
| 68                                    | 19.01.2024      | Kroger Co, Strike Price \$45.00 ±                                      | 13.838           | 0,00                         |
| 143                                   | 19.01.2024      | Kroger Co, Strike Price \$48.00 ±                                      | 46.475           | 0,00                         |
| 87                                    | 19.01.2024      | Kroger Co, Strike Price \$50.00 ±                                      | 38.062           | 0,00                         |
| 33.811                                | 11.01.2024      | L&F Co Ltd, Strike Price KRW229,775.68 ∞                               | 831.526          | 0,04                         |
| 27                                    | 19.01.2024      | Lam Research Corp, Strike Price \$350.00 ±                             | 6.885            | 0,00                         |
| 9                                     | 19.01.2024      | Lam Research Corp, Strike Price \$420.00 ±                             | 5.737            | 0,00                         |
| 13                                    | 19.01.2024      | Lam Research Corp, Strike Price \$430.00 ±                             | 9.392            | 0,00                         |
| 8                                     | 19.01.2024      | Lam Research Corp, Strike Price \$500.00 ±                             | 12.920           | 0,00                         |
| 11                                    | 19.01.2024      | Lam Research Corp, Strike Price \$510.00 ±                             | 19.800           | 0,00                         |
| 1.037                                 | 21.07.2023      | Lantheus Holdings Inc, Strike Price \$35.00 ±                          | 0                | 0,00                         |
| 175                                   | 19.01.2024      | Las Vegas Sands Corp, Strike Price \$42.00 ±                           | 17.413           | 0,00                         |
| 123                                   | 19.01.2024      | Las Vegas Sands Corp, Strike Price \$50.00 ±                           | 28.782           | 0,00                         |
| 87                                    | 19.01.2024      | Las Vegas Sands Corp, Strike Price \$60.00 ±                           | 51.765           | 0,00                         |
| 5.140                                 | 21.07.2023      | Live Nation Entertainment Inc, Strike Price \$50.00 ±                  | 0                | 0,00                         |
| 121                                   | 21.07.2023      | Live Nation Entertainment Inc, Strike Price \$55.00 ±                  | 0                | 0,00                         |
| 1.179                                 | 15.03.2024      | Live Nation Entertainment Inc, Strike Price \$65.00 ±                  | 215.168          | 0,01                         |
| 45.050                                | 15.09.2023      | Lloyds Banking Group Plc, Strike Price GBP24.00 ±                      | 0                | 0,00                         |
| 17.850                                | 15.12.2023      | Lloyds Banking Group Plc, Strike Price GBP24.00 ±                      | 0                | 0,00                         |
| 11.810                                | 21.06.2024      | Lloyds Banking Group Plc, Strike Price GBP24.00 ±                      | 112.610          | 0,01                         |
| 201                                   | 19.01.2024      | Louisiana-Pacific Corp, Strike Price \$32.50 ±                         | 0                | 0,00                         |
| 118                                   | 19.01.2024      | Louisiana-Pacific Corp, Strike Price \$42.50 ±                         | 4.720            | 0,00                         |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Verkaufte Optionskontrakte 10,74 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/<br>Nominalwert      | Fällig-<br>keit | Art  | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---------------------------------------|-----------------|--|------------------|------------------------------|
| <b>Verkaufsoptionen (Fortsetzung)</b> |                 |  |                  |                              |
| 154                                   | 19.01.2024      | Louisiana-Pacific Corp, Strike Price \$47.50 ±             | 39.270           | 0,00                         |
| 84                                    | 19.01.2024      | Louisiana-Pacific Corp, Strike Price \$50.00 ±             | 6.510            | 0,00                         |
| 105                                   | 19.01.2024      | Louisiana-Pacific Corp, Strike Price \$57.50 ±             | 12.600           | 0,00                         |
| 60                                    | 19.01.2024      | Louisiana-Pacific Corp, Strike Price \$60.00 ±             | 9.000            | 0,00                         |
| 77                                    | 19.01.2024      | Louisiana-Pacific Corp, Strike Price \$67.50 ±             | 24.640           | 0,00                         |
| 32                                    | 19.01.2024      | Lululemon Athletica Inc, Strike Price \$260.00 ±           | 11.440           | 0,00                         |
| 22                                    | 19.01.2024      | Lululemon Athletica Inc, Strike Price \$320.00 ±           | 24.750           | 0,00                         |
| 15                                    | 19.01.2024      | Lululemon Athletica Inc, Strike Price \$380.00 ±           | 45.300           | 0,00                         |
| 9.394                                 | 18.08.2023      | Luminar Technologies Inc, Strike Price \$4.00 ±            | 51.667           | 0,00                         |
| 950                                   | 21.07.2023      | Lyft Inc, Strike Price \$7.50 ±                            | 4.275            | 0,00                         |
| 82                                    | 19.01.2024      | LyondellBasell Industries NV, Strike Price \$64.80 ±       | 6.765            | 0,00                         |
| 53                                    | 15.09.2023      | LyondellBasell Industries NV, Strike Price \$70.00 ±       | 1.060            | 0,00                         |
| 67                                    | 19.01.2024      | LyondellBasell Industries NV, Strike Price \$79.80 ±       | 16.415           | 0,00                         |
| 47                                    | 15.09.2023      | LyondellBasell Industries NV, Strike Price \$80.00 ±       | 3.642            | 0,00                         |
| 60                                    | 19.01.2024      | LyondellBasell Industries NV, Strike Price \$89.80 ±       | 32.700           | 0,00                         |
| 39                                    | 15.09.2023      | LyondellBasell Industries NV, Strike Price \$95.00 ±       | 22.035           | 0,00                         |
| 429                                   | 19.01.2024      | Marathon Oil Corp, Strike Price \$16.00 ±                  | 17.804           | 0,00                         |
| 305                                   | 19.01.2024      | Marathon Oil Corp, Strike Price \$19.00 ±                  | 28.975           | 0,00                         |
| 227                                   | 19.01.2024      | Marathon Oil Corp, Strike Price \$22.00 ±                  | 43.811           | 0,00                         |
| 2.814                                 | 21.07.2023      | Marriott Vacations Worldwide Corp, Strike Price \$100.00 ± | 56.280           | 0,00                         |
| 860                                   | 21.07.2023      | Marriott Vacations Worldwide Corp, Strike Price \$110.00 ± | 30.100           | 0,00                         |
| 734                                   | 20.10.2023      | Marriott Vacations Worldwide Corp, Strike Price \$95.00 ±  | 99.090           | 0,01                         |
| 1.231                                 | 15.09.2023      | Match Group Inc, Strike Price \$25.00 ±                    | 14.772           | 0,00                         |
| 2.264.144                             | 15.12.2023      | Meituan, Strike Price HKD115.50 ±                          | 2.775.302        | 0,12                         |
| 41                                    | 19.01.2024      | Meta Platforms Inc, Strike Price \$190.00 ±                | 13.940           | 0,00                         |
| 28                                    | 19.01.2024      | Meta Platforms Inc, Strike Price \$230.00 ±                | 25.480           | 0,00                         |
| 20                                    | 19.01.2024      | Meta Platforms Inc, Strike Price \$275.00 ±                | 45.600           | 0,00                         |
| 89                                    | 19.01.2024      | Micron Technology Inc, Strike Price \$45.00 ±              | 9.612            | 0,00                         |
| 76                                    | 19.01.2024      | Micron Technology Inc, Strike Price \$52.50 ±              | 18.050           | 0,00                         |
| 63                                    | 19.01.2024      | Micron Technology Inc, Strike Price \$62.50 ±              | 36.540           | 0,00                         |
| 39                                    | 19.01.2024      | Microsoft Corp, Strike Price \$235.00 ±                    | 7.586            | 0,00                         |
| 27                                    | 19.01.2024      | Microsoft Corp, Strike Price \$285.00 ±                    | 17.348           | 0,00                         |
| 20                                    | 19.01.2024      | Microsoft Corp, Strike Price \$335.00 ±                    | 37.800           | 0,00                         |
| 3.982                                 | 15.09.2023      | Middleby Corp, Strike Price \$135.00 ±                     | 1.324.015        | 0,06                         |
| 252                                   | 15.09.2023      | Nasdaq 100 E-mini, Strike Price \$14,500.00 ±              | 1.150.380        | 0,05                         |
| 8.500                                 | 21.06.2024      | Natwest Group Plc, Strike Price GBP120.00 ±                | 189.113          | 0,01                         |
| 5.375                                 | 21.06.2024      | Natwest Group Plc, Strike Price GBP160.00 ±                | 222.089          | 0,01                         |
| (28)                                  | 15.12.2023      | nCino Inc, Strike Price \$20.00 ±                          | 0                | 0,00                         |
| 1.599                                 | 15.12.2023      | Nexi SpA, Strike Price EUR5.20 ±                           | 65.681           | 0,00                         |
| 2.500                                 | 15.09.2023      | Nexi SpA, Strike Price EUR5.60 ±                           | 56.050           | 0,00                         |
| 74                                    | 08.09.2023      | Nikkei 225 Index, Strike Price JPY29,000.00 ±              | 61.438           | 0,00                         |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Verkaufte Optionskontrakte 10,74 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/<br>Nominalwert      | Fällig-<br>keit | Art   | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---------------------------------------|-----------------|---|------------------|------------------------------|
| <b>Verkaufsoptionen (Fortsetzung)</b> |                 |   |                  |                              |
| 3                                     | 14.07.2023      | Nikkei 225 Index, Strike Price JPY31,000.00 ±               | 477              | 0,00                         |
| 3                                     | 14.07.2023      | Nikkei 225 Index, Strike Price JPY31,125.00 ±               | 602              | 0,00                         |
| 1                                     | 14.07.2023      | Nikkei 225 Index, Strike Price JPY31,250.00 ±               | 228              | 0,00                         |
| 6                                     | 14.07.2023      | Nikkei 225 Index, Strike Price JPY32,500.00 ±               | 7.680            | 0,00                         |
| 2                                     | 14.07.2023      | Nikkei 225 Index, Strike Price JPY33,250.00 ±               | 6.711            | 0,00                         |
| 2.100                                 | 15.09.2023      | Northern Oil and Gas Inc, Strike Price \$22.00 ±            | 57.750           | 0,00                         |
| 5.040                                 | 15.09.2023      | Norwegian Cruise Line Holdings Ltd, Strike Price \$10.00 ±  | 17.640           | 0,00                         |
| 5.050                                 | 15.09.2023      | Norwegian Cruise Line Holdings Ltd, Strike Price \$8.00 ±   | 47.975           | 0,00                         |
| 37                                    | 19.01.2024      | NVIDIA Corp, Strike Price \$170.00 ±                        | 2.553            | 0,00                         |
| 24                                    | 19.01.2024      | NVIDIA Corp, Strike Price \$215.00 ±                        | 4.416            | 0,00                         |
| 16                                    | 19.01.2024      | NVIDIA Corp, Strike Price \$260.00 ±                        | 7.520            | 0,00                         |
| 12                                    | 19.01.2024      | NVIDIA Corp, Strike Price \$305.00 ±                        | 12.750           | 0,00                         |
| 219                                   | 15.09.2023      | Ocado Group Plc, Strike Price GBP320.00 ±                   | 18.794           | 0,00                         |
| 796                                   | 15.09.2023      | Ocado Group Plc, Strike Price GBP400.00 ±                   | 161.919          | 0,01                         |
| 440                                   | 19.01.2024      | Okta Inc, Strike Price \$80.00 ±                            | 663.300          | 0,03                         |
| 140                                   | 19.01.2024      | ON Semiconductor Corp, Strike Price \$45.00 ±               | 4.480            | 0,00                         |
| 79                                    | 19.01.2024      | ON Semiconductor Corp, Strike Price \$60.00 ±               | 8.769            | 0,00                         |
| 1.357                                 | 15.09.2023      | ON Semiconductor Corp, Strike Price \$65.00 ±               | 59.708           | 0,00                         |
| 59                                    | 19.01.2024      | ON Semiconductor Corp, Strike Price \$70.00 ±               | 13.954           | 0,00                         |
| 40                                    | 19.01.2024      | ON Semiconductor Corp, Strike Price \$85.00 ±               | 24.500           | 0,00                         |
| 196                                   | 19.01.2024      | ONEOK Inc, Strike Price \$42.50 ±                           | 7.350            | 0,00                         |
| 128                                   | 19.01.2024      | ONEOK Inc, Strike Price \$52.50 ±                           | 17.920           | 0,00                         |
| 99                                    | 19.01.2024      | ONEOK Inc, Strike Price \$60.00 ±                           | 35.640           | 0,00                         |
| 320                                   | 15.12.2023      | Ormat Technologies Inc, Strike Price \$55.00 ±              | 0                | 0,00                         |
| 1.397                                 | 15.09.2023      | Palo Alto Networks Inc, Strike Price \$100.00 ±             | 0                | 0,00                         |
| 750.000                               | 21.11.2025      | Palo Alto Networks Inc, Strike Price \$136.16 ∞             | 4.306.132        | 0,19                         |
| 2.962                                 | 19.01.2024      | Peabody Energy Corp, Strike Price \$14.00 ±                 | 131.809          | 0,01                         |
| 550                                   | 19.01.2024      | PG&E Corp, Strike Price \$11.00 ±                           | 9.075            | 0,00                         |
| 1.695                                 | 19.01.2024      | PG&E Corp, Strike Price \$12.00 ±                           | 26.272           | 0,00                         |
| 340                                   | 19.01.2024      | PG&E Corp, Strike Price \$14.00 ±                           | 10.540           | 0,00                         |
| 1.255                                 | 19.01.2024      | PG&E Corp, Strike Price \$15.00 ±                           | 60.867           | 0,00                         |
| 261                                   | 19.01.2024      | PG&E Corp, Strike Price \$16.00 ±                           | 16.965           | 0,00                         |
| 1.065                                 | 19.01.2024      | PG&E Corp, Strike Price \$17.00 ±                           | 105.967          | 0,01                         |
| 820                                   | 19.01.2024      | PG&E Corp, Strike Price \$9.00 ±                            | 8.610            | 0,00                         |
| 40                                    | 19.01.2024      | Pioneer Natural Resources Co, Strike Price \$155.00 ±       | 11.000           | 0,00                         |
| 33                                    | 19.01.2024      | Pioneer Natural Resources Co, Strike Price \$190.00 ±       | 34.650           | 0,00                         |
| 28                                    | 19.01.2024      | Pioneer Natural Resources Co, Strike Price \$220.00 ±       | 72.240           | 0,00                         |
| 16.000.000                            | 15.12.2023      | Postal Savings Bank of China Co Ltd, Strike Price HKD3.77 ∞ | 125.677          | 0,01                         |
| 140                                   | 19.01.2024      | PPL Corporation, Strike Price \$20.00 ±                     | 3.500            | 0,00                         |
| 54                                    | 19.01.2024      | Qorvo Inc, Strike Price \$100.00 ±                          | 40.230           | 0,00                         |
| 109                                   | 19.01.2024      | Qorvo Inc, Strike Price \$70.00 ±                           | 12.535           | 0,00                         |



## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Verkaufte Optionskontrakte 10,74 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/<br>Nominalwert      | Fällig-<br>keit | Art  | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---------------------------------------|-----------------|--|------------------|------------------------------|
| <b>Verkaufsoptionen (Fortsetzung)</b> |                 |  |                  |                              |
| 74                                    | 19.01.2024      | Qorvo Inc, Strike Price \$85.00 ±                | 22.755           | 0,00                         |
| 389                                   | 19.01.2024      | Range Resources Corp, Strike Price \$18.00 ±     | 14.588           | 0,00                         |
| 261                                   | 19.01.2024      | Range Resources Corp, Strike Price \$22.00 ±     | 23.490           | 0,00                         |
| 187                                   | 19.01.2024      | Range Resources Corp, Strike Price \$26.00 ±     | 35.063           | 0,00                         |
| 43                                    | 19.01.2024      | RH, Strike Price \$140.00 ±                      | 4.623            | 0,00                         |
| 34                                    | 19.01.2024      | RH, Strike Price \$175.00 ±                      | 8.075            | 0,00                         |
| 27                                    | 19.01.2024      | RH, Strike Price \$180.00 ±                      | 6.885            | 0,00                         |
| 38                                    | 19.01.2024      | RH, Strike Price \$195.00 ±                      | 12.730           | 0,00                         |
| 29                                    | 19.01.2024      | RH, Strike Price \$210.00 ±                      | 13.630           | 0,00                         |
| 19                                    | 19.01.2024      | RH, Strike Price \$220.00 ±                      | 10.925           | 0,00                         |
| 27                                    | 19.01.2024      | RH, Strike Price \$230.00 ±                      | 18.495           | 0,00                         |
| 25                                    | 19.01.2024      | RH, Strike Price \$250.00 ±                      | 25.750           | 0,00                         |
| 13                                    | 19.01.2024      | RH, Strike Price \$260.00 ±                      | 15.730           | 0,00                         |
| 18                                    | 19.01.2024      | RH, Strike Price \$280.00 ±                      | 31.050           | 0,00                         |
| 1.045                                 | 15.12.2023      | Rheinmetall AG, Strike Price EUR170.00 ±         | 342.029          | 0,02                         |
| 276                                   | 15.03.2024      | Rheinmetall AG, Strike Price EUR170.00 ±         | 176.454          | 0,01                         |
| 225                                   | 15.09.2023      | S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$4,150.00 ± | 309.375          | 0,02                         |
| 2                                     | 18.08.2023      | S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$4,220.00 ± | 1.850            | 0,00                         |
| 1                                     | 18.08.2023      | S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$4,225.00 ± | 938              | 0,00                         |
| 204                                   | 15.09.2023      | S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$4,325.00 ± | 499.800          | 0,02                         |
| 1                                     | 18.08.2023      | S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$4,450.00 ± | 2.875            | 0,00                         |
| 214                                   | 15.09.2023      | S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$4,450.00 ± | 847.975          | 0,04                         |
| 2.544                                 | 15.12.2023      | S&P 500 Index, Strike Price \$3,734.74 ∞         | 21.087           | 0,00                         |
| 24                                    | 21.07.2023      | S&P 500 Index, Strike Price \$3,750.00 ±         | 2.820            | 0,00                         |
| 10                                    | 21.07.2023      | S&P 500 Index, Strike Price \$4,000.00 ±         | 2.270            | 0,00                         |
| 240                                   | 15.09.2023      | Safran SA, Strike Price EUR90.00 ±               | 5.237            | 0,00                         |
| 322                                   | 15.12.2023      | Safran SA, Strike Price EUR90.00 ±               | 16.511           | 0,00                         |
| 1.080.000                             | 21.12.2023      | Sasol Ltd, Strike Price ZAR16,500.00 ∞           | 410.224          | 0,02                         |
| 772.380                               | 21.09.2023      | Sasol Ltd, Strike Price ZAR17,000.00 ∞           | 146.180          | 0,01                         |
| 1.440.000                             | 21.12.2023      | Sasol Ltd, Strike Price ZAR17,500.00 ∞           | 705.882          | 0,03                         |
| 1.820                                 | 15.12.2023      | Semtech Corp, Strike Price \$15.00 ±             | 104.650          | 0,01                         |
| 17                                    | 19.01.2024      | ServiceNow Inc, Strike Price \$310.00 ±          | 3.102            | 0,00                         |
| 14                                    | 19.01.2024      | ServiceNow Inc, Strike Price \$370.00 ±          | 6.650            | 0,00                         |
| 12                                    | 19.01.2024      | ServiceNow Inc, Strike Price \$440.00 ±          | 14.760           | 0,00                         |
| 37                                    | 19.01.2024      | Sherwin-Williams Co, Strike Price \$165.00 ±     | 4.162            | 0,00                         |
| 31                                    | 19.01.2024      | Sherwin-Williams Co, Strike Price \$200.00 ±     | 5.425            | 0,00                         |
| 26                                    | 19.01.2024      | Sherwin-Williams Co, Strike Price \$240.00 ±     | 18.850           | 0,00                         |
| 355                                   | 21.07.2023      | Shift4 Payments Inc, Strike Price \$40.00 ±      | 0                | 0,00                         |
| 541                                   | 21.07.2023      | Shift4 Payments Inc, Strike Price \$45.00 ±      | 2.705            | 0,00                         |
| 561                                   | 20.10.2023      | Shift4 Payments Inc, Strike Price \$45.00 ±      | 44.880           | 0,00                         |
| 11                                    | 21.07.2023      | Shift4 Payments Inc, Strike Price \$50.00 ±      | 99               | 0,00                         |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

**Verkaufte Optionskontrakte 10,74 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)**

| Anzahl Kontrakte/<br>Nominalwert      | Fällig-<br>keit | Art   | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---------------------------------------|-----------------|---|------------------|------------------------------|
| <b>Verkaufsoptionen (Fortsetzung)</b> |                 |   |                  |                              |
| 2.090                                 | 19.07.2024      | Shift4 Payments Inc, Strike Price \$67.88 <sup>∞</sup>                | 2.328.971        | 0,10                         |
| 2.055                                 | 15.12.2023      | Siemens Energy AG, Strike Price EUR12.00 <sup>±</sup>                 | 145.730          | 0,01                         |
| 15.805                                | 21.06.2024      | Siemens Energy AG, Strike Price EUR12.00 <sup>±</sup>                 | 1.724.325        | 0,08                         |
| 751                                   | 15.12.2023      | Siemens Energy AG, Strike Price EUR8.00 <sup>±</sup>                  | 15.567           | 0,00                         |
| 254.374                               | 11.01.2024      | SK Hynix Inc, Strike Price KRW70,560.00 <sup>∞</sup>                  | 69.939           | 0,00                         |
| 213                                   | 19.01.2024      | Skechers USA Inc, Strike Price \$35.00 <sup>±</sup>                   | 13.845           | 0,00                         |
| 141                                   | 19.01.2024      | Skechers USA Inc, Strike Price \$43.00 <sup>±</sup>                   | 21.503           | 0,00                         |
| 105                                   | 19.01.2024      | Skechers USA Inc, Strike Price \$50.00 <sup>±</sup>                   | 36.750           | 0,00                         |
| 52                                    | 19.01.2024      | Skyworks Solutions Inc, Strike Price \$100.00 <sup>±</sup>            | 26.260           | 0,00                         |
| 45                                    | 19.01.2024      | Skyworks Solutions Inc, Strike Price \$115.00 <sup>±</sup>            | 51.075           | 0,00                         |
| 63                                    | 19.01.2024      | Skyworks Solutions Inc, Strike Price \$82.50 <sup>±</sup>             | 10.710           | 0,00                         |
| 5.735                                 | 15.12.2023      | Société Générale SA, Strike Price EUR14.00 <sup>±</sup>               | 106.367          | 0,01                         |
| 2.450                                 | 19.01.2024      | Southern Co, Strike Price \$47.50 <sup>±</sup>                        | 67.375           | 0,00                         |
| 716                                   | 19.01.2024      | Southern Co, Strike Price \$50.00 <sup>±</sup>                        | 21.480           | 0,00                         |
| 334                                   | 15.12.2023      | Swiss Prime Site AG, Strike Price CHF52.00 <sup>±</sup>               | 13.067           | 0,00                         |
| 153                                   | 15.03.2024      | Swiss Prime Site AG, Strike Price CHF56.00 <sup>±</sup>               | 11.971           | 0,00                         |
| 1.600                                 | 15.12.2023      | Swiss Re AG, Strike Price CHF64.00 <sup>±</sup>                       | 119.823          | 0,01                         |
| 54                                    | 19.01.2024      | T Rowe Price Group Inc, Strike Price \$110.00 <sup>±</sup>            | 38.610           | 0,00                         |
| 74                                    | 19.01.2024      | T Rowe Price Group Inc, Strike Price \$80.00 <sup>±</sup>             | 8.695            | 0,00                         |
| 63                                    | 19.01.2024      | T Rowe Price Group Inc, Strike Price \$95.00 <sup>±</sup>             | 18.900           | 0,00                         |
| 79                                    | 19.01.2024      | Take-Two Interactive Software Inc, Strike Price \$100.00 <sup>±</sup> | 8.809            | 0,00                         |
| 40                                    | 19.01.2024      | Take-Two Interactive Software Inc, Strike Price \$115.00 <sup>±</sup> | 9.060            | 0,00                         |
| 55                                    | 19.01.2024      | Take-Two Interactive Software Inc, Strike Price \$120.00 <sup>±</sup> | 15.868           | 0,00                         |
| 30                                    | 19.01.2024      | Take-Two Interactive Software Inc, Strike Price \$135.00 <sup>±</sup> | 17.850           | 0,00                         |
| 42                                    | 19.01.2024      | Take-Two Interactive Software Inc, Strike Price \$140.00 <sup>±</sup> | 31.500           | 0,00                         |
| 92                                    | 19.01.2024      | Take-Two Interactive Software Inc, Strike Price \$75.00 <sup>±</sup>  | 2.622            | 0,00                         |
| 58                                    | 19.01.2024      | Take-Two Interactive Software Inc, Strike Price \$95.00 <sup>±</sup>  | 5.278            | 0,00                         |
| 385                                   | 19.01.2024      | Tanger Factory Outlet Centers Inc, Strike Price \$18.00 <sup>±</sup>  | 16.363           | 0,00                         |
| 258                                   | 19.01.2024      | Tanger Factory Outlet Centers Inc, Strike Price \$22.00 <sup>±</sup>  | 39.990           | 0,00                         |
| 163                                   | 19.01.2024      | Targa Resources Corp, Strike Price \$40.00 <sup>±</sup>               | 6.520            | 0,00                         |
| 224                                   | 19.01.2024      | Targa Resources Corp, Strike Price \$50.00 <sup>±</sup>               | 8.960            | 0,00                         |
| 175                                   | 19.01.2024      | Targa Resources Corp, Strike Price \$60.00 <sup>±</sup>               | 20.125           | 0,00                         |
| 141                                   | 19.01.2024      | Targa Resources Corp, Strike Price \$70.00 <sup>±</sup>               | 45.120           | 0,00                         |
| 144                                   | 19.01.2024      | Tenet Healthcare Corp, Strike Price \$40.00 <sup>±</sup>              | 6.120            | 0,00                         |
| 210                                   | 19.01.2024      | Tenet Healthcare Corp, Strike Price \$50.00 <sup>±</sup>              | 17.850           | 0,00                         |
| 164                                   | 19.01.2024      | Tenet Healthcare Corp, Strike Price \$60.00 <sup>±</sup>              | 28.290           | 0,00                         |
| 133                                   | 19.01.2024      | Tenet Healthcare Corp, Strike Price \$70.00 <sup>±</sup>              | 46.550           | 0,00                         |
| 46                                    | 19.01.2024      | Texas Instruments Inc, Strike Price \$125.00 <sup>±</sup>             | 4.094            | 0,00                         |
| 37                                    | 19.01.2024      | Texas Instruments Inc, Strike Price \$155.00 <sup>±</sup>             | 13.967           | 0,00                         |
| 32                                    | 19.01.2024      | Texas Instruments Inc, Strike Price \$180.00 <sup>±</sup>             | 36.160           | 0,00                         |
| 297                                   | 15.12.2023      | The Walt Disney Company, Strike Price \$4.00 <sup>±</sup>             | 19.454           | 0,00                         |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Verkaufte Optionskontrakte 10,74 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/<br>Nominalwert      | Fällig-<br>keit | Art  | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---------------------------------------|-----------------|--|------------------|------------------------------|
| <b>Verkaufsoptionen (Fortsetzung)</b> |                 |  |                  |                              |
| 24.243                                | 15.09.2023      | The Walt Disney Company, Strike Price \$5.00 <sup>±</sup>                                    | 1.151.542        | 0,05                         |
| 312.085                               | 21.06.2024      | T-Mobile US Inc, Strike Price \$122.07 <sup>∞</sup>  | 1.487.437        | 0,07                         |
| 36                                    | 19.01.2024      | Tractor Supply Co, Strike Price \$160.00 <sup>±</sup>  | 5.580            | 0,00                         |
| 29                                    | 19.01.2024      | Tractor Supply Co, Strike Price \$195.00 <sup>±</sup>  | 17.545           | 0,00                         |
| 25                                    | 19.01.2024      | Tractor Supply Co, Strike Price \$230.00 <sup>±</sup>  | 46.375           | 0,00                         |
| 15.400                                | 15.09.2023      | Ubisoft Entertainment SA, Strike Price EUR12.00 <sup>±</sup>                                 | 168.014          | 0,01                         |
| 260                                   | 15.09.2023      | Ubisoft Entertainment SA, Strike Price EUR14.00 <sup>±</sup>                                 | 4.822            | 0,00                         |
| 10.370                                | 15.03.2024      | UBS Group AG, Strike Price CHF12.00 <sup>±</sup>   | 231.823          | 0,01                         |
| 10                                    | 15.09.2023      | Ulta Beauty Inc, Strike Price \$360.00 <sup>±</sup>  | 1.675            | 0,00                         |
| 12                                    | 19.01.2024      | Ulta Beauty Inc, Strike Price \$360.00 <sup>±</sup>  | 8.100            | 0,00                         |
| 16                                    | 19.01.2024      | Ulta Beauty Inc, Strike Price \$380.00 <sup>±</sup>  | 14.880           | 0,00                         |
| 8                                     | 15.09.2023      | Ulta Beauty Inc, Strike Price \$440.00 <sup>±</sup>  | 8.680            | 0,00                         |
| 9                                     | 19.01.2024      | Ulta Beauty Inc, Strike Price \$440.00 <sup>±</sup>  | 19.935           | 0,00                         |
| 13                                    | 19.01.2024      | Ulta Beauty Inc, Strike Price \$460.00 <sup>±</sup>  | 37.700           | 0,00                         |
| 7                                     | 15.09.2023      | Ulta Beauty Inc, Strike Price \$515.00 <sup>±</sup>  | 34.195           | 0,00                         |
| 8                                     | 19.01.2024      | Ulta Beauty Inc, Strike Price \$520.00 <sup>±</sup>  | 48.360           | 0,00                         |
| 11                                    | 19.01.2024      | Ulta Beauty Inc, Strike Price \$540.00 <sup>±</sup>  | 82.335           | 0,01                         |
| 855                                   | 21.06.2024      | UniCredit SpA, Strike Price EUR7.20 <sup>±</sup>   | 55.455           | 0,00                         |
| 1.235                                 | 15.09.2023      | UniCredit SpA, Strike Price EUR8.20 <sup>±</sup>   | 34.224           | 0,00                         |
| 1.240                                 | 15.09.2023      | UniCredit SpA, Strike Price EUR8.40 <sup>±</sup>   | 34.971           | 0,00                         |
| 666.400 USD                           | 07.03.2024      | United States Dollar/Chinese Yuan Renminbi Currency Option, Strike Price \$6.00 <sup>∞</sup> | 1.715            | 0,00                         |
| 56.000.000 USD                        | 06.07.2023      | United States Dollar/Japanese Yen Currency Option, Strike Price \$116.00 <sup>∞</sup>        | 0                | 0,00                         |
| 439                                   | 19.01.2024      | United States Steel Corp, Strike Price \$13.00 <sup>±</sup>                                  | 6.585            | 0,00                         |
| 306                                   | 19.01.2024      | United States Steel Corp, Strike Price \$15.00 <sup>±</sup>                                  | 8.874            | 0,00                         |
| 213                                   | 19.01.2024      | United States Steel Corp, Strike Price \$18.00 <sup>±</sup>                                  | 13.313           | 0,00                         |
| 143                                   | 19.01.2024      | United States Steel Corp, Strike Price \$22.00 <sup>±</sup>                                  | 22.094           | 0,00                         |
| 50                                    | 19.01.2024      | Valero Energy Corp, Strike Price \$110.00 <sup>±</sup>                                       | 38.250           | 0,00                         |
| 92                                    | 19.01.2024      | Valero Energy Corp, Strike Price \$80.00 <sup>±</sup>  | 12.926           | 0,00                         |
| 66                                    | 19.01.2024      | Valero Energy Corp, Strike Price \$95.00 <sup>±</sup>  | 22.770           | 0,00                         |
| 14.333                                | 21.07.2023      | Virgin Galactic Holdings Inc, Strike Price \$3.00 <sup>±</sup>                               | 150.496          | 0,01                         |
| 4.252                                 | 21.07.2023      | Vishay Intertechnology Inc, Strike Price \$15.00 <sup>±</sup>                                | 0                | 0,00                         |
| 3.200                                 | 20.09.2023      | VIX Index, Strike Price \$15.00 <sup>±</sup>   | 259.200          | 0,01                         |
| 47                                    | 19.01.2024      | Walmart Inc, Strike Price \$100.00 <sup>±</sup>  | 1.269            | 0,00                         |
| 38                                    | 19.01.2024      | Walmart Inc, Strike Price \$125.00 <sup>±</sup>  | 3.724            | 0,00                         |
| 32                                    | 19.01.2024      | Walmart Inc, Strike Price \$145.00 <sup>±</sup>  | 9.488            | 0,00                         |
| 591                                   | 18.08.2023      | Wayfair Inc, Strike Price \$25.00 <sup>±</sup>   | 6.796            | 0,00                         |
| 118                                   | 15.09.2023      | Wells Fargo & Co, Strike Price \$32.50 <sup>±</sup>  | 2.124            | 0,00                         |
| 96                                    | 15.09.2023      | Wells Fargo & Co, Strike Price \$40.00 <sup>±</sup>  | 9.264            | 0,00                         |
| 81                                    | 15.09.2023      | Wells Fargo & Co, Strike Price \$47.50 <sup>±</sup>  | 41.310           | 0,00                         |
| 141                                   | 19.01.2024      | Winnebago Industries Inc, Strike Price \$40.00 <sup>±</sup>                                  | 7.755            | 0,00                         |
| 113                                   | 19.01.2024      | Winnebago Industries Inc, Strike Price \$50.00 <sup>±</sup>                                  | 16.667           | 0,00                         |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Verkaufte Optionskontrakte 10,74 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/<br>Nominalwert   | Fällig-<br>keit | Art  | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|-----------------|--|--------------------|------------------------------|
| <b>Verkaufsoptionen (Fortsetzung)</b>  |                 |  |                    |                              |
| 94   | 19.01.2024      | Winnebago Industries Inc, Strike Price \$60.00 ± | 34.310             | 0,00                         |
| 400  | 15.12.2023      | Wolfspeed Inc, Strike Price \$35.00 ±            | 65.000             | 0,00                         |
| 50   | 19.01.2024      | Wyndham Worldwide Corp, Strike Price \$105.00 ±  | 48.000             | 0,00                         |
| 46   | 19.01.2024      | Wyndham Worldwide Corp, Strike Price \$110.00 ±  | 55.660             | 0,00                         |
| 97   | 19.01.2024      | Wyndham Worldwide Corp, Strike Price \$75.00 ±   | 18.139             | 0,00                         |
| 65   | 19.01.2024      | Wyndham Worldwide Corp, Strike Price \$77.50 ±   | 14.105             | 0,00                         |
| 66   | 19.01.2024      | Wyndham Worldwide Corp, Strike Price \$90.00 ±   | 29.535             | 0,00                         |
| 55   | 19.01.2024      | Wyndham Worldwide Corp, Strike Price \$92.50 ±   | 28.187             | 0,00                         |
| 4.400.000  | 15.12.2023      | Xiaomi Corp, Strike Price HKD7.70 ∞              | 81.989             | 0,01                         |
| 2.631.751  | 15.12.2023      | Xiaomi Corp, Strike Price HKD8.30 ∞              | 74.915             | 0,01                         |
| 2.131  | 18.08.2023      | Zillow Group Inc, Strike Price \$25.00 ±         | 20.244             | 0,00                         |
| 25   | 20.10.2023      | ZTO Express Cayman Inc, Strike Price \$15.64 ±   | 0                  | 0,00                         |
| 612  | 19.01.2024      | ZTO Express Cayman Inc, Strike Price \$19.40 ±   | 41.310             | 0,00                         |
| 3.440  | 21.07.2023      | ZTO Express Cayman Inc, Strike Price \$19.64 ±   | 0                  | 0,00                         |
| 1.100  | 19.01.2024      | ZTO Express Cayman Inc, Strike Price \$21.00 ±   | 134.750            | 0,01                         |
| 623  | 15.09.2023      | Zur Rose Group AG, Strike Price CHF22.00 ±       | 2.124              | 0,00                         |
| 2.570  | 15.09.2023      | Zur Rose Group AG, Strike Price CHF24.00 ±       | 10.916             | 0,00                         |
| <b>Beizulegender Zeitwert aus gekauften Optionskontrakten insgesamt (Prämie: (362.191.363) US\$)</b> |                 |  | <b>245.025.318</b> | <b>10,74</b>                 |

Die Gegenparteien von OTC-Optionskontrakten sind BNP Paribas, Daiwa, Goldman Sachs International, JPMorgan Chase Bank, Merrill Lynch, Morgan Stanley, Nomura International, SMBC Nikko Capital Markets Ltd und UBS AG.

### Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %)

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung    | Gegenpartei                 | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|-----------|--------------------------|-----------------------------|--------------------------------------|------------------------------|
| (7.200)   | 10X Genomics Inc Class A | Morgan Stanley              | 0                                    | 0,00                         |
| (38.300)  | 3D Systems Corp          | Morgan Stanley              | 0                                    | 0,00                         |
| 58.284    | 3i Group Plc             | BofA Securities             | 0                                    | 0,00                         |
| (52.349)  | 3M Co                    | Morgan Stanley              | 0                                    | 0,00                         |
| 1.205     | 4imprint Group Plc       | BofA Securities             | 0                                    | 0,00                         |
| (10.678)  | 89bio Inc                | JPMorgan Chase Bank         | 3                                    | 0,00                         |
| 31.391    | A10 Networks Inc         | Morgan Stanley              | 0                                    | 0,00                         |
| 10.957    | AAON Inc                 | Morgan Stanley              | 0                                    | 0,00                         |
| (800)     | AAR Corp                 | Morgan Stanley              | 0                                    | 0,00                         |
| (3.399)   | Abbott Laboratories      | Morgan Stanley              | 0                                    | 0,00                         |
| 176.676   | Abbott Laboratories      | Goldman Sachs International | 388                                  | 0,00                         |
| (370.624) | AbbVie Inc               | Goldman Sachs International | 17.830                               | 0,00                         |
| 154.866   | AbbVie Inc               | Morgan Stanley              | 274                                  | 0,00                         |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung          | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|--------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 874.750   | AbbVie Inc                     | JPMorgan Chase Bank         | 79.859                         | 0,00                 |
| (224.064) | AbCellera Biologics Inc        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 4.009     | Abercrombie & Fitch Co Class A | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 13.383    | ABM Industries Inc             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 160.083   | abrdn Plc                      | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (8.404)   | Academy Sports & Outdoors Inc  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (936.620) | Acadia Healthcare Co Inc       | Goldman Sachs International | 116.762                        | 0,01                 |
| (5.601)   | Acadia Healthcare Co Inc       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 17.286    | Acadia Realty Trust            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 254.443   | Accelleron Industries AG       | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 7.900     | Accenture Plc Class A          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 20.306    | Accolade Inc                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 3.800.000 | Accor SA                       | Société Générale            | 288.718                        | 0,01                 |
| (173.829) | ACELYRIN Inc                   | JPMorgan Chase Bank         | 14.923                         | 0,00                 |
| (343.620) | ACELYRIN Inc                   | Morgan Stanley              | 13.267                         | 0,00                 |
| 22.381    | ACI Worldwide Inc              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (166.390) | ACM Research Inc               | Goldman Sachs International | 9.388                          | 0,00                 |
| (61.800)  | Acom Co Ltd                    | BofA Securities             | 540                            | 0,00                 |
| (308.529) | Activision Blizzard Inc        | Goldman Sachs International | 24.671                         | 0,00                 |
| (227.600) | Activision Blizzard Inc        | JPMorgan Chase Bank         | 9.971                          | 0,00                 |
| (94.346)  | Activision Blizzard Inc        | Morgan Stanley              | 2.365                          | 0,00                 |
| 1.794     | Acuity Brands Inc              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (22.600)  | Acushnet Holdings Corp         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (4.729)   | ACV Auctions Inc Class A       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 16.200    | AdaptHealth Corp               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (16.816)  | Adaptive Biotechnologies Corp  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 2.796     | Addus HomeCare Corp            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (46.752)  | Adecco Group AG                | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 30.988    | Adecoagro SA                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (31.236)  | Adeia Inc                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 30.339    | Adient Plc                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 13.302    | Admiral Group Plc              | BofA Securities             | 14                             | 0,00                 |
| (40.813)  | Adobe Inc                      | JPMorgan Chase Bank         | 178                            | 0,00                 |
| (175.860) | Adobe Inc                      | Morgan Stanley              | 3.864                          | 0,00                 |
| 44.282    | ADT Inc                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 19.892    | Adtalem Global Education Inc   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (12.700)  | ADTRAN Holdings Inc            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 1.043.393 | Advance Auto Parts Inc         | Morgan Stanley              | 277.217                        | 0,01                 |
| (11.100)  | Advanced Drainage Systems Inc  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (7.229)   | Advanced Energy Industries Inc | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (145.932) | Advanced Micro Devices Inc     | Morgan Stanley              | 47.299                         | 0,00                 |
| 2.040.717 | Advanced Micro Devices Inc     | Goldman Sachs International | 110.747                        | 0,01                 |
| (3.014)   | AdvanSix Inc                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung               | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|-------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 5.900     | Aehr Test Systems                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 5.300     | AEON Financial Service Co Ltd       | BofA Securities             | 699                            | 0,00                 |
| 2.300     | Aeon Mall Co Ltd                    | BofA Securities             | 576                            | 0,00                 |
| 31.993    | AerCap Holdings NV                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 5.500     | AES Corp                            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 1.700     | Affiliated Managers Group Inc       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (13.138)  | Affirm Holdings Inc                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (33.995)  | Aflac Inc                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (12.164)  | AGCO Corp                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 8.982     | Agilent Technologies Inc            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (16.811)  | agilon health Inc                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 8.031     | Agilysys Inc                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (115.709) | AGNC Investment Corp                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (3.699)   | Agree Realty Corp                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (707.396) | Air France-KLM                      | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 3.189     | Air Lease Corp                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 44.877    | Air Liquide SA                      | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (701)     | Air Products & Chemicals Inc        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 14.082    | Air Transport Services Group Inc    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (6.396)   | Airbnb Inc Class A                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 42.118    | Airbus SE                           | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (23.512)  | AJ Bell Plc                         | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (500)     | Ajinomoto Co Inc                    | BofA Securities             | 483                            | 0,00                 |
| (363.820) | Akero Therapeutics Inc              | Goldman Sachs International | 68.956                         | 0,00                 |
| 117.067   | Akzo Nobel NV                       | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 5.200     | Alamo Group Inc                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 8.700     | Alarm.com Holdings Inc              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 6.905     | Alaska Air Group Inc                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (203)     | Albany International Corp Class A   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 157.606   | Albemarle Corp                      | Goldman Sachs International | 144                            | 0,00                 |
| (6.878)   | Albemarle Corp                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (46.400)  | Albertsons Cos Inc Class A          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 4.786     | Alcoa Corp                          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (145.621) | Alcon Inc                           | JPMorgan Chase Bank         | 863                            | 0,00                 |
| (80.769)  | Alcon Inc                           | Goldman Sachs International | 1.396                          | 0,00                 |
| (106.600) | Alcon Inc                           | Morgan Stanley              | 4.115                          | 0,00                 |
| (3.199)   | Alexandria Real Estate Equities Inc | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 1.500     | Alfresa Holdings Corp               | BofA Securities             | 46                             | 0,00                 |
| (40.018)  | Alight Inc Class A                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (34.800)  | Alignment Healthcare Inc            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (925.514) | Alkermes Plc                        | Goldman Sachs International | 69.720                         | 0,00                 |
| (237.986) | Alkermes Plc                        | JPMorgan Chase Bank         | 6.627                          | 0,00                 |
| (985.589) | Alkermes Plc                        | Morgan Stanley              | 75.183                         | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung                      | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|--|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 6.793       | Allegiant Travel Co                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 20.330      | Allegion Plc                               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 27.121      | Allegro MicroSystems Inc                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 10.506      | ALLETE Inc                                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (26.676)    | AllianceBernstein Holding LP               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 3.234.616   | Alliant Energy Corp                        | Nomura                      | 42.547                         | 0,00                 |
| (4.100)     | Alliant Energy Corp                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 16.667      | Allison Transmission Holdings Inc          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 322         | Allstate Corp                              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 44.936      | Ally Financial Inc                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (79.428)    | Alnylam Pharmaceuticals Inc                | Nomura                      | 157.881                        | 0,01                 |
| 617.506     | Alnylam Pharmaceuticals Inc                | JPMorgan Chase Bank         | 14.977                         | 0,00                 |
| (1.692)     | Alpha Metallurgical Resources Inc          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (45.405)    | Alpha Services and Holdings SA             | Morgan Stanley              | 1.252                          | 0,00                 |
| 341.820     | Alphabet Inc Class A                       | Goldman Sachs International | 5.306                          | 0,00                 |
| 128.580     | Alphabet Inc Class A                       | Morgan Stanley              | 2.252                          | 0,00                 |
| (404.910)   | Alphabet Inc Class C                       | Morgan Stanley              | 55.055                         | 0,00                 |
| 41.200      | Alphatec Holdings Inc                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (51.436)    | Alstom SA                                  | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (692)       | Altair Engineering Inc Class A             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (4.300)     | Alteryx Inc Class A                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 49.600      | Altus Power Inc                            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (3.331.554) | Amazon.com Inc                             | Morgan Stanley              | 680.546                        | 0,03                 |
| (43.508)    | Amazon.com Inc                             | Goldman Sachs International | 863                            | 0,00                 |
| (115.865)   | Amazon.com Inc                             | JPMorgan Chase Bank         | 430                            | 0,00                 |
| (4.605)     | Ambarella Inc                              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (9.417)     | Amcor Plc                                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (10.300)    | Amdocs Ltd                                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (4.804)     | Amedisys Inc                               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 11.100      | Ameren Corp                                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 7.576       | Ameresco Inc Class A                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (47.200)    | American Airlines Group Inc                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (4.000)     | American Assets Trust Inc                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 7.237       | American Axle & Manufacturing Holdings Inc | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 13.205      | American Eagle Outfitters Inc              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 5.005       | American Electric Power Co Inc             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (18.004)    | American Equity Investment Life Holding Co | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 90          | American Express Co                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (7.795)     | American Financial Group Inc               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (25.701)    | American Homes 4 Rent Class A              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 9.519       | American International Group Inc           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (6.800)     | American States Water Co                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (3.602)     | American Tower Corp                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile       | Wertpapierbezeichnung         | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------|-------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (1.798)       | American Water Works Co Inc   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 4.689         | American Woodmark Corp        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (17.900)      | Americold Realty Trust Inc    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.497)       | Ameriprise Financial Inc      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 6.213         | Ameris Bancorp                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (9.800)       | AMERISAFE Inc                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (61.996)      | AmerisourceBergen Corp        | JPMorgan Chase Bank         | 5.770                          | 0,00                 |
| (133.472)     | AmerisourceBergen Corp        | Morgan Stanley              | 13.468                         | 0,00                 |
| (2.022.439)   | AmerisourceBergen Corp        | Goldman Sachs International | 234.903                        | 0,01                 |
| 52.870        | AMETEK Inc                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 983.245       | Amgen Inc                     | JPMorgan Chase Bank         | 30.428                         | 0,00                 |
| 279.507       | Amgen Inc                     | Goldman Sachs International | 4.780                          | 0,00                 |
| 43.197        | Amgen Inc                     | Morgan Stanley              | 1.424                          | 0,00                 |
| 16.415        | Amicus Therapeutics Inc       | Goldman Sachs International | 23                             | 0,00                 |
| (11.727)      | Amkor Technology Inc          | Goldman Sachs International | 4.431                          | 0,00                 |
| (95.408)      | Amkor Technology Inc          | JPMorgan Chase Bank         | 17.724                         | 0,00                 |
| (416.624)     | Amkor Technology Inc          | Morgan Stanley              | 164.366                        | 0,01                 |
| 9.000         | AMN Healthcare Services Inc   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 5.562         | Amphastar Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (113.562)     | Amphenol Corp Class A         | JPMorgan Chase Bank         | 1.114                          | 0,00                 |
| 12.500        | Amphenol Corp Class A         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (14.175)      | Amplitude Inc Class A         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 3.493.555     | ams AG                        | Société Générale            | 205.373                        | 0,01                 |
| (3.613.941)   | ams AG                        | Goldman Sachs International | 707.340                        | 0,03                 |
| 33.000.000    | ams-OSRAM AG                  | Société Générale            | 9.137                          | 0,00                 |
| 23.707        | Amylyx Pharmaceuticals Inc    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 7.000         | ANA Holdings Inc              | BofA Securities             | 4.440                          | 0,00                 |
| 4.210.000.000 | ANA Holdings Inc              | Société Générale            | 10.103                         | 0,00                 |
| (374.116)     | Analog Devices Inc            | Morgan Stanley              | 17.536                         | 0,00                 |
| (22.642)      | Analog Devices Inc            | Goldman Sachs International | 616                            | 0,00                 |
| (13.800)      | Andersons Inc                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (30.177)      | Andritz AG                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (54.228)      | Anglo American Plc            | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 3.058         | Anglo American Plc            | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 394.710       | Anheuser-Busch InBev SA       | JPMorgan Chase Bank         | 14.254                         | 0,00                 |
| (75.815)      | Annaly Capital Management Inc | Morgan Stanley              | 14.190                         | 0,00                 |
| (2.397)       | ANSYS Inc                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 57.100        | Antero Midstream Corp         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (693.840)     | Antero Resources Corp         | JPMorgan Chase Bank         | 28.369                         | 0,00                 |
| 7.200         | Antero Resources Corp         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (28.310)      | Antofagasta Plc               | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 7.399         | AO Smith Corp                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 3.718         | Aon Plc Class A               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |



## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung                        | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|--|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 100       | Aozora Bank Ltd                              | BofA Securities             | 37                             | 0,00                 |
| (3.355)   | AP Moller - Maersk A/S Class B               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (816.301) | APA Corp                                     | JPMorgan Chase Bank         | 31.989                         | 0,00                 |
| 236.813   | APA Corp                                     | Goldman Sachs International | 1.638                          | 0,00                 |
| 11.343    | APA Corp                                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 3.272     | Apartment Income REIT Corp                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (2)       | Apartment Investment & Management Co Class A | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (15.785)  | API Group Corp                               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 120       | Apogee Enterprises Inc                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (14.601)  | Apollo Commercial Real Estate Finance Inc    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 4.787     | Apollo Global Management Inc                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (2.601)   | Apollo Medical Holdings Inc                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (902.000) | Apollo Strategic Growth Capital II           | Goldman Sachs International | 31.000                         | 0,00                 |
| (2.911)   | Appfolio, Inc - Class A                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.194)   | Appian Corp Class A                          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (27.500)  | Apple Hospitality REIT Inc                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (331.637) | Apple Inc                                    | Morgan Stanley              | 78.810                         | 0,00                 |
| (86.112)  | Apple Inc                                    | JPMorgan Chase Bank         | 918                            | 0,00                 |
| 2.619     | Applied Industrial Technologies Inc          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (97.784)  | Applied Materials Inc                        | Morgan Stanley              | 3.986                          | 0,00                 |
| (33.711)  | AppLovin Corp Class A                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 5.100     | AptarGroup Inc                               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 42.973    | Aptiv Plc                                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (933.606) | Aptiv Plc                                    | JPMorgan Chase Bank         | 69.814                         | 0,00                 |
| (49.800)  | Aramark                                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 700       | Arbor Realty Trust Inc                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (8.905)   | ArcBest Corp                                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 152.418   | Arcellx Inc                                  | Goldman Sachs International | 30.918                         | 0,00                 |
| 145.227   | Arcellx Inc                                  | Morgan Stanley              | 32.362                         | 0,00                 |
| 223.018   | Arcellx Inc                                  | JPMorgan Chase Bank         | 60.426                         | 0,00                 |
| (62.954)  | ArcelorMittal SA                             | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (3.634)   | Arch Capital Group Ltd                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (3.807)   | Arch Resources Inc                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 5.408     | Archer-Daniels-Midland Co                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 7.596     | Archrock Inc                                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (19.345)  | Arconic Corp                                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (8.500)   | Arcos Dorados Holdings Inc Class A           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 8.702     | Arcosa Inc                                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (4.207)   | Ares Management Corp Class A                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (580.350) | Argenx SE                                    | Morgan Stanley              | 31.511                         | 0,00                 |
| 55.899    | Arista Networks Inc                          | Goldman Sachs International | 333                            | 0,00                 |
| (808)     | Arista Networks Inc                          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 6.553     | Armstrong World Industries Inc               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung                         | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|---|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 47.100    | Array Technologies Inc                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 1.396     | Arrow Electronics Inc                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 145.934   | Arrowhead Pharmaceuticals Inc                 | JPMorgan Chase Bank         | 2.546                          | 0,00                 |
| 69.074    | Arrowhead Pharmaceuticals Inc                 | Goldman Sachs International | 170                            | 0,00                 |
| (7.618)   | Arthur J Gallagher & Co                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 11.601    | Artisan Partners Asset Management Inc Class A | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (11.600)  | Arvinas Inc                                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 500       | Asahi Group Holdings Ltd                      | BofA Securities             | 83                             | 0,00                 |
| 500       | Asahi Intecc Co Ltd                           | BofA Securities             | 166                            | 0,00                 |
| 395       | Asana Inc Class A                             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (2.287)   | Asbury Automotive Group Inc                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (62.368)  | Ascential Plc                                 | BofA Securities             | 14                             | 0,00                 |
| (3.890)   | ASGN Inc                                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (24.105)  | Ashland Inc                                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 39.923    | Ashmore Group Plc                             | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 1.296     | Ashtead Group Plc                             | BofA Securities             | 15.143                         | 0,00                 |
| 109.516   | ASML Holding NV                               | Goldman Sachs International | 76                             | 0,00                 |
| 22.166    | ASOS Plc                                      | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (5.936)   | Aspen Technology Inc                          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (126.097) | Assa Abloy AB Class B                         | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 13.904    | Associated Banc-Corp                          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (6.553)   | Associated British Foods Plc                  | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 203.921   | Assura Plc                                    | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (4.202)   | Assurant Inc                                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 14.500    | Assured Guaranty Ltd                          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (445.811) | AstraZeneca Plc                               | JPMorgan Chase Bank         | 7.672                          | 0,00                 |
| (4.060)   | AstraZeneca Plc                               | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 80.072    | AT&T Inc                                      | Morgan Stanley              | 4.396                          | 0,00                 |
| 225       | Athena Pubco BV                               | Goldman Sachs International | 47                             | 0,00                 |
| (15.100)  | ATI Inc                                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 1.899     | Atkore Inc                                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (14.203)  | Atlantic Union Bankshares Corp                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 16.205    | Atlantica Sustainable Infrastructure Plc      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (214.149) | Atlassian Corp Class A                        | Morgan Stanley              | 40.408                         | 0,00                 |
| (809)     | Atmos Energy Corp                             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 1.993     | AtriCure Inc                                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (4.796)   | Auction Technology Group Plc                  | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (34.513)  | Auto Trader Group Plc                         | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (7.000)   | Autobacs Seven Co Ltd                         | BofA Securities             | 30                             | 0,00                 |
| (43.198)  | Autodesk Inc                                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 27.499    | Autodesk Inc                                  | Goldman Sachs International | 215                            | 0,00                 |
| 73.016    | Autohome Inc                                  | Goldman Sachs International | 4.503                          | 0,00                 |
| 57.856    | Autoliv Inc                                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung                  | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|--|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (3.002)   | Automatic Data Processing Inc          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (5.494)   | AutoNation Inc                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 1.102     | AutoZone Inc                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 500       | AvalonBay Communities Inc              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 41.824    | Avangrid Inc                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (8.600)   | Avanos Medical Inc                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 4.880     | Avantax Inc                            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 43.473    | Avantor Inc                            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (4.321)   | Avery Dennison Corp                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 2.200     | Avid Technology Inc                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.081)   | AvidXchange Holdings Inc               | Morgan Stanley              | 64                             | 0,00                 |
| (6.611)   | Avient Corp                            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (3.800)   | Avis Budget Group Inc                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 6.542     | Avista Corp                            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (33.443)  | Aviva Plc                              | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (137.632) | Avnet Inc                              | JPMorgan Chase Bank         | 10.817                         | 0,00                 |
| (14.702)  | Avnet Inc                              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 7.815     | Axalta Coating Systems Ltd             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 1.400     | Axcelis Technologies Inc               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 9.915     | Axis Capital Holdings Ltd              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 376.831   | Axon Enterprise Inc                    | Goldman Sachs International | 3.733                          | 0,00                 |
| 16.201    | Axonics Inc                            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 8.589     | Axos Financial Inc                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 91.202    | Axsome Therapeutics Inc                | Morgan Stanley              | 3.453                          | 0,00                 |
| 62.896    | Axsome Therapeutics Inc                | JPMorgan Chase Bank         | 2.665                          | 0,00                 |
| (2.600)   | Azbil Corp                             | BofA Securities             | 126                            | 0,00                 |
| 26.841    | AZEK Co Inc                            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (14.709)  | Azenta Inc                             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (19.300)  | B Riley Financial Inc                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (34.200)  | B&G Foods Inc                          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (52.570)  | B&M European Value Retail SA           | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (41.460)  | Babcock International Group Plc        | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (396)     | Badger Meter Inc                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (76.227)  | Baidu Inc                              | Goldman Sachs International | 6.542                          | 0,00                 |
| (2.172)   | Baidu Inc                              | JPMorgan Chase Bank         | 3                              | 0,00                 |
| (303.965) | Baker Hughes Co                        | JPMorgan Chase Bank         | 10.461                         | 0,00                 |
| (241)     | Baker Hughes Co                        | Goldman Sachs International | 4                              | 0,00                 |
| (230.903) | Baker Hughes Co                        | Morgan Stanley              | 6.691                          | 0,00                 |
| 56.496    | Balanced Commercial Property Trust Ltd | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 625       | Balchem Corp                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (37.297)  | Ball Corp                              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (25.127)  | Bally's Corp                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 43.771    | Banc of California Inc                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile      | Wertpapierbezeichnung              | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------|------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (809)        | BancFirst Corp                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 12.800.000   | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA | Société Générale            | 997.449                        | 0,05                 |
| 8.400.000    | Banco BPM SpA                      | Société Générale            | 287.701                        | 0,01                 |
| 11.900       | Bancorp Inc                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 500          | Bandai Namco Holdings Inc          | BofA Securities             | 82                             | 0,00                 |
| 70.807       | Bank of America Corp               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (4.810)      | Bank of Georgia Group Plc          | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (6.172)      | Bank of Hawaii Corp                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (3.300)      | Bank of Kyoto Ltd                  | BofA Securities             | 944                            | 0,00                 |
| 39.399       | Bank of New York Mellon Corp       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 15.100       | Bank of NT Butterfield & Son Ltd   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (21.800)     | Bank OZK                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (791.371)    | Bank Pekao SA                      | Goldman Sachs International | 19.907                         | 0,00                 |
| (1.668.066)  | Bank Pekao SA                      | Morgan Stanley              | 60.080                         | 0,00                 |
| 28.465       | BankUnited Inc                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 2.003        | Banner Corp                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 142.970      | Barclays Plc                       | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 14.097       | Barnes Group Inc                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 10.801       | Barratt Developments Plc           | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (11.116.000) | Barrick Gold Corp                  | Goldman Sachs International | 35.000                         | 0,00                 |
| (124.857)    | BASF SE                            | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (94.890)     | Bath & Body Works Inc              | Goldman Sachs International | 1.434                          | 0,00                 |
| (42.535)     | Bausch + Lomb Corp                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (204.100)    | Bausch Health Cos Inc              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (125.646)    | Baxter International Inc           | JPMorgan Chase Bank         | 726                            | 0,00                 |
| (180.800)    | Baxter International Inc           | Morgan Stanley              | 2.172                          | 0,00                 |
| (1.485.397)  | Baxter International Inc           | Goldman Sachs International | 77.590                         | 0,00                 |
| (300)        | BayCurrent Consulting Inc          | BofA Securities             | 155                            | 0,00                 |
| 49.877       | Bayerische Motoren Werke AG        | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (219.057)    | Baytex Energy Corp                 | Morgan Stanley              | 23.399                         | 0,00                 |
| 444          | Beacon Roofing Supply Inc          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 67.281       | Beam Therapeutics Inc              | Goldman Sachs International | 2.297                          | 0,00                 |
| 294.177      | Beam Therapeutics Inc              | JPMorgan Chase Bank         | 15.158                         | 0,00                 |
| (24.485)     | Beauty Health Co                   | JPMorgan Chase Bank         | 1.642                          | 0,00                 |
| (20.400)     | Beauty Health Co                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 60.826       | Beazley Plc                        | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (257.176)    | Becton Dickinson & Co              | Goldman Sachs International | 13.987                         | 0,00                 |
| (90.475)     | Becton Dickinson & Co              | JPMorgan Chase Bank         | 2.631                          | 0,00                 |
| (1.799.448)  | Becton Dickinson & Co              | Morgan Stanley              | 73.972                         | 0,00                 |
| (3.004)      | Becton Dickinson and Co            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (110.697)    | Beijer Ref AB                      | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 10.501       | Belden Inc                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.163.151)  | BellRing Brands Inc                | Goldman Sachs International | 199.831                        | 0,01                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung                 | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|---------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (413)       | BellRing Brands Inc                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 6.768       | Bellway Plc                           | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (6.123)     | Benchmark Electronics Inc             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (10.500)    | Bentley Systems Inc Class B           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (24.732)    | Berkeley Group Holdings Plc           | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (901)       | Berkshire Hathaway Inc Class B        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 20.730      | Berkshire Hills Bancorp Inc           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 7.913       | Berry Global Group Inc                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 490.532     | Best Buy Co Inc                       | Goldman Sachs International | 5.740                          | 0,00                 |
| (7.200)     | Beyond Meat Inc                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (117.767)   | BHP Group Ltd                         | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (3.610.509) | Bidvest Group Ltd                     | Goldman Sachs International | 4.541                          | 0,00                 |
| (2.707.584) | Bidvest Group Ltd                     | JPMorgan Chase Bank         | 930                            | 0,00                 |
| (9.438)     | Big Yellow Group Plc                  | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 2.590       | BILL Holdings Inc                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (116.440)   | Billerud AB                           | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 5.319       | BioCryst Pharmaceuticals Inc          | Morgan Stanley              | 934                            | 0,00                 |
| 21.987      | BioCryst Pharmaceuticals Inc          | Goldman Sachs International | 4.151                          | 0,00                 |
| (400.497)   | Biogen Inc                            | Morgan Stanley              | 16.195                         | 0,00                 |
| 104.018     | Biogen Inc                            | Goldman Sachs International | 8.076                          | 0,00                 |
| (15.403)    | BioLife Solutions Inc                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (2.700)     | Bio-Rad Laboratories Inc Class A      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (5.500)     | Bio-Techne Corp                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 1.499.721   | BJ's Wholesale Club Holdings Inc      | JPMorgan Chase Bank         | 92.900                         | 0,01                 |
| (19.268)    | BJ's Wholesale Club Holdings Inc      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 9.294       | Black Hills Corp                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (47.900)    | Black Stone Minerals LP               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 3.798       | Blackbaud Inc                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 13.300      | Blackline Inc                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 3.000       | BlackRock Inc                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (466.201)   | Blackstone Inc                        | JPMorgan Chase Bank         | 16.274                         | 0,00                 |
| (569.395)   | Blackstone Inc                        | Morgan Stanley              | 23.098                         | 0,00                 |
| (44.600)    | Blackstone Mortgage Trust Inc Class A | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 1.200       | Blackstone Secured Lending Fund       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (104.749)   | Block Inc                             | JPMorgan Chase Bank         | 2.720                          | 0,00                 |
| (38.058)    | Block Inc                             | Morgan Stanley              | 1.999                          | 0,00                 |
| (14.145)    | Block Inc                             | Goldman Sachs International | 477                            | 0,00                 |
| (693)       | Bloomin' Brands Inc                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (61.220)    | Blue Owl Capital Inc                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 1.400       | BlueLinX Holdings Inc                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (900)       | BML Inc                               | BofA Securities             | 2.038                          | 0,00                 |
| 17.727      | Bodycote Plc                          | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (20.636)    | Boeing Co                             | Morgan Stanley              | 15                             | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung                | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|--------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (1.617.757) | Boeing Co                            | JPMorgan Chase Bank         | 21.071                         | 0,00                 |
| (3.807)     | Boise Cascade Co                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 5.712       | BOK Financial Corp                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (34.047)    | Boliden AB                           | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 381.580     | boohoo Group Plc                     | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (577.962)   | Booking Holdings Inc                 | JPMorgan Chase Bank         | 10.164                         | 0,00                 |
| (102.526)   | Booking Holdings Inc                 | Morgan Stanley              | 2.451                          | 0,00                 |
| (659.903)   | Booking Holdings Inc                 | Goldman Sachs International | 26.208                         | 0,00                 |
| (2.134.390) | Boot Barn Holdings Inc               | Morgan Stanley              | 330.618                        | 0,02                 |
| 12.915      | Booz Allen Hamilton Holding Corp     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (351.654)   | BorgWarner Inc                       | Morgan Stanley              | 11.326                         | 0,00                 |
| (372.945)   | BorgWarner Inc                       | JPMorgan Chase Bank         | 25.426                         | 0,00                 |
| 1.200       | Boston Beer Co Inc Class A           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (6.400)     | Boston Properties Inc                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (611.866)   | Boston Scientific Corp               | Goldman Sachs International | 27.072                         | 0,00                 |
| (400)       | Boston Scientific Corp               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.018.587) | Boston Scientific Corp               | JPMorgan Chase Bank         | 37.373                         | 0,00                 |
| 58.557      | Bowlero Corp                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 7.100       | Box Inc Class A                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 114.122     | Boyd Gaming Corp                     | Goldman Sachs International | 1.995                          | 0,00                 |
| (11.700)    | Boyd Gaming Corp                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (32.181)    | BP Plc                               | BofA Securities             | 116                            | 0,00                 |
| 1.280.332   | BP Plc                               | JPMorgan Chase Bank         | 77.292                         | 0,00                 |
| 2.400       | Brady Corp Class A                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (6.205)     | Braze Inc Class A                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 4.895       | Bread Financial Holdings Inc         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (34.060)    | Bridgebio Pharma Inc                 | Goldman Sachs International | 8.028                          | 0,00                 |
| (8.455)     | Bridgebio Pharma Inc                 | JPMorgan Chase Bank         | 1.897                          | 0,00                 |
| (7.600)     | Bridgepoint Group Plc                | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (8.909)     | Bright Horizons Family Solutions Inc | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.300)     | Brighthouse Financial Inc            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 42.825      | BrightSpire Capital Inc              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 2.400       | Brinker International Inc            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 11.250      | Brink's Co                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 87.272      | Bristol-Myers Squibb Co              | Morgan Stanley              | 2.838                          | 0,00                 |
| 352.944     | Bristol-Myers Squibb Co              | Goldman Sachs International | 13.391                         | 0,00                 |
| 16.067      | Britvic Plc                          | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (13.419)    | Brixmor Property Group Inc           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (282.595)   | Broadcom Inc                         | Morgan Stanley              | 48.518                         | 0,00                 |
| (88.569)    | Broadcom Inc                         | JPMorgan Chase Bank         | 2.406                          | 0,00                 |
| (30.922)    | Broadcom Inc                         | Goldman Sachs International | 269                            | 0,00                 |
| (1.797)     | Broadridge Financial Solutions Inc   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 31.713      | Broadstone Net Lease Inc             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung                   | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|---|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (14)      | Brookfield Asset Management Ltd Class A | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (56)      | Brookfield Corp                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 13.678    | Brookfield Renewable Corp Class A       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 46.300    | Brookline Bancorp Inc                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 200       | Brother Industries Ltd                  | BofA Securities             | 25                             | 0,00                 |
| 14.597    | Brown & Brown Inc                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (8.728)   | Brown-Forman Corp Class B               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (17.833)  | BRP Group Inc Class A                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 2.103     | Bruker Corp                             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 4.927     | Brunswick Corp                          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 60.203    | BT Group Plc                            | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (17.149)  | Buckle Inc                              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (25.433)  | Builders FirstSource Inc                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 82.774    | Bumble Inc Class A                      | Morgan Stanley              | 556                            | 0,00                 |
| 106.971   | Bumble Inc Class A                      | Goldman Sachs International | 2.492                          | 0,00                 |
| (16.800)  | Bunge Ltd                               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (4.819)   | Bunzl Plc                               | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (21.474)  | Burberry Group Plc                      | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 14.572    | Burford Capital Ltd                     | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 15.600    | Burlington Stores Inc                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (6.100)   | BWX Technologies Inc                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 35.150    | Bytes Technology Group Plc              | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 21.809    | C&C Group Plc                           | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (44.513)  | C3ai Inc Class A                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 300       | Cable One Inc                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.000)   | Cabot Corp                              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 8.619     | CACI International Inc Class A          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 9.900     | Cactus Inc- Class A                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 30.770    | Cadence Bank                            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (500)     | Cadence Design Systems Inc              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (11.700)  | Caesars Entertainment Inc               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (15.100)  | Caleres Inc                             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (3.100)   | California Resources Corp               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 5.200     | California Water Service Group          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 7.100     | Calix Inc                               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (5.600)   | Callon Petroleum Co                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (7.600)   | Cal-Maine Foods Inc                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (5.200)   | Camden Property Trust                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 1.131.842 | Campbell Soup Co                        | Morgan Stanley              | 52.623                         | 0,00                 |
| 319.308   | Campbell Soup Co                        | Goldman Sachs International | 2.314                          | 0,00                 |
| 6.600     | Camping World Holdings Inc Class A      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (25.400)  | Canada Goose Holdings Inc               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (48.455)  | Canadian National Railway Co            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung                  | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|--|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (1.789.975) | Canadian Natural Resources Ltd         | JPMorgan Chase Bank         | 25.098                         | 0,00                 |
| 312.396     | Canadian Pacific Kansas City Ltd       | Goldman Sachs International | 2.294                          | 0,00                 |
| 54          | Canadian Pacific Kansas City Ltd       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 20.300      | Canadian Solar Inc                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (14.700)    | Cannae Holdings Inc                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (100)       | Capcom Co Ltd                          | BofA Securities             | 256                            | 0,00                 |
| (7.200)     | Capital One Financial Corp             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (58.800)    | Capitol Federal Financial Inc          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 2.300       | Capri Holdings Ltd                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (22.013)    | Capricorn Energy Plc                   | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 1.727       | Cardinal Health Inc                    | Morgan Stanley              | 289                            | 0,00                 |
| 18.100      | CareTrust REIT Inc                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 58.613      | Cargotec OYJ Class B                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (48.400)    | Cargurus Inc                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (3.100)     | Carlisle Cos Inc                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (39.300)    | Carlyle Group Inc                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (5.500)     | CarMax Inc                             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.261.992) | Carnival Corp                          | JPMorgan Chase Bank         | 228.436                        | 0,01                 |
| (87.675)    | Carnival Corp                          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (52.746)    | Carnival Plc                           | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 3.300       | Carpenter Technology Corp              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (150.543)   | Carrier Global Corp                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (15.000)    | Cars.com Inc                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (9.800)     | Carter's Inc                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 19.300      | Carvana Co                             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (4.700)     | Casella Waste Systems Inc Class A      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (40.800)    | Cassava Sciences Inc                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (8.000)     | Catalent Inc                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (10.099)    | Caterpillar Inc                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (16.500)    | Cathay General Bancorp                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 2.100       | Cavco Industries Inc                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 1.800       | CBIZ Inc                               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (807.572)   | Cboe Global Markets Inc                | JPMorgan Chase Bank         | 8.460                          | 0,00                 |
| (16.000)    | CBRE Group Inc Class A                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 30.800      | CCC Intelligent Solutions Holdings Inc | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 9.400       | CDW Corp                               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 900         | Cedar Fair LP                          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 11.400.000  | Cellnex Telecom SA                     | Société Générale            | 33.730                         | 0,00                 |
| 13.405.815  | Cellnex Telecom SA                     | Goldman Sachs International | 87.648                         | 0,01                 |
| (1.294.876) | Celsius Holdings Inc                   | Morgan Stanley              | 575.817                        | 0,03                 |
| (135.554)   | Centamin Plc                           | BofA Securities             | 7                              | 0,00                 |
| 11.500      | Centene Corp                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 204.044     | Centene Corp                           | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |



## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile    | Wertpapierbezeichnung                        | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|------------|--|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 29.300     | CenterPoint Energy Inc                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.900)    | Centerspace                                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 13.500     | Central Garden & Pet Co Class A              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (2.300)    | Central Glass Co Ltd                         | BofA Securities             | 607                            | 0,00                 |
| (3.200)    | Central Japan Railway Co                     | BofA Securities             | 1.036                          | 0,00                 |
| 47.700     | Centrica Plc                                 | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 45.600     | Century Aluminum Co                          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 200        | Century Communities Inc                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (25.800)   | Cerence Inc                                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 24.706     | Ceres Power Holdings Plc                     | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 13.792.719 | Ceridian HCM Holding Inc                     | Goldman Sachs International | 236.082                        | 0,01                 |
| (5.800)    | Ceridian HCM Holding Inc                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (42.200)   | Certara Inc                                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 16.911     | CF Industries Holdings Inc                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 391.552    | CH Robinson Worldwide Inc                    | JPMorgan Chase Bank         | 18.899                         | 0,00                 |
| (30.836)   | CH Robinson Worldwide Inc                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (21.100)   | ChampionX Corp                               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 1.400      | Change Holdings Inc                          | BofA Securities             | 981                            | 0,00                 |
| (89.400)   | ChargePoint Holdings Inc                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 1.000      | Charles River Laboratories International Inc | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (531.498)  | Charles River Laboratories International Inc | Goldman Sachs International | 6.484                          | 0,00                 |
| (42.600)   | Charles Schwab Corp                          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (7.200)    | Chart Industries Inc                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 4.400      | Charter Communications Inc Class A           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 2.100      | Check Point Software Technologies Ltd        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (700)      | Cheesecake Factory Inc                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 900        | Chefs' Warehouse Inc                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 10.800     | Chegg Inc                                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (100)      | Chemed Corp                                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (16.200)   | Chemours Co                                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 13.629     | Chemring Group Plc                           | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 20.030     | Cheniere Energy Inc                          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (363.279)  | Chesapeake Energy Corp                       | Morgan Stanley              | 5.656                          | 0,00                 |
| (484.184)  | Chesapeake Energy Corp                       | JPMorgan Chase Bank         | 7.348                          | 0,00                 |
| 300        | Chesapeake Utilities Corp                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (8.869)    | Chevron Corp                                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (629.830)  | Chewy Inc Class A                            | Morgan Stanley              | 91.793                         | 0,01                 |
| 2.046      | Chimera Investment Corp                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 354        | Chipotle Mexican Grill Inc                   | Morgan Stanley              | 13.573                         | 0,00                 |
| 150.791    | Choice Hotels International Inc              | JPMorgan Chase Bank         | 13.880                         | 0,00                 |
| 1.487.012  | Choice Hotels International Inc              | Morgan Stanley              | 60.504                         | 0,00                 |
| (711.338)  | Chord Energy Corp                            | Goldman Sachs International | 47.009                         | 0,00                 |
| (3.465)    | Chord Energy Corp                            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung                        | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|--|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 7.400       | Chubb Ltd                                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 11.700      | Chubu Electric Power Co Inc                  | BofA Securities             | 1.730                          | 0,00                 |
| (158.962)   | Church & Dwight Co Inc                       | Goldman Sachs International | 9.828                          | 0,00                 |
| (800)       | Church & Dwight Co Inc                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 1.600       | Churchill Downs Inc                          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 217.021     | Cie de Saint-Gobain                          | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (247.366)   | Cie Generale des Etablissements Michelin SCA | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 3.300       | Ciena Corp                                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.181.570) | Cigna Corp                                   | Goldman Sachs International | 71.598                         | 0,00                 |
| 1.900       | Cimpress Plc                                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 14.400      | Cincinnati Financial Corp                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 3.800       | Cinemark Holdings Inc                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (13.000)    | Cirrus Logic Inc                             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 22.097      | Cisco Systems Inc                            | Morgan Stanley              | 40.247                         | 0,00                 |
| 1.400       | Citigroup Inc                                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (14.000)    | Citizen Watch Co Ltd                         | BofA Securities             | 3.000                          | 0,00                 |
| (2.702)     | Citizens Financial Group Inc                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.200)     | City Holding Co                              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (10.700)    | Civitas Resources Inc                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (4.100)     | CKD Corp                                     | BofA Securities             | 202                            | 0,00                 |
| (133.700)   | Clarivate Plc                                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (3.400)     | Clean Harbors Inc                            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 37.332      | Clear Secure Inc Class A                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (4.100)     | Clearwater Analytics Holdings Inc Class A    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 4.600       | Clearway Energy Inc Class A                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (4.300)     | Clearway Energy Inc Class C                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (216.770)   | Cleveland-Cliffs Inc                         | Goldman Sachs International | 21.301                         | 0,00                 |
| 28.500      | Cleveland-Cliffs Inc                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (5.352.337) | Clicks Group Ltd                             | JPMorgan Chase Bank         | 4.850                          | 0,00                 |
| 1.529.639   | Clorox Co                                    | Morgan Stanley              | 82.501                         | 0,01                 |
| (10.372)    | Close Brothers Group Plc                     | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 10.409      | Cloudflare, Inc Class A                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 892.288     | CME Group Inc                                | Goldman Sachs International | 3.642                          | 0,00                 |
| (6.000)     | CME Group Inc Class A                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 1.175.247   | CMS Energy Corp                              | Nomura                      | 31.681                         | 0,00                 |
| 8.200       | CNA Financial Corp                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 83.448      | CNH Industrial NV                            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 37.100      | CNO Financial Group Inc                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (54.800)    | CNX Resources Corp                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 198.988     | Coats Group Plc                              | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (17.500)    | Coca-Cola Bottlers Japan Holdings Inc        | BofA Securities             | 8.903                          | 0,00                 |
| 121.209     | Coca-Cola Co                                 | Goldman Sachs International | 6.203                          | 0,00                 |
| 828.885     | Coca-Cola Co                                 | JPMorgan Chase Bank         | 20.177                         | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung                       | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|---|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 21.201    | Coca-Cola Co                                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (700)     | Coca-Cola Consolidated Inc                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.200)   | Coca-Cola Europacific Partners Plc          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (5.600)   | Cogent Communications Holdings Inc          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.600)   | Cognex Corp                                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 10.300    | Cognizant Technology Solutions Corp Class A | Morgan Stanley              | 27.168                         | 0,00                 |
| 10.400    | Cohen & Steers Inc                          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (50.207)  | Coherent Corp                               | JPMorgan Chase Bank         | 5.320                          | 0,00                 |
| (5.384)   | Coherent Corp                               | Morgan Stanley              | 955                            | 0,00                 |
| 8.600     | Cohu Inc                                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 653.079   | Colgate-Palmolive Co                        | JPMorgan Chase Bank         | 4.078                          | 0,00                 |
| 106.782   | Colgate-Palmolive Co                        | Goldman Sachs International | 1.010                          | 0,00                 |
| 61.845    | Colgate-Palmolive Co                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 9.400     | Collegium Pharmaceutical Inc                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (90.700)  | Colonnade Acquisition Corp II Class A       | Goldman Sachs International | 1.400                          | 0,00                 |
| 1.765     | Columbia Banking System Inc                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (2.400)   | Columbia Sportswear Co                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (309.799) | Comcast Corp Class A                        | Morgan Stanley              | 24.903                         | 0,00                 |
| 6.000     | Comfort Systems USA Inc                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 4.563     | Commerce Bancshares Inc                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 900       | Commercial Metals Co                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (4.800)   | Community Bank System Inc                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 4.700     | CommVault Systems Inc                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (79.372)  | Compass Group Plc                           | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 16.900    | Compass Minerals International Inc          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (7.264)   | Computacenter Plc                           | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 22.191    | Compute Health Acquisition Corp             | Goldman Sachs International | 9.691                          | 0,00                 |
| (910.000) | Compute Health Acquisition Corp Class A     | Goldman Sachs International | 57.000                         | 0,00                 |
| (61.300)  | Comstock Resources Inc                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 1.100     | COMSYS Holdings Corp                        | BofA Securities             | 389                            | 0,00                 |
| 1.014.024 | Conagra Brands Inc                          | JPMorgan Chase Bank         | 86.085                         | 0,01                 |
| 12.438    | Conagra Brands Inc                          | Morgan Stanley              | 239                            | 0,00                 |
| 47.156    | Conagra Brands Inc                          | Goldman Sachs International | 759                            | 0,00                 |
| (200)     | Concentrix Corp                             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 7.700     | Concordia Financial Group Ltd               | BofA Securities             | 103                            | 0,00                 |
| (4.631)   | Conduit Holdings Ltd                        | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (25.500)  | Confluent Inc Class A                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (6.800)   | CONMED Corp                                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 119.817   | ConocoPhillips                              | Goldman Sachs International | 1.097                          | 0,00                 |
| 10.462    | ConocoPhillips                              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 1.304.569 | ConocoPhillips                              | JPMorgan Chase Bank         | 5.116                          | 0,00                 |
| (1.601)   | Consensus Cloud Solutions Inc               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (200)     | Consolidated Edison Inc                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung                | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|--------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (1.593.094) | Constellation Brands Inc Class A     | Goldman Sachs International | 150.026                        | 0,01                 |
| (3.376.754) | Constellation Brands Inc Class A     | Morgan Stanley              | 233.425                        | 0,01                 |
| (172.515)   | Constellation Brands Inc Class A     | JPMorgan Chase Bank         | 1.282                          | 0,00                 |
| 32.333      | Constellation Energy Corp            | Goldman Sachs International | 910                            | 0,00                 |
| (961.597)   | Constellation Energy Corp            | JPMorgan Chase Bank         | 1.402                          | 0,00                 |
| (5.700)     | Constellation Energy Corp            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 11.500      | Constellium SE                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (12.500)    | Construction Partners Inc Class A    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 54.500      | ContextLogic Inc                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (215.393)   | Cooper Cos Inc                       | JPMorgan Chase Bank         | 680                            | 0,00                 |
| (300)       | Cooper Cos Inc                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (4.000)     | Copa Holdings SA Class A             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (12.300)    | Copart Inc                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 400         | Corcept Therapeutics Inc             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (9.100)     | Core & Main Inc Class A              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 7.600       | Core Laboratories Inc                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (47.000)    | CoreCivic Inc                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (241.282)   | Corning Inc                          | Morgan Stanley              | 26.762                         | 0,00                 |
| (12.610)    | Corporate Office Properties Trust    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 31.800      | Corsair Gaming Inc                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 6.900       | Corteva Inc                          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.600)     | CorVel Corp                          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (500)       | Cosmos Pharmaceutical Corp           | BofA Securities             | 94                             | 0,00                 |
| 26.300      | Costamare Inc                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 8.500       | CoStar Group Inc                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.324.831) | Costco Wholesale Corp                | JPMorgan Chase Bank         | 83.642                         | 0,01                 |
| (3.900)     | Costco Wholesale Corp                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (956)       | Coterra Energy Inc                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (37.819)    | Coty Inc Class A                     | Goldman Sachs International | 20.313                         | 0,00                 |
| 27.254      | Coty Inc Class A                     | Morgan Stanley              | 2.647                          | 0,00                 |
| (72.766)    | Coupang Inc                          | JPMorgan Chase Bank         | 4.265                          | 0,00                 |
| (267.149)   | Coupang Inc                          | Morgan Stanley              | 2.381                          | 0,00                 |
| (10.210)    | Coupang Inc                          | Goldman Sachs International | 89                             | 0,00                 |
| 43.500      | Coursera Inc                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 6.900       | Cousins Properties Inc               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 123.056     | Covestro AG                          | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (1.400)     | CRA International Inc                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 1.130.392   | Cracker Barrel Old Country Store Inc | Morgan Stanley              | 145.246                        | 0,01                 |
| 1.300       | Crane Co                             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (14.400)    | Crane NXT Co                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (3.977)     | Cranswick Plc                        | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 3.904       | Credicorp Ltd                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (2.300)     | Credit Acceptance Corp               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung                  | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|--|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 26.300.000  | Credit Agricole SA                     | Société Générale            | 227.093                        | 0,01                 |
| (4.700)     | Credo Technology Group Holding Ltd     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (37.143)    | Crest Nicholson Holdings Plc           | BofA Securities             | 2                              | 0,00                 |
| (35.900)    | Crestwood Equity Partners LP           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (6.291)     | CRH Plc                                | BofA Securities             | 98                             | 0,00                 |
| 280.099     | CRH Plc                                | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 35.329      | CRISPR Therapeutics AG                 | Morgan Stanley              | 4.340                          | 0,00                 |
| 41.886      | CRISPR Therapeutics AG                 | Goldman Sachs International | 2.130                          | 0,00                 |
| 620.406     | CRISPR Therapeutics AG                 | JPMorgan Chase Bank         | 31.345                         | 0,00                 |
| (3.600)     | Crocs Inc                              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (11.282)    | Croda International Plc                | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (29.300)    | Cross Country Healthcare Inc           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 9.500       | CrowdStrike Holdings Inc Class A       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (196.641)   | Crown Castle Inc                       | Morgan Stanley              | 3.426                          | 0,00                 |
| (80.519)    | Crown Castle Inc                       | JPMorgan Chase Bank         | 459                            | 0,00                 |
| 5.400       | Crown Holdings Inc                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 4.500       | CryoPort Inc                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (10.500)    | CSG Systems International Inc          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 5.400       | CSW Industrials Inc                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (126.307)   | CSX Corp                               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (500)       | CTS Corp                               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.000)     | Cullen/Frost Bankers Inc               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 300         | Cummins Inc                            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 103.292     | Currys Plc                             | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (800)       | Curtiss-Wright Corp                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 4.300       | Cushman & Wakefield Plc                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (11.600)    | CVB Financial Corp                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 1.700       | CVR Partners LP                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (3.176)     | CVS Group Plc                          | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (417.890)   | CVS Health Corp                        | Goldman Sachs International | 2.881                          | 0,00                 |
| 409.231.317 | CyberAgent Inc                         | Société Générale            | 344.671                        | 0,02                 |
| (3.200)     | CyberArk Software Ltd                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 64.800      | Cymabay Therapeutics Inc               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 19.179      | Cytek Biosciences Inc                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.799.982) | D and Z Media Acquisition Corp Class A | Goldman Sachs International | 32.000                         | 0,00                 |
| (1.600)     | Daifuku Co Ltd                         | BofA Securities             | 479                            | 0,00                 |
| (4.100)     | Daiichikosho Co Ltd                    | BofA Securities             | 177                            | 0,00                 |
| (800)       | Daito Trust Construction Co Ltd        | BofA Securities             | 7                              | 0,00                 |
| (2.200)     | Daiwa House Industry Co Ltd            | BofA Securities             | 380                            | 0,00                 |
| (600)       | Daiwabo Holdings Co Ltd                | BofA Securities             | 468                            | 0,00                 |
| (1.700)     | Dana Inc                               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 98.537      | Danaher Corp                           | Goldman Sachs International | 1.264                          | 0,00                 |
| (5.200)     | Danaher Corp                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung             | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|-----------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (6.800)     | Danaos Corp                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (2.500)     | Darden Restaurants Inc            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (59.726)    | Darktrace Plc                     | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 22.800      | Darling Ingredients Inc           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (67.818)    | Dassault Systemes SE              | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (141.165)   | Datadog Inc Class A               | Morgan Stanley              | 916                            | 0,00                 |
| (75.013)    | Datadog Inc Class A               | JPMorgan Chase Bank         | 3.280                          | 0,00                 |
| 15.997      | Dave & Buster's Entertainment Inc | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 12.200      | DaVita Inc                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 889         | DCC Plc                           | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (10.568)    | Dechra Pharmaceuticals Plc        | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (1.197.856) | Deckers Outdoor Corp              | JPMorgan Chase Bank         | 147.761                        | 0,01                 |
| (3.100)     | Deckers Outdoor Corp              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 705.885     | Deere & Co                        | Morgan Stanley              | 4.345                          | 0,00                 |
| 17.714      | Definitive Healthcare Corp        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 9.800       | Delek US Holdings Inc             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (89.415)    | Deliveroo Plc                     | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (232.089)   | Dell Technologies Inc             | Morgan Stanley              | 98.096                         | 0,01                 |
| (39.500)    | Dell Technologies Inc Class C     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (32.558)    | Delta Air Lines Inc               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (7.100)     | DeNA Co Ltd                       | BofA Securities             | 536                            | 0,00                 |
| (7.300)     | Denbury Inc                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 3.100       | Denka Co Ltd                      | BofA Securities             | 1.532                          | 0,00                 |
| 19.700      | DENTSPLY SIRONA Inc               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (6.863)     | Derwent London Plc                | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 2.400       | Descente Ltd                      | BofA Securities             | 2.298                          | 0,00                 |
| 3.800.000   | Deutsche Bank AG                  | Société Générale            | 3.510                          | 0,00                 |
| 436.699     | Deutsche Lufthansa AG             | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 50.866.549  | Deutsche Lufthansa AG             | Société Générale            | 429.927                        | 0,03                 |
| 18.891.978  | Deutsche Telekom AG               | Goldman Sachs International | 470.724                        | 0,02                 |
| (170.997)   | Deutschen Telekom AG ADR          | Morgan Stanley              | 2.642                          | 0,00                 |
| (457.013)   | Devon Energy Corp                 | Goldman Sachs International | 7.087                          | 0,00                 |
| 406.862     | Devon Energy Corp                 | Morgan Stanley              | 5.371                          | 0,00                 |
| 1.334.419   | Devon Energy Corp                 | JPMorgan Chase Bank         | 18.603                         | 0,00                 |
| 11.190      | Dexcom Inc                        | Morgan Stanley              | 654                            | 0,00                 |
| (1.200)     | Dexerials Corp                    | BofA Securities             | 68                             | 0,00                 |
| 42.900      | DHT Holdings Inc                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (38.100)    | Diamond Offshore Drilling Inc     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (213)       | Diamondback Energy Inc            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 16.900      | DiamondRock Hospitality Co        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (12.100)    | DICE Therapeutics Inc             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 130.703     | Dick's Sporting Goods Inc         | Goldman Sachs International | 5.154                          | 0,00                 |
| (1.581.608) | Dick's Sporting Goods Inc         | JPMorgan Chase Bank         | 46.066                         | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung             | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|-----------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (5.200)     | Dick's Sporting Goods Inc         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (8.900)     | Digi International Inc            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 5.800       | Digital Realty Trust Inc          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (87.750)    | Digital Turbine Inc               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 36.700      | DigitalBridge Group Inc           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (7.700)     | DigitalOcean Holdings Inc         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (2.500)     | Dillard's Inc Class A             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 8.400       | Dime Community Bancshares Inc     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.000)     | Dine Brands Global Inc            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 3.100       | Diodes Inc                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 7.340       | Diploma Plc                       | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 188.491     | Direct Line Insurance Group Plc   | BofA Securities             | 9                              | 0,00                 |
| 100         | Disco Corp                        | BofA Securities             | 184                            | 0,00                 |
| (100)       | Discover Financial Services       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (6.792)     | DiscoverIE Group Plc              | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (2.727.119) | Discovery Ltd                     | JPMorgan Chase Bank         | 1.133                          | 0,00                 |
| (7.450.363) | Discovery Ltd                     | Morgan Stanley              | 368                            | 0,00                 |
| (121.000)   | Diversey Holdings Ltd             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (2.436)     | Diversified Energy Co Plc         | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 39.600      | Dlocal Ltd                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 800         | DMG Mori Co Ltd                   | BofA Securities             | 156                            | 0,00                 |
| (63.900)    | DocGo Inc                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 72.795      | DocuSign Inc                      | Morgan Stanley              | 7.256                          | 0,00                 |
| (10.600)    | Dolby Laboratories Inc Class A    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (33.000)    | Dole Plc                          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 9.200       | Dollar General Corp               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (190.044)   | Dollar Tree Inc                   | Goldman Sachs International | 8.886                          | 0,00                 |
| 6.730       | Dollar Tree Inc                   | Morgan Stanley              | 5.310                          | 0,00                 |
| (520.457)   | Dometic Group AB                  | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 10.400      | Dominion Energy Inc               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 23.687      | Domino's Pizza Group Plc          | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 5.900       | Domino's Pizza Inc                | Morgan Stanley              | 16.513                         | 0,00                 |
| 21.800      | Donaldson Co Inc                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (7.300)     | Donnelley Financial Solutions Inc | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 55.757      | DoorDash Inc Class A              | Goldman Sachs International | 172                            | 0,00                 |
| 8.400       | DoorDash Inc Class A              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (5.000)     | Dorian LPG Ltd                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 11.500      | Dorman Products Inc               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (31.400)    | DoubleVerify Holdings Inc         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 20.500      | Douglas Emmett Inc                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 4.100       | Doutor Nichires Holdings Co Ltd   | BofA Securities             | 236                            | 0,00                 |
| 4.900       | Dover Corp                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 35.698      | Dow Inc                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung              | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (54.145)  | Dowlais Group Plc                  | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (1.800)   | Doximity Inc Class A               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (10.600)  | DR Horton Inc                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 36.605    | Dr ING hc F Porsche AG             | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 100.841   | Dr Martens Plc                     | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 25.400    | DraftKings Inc Class A             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 16.300    | Dril-Quip Inc                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 40.300    | Driven Brands Holdings Inc         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 8.300     | Dropbox Inc Class A                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (103.427) | DS Smith Plc                       | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 41.422    | DSM-Firmenich AG                   | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (7.506)   | DSV A/S                            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (2.900)   | DT Midstream Inc                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (2.900)   | DTE Energy Co                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 41.419    | Duckhorn Portfolio Inc             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 3.800     | Duke Energy Corp                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (111.400) | Dun & Bradstreet Holdings Inc      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (16.796)  | Dunelm Group Plc                   | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (900)     | Duolingo Inc                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 16.300    | DuPont de Nemours Inc              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (42.711)  | Dutch Bros Inc Class A             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 35.700    | DXC Technology Co                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (2.800)   | Dycom Industries Inc               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 7.000     | Dynatrace Inc                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (125.182) | Dyne Therapeutics Inc              | Goldman Sachs International | 7.863                          | 0,00                 |
| (274.153) | Dyne Therapeutics Inc              | Morgan Stanley              | 42.531                         | 0,00                 |
| (359.683) | E.ON SE                            | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (113.800) | E2open Parent Holdings Inc         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 15.623    | Eagle Bancorp Inc                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (34.200)  | Earthstone Energy Inc Class A      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 1.500     | East Japan Railway Co              | BofA Securities             | 28                             | 0,00                 |
| (3.800)   | East West Bancorp Inc              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (22.400)  | Easterly Government Properties Inc | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (37.600)  | Eastern Bankshares Inc             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (5.200)   | EastGroup Properties Inc           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (508.187) | easyJet Plc                        | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (278.306) | Eaton Corp Plc                     | Goldman Sachs International | 46.456                         | 0,00                 |
| 50.010    | Eaton Corp Plc                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.200)   | Ebara Corp                         | BofA Securities             | 1.744                          | 0,00                 |
| 29.851    | eBay Inc                           | JPMorgan Chase Bank         | 360                            | 0,00                 |
| 7.873     | eBay Inc                           | Morgan Stanley              | 121                            | 0,00                 |
| 700       | Ecolab Inc                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 8.500     | Ecovyst Inc                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |



## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung                 | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|---------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 4.700       | Edgewell Personal Care Co             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (21.400)    | Edison International                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 20.100      | Edwards Lifesciences Corp             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 115.438     | eFFECTOR Therapeutics                 | Goldman Sachs International | 7.562                          | 0,00                 |
| (1.800)     | Eisai Co Ltd                          | BofA Securities             | 5.263                          | 0,00                 |
| (100)       | Eizo Corp                             | BofA Securities             | 63                             | 0,00                 |
| (60.100)    | Elanco Animal Health Inc              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 10.708      | Elastic NV                            | Morgan Stanley              | 154                            | 0,00                 |
| (400)       | Elecom Co Ltd                         | BofA Securities             | 315                            | 0,00                 |
| (70.726)    | Electrolux AB Class B                 | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (4.800)     | Electronic Arts Inc                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (203.657)   | Elekta AB                             | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 15.300      | Element Solutions Inc                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 48.932      | Elementis Plc                         | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 2.500       | Elevance Health Inc                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (667.331)   | elf Beauty Inc                        | Goldman Sachs International | 135.470                        | 0,01                 |
| 2.100       | elf Beauty Inc                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (121.418)   | Eli Lilly & Co                        | Morgan Stanley              | 4.220                          | 0,00                 |
| (1.045.140) | Eli Lilly & Co                        | Goldman Sachs International | 460.820                        | 0,02                 |
| (38.400)    | Ellington Financial Inc               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.800)     | Elme Communities                      | Morgan Stanley              | 2.893                          | 0,00                 |
| 754.964     | Embecta Corp                          | Goldman Sachs International | 169.800                        | 0,01                 |
| 10.560      | Embecta Corp                          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (9.500)     | EMCOR Group Inc                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (957.416)   | Emerson Electric Co                   | Morgan Stanley              | 70.489                         | 0,00                 |
| (166.321)   | Emerson Electric Co                   | JPMorgan Chase Bank         | 8.615                          | 0,00                 |
| (34.200)    | Empire State Realty Trust Inc Class A | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 3.700       | Employers Holdings Inc                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (900)       | Enact Holdings Inc                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (223.401)   | Encompass Health Corp                 | Goldman Sachs International | 22.225                         | 0,00                 |
| (426.969)   | Encompass Health Corp                 | Morgan Stanley              | 50.039                         | 0,00                 |
| (5.300)     | Encore Capital Group Inc              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (3.000)     | Encore Wire Corp                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (70.975)    | Endeavor Group Holdings Inc           | JPMorgan Chase Bank         | 2.506                          | 0,00                 |
| (27.108)    | Endeavor Group Holdings Inc           | Goldman Sachs International | 648                            | 0,00                 |
| (227)       | Endeavor Group Holdings Inc           | Morgan Stanley              | 2                              | 0,00                 |
| (17.700)    | Endeavor Group Holdings Inc Class A   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (22.252)    | Energiean Plc                         | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 208.189     | Energizer Holdings Inc                | Goldman Sachs International | 459                            | 0,00                 |
| 457.399     | Energizer Holdings Inc                | JPMorgan Chase Bank         | 18.351                         | 0,00                 |
| 7.700       | Energizer Holdings Inc                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 2.800       | Energy Recovery Inc                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (985.351)   | Energy Transfer LP                    | Morgan Stanley              | 10.685                         | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung              | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 18.300      | Enerpac Tool Group Corp            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (4.200)     | EnerSys                            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 15.100      | EngageSmart Inc                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 39.327      | Enhabit Inc                        | JPMorgan Chase Bank         | 11.785                         | 0,00                 |
| (4.300)     | en-japan Inc                       | BofA Securities             | 462                            | 0,00                 |
| (5.600)     | EnLink Midstream LLC               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.000)     | Enova International Inc            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (93.600)    | Enovix Corp                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 198.149     | Enphase Energy Inc                 | JPMorgan Chase Bank         | 3.367                          | 0,00                 |
| 16.700      | Enphase Energy Inc                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (3.806)     | EnPro Industries Inc               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (6.500)     | Ensign Group Inc                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 1.800       | Enstar Group Ltd                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 3.485       | Entain Plc                         | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (84.141)    | Entegris Inc                       | JPMorgan Chase Bank         | 2.068                          | 0,00                 |
| (83.380)    | Entegris Inc                       | Morgan Stanley              | 3.300                          | 0,00                 |
| 4.600       | Energy Corp                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 8.500       | Enterprise Financial Services Corp | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (19.200)    | Enterprise Products Partners LP    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 2.478.783   | Envestnet Inc                      | Goldman Sachs International | 10.578                         | 0,00                 |
| (14.300)    | Envestnet Inc                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 2.820       | Envista Holdings Corp              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (23.900)    | Enviva Inc                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 654.801     | EOG Resources Inc                  | JPMorgan Chase Bank         | 11.370                         | 0,00                 |
| (14.500)    | EOG Resources Inc                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.400)     | EPAM Systems Inc                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (316.586)   | Epiroc AB Class A                  | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (7.293)     | ePlus Inc                          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.100)     | EPR Properties                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (310.997)   | EQT Corp                           | Goldman Sachs International | 31.512                         | 0,00                 |
| (1.314.567) | EQT Corp                           | Morgan Stanley              | 348.679                        | 0,02                 |
| (4.338)     | EQT Corp                           | JPMorgan Chase Bank         | 759                            | 0,00                 |
| (2.400)     | Equifax Inc                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 100         | Equinix Inc                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (51.676)    | Equinor ASA                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 791.626     | Equinor ASA                        | Goldman Sachs International | 25                             | 0,00                 |
| (29.500)    | Equitable Holdings Inc             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (20.400)    | Equitrans Midstream Corp           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 16.500      | Equity Commonwealth                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 8.300       | Equity LifeStyle Properties Inc    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 16.100      | Equity Residential                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.000)     | Erie Indemnity Co Class A          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (78.425)    | Erste Group Bank AG                | JPMorgan Chase Bank         | 1.474                          | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung                      | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|--|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (5.733)   | Esab Corp                                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 100       | ESCO Technologies Inc                      | Morgan Stanley              | 4                              | 0,00                 |
| (9.081)   | ESM Acquisition Corp                       | Goldman Sachs International | 110                            | 0,00                 |
| 11.300    | Essent Group Ltd                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 18.200    | Essential Properties Realty Trust Inc      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 9.300     | Essential Utilities Inc                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (4.300)   | Essex Property Trust Inc                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 66.399    | Essity AB Class B                          | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 900       | Establishment Labs Holdings Inc            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 3.600     | Estee Lauder Cos Inc Class A               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 55.616    | Etsy Inc                                   | Goldman Sachs International | 4.948                          | 0,00                 |
| 7.325     | Etsy Inc                                   | Morgan Stanley              | 386                            | 0,00                 |
| (17.100)  | euglena Co Ltd                             | BofA Securities             | 3.332                          | 0,00                 |
| (73.369)  | Eurofins Scientific SE                     | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (7.900)   | Euronet Worldwide Inc                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 9.600     | Everbridge Inc                             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 4.500     | Evercore Inc Class A                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (100)     | Everest Re Group Ltd                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 20.200    | Evergy Inc                                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 39.900    | Everi Holdings Inc                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 15.100    | Eversource Energy                          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 22.200    | EVERTEC Inc                                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 18.800    | Evolent Health Inc Class A                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (244.340) | Evonik Industries AG                       | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 35.062    | Exelixis Inc                               | Goldman Sachs International | 164                            | 0,00                 |
| 8.582     | Exelixis Inc                               | Morgan Stanley              | 15                             | 0,00                 |
| (19.500)  | Exelon Corp                                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 6.700     | EXEO Group Inc                             | BofA Securities             | 1.509                          | 0,00                 |
| 5.200     | ExlService Holdings Inc                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 20.400    | eXp World Holdings Inc                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 25.343    | Expedia Group Inc                          | Morgan Stanley              | 2                              | 0,00                 |
| (8.700)   | Expeditors International of Washington Inc | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (39.777)  | Experian Plc                               | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 6.557     | Experian Plc                               | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 7.200     | Exponent Inc                               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 9.889     | Expro Group Holdings NV                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 3.300     | Extra Space Storage Inc                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 35.900    | Extreme Networks Inc                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (53.961)  | Exxon Mobil Corp                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (71.542)  | Exxon Mobil Corp                           | JPMorgan Chase Bank         | 3.790                          | 0,00                 |
| (5.100)   | Ezaki Glico Co Ltd                         | BofA Securities             | 3.349                          | 0,00                 |
| 4.400     | F5 Inc                                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.200)   | Fabrinet                                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile      | Wertpapierbezeichnung                      | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------|--|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 1.600        | Fair Isaac Corp                            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 12.032.828   | Fancl Corp                                 | Société Générale            | 5.719                          | 0,00                 |
| (18.300)     | Fancl Corp                                 | BofA Securities             | 5.413                          | 0,00                 |
| 1.900        | FANUC Corp                                 | BofA Securities             | 782                            | 0,00                 |
| 2.300        | Farfetch Ltd Class A                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (79.451)     | Fastenal Co                                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 371.034      | Fastighets AB Balder                       | Société Générale            | 157.856                        | 0,01                 |
| 7.600        | FB Financial Corp                          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 6.906        | FDM Group Holdings Plc                     | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (800)        | Federal Agricultural Mortgage Corp         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.000)      | Federal Realty Investment Trust            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (8.600)      | Federal Signal Corp                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 9.400        | Federated Hermes Inc                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (157.604)    | FedEx Corp                                 | Goldman Sachs International | 18.436                         | 0,00                 |
| (2.236.029)  | FedEx Corp                                 | JPMorgan Chase Bank         | 93.966                         | 0,00                 |
| 3.725        | FedEx Corp                                 | Morgan Stanley              | 24.500                         | 0,00                 |
| 48.753       | Ferguson Plc                               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 14.478       | Ferrari NV                                 | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 25.100       | Ferroglobe Plc                             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 12.953       | Fevertree Drinks Plc                       | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (4.800)      | Fidelity National Financial Inc            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 7.100        | Fidelity National Information Services Inc | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 12.500       | Fifth Third Bancorp                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 38.000       | Figs Inc Class A                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 4.000        | Financial Partners Group Co Ltd            | BofA Securities             | 1.304                          | 0,00                 |
| (24.800)     | First Advantage Corp                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (16.000)     | First American Financial Corp              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (7.500)      | First BanCorp                              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 5.000        | First Bancorp                              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (2.600)      | First Citizens BancShares Inc Class A      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 21.200       | First Commonwealth Financial Corp          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 9.000        | First Financial Bancorp                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 20.800       | First Financial Bankshares Inc             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 59.800       | First Foundation Inc                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (23.000)     | First Hawaiian Inc                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 10.400       | First Industrial Realty Trust Inc          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (4.838)      | First Interstate BancSystem Inc Class A    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (18.700)     | First Merchants Corp                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 7.000        | First Solar Inc                            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 4.300        | FirstCash Holdings Inc                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (39.900)     | FirstEnergy Corp                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (76.169)     | Firstgroup Plc                             | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (10.528.385) | FirstRand Ltd                              | JPMorgan Chase Bank         | 48.908                         | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung              | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (2.621.090) | FirstRand Ltd                      | Goldman Sachs International | 540                            | 0,00                 |
| (3.881.331) | FirstRand Ltd                      | Morgan Stanley              | 2.904                          | 0,00                 |
| 20.600      | Fiserv Inc                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (98.811)    | Fisker Inc                         | Morgan Stanley              | 7.133                          | 0,00                 |
| 24.900      | Five Below Inc                     | Goldman Sachs International | 262                            | 0,00                 |
| (6.600)     | Five9 Inc                          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 24.000      | Fiverr International Ltd           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (6.400)     | FleetCor Technologies Inc          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (20.400)    | FLEX LNG Ltd                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (27.907)    | Flex Ltd                           | Goldman Sachs International | 412                            | 0,00                 |
| (271.523)   | Flex Ltd                           | Morgan Stanley              | 94.412                         | 0,01                 |
| (200.130)   | Flex Ltd                           | JPMorgan Chase Bank         | 8.807                          | 0,00                 |
| (4.300)     | Floor & Decor Holdings Inc Class A | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 729.684     | Flowers Foods Inc                  | Goldman Sachs International | 69.378                         | 0,00                 |
| 17.300      | Flowers Foods Inc                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 13.600      | Flowserve Corp                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 127.815     | FLSmidth & Co A/S                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 8.300       | Fluence Energy Inc                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (10.100)    | Fluor Corp                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 4.980       | Flutter Entertainment Plc          | BofA Securities             | 527                            | 0,00                 |
| (3.400)     | FMC Corp                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (66.300)    | FNB Corp                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (21.100)    | Foot Locker Inc                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (4.147.716) | Foran Mining Corp                  | Goldman Sachs International | 284.954                        | 0,01                 |
| (173.800)   | Ford Motor Co                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (8.800)     | FormFactor Inc                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (28.900)    | Fortinet Inc                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (7.200)     | Fortive Corp                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 79.368      | Fortum OYJ                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 4.800       | Fortune Brands Home & Security Inc | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (60.518)    | Forvia                             | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (1.800)     | Forward Air Corp                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (3.976.525) | Foschini Group Ltd                 | Goldman Sachs International | 2.318                          | 0,00                 |
| (2.100)     | Four Corners Property Trust Inc    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (22.865)    | Fox Corp Class A                   | JPMorgan Chase Bank         | 2.050                          | 0,00                 |
| (299.374)   | Fox Corp Class A                   | Goldman Sachs International | 9.671                          | 0,00                 |
| (152.657)   | Fox Corp Class A                   | Morgan Stanley              | 12.323                         | 0,00                 |
| (26.200)    | Fox Corp Class B                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (900)       | FP Corp                            | BofA Securities             | 143                            | 0,00                 |
| (20.100)    | Franchise Group Inc                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (4.200)     | Franklin Electric Co Inc           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (22.661)    | Franklin Resources Inc             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (14.400)    | Freedom Holding Corp               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung              | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (359.790)   | Freeport-McMoRan Inc               | Goldman Sachs International | 36.802                         | 0,00                 |
| 105.489     | Freeport-McMoRan Inc               | Morgan Stanley              | 2.622                          | 0,00                 |
| 17.600      | Fresh Del Monte Produce Inc        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.195.014) | Freshpet Inc                       | Goldman Sachs International | 43.570                         | 0,00                 |
| (83.551)    | Freshpet Inc                       | JPMorgan Chase Bank         | 8.350                          | 0,00                 |
| (459.647)   | Freshpet Inc                       | Morgan Stanley              | 2.220                          | 0,00                 |
| (19.000)    | Freshworks Inc Class A             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (28.723)    | Fresnillo Plc                      | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (103.000)   | FREYR Battery SA                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 19.500      | Frontdoor Inc                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (7.200)     | Frontier Communications Parent Inc | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 13.800      | Frontier Group Holdings Inc        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (874.647)   | Frontier Investment Corp           | Goldman Sachs International | 29.187                         | 0,00                 |
| (18.710)    | Frontline Plc                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 5.100       | FS KKR Capital Corp                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 13.900      | FTAI Aviation Ltd                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (3.700)     | FTI Consulting Inc                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (5.100)     | Fuji Corp                          | BofA Securities             | 592                            | 0,00                 |
| (200)       | Fuji Electric Co Ltd               | BofA Securities             | 317                            | 0,00                 |
| 400         | Fuji Kyuko Co Ltd                  | BofA Securities             | 904                            | 0,00                 |
| 7.700       | Fuji Media Holdings Inc            | BofA Securities             | 6.057                          | 0,00                 |
| (1.000)     | FUJIFILM Holdings Corp             | BofA Securities             | 2.201                          | 0,00                 |
| 3.000       | Fulgent Genetics Inc               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 4.000       | Fulton Financial Corp              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 5.600       | Furukawa Electric Co Ltd           | BofA Securities             | 2.762                          | 0,00                 |
| (1.300)     | Future Corp                        | BofA Securities             | 1.024                          | 0,00                 |
| (13.008)    | Future Plc                         | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (1.800)     | Fuyo General Lease Co Ltd          | BofA Securities             | 983                            | 0,00                 |
| 12.100      | Gaming and Leisure Properties Inc  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (6.253)     | Gamma Communications Plc           | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (12.300)    | Gap Inc                            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 1.400       | Garmin Ltd                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 4.900       | Gartner Inc                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 51.100      | Gates Industrial Corp Plc          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 1.300       | GATX Corp                          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (41.493)    | GB Group Plc                       | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 9.616       | GE HealthCare Technologies Inc     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 35.338      | GEA Group AG                       | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (8.121)     | Geberit AG                         | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (15.500)    | Gen Digital Inc                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.600)     | Generac Holdings Inc               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (43.556)    | General Electric Co                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (17.700)    | General Mills Inc                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung           | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|---------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 391.849   | General Mills Inc               | Goldman Sachs International | 43.348                         | 0,00                 |
| 127.300   | General Motors Co               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (17.500)  | Genius Sports Ltd               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 13.095    | Genmab A/S                      | Morgan Stanley              | 993                            | 0,00                 |
| 1.312.873 | Genmab A/S                      | Goldman Sachs International | 11.453                         | 0,00                 |
| 1.812.778 | Genmab A/S                      | JPMorgan Chase Bank         | 18.100                         | 0,00                 |
| 9.600     | Genpact Ltd                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (10.100)  | Gentex Corp                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 8.600     | Gentherm Inc                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 3.200     | Genuine Parts Co                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 19.831    | Genuit Group Plc                | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (107.600) | Genworth Financial Inc Class A  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (24.700)  | GEO Group Inc                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (17.800)  | Getty Realty Corp               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 7.400     | Gibraltar Industries Inc        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (17.800)  | G-III Apparel Group Ltd         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 52.466    | Gilead Sciences Inc             | Morgan Stanley              | 1.804                          | 0,00                 |
| 305.549   | Gilead Sciences Inc             | Goldman Sachs International | 2.714                          | 0,00                 |
| 3.900     | Gitlab Inc Class A              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (2.711)   | Givaudan SA                     | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 33.500    | Glacier Bancorp Inc             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 2.700     | Glaukos Corp                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 1.076.187 | Glencore Plc                    | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (26.200)  | Global Net Lease Inc            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 4.900     | Global Payments Inc             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (36.100)  | Global-e Online Ltd             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (62.200)  | GlobalFoundries Inc             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 296.496   | GlobalFoundries Inc             | Goldman Sachs International | 8.606                          | 0,00                 |
| 1.900     | Globant SA                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (300)     | Globe Life Inc                  | Morgan Stanley              | 3                              | 0,00                 |
| 3.100     | Glory Ltd                       | BofA Securities             | 2.870                          | 0,00                 |
| (7.100)   | GMO internet group Inc          | BofA Securities             | 4.596                          | 0,00                 |
| 20.500    | GMS Inc                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 7.500     | GoDaddy Inc Class A             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 31.000    | Gogo Inc                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 60.800    | Golar LNG Ltd                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 6.500     | Golden Entertainment Inc        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 27.200    | Golden Ocean Group Ltd          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 251.934   | Goodyear Tire & Rubber Co       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 3.500     | Goosehead Insurance Inc Class A | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (2.700)   | Graco Inc                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.100)   | Graham Holdings Co Class B      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (68.891)  | Grainger Plc                    | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung           | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|---------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 3.300       | Grand Canyon Education Inc      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (6.700)     | Granite Construction Inc        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 9.600       | Graphic Packaging Holding Co    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 101.300     | Gray Television Inc             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 4.258       | Great Portland Estates Plc      | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (1.900)     | Green Brick Partners Inc        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 18.900      | Green Dot Corp Class A          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (7.500)     | Green Plains Inc                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (400)       | Greenbrier Cos Inc              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 444         | Greggs Plc                      | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (1.800)     | Greif Inc Class A               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (3.170)     | Grid Dynamics Holdings Inc      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 900         | Griffon Corp                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (962.667)   | Grifols SA                      | Goldman Sachs International | 321.664                        | 0,02                 |
| (475.174)   | Grifols SA                      | JPMorgan Chase Bank         | 9.912                          | 0,00                 |
| (260.363)   | Grifols SA                      | Morgan Stanley              | 5.571                          | 0,00                 |
| 24.500      | Grocery Outlet Holding Corp     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (2.454.377) | Group 1 Automotive Inc          | Morgan Stanley              | 333.801                        | 0,02                 |
| 2.129.693   | Growthpoint Properties Ltd      | JPMorgan Chase Bank         | 20.671                         | 0,00                 |
| 68.049      | GSK Plc                         | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 126.124     | GSK Plc                         | Morgan Stanley              | 4.785                          | 0,00                 |
| 152.235     | GSK Plc                         | Goldman Sachs International | 1.967                          | 0,00                 |
| (37.400)    | Guess? Inc                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 500         | Guidewire Software Inc          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.800)     | Gulfport Energy Corp            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (700)       | GungHo Online Entertainment Inc | BofA Securities             | 202                            | 0,00                 |
| (11.800)    | GXO Logistics Inc               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 16.046      | H Lundbeck A/S                  | Goldman Sachs International | 287                            | 0,00                 |
| 86.262      | H Lundbeck A/S                  | Morgan Stanley              | 906                            | 0,00                 |
| 6.600       | H&E Equipment Services Inc      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (16.200)    | H&R Block Inc                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 1.600       | Hachijuni Bank Ltd              | BofA Securities             | 125                            | 0,00                 |
| 9.600       | Haemonetics Corp                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 53.090      | Hain Celestial Group Inc        | Goldman Sachs International | 10.066                         | 0,00                 |
| 46.076      | Hain Celestial Group Inc        | Morgan Stanley              | 15                             | 0,00                 |
| 371.426     | Hain Celestial Group Inc        | JPMorgan Chase Bank         | 128.830                        | 0,01                 |
| (4.900)     | Hakuhodo DY Holdings Inc        | BofA Securities             | 1.234                          | 0,00                 |
| 2.600       | Hakuto Co Ltd                   | BofA Securities             | 6.674                          | 0,00                 |
| (46.519)    | Haleon Plc                      | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (39.000)    | Halliburton Co                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 851         | Halma Plc                       | BofA Securities             | 23                             | 0,00                 |
| (9.600)     | Hamilton Lane Inc Class A       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 366.545     | Hammerson Plc                   | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |



## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung                                   | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|---|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 3.800       | Hancock Whitney Corp                                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (3.500)     | Hannon Armstrong Sustainable Infrastructure Capital Inc | Morgan Stanley              | 181                            | 0,00                 |
| 3.700       | Hanover Insurance Group Inc                             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 25.360      | Harbour Energy Plc                                      | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 42.855      | Hargreaves Lansdown Plc                                 | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 1.439.002   | Harley-Davidson Inc                                     | Morgan Stanley              | 28.421                         | 0,00                 |
| (600)       | Harmonic Drive Systems Inc                              | BofA Securities             | 1.735                          | 0,00                 |
| 6.000       | Harmonic Inc  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (3.700)     | Harmony Biosciences Holdings Inc                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.800)     | Hartford Financial Services Group Inc                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (3.800)     | Hasbro Inc  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 2.600       | Haseko Corp   | BofA Securities             | 1.623                          | 0,00                 |
| 17.100      | HashiCorp Inc Class A                                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 18.600      | Hawaiian Electric Industries Inc                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.236.373) | Hays Plc  | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 115.699     | Hays Plc  | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 242.558     | Hayward Holdings Inc                                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 7.000       | HB Fuller Co  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.481)     | HCA Healthcare Inc                                      | Goldman Sachs International | 31                             | 0,00                 |
| 5.700       | HCA Healthcare Inc                                      | Morgan Stanley              | 87.963                         | 0,01                 |
| (137.400)   | Healthcare Realty Trust Inc                             | Morgan Stanley              | 68.222                         | 0,00                 |
| (27.600)    | Healthcare Services Group Inc                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 3.100       | HealthEquity Inc  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 73.381      | Healthpeak Properties Inc                               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 9.400       | Heartland Financial USA Inc                             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (3.400)     | HEICO Corp  | Morgan Stanley              | 27                             | 0,00                 |
| (1.000)     | HEICO Corp Class A                                      | Morgan Stanley              | 92                             | 0,00                 |
| 247         | HeidelbergCement AG                                     | Goldman Sachs International | 1.709                          | 0,00                 |
| 8.900       | Heiwa Corp  | BofA Securities             | 5.053                          | 0,00                 |
| 6.900       | Helen of Troy Ltd                                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 12.600      | Helix Energy Solutions Group Inc                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (6.000)     | Helmerich & Payne Inc                                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (18.579)    | Henkel AG & Co KGaA – Preferred Shares                  | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 1.600       | Henry Schein Inc  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 8.995.599   | Herbalife Ltd   | Goldman Sachs International | 2.308.018                      | 0,10                 |
| (14.100)    | Herbalife Ltd   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 4.100       | Herc Holdings Inc                                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 6.000       | Heritage Financial Corp                                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (680)       | Hermes International                                    | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (764.771)   | Hershey Co  | Morgan Stanley              | 3.233                          | 0,00                 |
| (434.951)   | Hess Corp   | JPMorgan Chase Bank         | 14.702                         | 0,00                 |
| 15.861      | Hess Corp   | Morgan Stanley              | 1.818                          | 0,00                 |
| (31.100)    | Hess Midstream LP Class A                               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung          | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|--------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 77.400    | Hewlett Packard Enterprise Co  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 737.299   | Hexagon AB                     | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (38.501)  | Hexcel Corp                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (13.700)  | HF Sinclair Corp               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 5.400     | Hibbett Inc                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 102.827   | HighPeak Energy Inc            | Goldman Sachs International | 9.461                          | 0,00                 |
| (47.700)  | HighPeak Energy Inc            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 8.300     | Highwoods Properties Inc       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (300)     | Hikari Tsushin Inc             | BofA Securities             | 2.921                          | 0,00                 |
| 20.946    | Hikma Pharmaceuticals Plc      | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (5.967)   | Hill & Smith Plc               | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (7.400)   | Hillenbrand Inc                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 46.000    | Hillman Solutions Corp         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (100)     | Hilltop Holdings Inc           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (12.400)  | Hilton Grand Vacations Inc     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (16.904)  | Hilton Worldwide Holdings Inc  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (71.619)  | Hims & Hers Health Inc         | JPMorgan Chase Bank         | 3.276                          | 0,00                 |
| (116.864) | Hims & Hers Health Inc         | Morgan Stanley              | 8.756                          | 0,00                 |
| (157.979) | Hims & Hers Health Inc         | Goldman Sachs International | 7.610                          | 0,00                 |
| (700)     | Hino Motors Ltd                | BofA Securities             | 34                             | 0,00                 |
| 700       | Hioki EE Corp                  | BofA Securities             | 2.204                          | 0,00                 |
| (7.000)   | HireRight Holdings Corp        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (6.400)   | HIS Co Ltd                     | BofA Securities             | 3.351                          | 0,00                 |
| 54        | Hiscox Ltd                     | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 2.100     | Hitachi Ltd                    | BofA Securities             | 2.095                          | 0,00                 |
| 10.400    | HNI Corp                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (15.400)  | Hokkaido Electric Power Co Inc | BofA Securities             | 2.913                          | 0,00                 |
| 16.900    | Hokuriku Electric Power Co     | BofA Securities             | 607                            | 0,00                 |
| (44.823)  | Holcim AG                      | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 25.100    | Hologic Inc                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (18.700)  | Home BancShares Inc            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (3.100)   | Home Depot Inc                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 488.195   | Home Reit Plc                  | BofA Securities             | 621                            | 0,00                 |
| (600)     | Honda Motor Co Ltd             | BofA Securities             | 326                            | 0,00                 |
| (547.980) | Honeywell International Inc    | Goldman Sachs International | 35.176                         | 0,00                 |
| (141.069) | Honeywell International Inc    | JPMorgan Chase Bank         | 5.339                          | 0,00                 |
| (143.781) | Honeywell International Inc    | Morgan Stanley              | 5.105                          | 0,00                 |
| 29.150    | Honeywell International Inc    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 23.600    | Hope Bancorp Inc               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 13.400    | Horace Mann Educators Corp     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 1.100     | Horiba Ltd                     | BofA Securities             | 1.778                          | 0,00                 |
| (138.858) | Hormel Foods Corp              | JPMorgan Chase Bank         | 177                            | 0,00                 |
| 22.900    | Hormel Foods Corp              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung             | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|-----------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (83.400)    | Host Hotels & Resorts Inc         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 31.700      | Hostess Brands Inc                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (14.900)    | Houlihan Lokey Inc                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (700)       | House Foods Group Inc             | BofA Securities             | 453                            | 0,00                 |
| (375.877)   | Howden Joinery Group Plc          | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (1.591.771) | Howmet Aerospace Inc              | Goldman Sachs International | 209.514                        | 0,01                 |
| (281.391)   | Howmet Aerospace Inc              | JPMorgan Chase Bank         | 29.685                         | 0,00                 |
| 152.553     | Howmet Aerospace Inc              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 400         | Hoya Corp                         | BofA Securities             | 548                            | 0,00                 |
| 399.099     | HSBC Holdings Plc                 | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (2.400)     | Hub Group Inc Class A             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 1.400       | Hubbell Inc                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (39.413)    | HubSpot Inc                       | JPMorgan Chase Bank         | 2.012                          | 0,00                 |
| (256.037)   | HubSpot Inc                       | Morgan Stanley              | 76.850                         | 0,00                 |
| (5.000)     | Hudson Pacific Properties Inc     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 77.185      | Humana Inc                        | Morgan Stanley              | 9.796                          | 0,00                 |
| 2.551.569   | Humana Inc                        | Goldman Sachs International | 181.280                        | 0,01                 |
| 257.091     | Humana Inc                        | JPMorgan Chase Bank         | 33.134                         | 0,00                 |
| (2.600)     | Huntington Ingalls Industries Inc | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 15.700      | Huntsman Corp                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 9.200       | Huron Consulting Group Inc        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (103.051)   | Husqvarna AB Class B              | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (1.003.725) | Hyatt Hotels Corp Class A         | JPMorgan Chase Bank         | 2.935                          | 0,00                 |
| (3.100)     | Hyatt Hotels Corp Class A         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (71.557)    | IAC Inc                           | Goldman Sachs International | 3.839                          | 0,00                 |
| (191.916)   | IAC Inc                           | JPMorgan Chase Bank         | 18.513                         | 0,00                 |
| (116.052)   | IAC Inc                           | Morgan Stanley              | 5.322                          | 0,00                 |
| 116.905     | Iberdrola SA                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (46.627)    | Icahn Enterprises LP              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.200)     | ICF International Inc             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (14.100)    | Ichor Holdings Ltd                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (162.674)   | ICON Plc                          | Morgan Stanley              | 30.207                         | 0,00                 |
| (1.311.852) | ICON Plc                          | JPMorgan Chase Bank         | 199.796                        | 0,01                 |
| (47.026)    | ICON Plc                          | Goldman Sachs International | 15.025                         | 0,00                 |
| (700)       | ICU Medical Inc                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (6.800)     | IDACORP Inc                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 4.200       | Idec Corp                         | BofA Securities             | 3.991                          | 0,00                 |
| 4.000       | IDEX Corp                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 800         | IDEXX Laboratories Inc            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 160.241     | Idorsia Ltd                       | JPMorgan Chase Bank         | 101.087                        | 0,01                 |
| 14.796      | IG Group Holdings Plc             | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 5.600       | Iida Group Holdings Co Ltd        | BofA Securities             | 194                            | 0,00                 |
| 18.000      | Iino Kaiun Kaisha Ltd             | BofA Securities             | 2.798                          | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung                | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|--------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (40.673)    | Illinois Tool Works Inc              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 496.116     | Illumina Inc                         | Goldman Sachs International | 33.621                         | 0,00                 |
| (6.300)     | Illumina Inc                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 6.661       | IMAX Corp                            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 156.436     | IMI Plc                              | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (277.089)   | Immunocore Holdings Plc              | Morgan Stanley              | 9.692                          | 0,00                 |
| (27.888)    | Immunocore Holdings Plc              | Goldman Sachs International | 1.238                          | 0,00                 |
| (102.275)   | Immunocore Holdings Plc              | JPMorgan Chase Bank         | 5.917                          | 0,00                 |
| (11.131)    | Impax Asset Management Group Plc     | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (1.763.806) | Imperial Oil Ltd                     | JPMorgan Chase Bank         | 74.340                         | 0,00                 |
| (410.209)   | Imperial Oil Ltd                     | Morgan Stanley              | 13.944                         | 0,00                 |
| (5.087)     | Imperial Oil Ltd                     | Goldman Sachs International | 29                             | 0,00                 |
| 10          | Impinj Inc                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 25.268      | Inari Medical Inc                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (148.924)   | Inchcape Plc                         | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 13.041      | Incyte Corp                          | Morgan Stanley              | 1.158                          | 0,00                 |
| 298.531     | Incyte Corp                          | JPMorgan Chase Bank         | 12.004                         | 0,00                 |
| 86.107      | Incyte Corp                          | Goldman Sachs International | 2.194                          | 0,00                 |
| (454.500)   | Independence Holdings Corp           | Goldman Sachs International | 5.500                          | 0,00                 |
| (20.500)    | Independence Realty Trust Inc        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (5.400)     | Independent Bank Corp                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (10.200)    | Independent Bank Group Inc           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (16.000)    | indie Semiconductor Inc Class A      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (13.788)    | Indivior Plc                         | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 75.631      | Indivior Plc                         | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (76.227)    | Infineon Technologies AG             | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 87.600      | Infinera Corp                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 32.019      | Informa Plc                          | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (378.641)   | Informa Plc                          | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (15.700)    | Informatica Inc Class A              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 149.293     | Ingersoll Rand Inc                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 6.885       | Ingevity Corp                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 5.600       | Ingles Markets Inc Class A           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (147.919)   | Ingredion Inc                        | Goldman Sachs International | 900                            | 0,00                 |
| (8.600)     | Ingredion Inc                        | Morgan Stanley              | 32                             | 0,00                 |
| (4.875)     | Inhibrx Inc                          | Goldman Sachs International | 341                            | 0,00                 |
| (28.070)    | Inhibrx Inc                          | JPMorgan Chase Bank         | 2.930                          | 0,00                 |
| 18.700      | Inmode Ltd                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (2.700)     | Innospec Inc                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 900         | Innovative Industrial Properties Inc | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 5.100       | Innoviva Inc                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 603         | Insight Enterprises Inc              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (359.451)   | Insmed Inc                           | Morgan Stanley              | 42.468                         | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile    | Wertpapierbezeichnung                        | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|------------|--|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (2.097)    | Insperty Inc                                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 900        | Inspire Medical Systems Inc                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 2.300      | Installed Building Products Inc              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 23.374.337 | Insulet Corp                                 | Goldman Sachs International | 112.440                        | 0,01                 |
| (3.498)    | Insulet Corp                                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (2.600)    | Intapp Inc                                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (11.400)   | Integer Holdings Corp                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 10.200     | Integra LifeSciences Holdings Corp           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (19.966)   | IntegraFin Holdings Plc                      | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (163.069)  | Integral Ad Science Holding Corp             | Morgan Stanley              | 1.508                          | 0,00                 |
| (101.100)  | Intel Corp                                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (219.872)  | Intel Corp                                   | JPMorgan Chase Bank         | 14.151                         | 0,00                 |
| (411.551)  | Intel Corp                                   | Goldman Sachs International | 77.936                         | 0,00                 |
| 2.000      | Inter Parfums Inc                            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (588.165)  | Interactive Brokers Group Inc Class A        | Goldman Sachs International | 11.028                         | 0,00                 |
| (360.616)  | Interactive Brokers Group Inc Class A        | Morgan Stanley              | 12.487                         | 0,00                 |
| (149.327)  | Interactive Brokers Group Inc Class A        | JPMorgan Chase Bank         | 7.837                          | 0,00                 |
| (6.800)    | Intercontinental Exchange Inc                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (896)      | InterContinental Hotels Group Plc            | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (17.300)   | InterDigital Inc                             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 7.905      | Intermediate Capital Group Plc               | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (6.500)    | International Bancshares Corp                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (31.900)   | International Business Machines Corp         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 68.691     | International Business Machines Corp         | Goldman Sachs International | 28                             | 0,00                 |
| 115.477    | International Consolidated Airlines Group SA | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (236.916)  | International Consolidated Airlines Group SA | Société Générale            | 39.411                         | 0,00                 |
| (762.535)  | International Consolidated Airlines Group SA | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 660.602    | International Flavors & Fragrances Inc       | JPMorgan Chase Bank         | 47.678                         | 0,00                 |
| 10.627     | International Flavors & Fragrances Inc       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (10.100)   | International Game Technology Plc            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 14.200     | International Money Express Inc              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (83.879)   | International Paper Co                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.900)    | International Seaways Inc                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (16.500)   | Interpublic Group of Cos Inc                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (2.258)    | Intertek Group Plc                           | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 19.400.000 | Intesa Sanpaolo SpA                          | Société Générale            | 46.982                         | 0,00                 |
| (42.647)   | Intra-Cellular Therapies Inc                 | Goldman Sachs International | 167                            | 0,00                 |
| (98.280)   | Intra-Cellular Therapies Inc                 | JPMorgan Chase Bank         | 684                            | 0,00                 |
| 2.000      | Intra-Cellular Therapies Inc                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (10.463)   | Intuit Inc                                   | Goldman Sachs International | 53                             | 0,00                 |
| (35.446)   | Intuit Inc                                   | Morgan Stanley              | 2.515                          | 0,00                 |
| (592.714)  | Intuit Inc                                   | JPMorgan Chase Bank         | 56.039                         | 0,00                 |
| (697.424)  | Intuitive Surgical Inc                       | JPMorgan Chase Bank         | 27.415                         | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung          | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|--------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (917.621)   | Intuitive Surgical Inc         | Morgan Stanley              | 48.703                         | 0,00                 |
| (448.857)   | Intuitive Surgical Inc         | Goldman Sachs International | 52.666                         | 0,00                 |
| (18.900)    | InvenTrust Properties Corp     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 13.200      | Invesco Ltd                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 9.793       | Investec Plc                   | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (7.100)     | Invitation Homes Inc           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.338.789) | Ionis Pharmaceuticals Inc      | Goldman Sachs International | 189.957                        | 0,01                 |
| (95.805)    | Ionis Pharmaceuticals Inc      | Morgan Stanley              | 2.589                          | 0,00                 |
| (74.600)    | IonQ Inc                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (290.653)   | Iovance Biotherapeutics Inc    | Morgan Stanley              | 30.469                         | 0,00                 |
| 24.376      | IP Group Plc                   | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 3.300       | IPG Photonics Corp             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (538.979)   | IQVIA Holdings Inc             | Goldman Sachs International | 43.718                         | 0,00                 |
| 2.100       | IQVIA Holdings Inc             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (4.500)     | iRhythm Technologies Inc       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (20.600)    | Iridium Communications Inc     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (51.800)    | Iron Mountain Inc              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (5.000)     | Isetan Mitsukoshi Holdings Ltd | BofA Securities             | 736                            | 0,00                 |
| (74.228)    | ISS A/S                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 113.479     | ITM Power Plc                  | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (4.700)     | Itron Inc                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (8.700)     | ITT Inc                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 342.641     | ITV Plc                        | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (2.000)     | Iwatani Corp                   | BofA Securities             | 2.087                          | 0,00                 |
| (75.604)    | IWG Plc                        | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 500         | J & J Snack Foods Corp         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (17.045)    | J D Wetherspoon Plc            | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (4.900)     | J Front Retailing Co Ltd       | BofA Securities             | 2.581                          | 0,00                 |
| 26.904      | J Sainsbury Plc                | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (59.994)    | Jabil Inc                      | JPMorgan Chase Bank         | 2.454                          | 0,00                 |
| (5.400)     | Jabil Inc                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.600)     | Jack Henry & Associates Inc    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (3.200)     | Jack in the Box Inc            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (18.200)    | Jackson Financial Inc Class A  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (585.225)   | Jacobs Solutions Inc           | Goldman Sachs International | 18.490                         | 0,00                 |
| (158.767)   | Jacobs Solutions Inc           | JPMorgan Chase Bank         | 8.401                          | 0,00                 |
| 6.300       | Jacobs Solutions Inc           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (4.600)     | JAFCO Group Co Ltd             | BofA Securities             | 236                            | 0,00                 |
| (36.400)    | Jamf Holding Corp              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 3.700       | Janus Henderson Group Plc      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 50.500      | Janus International Group Inc  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 10.200      | Japan Post Bank Co Ltd         | BofA Securities             | 2.887                          | 0,00                 |
| 11.000      | Japan Post Insurance Co Ltd    | BofA Securities             | 1.187                          | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile    | Wertpapierbezeichnung              | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|------------|------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 26.057     | Jazz Pharmaceuticals Plc           | Morgan Stanley              | 2.066                          | 0,00                 |
| 88.413     | Jazz Pharmaceuticals Plc           | Goldman Sachs International | 4.917                          | 0,00                 |
| 100        | JB Hunt Transport Services Inc     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 32.900     | JBG SMITH Properties               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 800        | JCR Pharmaceuticals Co Ltd         | BofA Securities             | 91                             | 0,00                 |
| 291.643    | JD Sports Fashion Plc              | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 115.744    | JD.com Inc                         | Morgan Stanley              | 7.707                          | 0,00                 |
| 22.900     | Jefferies Financial Group Inc      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (7.600)    | Jeol Ltd                           | BofA Securities             | 1.622                          | 0,00                 |
| (15.806)   | JET2 Plc                           | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 134.400    | JetBlue Airways Corp               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (17.900)   | JFrog Ltd                          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.200)    | JINS Holdings Inc                  | BofA Securities             | 1.286                          | 0,00                 |
| (2.700)    | JM Smucker Co                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (600)      | JMDC Inc                           | BofA Securities             | 1.232                          | 0,00                 |
| (97.300)   | Joby Aviation Inc                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (3.800)    | John B Sanfilippo & Son Inc        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 4.400      | John Bean Technologies Corp        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (20.400)   | John Wiley & Sons Inc Class A      | Morgan Stanley              | 57.136                         | 0,00                 |
| (18.200)   | Johnson & Johnson                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 95.417     | Johnson Controls International Plc | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (39.638)   | Johnson Matthey Plc                | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (10.900)   | Jones Lang LaSalle Inc             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (14.200)   | JPMorgan Chase & Co                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (5.226)    | JTC Plc                            | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 6.000      | Juniper Networks Inc               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 84.699     | Jupiter Fund Management Plc        | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 13.457.731 | Just Eat Takeaway.com NV           | Société Générale            | 125.361                        | 0,01                 |
| 85.742     | Just Group Plc                     | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (700)      | Justsystems Corp                   | BofA Securities             | 1.640                          | 0,00                 |
| (1.000)    | JVCKenwood Corp                    | BofA Securities             | 96                             | 0,00                 |
| (86.480)   | K+S AG                             | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (2.995)    | Kadant Inc                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 8.100      | Kadokawa Corp                      | BofA Securities             | 13.381                         | 0,00                 |
| (316.060)  | Kahoot! ASA                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (12.521)   | Kainos Group Plc                   | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (3.900)    | Kaiser Aluminum Corp               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 4.800      | Kajima Corp                        | BofA Securities             | 407                            | 0,00                 |
| (8.900)    | Kakaku.com Inc                     | BofA Securities             | 915                            | 0,00                 |
| (2.100)    | Kaken Pharmaceutical Co Ltd        | BofA Securities             | 865                            | 0,00                 |
| 1.000      | Kaneka Corp                        | BofA Securities             | 167                            | 0,00                 |
| 7.700      | Kanematsu Corp                     | BofA Securities             | 5.068                          | 0,00                 |
| (600)      | Kansai Paint Co Ltd                | BofA Securities             | 158                            | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile    | Wertpapierbezeichnung                    | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|------------|--|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 4.900      | Katitas Co Ltd                           | BofA Securities             | 2.863                          | 0,00                 |
| (1.800)    | KB Home                                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (16.200)   | KBR Inc                                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 588.999    | Kellogg Co                               | JPMorgan Chase Bank         | 24.068                         | 0,00                 |
| (11.400)   | Kellogg Co                               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (100.104)  | Kemira OYJ                               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 1.800      | Kemper Corp                              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (88.936)   | Kennametal Inc                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (5.500)    | Kennedy-Wilson Holdings Inc              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (143.625)  | Kenvue Inc                               | Goldman Sachs International | 201                            | 0,00                 |
| (82.803)   | Kenvue Inc                               | Morgan Stanley              | 244                            | 0,00                 |
| 3.429      | Kering SA                                | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 9.390      | Kerry Group Plc                          | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (36.400)   | Keurig Dr Pepper Inc                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (8.300)    | Kewpie Corp                              | BofA Securities             | 544                            | 0,00                 |
| 46.200     | KeyCorp                                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (5.667)    | Keywords Studios Plc                     | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (7.200)    | Kforce Inc                               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 1.223.098  | KGHM Polska Miedz SA                     | Goldman Sachs International | 119                            | 0,00                 |
| (18.200)   | Kilroy Realty Corp                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 2.800      | Kimbell Royalty Partners LP              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 446.258    | Kimberly-Clark Corp                      | Goldman Sachs International | 9.859                          | 0,00                 |
| 305.704    | Kimberly-Clark Corp                      | JPMorgan Chase Bank         | 14.177                         | 0,00                 |
| 736.832    | Kimberly-Clark Corp                      | Morgan Stanley              | 34.316                         | 0,00                 |
| 10.600     | Kimco Realty Corp                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 1.304.107  | Kinder Morgan Inc                        | JPMorgan Chase Bank         | 39.109                         | 0,00                 |
| 45.700     | Kinder Morgan Inc                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (16.900)   | Kinetik Holdings Inc                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 230.544    | Kingfisher Plc                           | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (300.260)  | Kingfisher Plc                           | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 72.000.000 | Kingsoft Corp Ltd                        | Nomura                      | 23.897                         | 0,00                 |
| (3.300)    | Kinsale Capital Group Inc                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (7.900)    | Kintetsu Group Holdings Co Ltd           | BofA Securities             | 4.255                          | 0,00                 |
| (31.650)   | KION Group AG                            | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 8.400      | Kirby Corp                               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (31.176)   | Kite Realty Group Trust                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 7.300      | KKR & Co Inc                             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (16.400)   | KKR Real Estate Finance Trust Inc        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 3.000      | KLA Corp                                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (59.687)   | Klepierre SA                             | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 3.650      | Knife River Corp                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 124.086    | Knight-Swift Transportation Holdings Inc | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (14.800)   | Knowles Corp                             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |



## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung                   | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|---|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (4.000)     | Kobe Steel Ltd                          | BofA Securities             | 54                             | 0,00                 |
| 2.800       | Koei Tecmo Holdings Co Ltd              | BofA Securities             | 1.073                          | 0,00                 |
| 19.000      | Kohl's Corp                             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.900)     | Kohnan Shoji Co Ltd                     | BofA Securities             | 217                            | 0,00                 |
| 5.800       | Kokuyo Co Ltd                           | BofA Securities             | 646                            | 0,00                 |
| 1.500       | Komatsu Ltd                             | BofA Securities             | 2.130                          | 0,00                 |
| (500)       | KOMEDA Holdings Co Ltd                  | BofA Securities             | 128                            | 0,00                 |
| (5.300)     | Komeri Co Ltd                           | BofA Securities             | 3.379                          | 0,00                 |
| (80.956)    | Konecranes OYJ                          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 57.200      | Konica Minolta Inc                      | BofA Securities             | 7.912                          | 0,00                 |
| (25.000)    | Kontoor Brands Inc                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (14.614)    | Korn Ferry                              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 25.500      | Kornit Digital Ltd                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 114.846     | Kosmos Energy Ltd                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (300)       | Kotobuki Spirits Co Ltd                 | BofA Securities             | 594                            | 0,00                 |
| 120.905     | Kraft Heinz Co                          | Morgan Stanley              | 11.055                         | 0,00                 |
| 338.660     | Kraft Heinz Co                          | JPMorgan Chase Bank         | 44.203                         | 0,00                 |
| (7.300)     | Kratos Defense & Security Solutions Inc | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 25.500      | Krispy Kreme Inc                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 199.657     | Kroger Co                               | Goldman Sachs International | 10.643                         | 0,00                 |
| (500)       | Kroger Co                               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 7.800       | Kubota Corp                             | BofA Securities             | 2.020                          | 0,00                 |
| (15.700)    | Kulicke & Soffa Industries Inc          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (2.400)     | Kumagai Gumi Co Ltd                     | BofA Securities             | 643                            | 0,00                 |
| 1.400       | Kuraray Co Ltd                          | BofA Securities             | 49                             | 0,00                 |
| 2.800       | KYB Corp                                | BofA Securities             | 4.230                          | 0,00                 |
| 68.902      | Kymera Therapeutics Inc                 | JPMorgan Chase Bank         | 9.265                          | 0,00                 |
| 46.523      | Kymera Therapeutics Inc                 | Morgan Stanley              | 5.028                          | 0,00                 |
| 38.489      | Kymera Therapeutics Inc                 | Goldman Sachs International | 1.612                          | 0,00                 |
| 66.800      | Kyndryl Holdings Inc                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.100)     | Kyudenko Corp                           | BofA Securities             | 1.800                          | 0,00                 |
| 1.146.856   | L&F Co Ltd                              | Goldman Sachs International | 83.370                         | 0,01                 |
| (102.949)   | L3Harris Technologies Inc               | Morgan Stanley              | 3.179                          | 0,00                 |
| (655.038)   | L3Harris Technologies Inc               | Goldman Sachs International | 35.422                         | 0,00                 |
| (392.771)   | L3Harris Technologies Inc               | JPMorgan Chase Bank         | 21.505                         | 0,00                 |
| (3.000)     | Laboratory Corp of America Holdings     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 13.600      | Ladder Capital Corp                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 2.700       | Lakeland Bancorp Inc                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 7.200       | Lakeland Financial Corp                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (3.000)     | Lam Research Corp                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 3.800       | Lamar Advertising Co Class A            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.501.179) | Lamb Weston Holdings Inc                | Goldman Sachs International | 276.213                        | 0,01                 |
| (700)       | Lamb Weston Holdings Inc                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung            | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|----------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 13.287      | Lancashire Holdings Ltd          | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (2.600)     | Lancaster Colony Corp            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 30.310      | Land Securities Group Plc        | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 2.200       | Landstar System Inc              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (30.381)    | LANXESS AG                       | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (32.956)    | Las Vegas Sands Corp             | Goldman Sachs International | 389                            | 0,00                 |
| (28.041)    | Lattice Semiconductor Corp       | Goldman Sachs International | 765                            | 0,00                 |
| (229.023)   | Lattice Semiconductor Corp       | JPMorgan Chase Bank         | 243                            | 0,00                 |
| 8.800       | Lattice Semiconductor Corp       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (47.500)    | Laureate Education Inc           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (911.000)   | Lazard Growth Acquisition Corp I | Goldman Sachs International | 8.000                          | 0,00                 |
| 1.055.922   | Lazard Ltd Class A               | JPMorgan Chase Bank         | 99.851                         | 0,01                 |
| (14.000)    | La-Z-Boy Inc                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (5.000)     | LCI Industries                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (40.682)    | Lear Corp                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (68.870)    | Learning Technologies Group Plc  | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 37.855      | Legal & General Group Plc        | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 88.098      | Legalzoom.com Inc                | Morgan Stanley              | 18                             | 0,00                 |
| (858.484)   | Legend Biotech Corp              | JPMorgan Chase Bank         | 235.030                        | 0,01                 |
| (92.365)    | Legend Biotech Corp              | Morgan Stanley              | 37.097                         | 0,00                 |
| 18.500      | Leggett & Platt Inc              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 60.279      | Legrand SA                       | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 7.100       | Leidos Holdings Inc              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (900)       | LeMaitre Vascular Inc            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (7.300)     | Lemonade Inc                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 40.700      | LendingClub Corp                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 400         | Lennar Corp Class A              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 100         | Lennar Corp Class B              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.862.986) | Lennox International Inc         | JPMorgan Chase Bank         | 139.770                        | 0,01                 |
| (142.084)   | Lennox International Inc         | Goldman Sachs International | 1.922                          | 0,00                 |
| (989.453)   | Lennox International Inc         | Morgan Stanley              | 42.539                         | 0,00                 |
| 14.900      | Leonardo DRS Inc                 | Morgan Stanley              | 11.131                         | 0,00                 |
| 128.967     | Leonardo SpA                     | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (14.600)    | Leslie's Inc                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 429.332     | Levi Strauss & Co Class A        | JPMorgan Chase Bank         | 834                            | 0,00                 |
| (48.900)    | Levi Strauss & Co Class A        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (9.600)     | LGI Homes Inc                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (75.385)    | Liberty Broadband Corp Class C   | Goldman Sachs International | 482                            | 0,00                 |
| (194.470)   | Liberty Broadband Corp Class C   | JPMorgan Chase Bank         | 8.447                          | 0,00                 |
| (27.907)    | Liberty Broadband Corp Class C   | Morgan Stanley              | 810                            | 0,00                 |
| 4.300       | Liberty Broadband Corp Class A   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 8.214       | Liberty Broadband Corp Class C   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 54.600      | Liberty Energy Inc               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung                          | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|--|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 30.300      | Liberty Global Plc Class A                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 64.400      | Liberty Global Plc Class C                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 26.200      | Liberty Latin America Ltd Class C              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (15.000)    | Liberty Media Corp Liberty Formula One Class C | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (10.600)    | Liberty Media Corp Liberty SiriusXM Class A    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (3.100)     | Liberty Media Corp Liberty SiriusXM Class C    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (2.600)     | Liberty Media Corp-Liberty Formula One Class A | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (326.101)   | Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM            | JPMorgan Chase Bank         | 24.911                         | 0,00                 |
| (30.180)    | Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM            | Morgan Stanley              | 2.520                          | 0,00                 |
| (138.264)   | Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM            | Goldman Sachs International | 19.474                         | 0,00                 |
| (59.700)    | Li-Cycle Holdings Corp                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (487.768)   | Life Time Group Holdings Inc                   | Morgan Stanley              | 36.477                         | 0,00                 |
| (51.500)    | LifeStance Health Group Inc                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (2.600)     | Ligand Pharmaceuticals Inc                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (200)       | Lincoln Electric Holdings Inc                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 21.800      | Lincoln National Corp                          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (767.445)   | Linde Plc                                      | Goldman Sachs International | 40.985                         | 0,00                 |
| (125.771)   | Linde Plc                                      | JPMorgan Chase Bank         | 9.157                          | 0,00                 |
| 21.623      | Linde Plc                                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (500)       | Lindsay Corp                                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 62.900      | Lions Gate Entertainment Corp Class A          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 79.300      | Lions Gate Entertainment Corp Class B          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (4.256)     | Liontrust Asset Management Plc                 | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (7.000)     | Lithia Motors Inc                              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (645.912)   | Lithia Motors Inc Class A                      | Morgan Stanley              | 175.516                        | 0,01                 |
| (100)       | Littelfuse Inc                                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (4.000)     | LivaNova Plc                                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (4.700)     | Live Nation Entertainment Inc                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 9.000       | Live Oak Bancshares Inc                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (28.100)    | Livent Corp                                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 319.200     | LivePerson Inc                                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (4.200)     | LiveRamp Holdings Inc                          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.900)     | LKQ Corp                                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (2.451.058) | Lloyds Banking Group Plc                       | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (988.117)   | Lockheed Martin Corp                           | JPMorgan Chase Bank         | 15.628                         | 0,00                 |
| (39.620)    | Lockheed Martin Corp                           | Goldman Sachs International | 16.884                         | 0,00                 |
| (6.820)     | Lockheed Martin Corp                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 19.000      | Loews Corp                                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (11.788)    | London Stock Exchange Group Plc                | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 151.219     | LondonMetric Property Plc                      | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (2.525)     | Lonza Group AG                                 | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (3.605)     | L'Oreal SA                                     | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (2.005.834) | Lowe's Cos Inc                                 | JPMorgan Chase Bank         | 144.096                        | 0,01                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung                     | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|---|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 6.600       | Lowe's Cos Inc                            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.066.002) | LPL Financial Holdings Inc                | Goldman Sachs International | 115.489                        | 0,01                 |
| 2.600       | LPL Financial Holdings Inc                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 18.572      | LSB Industries Inc                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (13.500)    | LTC Properties Inc                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 157.800     | Lucid Group Inc                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 38.248      | Lululemon Athletica Inc                   | Goldman Sachs International | 120                            | 0,00                 |
| (2.095.529) | Lululemon Athletica Inc                   | JPMorgan Chase Bank         | 97.746                         | 0,01                 |
| (9.900)     | Lumentum Holdings Inc                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (153.374)   | Luminar Technologies Inc                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 6.850.000   | Luminar Technologies Inc                  | Goldman Sachs International | 34.536                         | 0,00                 |
| 1.582       | LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE       | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 77.399      | LXI REIT Plc                              | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 78.800      | LXP Industrial Trust                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 5.326.738   | Lyft Inc Class A                          | Goldman Sachs International | 751.016                        | 0,03                 |
| (233.846)   | LyondellBasell Industries NV Class A      | Goldman Sachs International | 7.363                          | 0,00                 |
| (1.500)     | M&A Capital Partners Co Ltd               | BofA Securities             | 1.398                          | 0,00                 |
| (149.892)   | M&G Plc                                   | BofA Securities             | 103                            | 0,00                 |
| (12.824)    | M&T Bank Corp                             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (3.400)     | M/I Homes Inc                             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 4.900       | M3 Inc                                    | BofA Securities             | 1.153                          | 0,00                 |
| 47.300      | Macerich Co                               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 7.794       | MACOM Technology Solutions Holdings Inc   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (17.900)    | Macy's Inc                                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 15.300      | Madison Square Garden Entertainment Corp  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 202         | Madison Square Garden Sports Corp Class A | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (21.300)    | Magellan Midstream Partners LP            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (82.950)    | Magna International Inc                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 14.400      | Magnite Inc                               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 700         | Magnolia Oil & Gas Corp Class A           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (27.900)    | MakeMyTrip Ltd                            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 5.300       | Malibu Boats Inc Class A                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (268.988)   | Man Group Plc                             | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (26.200)    | Manchester United Plc                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (500)       | Manhattan Associates Inc                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 11.900      | Mani Inc                                  | BofA Securities             | 1.221                          | 0,00                 |
| (26.999)    | ManpowerGroup Inc                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (56.200)    | Marathon Digital Holdings Inc             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 158.597     | Marathon Oil Corp                         | Goldman Sachs International | 3.833                          | 0,00                 |
| (471.354)   | Marathon Oil Corp                         | Morgan Stanley              | 13.781                         | 0,00                 |
| (160.046)   | Marathon Petroleum Corp                   | JPMorgan Chase Bank         | 3.874                          | 0,00                 |
| (1.467.910) | Marathon Petroleum Corp                   | Morgan Stanley              | 80.937                         | 0,01                 |
| 72.200      | Maravai LifeSciences Holdings Inc Class A | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung               | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|-------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (2.500)     | Marcus & Millichap Inc              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 400         | Markel Group Inc                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 4.400       | MarketAxess Holdings Inc            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 24.138      | Marks & Spencer Group Plc           | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (600)       | Marriott International Inc Class A  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 11.797.874  | Marriott Vacations Worldwide Corp   | Goldman Sachs International | 1.703.941                      | 0,08                 |
| (5.200)     | Marsh & McLennan Cos Inc            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 31.169      | Marshalls Plc                       | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 11.900      | Marten Transport Ltd                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.696.945) | Martin Marietta Materials Inc       | Goldman Sachs International | 265.594                        | 0,01                 |
| (280.874)   | Martin Marietta Materials Inc       | Morgan Stanley              | 24.445                         | 0,00                 |
| (568.625)   | Martin Marietta Materials Inc       | JPMorgan Chase Bank         | 78.184                         | 0,00                 |
| 100         | Marubeni Corp                       | BofA Securities             | 14                             | 0,00                 |
| 200         | Maruichi Steel Tube Ltd             | BofA Securities             | 129                            | 0,00                 |
| 249.000     | Marvell Technology Inc              | Goldman Sachs International | 301                            | 0,00                 |
| (50.493)    | Marvell Technology Inc              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (36.837)    | Masco Corp                          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.900)     | Masimo Corp                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 2.300       | Masonite International Corp         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (286.162)   | MasTec Inc                          | JPMorgan Chase Bank         | 4.040                          | 0,00                 |
| (253.077)   | MasTec Inc                          | Morgan Stanley              | 4.019                          | 0,00                 |
| (234.600)   | Mastercard Inc Class A              | Goldman Sachs International | 6.082                          | 0,00                 |
| (210.269)   | Mastercard Inc Class A              | JPMorgan Chase Bank         | 13.342                         | 0,00                 |
| (99.649)    | Mastercard Inc Class A              | Morgan Stanley              | 5.557                          | 0,00                 |
| (12.298)    | Matador Resources Co                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (81.473)    | Match Group Inc                     | JPMorgan Chase Bank         | 3.944                          | 0,00                 |
| (88)        | Materion Corp                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 3.600       | Matson Inc                          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.860)     | MatsukiyoCocokara & Co              | BofA Securities             | 1.919                          | 0,00                 |
| 6.000       | Mattel Inc                          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (5.400)     | Matthews International Corp Class A | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 119.862     | Maxeon Solar Technologies Ltd       | JPMorgan Chase Bank         | 1.173                          | 0,00                 |
| 10.200      | Maxeon Solar Technologies Ltd       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 2.300       | MAXIMUS Inc                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (2.803)     | MaxLinear Inc Class A               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.000.965) | McCormick & Co Inc                  | Morgan Stanley              | 55.845                         | 0,00                 |
| (856.132)   | McCormick & Co Inc                  | Goldman Sachs International | 57.043                         | 0,00                 |
| (8.700)     | McDonald's Corp                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (100)       | McDonald's Holdings Co Japan Ltd    | BofA Securities             | 145                            | 0,00                 |
| (6.400)     | McGrath RentCorp                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (2.170.348) | McKesson Corp                       | Goldman Sachs International | 178.194                        | 0,01                 |
| (330.832)   | McKesson Corp                       | JPMorgan Chase Bank         | 31.957                         | 0,00                 |
| (387.009)   | McKesson Corp                       | Morgan Stanley              | 31.680                         | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung            | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|----------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 11.044      | MDC Holdings Inc                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (11.100)    | MDU Resources Group Inc          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (379.324)   | Medical Properties Trust Inc     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (2.100)     | Medifast Inc                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 3.200       | Medpace Holdings Inc             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (6.300)     | Medtronic Plc                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.459.758) | Medtronic Plc                    | Goldman Sachs International | 10.925                         | 0,00                 |
| 7.000.000   | Meituan                          | Nomura                      | 1.295                          | 0,00                 |
| 414.204     | Meituan Class B                  | Goldman Sachs International | 3.088                          | 0,00                 |
| 3.129.842   | Meituan Class B                  | Société Générale            | 981.187                        | 0,04                 |
| 113.370     | Meituan Class B                  | JPMorgan Chase Bank         | 1.837                          | 0,00                 |
| (313.188)   | Melrose Industries Plc           | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 2.133.733   | Melrose Industries Plc           | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 98.529.669  | Menicon Co Ltd                   | Société Générale            | 93.395                         | 0,01                 |
| 2.400       | MercadoLibre Inc                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 37.259      | Mercedes-Benz Group AG           | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (1.164.980) | Merck & Co Inc                   | Goldman Sachs International | 29.709                         | 0,00                 |
| (14.800)    | Merck & Co Inc                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 1.043.468   | Merck KGaA                       | JPMorgan Chase Bank         | 96.750                         | 0,01                 |
| 706.003     | Merck KGaA                       | Morgan Stanley              | 16.506                         | 0,00                 |
| 1.100       | Mercury General Corp             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 800         | Mercury Systems Inc              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 3.200       | Merit Medical Systems Inc        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (3.002)     | Meritage Homes Corp              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (74.211)    | Merus NV                         | JPMorgan Chase Bank         | 13.988                         | 0,00                 |
| (402.399)   | Merus NV                         | Goldman Sachs International | 155.874                        | 0,01                 |
| 2.500       | Mesa Laboratories Inc            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (28.052)    | Meta Platforms Inc               | Goldman Sachs International | 546                            | 0,00                 |
| (109.320)   | Meta Platforms Inc Class A       | Goldman Sachs International | 14.795                         | 0,00                 |
| (524.161)   | Meta Platforms Inc Class A       | JPMorgan Chase Bank         | 29.496                         | 0,00                 |
| (1.326.033) | Meta Platforms Inc Class A       | Morgan Stanley              | 363.824                        | 0,02                 |
| 8.800       | Methode Electronics Inc          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 15.600      | MetLife Inc                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (255.097)   | Metso OYJ                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 1.200       | Mettler-Toledo International Inc | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 5.080.101   | Meyer Burger Technology AG       | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 102.200     | MFA Financial Inc                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (5.700)     | MGE Energy Inc                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (18.142)    | MGIC Investment Corp             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 13.900      | MGM Resorts International        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 12.584      | MGM Resorts International        | JPMorgan Chase Bank         | 266                            | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung                 | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|---------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 3.900       | MGP Ingredients Inc                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 10.900      | Microchip Technology Inc              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 15.616      | Micron Technology Inc                 | Goldman Sachs International | 1.195                          | 0,00                 |
| (26.228)    | Micron Technology Inc                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.360.496) | Microsoft Corp                        | Morgan Stanley              | 228.551                        | 0,02                 |
| 50.492      | Microsoft Corp                        | Goldman Sachs International | 579                            | 0,00                 |
| (1.334.382) | Microsoft Corp                        | JPMorgan Chase Bank         | 28.892                         | 0,00                 |
| (6.200)     | Mid-America Apartment Communities Inc | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (6.307)     | Middlesex Water Co                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 2.200       | Milbon Co Ltd                         | BofA Securities             | 677                            | 0,00                 |
| 22.012      | MillerKnoll Inc                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 900         | Mimasu Semiconductor Industry Co Ltd  | BofA Securities             | 362                            | 0,00                 |
| 2.900       | Minebea Mitsumi Inc                   | BofA Securities             | 788                            | 0,00                 |
| 4.893       | Minerals Technologies Inc             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 4.100       | MIRAIT ONE corp                       | BofA Securities             | 367                            | 0,00                 |
| (57.700)    | Mister Car Wash Inc                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 69.194      | Mitie Group Plc                       | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 16.000      | Mitsubishi Chemical Group Corp        | BofA Securities             | 4.092                          | 0,00                 |
| (19.000)    | Mitsubishi Electric Corp              | BofA Securities             | 1.231                          | 0,00                 |
| (10.100)    | Mitsubishi Estate Co Ltd              | BofA Securities             | 2.652                          | 0,00                 |
| (4.800)     | Mitsubishi Gas Chemical Co Inc        | BofA Securities             | 1.241                          | 0,00                 |
| 98.300      | Mitsubishi Motors Corp                | BofA Securities             | 17.233                         | 0,00                 |
| 2.500       | Mitsuboshi Belting Ltd                | BofA Securities             | 452                            | 0,00                 |
| (3.000)     | Mitsui & Co Ltd                       | BofA Securities             | 6.469                          | 0,00                 |
| 1.300       | Mitsui High-Tec Inc                   | BofA Securities             | 2.731                          | 0,00                 |
| (1.400)     | Mitsui Mining & Smelting Co Ltd       | BofA Securities             | 1.286                          | 0,00                 |
| 5.100       | Mitsui-Soko Holdings Co Ltd           | BofA Securities             | 1.305                          | 0,00                 |
| 2.500       | Mizuho Financial Group Inc            | BofA Securities             | 130                            | 0,00                 |
| (1.600)     | Mizuno Corp                           | BofA Securities             | 740                            | 0,00                 |
| (3.943)     | MKS Instruments Inc                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (4.049)     | Mobico Group Plc                      | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 55.689      | Mobileye Global Inc Class A           | JPMorgan Chase Bank         | 569                            | 0,00                 |
| 145.610     | Mobileye Global Inc Class A           | Morgan Stanley              | 15.987                         | 0,00                 |
| (4.900)     | Model N Inc                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 497.713     | Moderna Inc                           | JPMorgan Chase Bank         | 25.835                         | 0,00                 |
| 56.385      | Moderna Inc                           | Morgan Stanley              | 2.281                          | 0,00                 |
| 900         | Modine Manufacturing Co               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (4.000)     | ModivCare Inc                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (11.800)    | Moelis & Co Class A                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (3.300)     | Mohawk Industries Inc                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (5.100)     | Molina Healthcare Inc                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung                | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|--------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (6.400)   | Molson Coors Beverage Co Class B     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (6.900)   | Monarch Casino & Resort Inc          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 6.700     | Monday.com Ltd                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 326.791   | Mondelez International Inc Class A   | JPMorgan Chase Bank         | 20.758                         | 0,00                 |
| 51.127    | Mondelez International Inc Class A   | Goldman Sachs International | 121                            | 0,00                 |
| (674.031) | Mondelez International Inc Class A   | Morgan Stanley              | 96.744                         | 0,00                 |
| (97.459)  | Mondi Plc                            | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 4.100     | Monex Group Inc                      | BofA Securities             | 621                            | 0,00                 |
| (500)     | Money Forward Inc                    | BofA Securities             | 2.572                          | 0,00                 |
| 51.203    | Moneysupermarket.com Group Plc       | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (1.903)   | MongoDB Inc                          | JPMorgan Chase Bank         | 147                            | 0,00                 |
| (5.200)   | MongoDB Inc                          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (11.224)  | Monolithic Power Systems Inc         | Goldman Sachs International | 100                            | 0,00                 |
| (28.632)  | Monolithic Power Systems Inc         | JPMorgan Chase Bank         | 486                            | 0,00                 |
| (87.705)  | Monolithic Power Systems Inc         | Morgan Stanley              | 3.119                          | 0,00                 |
| 22.100    | Monro Inc                            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 27.200    | Monster Beverage Corp                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 900       | Montrose Environmental Group Inc     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 2.600     | Moody's Corp                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 600       | Moog Inc Class A                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 35.800    | Morgan Stanley                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (3.200)   | Morinaga & Co Ltd                    | BofA Securities             | 1.522                          | 0,00                 |
| (700)     | Morningstar Inc                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (207.820) | MorphoSys AG                         | Goldman Sachs International | 209.476                        | 0,01                 |
| (211.973) | MorphoSys AG                         | Morgan Stanley              | 207.321                        | 0,01                 |
| 800       | MOS Food Services Inc                | BofA Securities             | 195                            | 0,00                 |
| (43.219)  | Mosaic Co                            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (197.350) | Motorola Solutions Inc               | JPMorgan Chase Bank         | 9.584                          | 0,00                 |
| (28.946)  | Motorola Solutions Inc               | Goldman Sachs International | 574                            | 0,00                 |
| (141.782) | Motorola Solutions Inc               | Morgan Stanley              | 13.164                         | 0,00                 |
| (5.600)   | MP Materials Corp                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 40.900    | MPLX LP                              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 15.900    | Mr Cooper Group Inc                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 1.951.886 | Mr Price Group Ltd                   | Goldman Sachs International | 6.834                          | 0,00                 |
| (1.300)   | MRC Global Inc                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 3.100     | MS&AD Insurance Group Holdings Inc   | BofA Securities             | 29                             | 0,00                 |
| (5.113)   | MSA Safety Inc                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (3.915)   | MSC Industrial Direct Co Inc Class A | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 2.017     | MSCI Inc                             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (11.557)  | MTU Aero Engines AG                  | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (10.000)  | Mueller Industries Inc               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |



## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung               | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|-------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (16.072)    | Mueller Water Products Inc Class A  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 300         | Murata Manufacturing Co Ltd         | BofA Securities             | 197                            | 0,00                 |
| (21.862)    | Murphy Oil Corp                     | JPMorgan Chase Bank         | 2.420                          | 0,00                 |
| (2.638)     | Murphy Oil Corp                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 9.300       | Musashi Seimitsu Industry Co Ltd    | BofA Securities             | 617                            | 0,00                 |
| 12          | MYR Group Inc                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 18.757      | N-able Inc Class A                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 5.300       | Nabors Industries Ltd               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (29.600)    | Nano-X Imaging Ltd                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 19.833      | Napco Security Technologies Inc     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 795.543     | Nasdaq Inc                          | Goldman Sachs International | 105.830                        | 0,01                 |
| 420         | Nasdaq Inc                          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (7.554.679) | Naspers Ltd                         | Goldman Sachs International | 8.945                          | 0,00                 |
| (9.222.121) | Naspers Ltd                         | JPMorgan Chase Bank         | 24.105                         | 0,00                 |
| 19.808      | National Bank Holdings Corp Class A | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 10.500      | National Beverage Corp              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 2.294.158   | National Fuel Gas Co                | JPMorgan Chase Bank         | 323.269                        | 0,02                 |
| (6.490)     | National Fuel Gas Co                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (16.313)    | National Grid Plc                   | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (2.084)     | National Health Investors Inc       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (280.522)   | National Instruments Corp           | Morgan Stanley              | 39.378                         | 0,00                 |
| 19.006      | National Storage Affiliates Trust   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 53.100      | National Vision Holdings Inc        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (89.476)    | NatWest Group Plc                   | BofA Securities             | 32                             | 0,00                 |
| 22.700.000  | NatWest Group Plc                   | Société Générale            | 480.806                        | 0,02                 |
| (239.093)   | NAURA Technology Group Co Ltd       | JPMorgan Chase Bank         | 811                            | 0,00                 |
| (4.069)     | NAURA Technology Group Co Ltd       | Morgan Stanley              | 215                            | 0,00                 |
| (14.137)    | Navient Corp                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 17.585      | Navitas Semiconductor Corp          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 4.791       | NBT Bancorp Inc                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (137.422)   | nCino Inc                           | JPMorgan Chase Bank         | 33.716                         | 0,00                 |
| (40.507)    | nCino Inc                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 3.900.000   | NCL Corp Ltd                        | Nomura                      | 807.200                        | 0,04                 |
| (32.775)    | NCR Corp                            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (72.800)    | Necessity Retail REIT Inc           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.985.085) | Nedbank Group Ltd                   | Morgan Stanley              | 1.547                          | 0,00                 |
| (464.979)   | NEL ASA                             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (61.606)    | Neogen Corp                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 60.209      | NeoGenomics Inc                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (74.177)    | Nestle SA                           | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 989         | NetApp Inc                          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung              | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (27.894)  | Netflix Inc                        | JPMorgan Chase Bank         | 233                            | 0,00                 |
| (25.774)  | Netflix Inc                        | Morgan Stanley              | 1.474                          | 0,00                 |
| 4.977     | NetScout Systems Inc               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 20.847    | NETSTREIT Corp                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (160.090) | Network International Holdings Plc | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 65.447    | Neurocrine Biosciences Inc         | Goldman Sachs International | 231                            | 0,00                 |
| 17.120    | Neurocrine Biosciences Inc         | Morgan Stanley              | 886                            | 0,00                 |
| 6.663     | Nevro Corp                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 44.956    | New Fortress Energy Inc Class A    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (9.603)   | New Jersey Resources Corp          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (4.241)   | New Relic Inc                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (109.224) | New York Community Bancorp Inc     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 73.200    | New York Mortgage Trust Inc        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (22.897)  | New York Times Co Class A          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 564.295   | Newell Brands Inc                  | JPMorgan Chase Bank         | 130.547                        | 0,01                 |
| 14.410    | Newell Brands Inc                  | Goldman Sachs International | 496                            | 0,00                 |
| 5.488     | Newmark Group Inc Class A          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 200       | NewMarket Corp                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (22.261)  | Newmont Corp                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 38.861    | News Corp Class A                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 31.488    | News Corp Class B                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (18.580)  | Nexans SA                          | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 10.400    | NexPoint Residential Trust Inc     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 3.207     | Nexstar Media Group Inc Class A    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 7.943     | Next 15 Group Plc                  | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 2.196     | Next Plc                           | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (9.000)   | Nextage Co Ltd                     | BofA Securities             | 4.590                          | 0,00                 |
| (59.064)  | NextDecade Corp                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 6.590     | NextEra Energy Inc                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 3.219.115 | NextEra Energy Partners LP         | Goldman Sachs International | 188.750                        | 0,01                 |
| (1.657)   | NextGen Healthcare Inc             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (67.389)  | NexTier Oilfield Solutions Inc     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (3.000)   | NH Foods Ltd                       | BofA Securities             | 987                            | 0,00                 |
| 2.100     | NHK Spring Co Ltd                  | BofA Securities             | 268                            | 0,00                 |
| (181.158) | Nibe Industrier AB                 | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (1.400)   | Nichirei Corp                      | BofA Securities             | 757                            | 0,00                 |
| 2.900     | Nifco Inc                          | BofA Securities             | 6.450                          | 0,00                 |
| 23.749    | NIKE Inc Class B                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (3.800)   | Nikkon Holdings Co Ltd             | BofA Securities             | 277                            | 0,00                 |
| (17.800)  | Ninety One Plc                     | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 200       | Nintendo Co Ltd                    | BofA Securities             | 365                            | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung             | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|-----------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (1.000)     | Nippon Electric Glass Co Ltd      | BofA Securities             | 666                            | 0,00                 |
| 15.400      | Nippon Paint Holdings Co Ltd      | BofA Securities             | 5.256                          | 0,00                 |
| 7.500       | Nippon Parking Development Co Ltd | BofA Securities             | 33                             | 0,00                 |
| 15.100      | Nippon Steel Corp                 | BofA Securities             | 10.058                         | 0,00                 |
| 1.900       | Nippon Television Holdings Inc    | BofA Securities             | 67                             | 0,00                 |
| 7.700       | Nippon Yusen KK                   | BofA Securities             | 4.066                          | 0,00                 |
| 36.400      | Nipro Corp                        | Société Générale            | 252                            | 0,00                 |
| (2.600)     | Nipro Corp                        | BofA Securities             | 373                            | 0,00                 |
| (3.700)     | Nishimatsuya Chain Co Ltd         | BofA Securities             | 284                            | 0,00                 |
| 42.422      | NiSource Inc                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 47.300      | Nissan Motor Co Ltd               | BofA Securities             | 12.365                         | 0,00                 |
| (15.700)    | Nisshin Seifun Group Inc          | BofA Securities             | 9.587                          | 0,00                 |
| 8.800       | Nisshinbo Holdings Inc            | BofA Securities             | 4.058                          | 0,00                 |
| 2.100       | Niterra Co Ltd                    | BofA Securities             | 2.468                          | 0,00                 |
| (15.700)    | Nitto Boseki Co Ltd               | BofA Securities             | 22.976                         | 0,00                 |
| 15.110      | NMI Holdings Inc Class A          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 25.284      | NNN REIT Inc                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (9.505)     | Noble Corp Plc                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (159.950)   | Nokian Renkaat OYJ                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 42.333      | Nomad Foods Ltd                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 8.800       | Nomura Holdings Inc               | BofA Securities             | 1.964                          | 0,00                 |
| (75.458)    | Nordex SE                         | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (6.299)     | Nordson Corp                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (52.300)    | Nordstrom Inc                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.037.786) | Nordstrom Inc                     | JPMorgan Chase Bank         | 135.574                        | 0,01                 |
| (460.818)   | Norfolk Southern Corp             | Goldman Sachs International | 19.373                         | 0,00                 |
| (299.200)   | Norfolk Southern Corp             | JPMorgan Chase Bank         | 20.928                         | 0,00                 |
| 19.470      | Norfolk Southern Corp             | Morgan Stanley              | 34                             | 0,00                 |
| 37.700      | North Pacific Bank Ltd            | BofA Securities             | 4.038                          | 0,00                 |
| (27.830)    | Northern Oil & Gas Inc            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 2.510       | Northern Trust Corp               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (13.282)    | Northrop Grumman Corp             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 21.663      | Northwest Bancshares Inc          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 11.400      | Northwest Natural Holding Co      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 2.400       | NorthWestern Corp                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 1.659.504   | NOV Inc                           | JPMorgan Chase Bank         | 379.901                        | 0,02                 |
| 14.600      | NOV Inc                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (5.387)     | Nova Ltd                          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (3.203)     | Novanta Inc                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (125.832)   | Novartis AG                       | JPMorgan Chase Bank         | 414                            | 0,00                 |
| 29.074      | Novo Nordisk A/S                  | Goldman Sachs International | 1.089                          | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung           | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|---------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 176.680     | Novo Nordisk A/S                | Morgan Stanley              | 1.264                          | 0,00                 |
| 8.115       | Novocure Ltd                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (64.125)    | Novozymes A/S Class B           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (20.700)    | NOW Inc                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (10.633)    | NRG Energy Inc                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 4.800       | NS United Kaiun Kaisha Ltd      | BofA Securities             | 887                            | 0,00                 |
| 66.700      | NTN Corp                        | BofA Securities             | 8.716                          | 0,00                 |
| 300         | NTT Data Corp                   | BofA Securities             | 39                             | 0,00                 |
| (60.304)    | NU Holdings Ltd Class A         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 131.628     | Nu Skin Enterprises Inc Class A | JPMorgan Chase Bank         | 17.479                         | 0,00                 |
| (4.845)     | Nu Skin Enterprises Inc Class A | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.801)     | Nucor Corp                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 26.305      | NuStar Energy LP                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 31.407      | Nutanix Inc Class A             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (5.994)     | NV5 Global Inc                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (133.649)   | nVent Electric Plc              | JPMorgan Chase Bank         | 10.051                         | 0,00                 |
| (277.751)   | nVent Electric Plc              | Morgan Stanley              | 16.649                         | 0,00                 |
| (665.976)   | NVIDIA Corp                     | Morgan Stanley              | 242.028                        | 0,02                 |
| (1.554.726) | NVIDIA Corp                     | JPMorgan Chase Bank         | 161.208                        | 0,01                 |
| (364.158)   | NVIDIA Corp                     | Goldman Sachs International | 37.604                         | 0,00                 |
| 300         | NVR Inc                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 2.104       | NXP Semiconductors NV           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (8.400)     | Oaktree Specialty Lending Corp  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 5.000       | Obayashi Corp                   | BofA Securities             | 1.472                          | 0,00                 |
| 4.565.630   | Ocado Group Plc                 | Société Générale            | 204.798                        | 0,02                 |
| (18.041)    | Ocado Group Plc                 | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (487.461)   | Occidental Petroleum Corp       | JPMorgan Chase Bank         | 12.509                         | 0,00                 |
| 23.458      | Occidental Petroleum Corp       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (12.794)    | Oceaneering International Inc   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (10.711)    | OceanFirst Financial Corp       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 5.300       | Odakyu Electric Railway Co Ltd  | BofA Securities             | 245                            | 0,00                 |
| 1.604       | ODP Corp                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 4.491       | OFG Bancorp                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 8.514       | OGE Energy Corp                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 19.388      | O-I Glass Inc                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 2.200       | Oisix ra daichi Inc             | BofA Securities             | 1.344                          | 0,00                 |
| (100)       | Okamura Corp                    | BofA Securities             | 33                             | 0,00                 |
| 300         | Okasan Securities Group Inc     | BofA Securities             | 5                              | 0,00                 |
| 14.226.504  | Okta Inc                        | Goldman Sachs International | 762.989                        | 0,03                 |
| 19.291      | Olaplex Holdings Inc            | Goldman Sachs International | 6                              | 0,00                 |
| (11.872)    | Old Dominion Freight Line Inc   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung               | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|-------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (49.443)    | Old National Bancorp                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 11.591      | Old Republic International Corp     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 7.721       | Olin Corp                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 8.827       | Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 5.500       | Olympus Corp                        | BofA Securities             | 2.707                          | 0,00                 |
| 19.176      | Omega Healthcare Investors Inc      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 8.951       | Omnicell Inc                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (7.812)     | Omnicom Group Inc                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 3.200       | Omron Corp                          | BofA Securities             | 1.555                          | 0,00                 |
| (47.208)    | On Holding AG Class A               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (274.284)   | ON Semiconductor Corp               | Morgan Stanley              | 56.156                         | 0,00                 |
| (224.616)   | ON Semiconductor Corp               | JPMorgan Chase Bank         | 10.738                         | 0,00                 |
| (1.600)     | ONE Gas Inc                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (13.495)    | OneMain Holdings Inc                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (18.294)    | OneSpaWorld Holdings Ltd            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (5.900)     | Ono Pharmaceutical Co Ltd           | BofA Securities             | 3.684                          | 0,00                 |
| (4.312)     | Onto Innovation Inc                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 47.400      | Open Lending Corp Class A           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (5.000)     | Open Up Group Inc                   | BofA Securities             | 1.537                          | 0,00                 |
| 30.350      | OPENLANE Inc                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (717)       | Option Care Health Inc              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.100)     | Optorun Co Ltd                      | BofA Securities             | 13                             | 0,00                 |
| (233.582)   | Oracle Corp                         | Morgan Stanley              | 77.138                         | 0,00                 |
| (600)       | Oracle Corp Japan                   | BofA Securities             | 3.494                          | 0,00                 |
| 18.016      | Orchid Island Capital Inc           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (100)       | O'Reilly Automotive Inc             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (22.007)    | Organon & Co                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 600         | Oriental Land Co Ltd                | BofA Securities             | 1.202                          | 0,00                 |
| (20)        | Orion Office REIT Inc               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 254.587     | Orion Oyj                           | Goldman Sachs International | 9.451                          | 0,00                 |
| 489.718     | Orion Oyj                           | JPMorgan Chase Bank         | 68.760                         | 0,00                 |
| 27.246      | Orion SA                            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 1.600       | ORIX Corp                           | BofA Securities             | 94                             | 0,00                 |
| 6.903.127   | Ormat Technologies Inc              | Nomura                      | 389.711                        | 0,02                 |
| (12.424)    | Ormat Technologies Inc              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (14.425)    | Orsted A/S                          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (800)       | OrthoPediatrics Corp                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (600)       | OSAKA Titanium Technologies Co Ltd  | BofA Securities             | 558                            | 0,00                 |
| 41.456      | OSB Group Plc                       | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 113.908     | Oscar Health Inc Class A            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.139.301) | Oshkosh Corp                        | JPMorgan Chase Bank         | 87.718                         | 0,01                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile       | Wertpapierbezeichnung                 | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------|---------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (434.976)     | Oshkosh Corp                          | Goldman Sachs International | 70.347                         | 0,00                 |
| 5.506         | Oshkosh Corp                          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 5.701         | OSI Systems Inc                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (83.688)      | Otis Worldwide Corp                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (216.548.672) | OTP Bank Nyrt                         | Goldman Sachs International | 84.938                         | 0,01                 |
| (23.532.462)  | OTP Bank Nyrt                         | Morgan Stanley              | 987                            | 0,00                 |
| (117.375.922) | OTP Bank Nyrt                         | JPMorgan Chase Bank         | 23.581                         | 0,00                 |
| (300)         | Otsuka Corp                           | BofA Securities             | 403                            | 0,00                 |
| (3.300)       | Otsuka Holdings Co Ltd                | BofA Securities             | 3.980                          | 0,00                 |
| (12.395)      | Otter Tail Corp                       | Morgan Stanley              | 13.990                         | 0,00                 |
| (10.724)      | Outfront Media Inc                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (381.535)     | Outokumpu OYJ                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 8.044         | Outset Medical Inc                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (2.300)       | Outsourcing Inc                       | BofA Securities             | 203                            | 0,00                 |
| 12.991        | Overstock.com Inc                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (7.800)       | Ovintiv Inc                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (56.210)      | Owens & Minor Inc                     | Goldman Sachs International | 1.500                          | 0,00                 |
| 33.273        | Owens & Minor Inc                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 43.110        | Owens Corning                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (14.606)      | Owl Rock Capital Corp                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 6.276         | Oxford Industries Inc                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (5.024)       | Oxford Instruments Plc                | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 69.484        | PACCAR Inc                            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (66.446)      | Pacific Biosciences of California Inc | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 8.919         | Pacific Premier Bancorp Inc           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 97.422        | Pacira BioSciences Inc                | Goldman Sachs International | 8.773                          | 0,00                 |
| 12.988        | Pacira BioSciences Inc                | JPMorgan Chase Bank         | 7.088                          | 0,00                 |
| 23.330        | Pacira BioSciences Inc                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (3.292)       | Packaging Corp of America             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (284.933)     | Pagegroup Plc                         | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 18.081        | Pagegroup Plc                         | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 19.490        | PagerDuty Inc                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (11.532)      | Pageseguro Digital Ltd Class A        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (24.914)      | Palantir Technologies Inc Class A     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (320.354)     | Palo Alto Networks Inc                | Morgan Stanley              | 113.331                        | 0,01                 |
| 48.500.000    | Palo Alto Networks Inc                | Société Générale            | 30.200.692                     | 1,33                 |
| (1.495)       | Palomar Holdings Inc                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (88.333.576)  | Panasonic Holdings Corp               | Goldman Sachs International | 206.118                        | 0,01                 |
| 1.193         | Papa John's International Inc         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 12.402        | Par Pacific Holdings Inc              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 2.488         | PAR Technology Corp                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile       | Wertpapierbezeichnung              | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------|------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (25.100)      | Paragon 28 Inc                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 26.291        | Paragon Banking Group Plc          | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 21.435        | Paramount Global                   | Goldman Sachs International | 680                            | 0,00                 |
| (6.614)       | Paramount Global Class B           | Morgan Stanley              | 58                             | 0,00                 |
| 18.998        | Park Hotels & Resorts Inc          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 1.070.507.488 | Park24 Co Ltd                      | Société Générale            | 139.640                        | 0,01                 |
| (236.417)     | Parker-Hannifin Corp               | Goldman Sachs International | 51.861                         | 0,00                 |
| 18.743        | Parker-Hannifin Corp               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (14.205)      | Parsons Corp                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 9.100         | Pathward Financial Inc             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (6.782)       | Patrick Industries Inc             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (575.251)     | Patterson Cos Inc                  | Goldman Sachs International | 99.015                         | 0,01                 |
| (11.905)      | Patterson Cos Inc                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (14.063)      | Patterson-UTI Energy Inc           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 8.403         | Paychex Inc                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 5.305         | Paycom Software Inc                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 4.751         | Paycor HCM Inc                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 3.922         | Paylocity Holding Corp             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (9.702)       | Payoneer Global Inc                | JPMorgan Chase Bank         | 452                            | 0,00                 |
| 278.103       | Payoneer Global Inc                | Morgan Stanley              | 2.409                          | 0,00                 |
| 17.312        | PayPal Holdings Inc                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 64.042        | Paysafe Ltd                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (17.202)      | PBF Energy Inc Class A             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 2.400         | PDC Energy Inc                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (2.283)       | PDF Solutions Inc                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 20.721        | Pearson Plc                        | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (430.247)     | Pearson Plc                        | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (27.049)      | Pebblebrook Hotel Trust            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (41.600)      | Pediatrix Medical Group Inc        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 21.411        | Pegasystems Inc                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 169.285       | Peloton Interactive Inc Class A    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 25.544        | Penn Entertainment Inc             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 17.010        | Pennon Group Plc                   | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (9.808)       | PennyMac Financial Services Inc    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (13.877)      | PennyMac Mortgage Investment Trust | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (2.802)       | Penske Automotive Group Inc        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (298.804)     | Pentair Plc                        | JPMorgan Chase Bank         | 33.761                         | 0,00                 |
| (718.139)     | Pentair Plc                        | Goldman Sachs International | 67.321                         | 0,00                 |
| 109.958       | Pentair Plc                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.936)       | Penumbra Inc                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 334.937       | Pepco Group NV                     | Morgan Stanley              | 6.494                          | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung                    | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|--|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (346.546)   | PepsiCo Inc                              | Goldman Sachs International | 16.736                         | 0,00                 |
| 10.288      | PepsiCo Inc                              | Morgan Stanley              | 1.210                          | 0,00                 |
| (5.300)     | PeptiDream Inc                           | BofA Securities             | 10.391                         | 0,00                 |
| (18.885)    | Perdoceo Education Corp                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (6.912)     | Perficient Inc                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (9.780)     | Performance Food Group Co                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 139.465     | Perimeter Solutions SA                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 3.907       | Perion Network Ltd                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (182.261)   | Permian Resources Corp                   | Goldman Sachs International | 29.589                         | 0,00                 |
| (201.825)   | Permian Resources Corp                   | JPMorgan Chase Bank         | 10.024                         | 0,00                 |
| (26.377)    | Permian Resources Corp                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 731.539     | Perrigo Co Plc                           | Goldman Sachs International | 15.635                         | 0,00                 |
| (3.042)     | Perrigo Co Plc                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 28.100      | Petco Health & Wellness Co Inc           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (15.262)    | Petershill Partners Plc                  | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (15.673)    | Pets at Home Group Plc                   | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 45.540      | Pfizer Inc                               | Morgan Stanley              | 322                            | 0,00                 |
| 353.953     | Pfizer Inc                               | JPMorgan Chase Bank         | 19.953                         | 0,00                 |
| 578.093     | Pfizer Inc                               | Goldman Sachs International | 40.252                         | 0,00                 |
| 112.465     | PG&E Corp                                | Goldman Sachs International | 1.631                          | 0,00                 |
| (1.000)     | PGT Innovations Inc                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 3.470       | Phillips 66                              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 1.813.198   | Phillips 66                              | Goldman Sachs International | 6.009                          | 0,00                 |
| (30.893)    | Phillips Edison & Co Inc                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (73.531)    | Phoenix Group Holdings Plc               | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (8.859)     | Photronics Inc                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 9.147       | Phreesia Inc                             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (8.416)     | Piedmont Lithium Inc                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (45.775)    | Piedmont Office Realty Trust Inc Class A | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 13.754      | Pilgrim's Pride Corp                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 1.254       | Pinnacle Financial Partners Inc          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (4.960)     | Pinnacle West Capital Corp               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (71.703)    | Pinterest Inc Class A                    | Morgan Stanley              | 5.126                          | 0,00                 |
| (426.558)   | Pinterest Inc Class A                    | JPMorgan Chase Bank         | 17.245                         | 0,00                 |
| (1.281.341) | Pioneer Natural Resources Co             | JPMorgan Chase Bank         | 47.283                         | 0,00                 |
| (210.960)   | Pioneer Natural Resources Co             | Goldman Sachs International | 7.178                          | 0,00                 |
| 2.000       | Piper Sandler Cos                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 1.221.706   | Pirelli & C SpA                          | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 6.007       | PJT Partners Inc Class A                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (81.990)    | Plains All American Pipeline LP          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (28.483)    | Plains GP Holdings LP Class A            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |



## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung            | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|----------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 10.876      | Planet Fitness Inc Class A       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 28.880      | Playa Hotels & Resorts NV        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 22.305      | Playtech Plc                     | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 86.240      | Playtika Holding Corp            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.583)     | Plexus Corp                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 17.575      | Pliant Therapeutics Inc          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (56.330)    | Plug Power Inc                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 11.276      | Plus500 Ltd                      | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 6.470       | PNC Financial Services Group Inc | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 17.700      | PNM Resources Inc                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (3.105)     | Polaris Inc                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 109.469     | Polski Koncern Naftowy ORLEN SA  | Goldman Sachs International | 755                            | 0,00                 |
| 1.746.582   | Polski Koncern Naftowy ORLEN SA  | JPMorgan Chase Bank         | 9.243                          | 0,00                 |
| 65.161      | Polymetal International Plc      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.199)     | Pool Corp                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (11.003)    | Popular Inc                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 10.700      | Portillo's Inc                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (5.630)     | Portland General Electric Co     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 14.811      | Post Holdings Inc                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 441.806     | Post Holdings Inc                | Goldman Sachs International | 13.470                         | 0,00                 |
| 495.935     | Post Holdings Inc                | JPMorgan Chase Bank         | 13.383                         | 0,00                 |
| (16.102)    | PotlatchDeltic Corp              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (6.612)     | Power Integrations Inc           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (36.196)    | PowerSchool Holdings Inc Class A | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.392.444) | Powszechny Zakład Ubezpieczeń SA | Goldman Sachs International | 2.551                          | 0,00                 |
| (8.521)     | PPG Industries Inc               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 1.423.644   | PPL Corp                         | Nomura                      | 109.908                        | 0,01                 |
| (20.597)    | PPL Corp                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 10.683      | PRA Group Inc                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 3.412       | Preferred Bank                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (46.033)    | Premier Foods Plc                | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (12.360)    | Premier Inc Class A              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 14.701      | Prestige Consumer Healthcare Inc | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 3.105       | PriceSmart Inc                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 140.596     | Primary Health Properties Plc    | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 2.314       | Primerica Inc                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 28.823      | Primo Water Corp                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (5.227)     | Primoris Services Corp           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (7.573)     | Principal Financial Group Inc    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 37.951      | ProAssurance Corp                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 7.111       | PROCEPT BioRobotics Corp         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung               | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|-------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (47.333)    | Procore Technologies Inc            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (73.999)    | Procter & Gamble Co                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 3.311       | PROG Holdings Inc                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.201)     | Progress Software Corp              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (18.493)    | Progressive Corp                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (543)       | Progyny Inc                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (4.942)     | Prologis Inc                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (284.542)   | ProPetro Holding Corp               | Morgan Stanley              | 19.117                         | 0,00                 |
| 1.520       | PROS Holdings Inc                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 6.903       | ProSiebenSat.1 Media SE             | Goldman Sachs International | 35                             | 0,00                 |
| 6.104       | Prosperity Bancshares Inc           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 134.900     | Protagonist Therapeutics Inc        | Goldman Sachs International | 336                            | 0,00                 |
| 5.710       | Proto Labs Inc                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 7.393       | Provident Financial Services Inc    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 7.503       | Prudential Financial Inc            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (38.301)    | Prudential Plc                      | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 182.292     | Prysmian SpA                        | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (2.799)     | PTC Inc                             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (25.507)    | Public Service Enterprise Group Inc | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.701)     | Public Storage                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (54.732)    | Publicis Groupe SA                  | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (659.029)   | PulteGroup Inc                      | Goldman Sachs International | 81.623                         | 0,01                 |
| (93.387)    | PulteGroup Inc                      | Morgan Stanley              | 42.185                         | 0,00                 |
| (55.398)    | Pure Storage Inc Class A            | JPMorgan Chase Bank         | 374                            | 0,00                 |
| 74.434      | Pure Storage Inc Class A            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (41.878)    | PureCycle Technologies Inc          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.248.435) | PVH Corp                            | JPMorgan Chase Bank         | 1.542                          | 0,00                 |
| 2.213       | PVH Corp                            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 9.800       | Q2 Holdings Inc                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 8.205       | QIAGEN NV                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (39.413)    | QinetiQ Group Plc                   | BofA Securities             | 112                            | 0,00                 |
| (146.661)   | Qorvo Inc                           | Morgan Stanley              | 13.024                         | 0,00                 |
| 1.300       | Quaker Chemical Corp                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 9.107       | QUALCOMM Inc                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 3.200       | Qualys Inc                          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (8.205)     | Quanta Services Inc                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (162.192)   | Quanta Services Inc                 | Goldman Sachs International | 22.899                         | 0,00                 |
| (99.900)    | QuantumScape Corp                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (2.900)     | Quest Diagnostics Inc               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (3.419)     | QuidelOrtho Corp                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (104.533)   | Quilter Plc                         | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile      | Wertpapierbezeichnung                    | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------|--|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (25.407)     | QuinStreet Inc                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (15.500)     | R1 RCM Inc                               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.400)      | Radian Group Inc                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 6.500        | Radius Global Infrastructure Inc Class A | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (14.000)     | RadNet Inc                               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (82.592.719) | Rakuten Bank Ltd                         | Goldman Sachs International | 13.195                         | 0,00                 |
| (2.400)      | Ralph Lauren Corp                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 3.100        | Rambus Inc                               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (28.820)     | Randstad NV                              | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (16.200)     | Range Resources Corp                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (3.600)      | Rapid7 Inc                               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 3.101        | Rathbones Group Plc                      | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (13.350)     | Raymond James Financial Inc              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 11.000       | Rayonier Inc                             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (100.109)    | Raytheon Technologies Corp               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 10.766       | RB Global Inc                            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 3.500        | RBC Bearings Inc                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.300)      | RCI Hospitality Holdings Inc             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (7.200)      | Ready Capital Corp                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 16.506       | Realty Income Corp                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (655.963)    | Reata Pharmaceuticals Inc Class A        | Morgan Stanley              | 270.787                        | 0,01                 |
| (299.771)    | Reata Pharmaceuticals Inc Class A        | JPMorgan Chase Bank         | 22.191                         | 0,00                 |
| (126.207)    | Reata Pharmaceuticals Inc Class A        | Goldman Sachs International | 16.853                         | 0,00                 |
| 19.323       | Reckitt Benckiser Group Plc              | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (6.100)      | Recruit Holdings Co Ltd                  | BofA Securities             | 2.102                          | 0,00                 |
| 1.200        | Red Rock Resorts Inc Class A             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 23.810       | Redde Northgate Plc                      | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 31.503       | Redfin Corp                              | Morgan Stanley              | 163                            | 0,00                 |
| (8.585)      | Redrow Plc                               | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 46.534       | Redwood Trust Inc                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (4.306)      | Regal Rexnord Corp                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 18.800       | Regency Centers Corp                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 441.640      | Regeneron Pharmaceuticals Inc            | Goldman Sachs International | 6.811                          | 0,00                 |
| 801.963      | Regeneron Pharmaceuticals Inc            | JPMorgan Chase Bank         | 29.172                         | 0,00                 |
| (37.800)     | Regions Financial Corp                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.300)      | Reinsurance Group of America Inc Class A | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (5.900)      | Reliance Steel & Aluminum Co             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 44.688.800   | Relo Group Inc                           | Société Générale            | 28.512                         | 0,00                 |
| (158.935)    | RELX Plc                                 | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (147.193)    | Remitly Global Inc                       | Goldman Sachs International | 12.528                         | 0,00                 |
| (105.218)    | Remitly Global Inc                       | Morgan Stanley              | 1.953                          | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile    | Wertpapierbezeichnung               | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|------------|-------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (900)      | RenaissanceRe Holdings Ltd          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 9.300      | Renasant Corp                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (39.599)   | Renault SA                          | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (8.800)    | ReNew Energy Global Plc Class A     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (2.903)    | Renishaw Plc                        | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (54.238)   | Rentokil Initial Plc                | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 187.784    | Rentokil Initial Plc                | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (70)       | Rentokil Initial Plc                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 6.530      | Repligen Corp                       | Morgan Stanley              | 1.324                          | 0,00                 |
| 34.596     | Repligen Corp                       | Goldman Sachs International | 2.291                          | 0,00                 |
| (6.300)    | Republic Services Inc               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 9.400      | Resideo Technologies Inc            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 4.100      | ResMed Inc                          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (424.502)  | ResMed Inc                          | Goldman Sachs International | 3.756                          | 0,00                 |
| 39.900     | Resona Holdings Inc                 | BofA Securities             | 7.867                          | 0,00                 |
| 4.700      | Resonac Holdings Corp               | BofA Securities             | 709                            | 0,00                 |
| 300        | Retail Opportunity Investments Corp | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 82.365     | Revance Therapeutics Inc            | Morgan Stanley              | 5.145                          | 0,00                 |
| (604.184)  | REVOLUTION Medicines Inc            | Morgan Stanley              | 109.889                        | 0,01                 |
| (26.810)   | REVOLUTION Medicines Inc            | JPMorgan Chase Bank         | 1.361                          | 0,00                 |
| 7.300      | Revolve Group Inc                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (5.300)    | Revvity Inc                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 302.476    | Rexel SA                            | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 26.600     | Rexford Industrial Realty Inc       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 306.582    | Reynolds Consumer Products Inc      | JPMorgan Chase Bank         | 16.778                         | 0,00                 |
| (1.600)    | Reynolds Consumer Products Inc      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 32.200.000 | Rheinmetall AG                      | Société Générale            | 1.592.165                      | 0,07                 |
| 1.862      | RHI Magnesita NV                    | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (13.700)   | Ricoh Co Ltd                        | BofA Securities             | 4.095                          | 0,00                 |
| 98.219     | Rightmove Plc                       | JPMorgan Chase Bank         | 8.031                          | 0,00                 |
| 5.237      | Rightmove Plc                       | Goldman Sachs International | 25                             | 0,00                 |
| 23.515     | Rightmove Plc                       | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 19.700     | RingCentral Inc Class A             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 9.600      | Rinnai Corp                         | BofA Securities             | 4.991                          | 0,00                 |
| (54.746)   | Rio Tinto Plc                       | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 17.932     | Rio Tinto Plc                       | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (12.894)   | Riot Platforms Inc                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 166.500    | Rithm Capital Corp                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 137.700    | Rivian Automotive Inc Class A       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (5.500)    | RLI Corp                            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 74.200     | RLJ Lodging Trust                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile      | Wertpapierbezeichnung            | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------|----------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (36.200)     | Robert Half International Inc    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (37.700)     | Robinhood Markets Inc Class A    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 20.300       | ROBLOX Corp Class A              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 121.542      | Roche Holding AG                 | Morgan Stanley              | 5.186                          | 0,00                 |
| 1.306.853    | Roche Holding AG                 | Goldman Sachs International | 63.595                         | 0,00                 |
| 447.259      | Roche Holding AG                 | JPMorgan Chase Bank         | 4.361                          | 0,00                 |
| (25.800)     | Rocket Cos Inc Class A           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (73.000)     | Rocket Lab USA Inc               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (28.479)     | Rockwell Automation Inc          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (2.327)      | ROCKWOOL A/S                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 800          | Rogers Corp                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (23.182.627) | Rohm Co Ltd                      | Goldman Sachs International | 47.637                         | 0,00                 |
| 400          | Rohm Co Ltd                      | BofA Securities             | 2.659                          | 0,00                 |
| 11.500       | Roku Inc                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 36.300       | Rollins Inc                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 1.233.769    | Rolls-Royce Holdings Plc         | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (2.407)      | Roper Technologies Inc           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.546.417)  | Ross Stores Inc                  | JPMorgan Chase Bank         | 100.307                        | 0,01                 |
| 3.300        | Ross Stores Inc                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 101.687      | Rotork Plc                       | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (1.076.165)  | Royal Caribbean Cruises Ltd      | JPMorgan Chase Bank         | 308.667                        | 0,02                 |
| (4.100)      | Royal Caribbean Cruises Ltd      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 4.000        | Royal Gold Inc                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 35.106       | Royalty Pharma Plc Class A       | Morgan Stanley              | 4.801                          | 0,00                 |
| 133.956      | Royalty Pharma Plc Class A       | Goldman Sachs International | 10.922                         | 0,00                 |
| 56.200       | Royalty Pharma Plc Class A       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (26.677)     | RPC Inc                          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (74.409)     | RPM International Inc            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (44.800)     | RPT Realty                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 31.772       | RS GROUP Plc                     | BofA Securities             | 41                             | 0,00                 |
| 6.200        | Rush Enterprises Inc Class A     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 169.694      | RWE AG                           | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 37.094       | RWS Holdings Plc                 | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (6.800)      | Ryan Specialty Holdings Inc      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 401.420      | Ryanair Holdings Plc             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 1.200        | Ryder System Inc                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (2.000)      | Ryerson Holding Corp             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 1.900        | Ryman Hospitality Properties Inc | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 9.700        | Ryohin Keikaku Co Ltd            | BofA Securities             | 1.126                          | 0,00                 |
| (3.540)      | S&P Global Inc                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 8.900        | S&T Bancorp Inc                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile       | Wertpapierbezeichnung                         | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------|---|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 71.440        | S4 Capital Plc                                | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 8.300         | Sabra Health Care REIT Inc                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 10.435        | Safehold Inc                                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 15.851        | Safestore Holdings Plc                        | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 700           | Safety Insurance Group Inc                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 1.714.671     | Safran SA                                     | Société Générale            | 372.555                        | 0,02                 |
| 37.943        | Safran SA                                     | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 14.554        | Sage Group Plc                                | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 154.143       | Sage Therapeutics Inc                         | JPMorgan Chase Bank         | 1.265                          | 0,00                 |
| 45.651        | Sage Therapeutics Inc                         | Goldman Sachs International | 2.668                          | 0,00                 |
| 68.107        | Sage Therapeutics Inc                         | Morgan Stanley              | 2.575                          | 0,00                 |
| (5.000)       | Saia Inc                                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (2.400)       | Saizeriya Co Ltd                              | BofA Securities             | 1.014                          | 0,00                 |
| (4.300)       | Sakata Seed Corp                              | BofA Securities             | 359                            | 0,00                 |
| 95.495        | Salesforce Inc                                | Morgan Stanley              | 553                            | 0,00                 |
| 139.932       | Salesforce Inc                                | Goldman Sachs International | 109                            | 0,00                 |
| 18.200        | Sally Beauty Holdings Inc                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (2.131)       | Samsara Inc Class A                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (404.742)     | Samsung Electronics Co Ltd                    | Morgan Stanley              | 23.279                         | 0,00                 |
| (455.408)     | Samsung Electronics Co Ltd - Preferred Shares | JPMorgan Chase Bank         | 67.006                         | 0,00                 |
| (5.600)       | SAMTY Co Ltd                                  | BofA Securities             | 90                             | 0,00                 |
| (1.300)       | San-A Co Ltd                                  | BofA Securities             | 1.109                          | 0,00                 |
| 470.130       | Sandvik AB                                    | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (4.400)       | Sandy Spring Bancorp Inc                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 7.700         | Sangetsu Corp                                 | BofA Securities             | 552                            | 0,00                 |
| 800           | Sanken Electric Co Ltd                        | BofA Securities             | 10.465                         | 0,00                 |
| 3.300         | Sanmina Corp                                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (96.240)      | Sanofi  | Morgan Stanley              | 198                            | 0,00                 |
| (126.866)     | Sarepta Therapeutics Inc                      | Morgan Stanley              | 4.477                          | 0,00                 |
| 326.605       | Sarepta Therapeutics Inc                      | Goldman Sachs International | 666.598                        | 0,03                 |
| 2.793.371     | Sasol Ltd                                     | Goldman Sachs International | 134                            | 0,00                 |
| 7.982         | Savills Plc                                   | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (191.224)     | SBA Communications Corp                       | Morgan Stanley              | 7.053                          | 0,00                 |
| (355.505)     | SBA Communications Corp                       | JPMorgan Chase Bank         | 7.250                          | 0,00                 |
| 2.216.197.334 | SBI Holdings Inc                              | Société Générale            | 855.638                        | 0,04                 |
| 5.300         | SBI Holdings Inc                              | BofA Securities             | 85                             | 0,00                 |
| 40.698        | Schindler Holding AG                          | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (184.043)     | Schlumberger Ltd                              | JPMorgan Chase Bank         | 3.577                          | 0,00                 |
| 31.200        | Schlumberger Ltd                              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 85.129        | Schneider Electric SE                         | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (9.500)       | Schneider National Inc Class B                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung                   | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|---|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 3.900     | Schnitzer Steel Industries Inc Class A  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (25.541)  | Scholastic Corp                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (43.430)  | Schroders Plc                           | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (19.200)  | Schrodinger Inc                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (7.200)   | Science Applications International Corp | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 7.700     | Scorpio Tankers Inc                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 5.100     | Scotts Miracle-Gro Co                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (4.400)   | SCSK Corp                               | BofA Securities             | 1.215                          | 0,00                 |
| 80.268    | Sea Ltd                                 | Goldman Sachs International | 4.005                          | 0,00                 |
| 18.100    | Seacoast Banking Corp of Florida        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (7.500)   | Seagate Technology Holdings Plc         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 522.948   | SeaWorld Entertainment Inc              | JPMorgan Chase Bank         | 353                            | 0,00                 |
| (8.200)   | SeaWorld Entertainment Inc              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (202.170) | Securitas AB                            | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (65.451)  | Segro Plc                               | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 14.000    | SEI Investments Co                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (2.900)   | Seiko Epson Corp                        | BofA Securities             | 79                             | 0,00                 |
| 4.800     | Sekisui Chemical Co Ltd                 | BofA Securities             | 2.072                          | 0,00                 |
| 6.300     | Sekisui House Ltd                       | BofA Securities             | 3.617                          | 0,00                 |
| (400)     | Select Medical Holdings Corp            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (53.100)  | Select Water Solutions Inc              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (7.000)   | Selective Insurance Group Inc           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (6.600)   | Sempra Energy                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (343.953) | Semtech Corp                            | Goldman Sachs International | 121.374                        | 0,01                 |
| 12.341    | Senior Plc                              | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 30.800    | Sensata Technologies Holding Plc        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 4.900     | Sensient Technologies Corp              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (35.600)  | SentinelOne Inc Class A                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 263.097   | Serco Group Plc                         | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (4.300)   | Seria Co Ltd                            | BofA Securities             | 243                            | 0,00                 |
| (39.976)  | Serica Energy Plc                       | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 5.200     | Service Corp International              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 48.300    | Service Properties Trust                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (490.992) | ServiceNow Inc                          | JPMorgan Chase Bank         | 90.173                         | 0,01                 |
| (116.808) | ServiceNow Inc                          | Morgan Stanley              | 34.598                         | 0,00                 |
| 14.300    | ServisFirst Bancshares Inc              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (25.095)  | Seymour Trent Plc                       | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (10.800)  | SFL Corp Ltd                            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (233.607) | Shaftesbury Capital Plc                 | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 700       | Shake Shack Inc Class A                 | Morgan Stanley              | 57                             | 0,00                 |
| (364.760) | Shell Plc                               | Morgan Stanley              | 4.979                          | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung                 | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|---------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (863.875)   | Shell Plc                             | JPMorgan Chase Bank         | 6.828                          | 0,00                 |
| 21.784      | Shell Plc                             | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 310.958     | Shell Plc                             | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 42.521      | Sherwin-Williams Co                   | Morgan Stanley              | 20.147                         | 0,00                 |
| (200)       | Shibaura Mechatronics Corp            | BofA Securities             | 197                            | 0,00                 |
| 200         | SHIFT Inc                             | BofA Securities             | 1.587                          | 0,00                 |
| (2.200)     | Shift4 Payments Inc Class A           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (982.173)   | Shift4 Payments Inc Class A           | Goldman Sachs International | 85.844                         | 0,01                 |
| 700         | Shikoku Electric Power Co Inc         | BofA Securities             | 13                             | 0,00                 |
| (1.500)     | Shimamura Co Ltd                      | BofA Securities             | 3.235                          | 0,00                 |
| 1.800       | Shin-Etsu Chemical Co Ltd             | BofA Securities             | 1.149                          | 0,00                 |
| 2.600       | Shin-Etsu Polymer Co Ltd              | BofA Securities             | 1.003                          | 0,00                 |
| 2.100       | Shiseido Co Ltd                       | BofA Securities             | 358                            | 0,00                 |
| 56.300      | Shoals Technologies Group Inc Class A | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (587.936)   | Shockwave Medical Inc                 | Goldman Sachs International | 1.931                          | 0,00                 |
| 3.600       | Shockwave Medical Inc                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (8.800)     | Shopify Inc Class A                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.323.502) | Shoprite Holdings Ltd                 | Goldman Sachs International | 110                            | 0,00                 |
| (9.634.364) | Shoprite Holdings Ltd                 | JPMorgan Chase Bank         | 22.403                         | 0,00                 |
| (2.611.668) | Shoprite Holdings Ltd                 | Morgan Stanley              | 486                            | 0,00                 |
| 9.700       | Shutterstock Inc                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 12.400      | Shyft Group Inc                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 28.800      | SI-BONE Inc                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 53.883      | Siemens AG                            | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 81.340.206  | Siemens Energy AG                     | Société Générale            | 16.739.462                     | 0,74                 |
| 1.600       | Signature Bank                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (10.600)    | Signet Jewelers Ltd                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (32.122)    | Signify NV                            | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 15.448      | Sika AG                               | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 6.000       | Silgan Holdings Inc                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 5.000       | Silicon Laboratories Inc              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 13.700      | Silk Road Medical Inc                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 11.076      | Siltronic AG                          | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 11.700      | Simmons First National Corp Class A   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (800)       | Simon Property Group Inc              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 689.437     | Simply Good Foods Co                  | JPMorgan Chase Bank         | 33.371                         | 0,00                 |
| 16.000      | Simply Good Foods Co                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 5.000       | Simpson Manufacturing Co Inc          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (5.800)     | Simulations Plus Inc                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 21.478      | Sinclair Inc                          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 15.493.061  | Singapore Airlines Ltd                | Société Générale            | 386.364                        | 0,02                 |



## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung                 | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|---------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 84.062    | Sirius Real Estate Ltd                | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 34.400    | SiriusPoint Ltd                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (65.100)  | SITE Centers Corp                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 3.400     | SiteOne Landscape Supply Inc          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (7.200)   | SiTime Corp                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (2.492)   | Sitio Royalties Corp Class A          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 17.600    | Six Flags Entertainment Corp          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (8.800)   | Sixth Street Specialty Lending Inc    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.600)   | SJW Group                             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (140.835) | SK Hynix Inc                          | Morgan Stanley              | 146                            | 0,00                 |
| (16.420)  | SK Hynix Inc                          | Goldman Sachs International | 85                             | 0,00                 |
| (642.857) | SK Hynix Inc                          | JPMorgan Chase Bank         | 16.964                         | 0,00                 |
| (420.429) | Skanska AB Class B                    | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 69.366    | Skechers USA Inc Class A              | Goldman Sachs International | 142                            | 0,00                 |
| 482.269   | Skechers USA Inc Class A              | JPMorgan Chase Bank         | 2.399                          | 0,00                 |
| (5.900)   | Skechers USA Inc Class A              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 15.800    | SKY Perfect JSAT Holdings Inc         | BofA Securities             | 2.495                          | 0,00                 |
| (900)     | Skylark Holdings Co Ltd               | BofA Securities             | 694                            | 0,00                 |
| 3.200     | Skyline Champion Corp                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 9.725     | SkyWest Inc                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 128.466   | Skyworks Solutions Inc                | Morgan Stanley              | 4.077                          | 0,00                 |
| (73.637)  | Skyworks Solutions Inc                | Goldman Sachs International | 10.495                         | 0,00                 |
| 12.502    | SL Green Realty Corp                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 65.400    | SLM Corp                              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 1.826     | SM Energy Co                          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (15.100)  | SMART Global Holdings Inc             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (8.962)   | Smart Metering Systems Plc            | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 9.500     | Smartsheet Inc Class A                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 100       | SMC Corp                              | BofA Securities             | 1.746                          | 0,00                 |
| 41.497    | Smith & Nephew Plc                    | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 290.256   | Smiths Group Plc                      | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 900       | SMS Co Ltd                            | BofA Securities             | 174                            | 0,00                 |
| 19.945    | Smurfit Kappa Group Plc               | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 44.754    | Smurfit Kappa Group Plc               | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (824.792) | Snap Inc Class A                      | JPMorgan Chase Bank         | 89.302                         | 0,00                 |
| 25.529    | Snap Inc Class A                      | Goldman Sachs International | 77                             | 0,00                 |
| (282.354) | Snap Inc Class A                      | Morgan Stanley              | 17.756                         | 0,00                 |
| (1.700)   | Snap-on Inc                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 132.742   | Snowflake Inc Class A                 | Goldman Sachs International | 2.557                          | 0,00                 |
| (8.900)   | Snowflake Inc Class A                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (22.547)  | Sociedad Quimica y Minera de Chile SA | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile      | Wertpapierbezeichnung                   | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------|---|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 15.324       | Sodexo SA                               | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 11.200       | SoFi Technologies Inc                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 11.900       | Softbank Corp                           | BofA Securities             | 99                             | 0,00                 |
| 6.685        | Softcat Plc                             | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 7.120        | Sojitz Corp                             | BofA Securities             | 11.317                         | 0,00                 |
| (398.771)    | SolarEdge Technologies Inc              | JPMorgan Chase Bank         | 4.108                          | 0,00                 |
| 1.200        | SolarEdge Technologies Inc              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 105.610      | Solaria Energia y Medio Ambiente SA     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (15.433)     | Solvay SA                               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (7.900)      | Sonic Automotive Inc Class A            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (5.500)      | Sonoco Products Co                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (6.800)      | Sonos Inc                               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (42.780.865) | Sony Group Corp                         | Goldman Sachs International | 21.089                         | 0,00                 |
| (20.100)     | Sotera Health Co                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (5.300)      | South State Corp                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 5.919.124    | Southern Co                             | Goldman Sachs International | 123.660                        | 0,01                 |
| (38.600)     | Southern Co                             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 17.000.000   | Southern Co                             | Nomura                      | 33.490                         | 0,00                 |
| 8.100        | Southern Copper Corp                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 9.300        | Southside Bancshares Inc                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (51.417)     | Southwest Airlines Co                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (17.700)     | Southwest Gas Holdings Inc              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (678.116)    | Southwestern Energy Co                  | JPMorgan Chase Bank         | 77.547                         | 0,00                 |
| 117.100      | Southwestern Energy Co                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (24.400)     | Sovos Brands Inc                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (700)        | SpartanNash Co                          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 9.860        | Spectris Plc                            | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (367.271)    | Spectrum Brands Holdings Inc            | JPMorgan Chase Bank         | 15.128                         | 0,00                 |
| (214.675)    | Spectrum Brands Holdings Inc            | Morgan Stanley              | 9.038                          | 0,00                 |
| (2.348.430)  | Spectrum Brands Holdings Inc            | Goldman Sachs International | 437.621                        | 0,02                 |
| (141.356)    | Sphere Entertainment Co                 | JPMorgan Chase Bank         | 10.492                         | 0,00                 |
| 15.300       | Sphere Entertainment Co                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (5.252)      | Spirax-Sarco Engineering Plc            | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 12.269       | Spire Healthcare Group Plc              | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 1.800        | Spire Inc                               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (2.900)      | Spirit AeroSystems Holdings Inc Class A | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.400)      | Spirit Realty Capital Inc               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 1.300        | Splunk Inc                              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.800)      | Spotify Technology SA                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 24.470       | SpringBig Holdings Inc                  | Goldman Sachs International | 138                            | 0,00                 |
| (21.300)     | Sprinklr Inc Class A                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung             | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|-----------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 14.645      | Sprout Social Inc Class A         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 48.703      | Sprout Social Inc Class A         | Goldman Sachs International | 4.130                          | 0,00                 |
| 137.873     | Sprouts Farmers Market Inc        | Goldman Sachs International | 1.848                          | 0,00                 |
| 542.528     | Sprouts Farmers Market Inc        | Morgan Stanley              | 5.815                          | 0,00                 |
| (4.500)     | SPS Commerce Inc                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 3.600       | SPX Technologies Inc              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (500)       | Square Enix Holdings Co Ltd       | BofA Securities             | 1.672                          | 0,00                 |
| 18.104      | Squarespace Inc Class A           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (300)       | SS&C Technologies Holdings Inc    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (348.652)   | SSAB AB Class B                   | Goldman Sachs International | 560                            | 0,00                 |
| (51.254)    | SSP Group Plc                     | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (25.898)    | St James's Place Plc              | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 2.800       | STAAR Surgical Co                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (3.309)     | Stadler Rail AG                   | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (26.900)    | STAG Industrial Inc               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (7.984.601) | Standard Bank Group Ltd           | JPMorgan Chase Bank         | 638                            | 0,00                 |
| (140.856)   | Standard Chartered plc            | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 2.500       | Standex International Corp        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (15.085)    | Stanley Black & Decker Inc        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 14.500      | Stanley Electric Co Ltd           | BofA Securities             | 485                            | 0,00                 |
| (7.400)     | Star Bulk Carriers Corp           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (11.600)    | Starbucks Corp                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 413.904     | Starbucks Corp                    | Goldman Sachs International | 15.683                         | 0,00                 |
| (100)       | Starts Corp Inc                   | BofA Securities             | 5                              | 0,00                 |
| (73.000)    | Starwood Property Trust Inc       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 12.500      | State Street Corp                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 12.200      | Steel Dynamics Inc                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (259.351)   | Stellantis NV                     | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 31.400      | Stem Inc                          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 800         | Stepan Co                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 12.100      | StepStone Group Inc Class A       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 2.400       | Stericycle Inc                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (8.900)     | STERIS Plc                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 3.300       | Sterling Infrastructure Inc       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (8.300)     | Stevanato Group SpA               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (14.600)    | Steven Madden Ltd                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (2.000)     | Stewart Information Services Corp | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 15.950      | Stifel Financial Corp             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 200         | Stock Yards Bancorp Inc           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 19.100      | Stone Co Ltd Class A              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (6.100)     | StoneX Group Inc                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung                | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|--------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 164.721   | Stora Enso OYJ Class R               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (18.900)  | Stratasys Ltd                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (5.100)   | Strategic Education Inc              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 6.500     | Stride Inc                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (9.000)   | Stryker Corp                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (579.433) | Stryker Corp                         | Goldman Sachs International | 44.864                         | 0,00                 |
| (1.300)   | Sturm Ruger & Co Inc                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 1.500     | Sumitomo Bakelite Co Ltd             | BofA Securities             | 3.667                          | 0,00                 |
| 57.100    | Sumitomo Chemical Co Ltd             | BofA Securities             | 2.885                          | 0,00                 |
| 1.100     | Sumitomo Corp                        | BofA Securities             | 172                            | 0,00                 |
| 16.700    | Sumitomo Electric Industries Ltd     | BofA Securities             | 5.428                          | 0,00                 |
| 3.200     | Sumitomo Heavy Industries Ltd        | BofA Securities             | 1.042                          | 0,00                 |
| 1.500     | Sumitomo Metal Mining Co Ltd         | BofA Securities             | 2.929                          | 0,00                 |
| 4.800     | Sumitomo Mitsui Financial Group Inc  | BofA Securities             | 7.582                          | 0,00                 |
| 7.000     | Sumitomo Osaka Cement Co Ltd         | BofA Securities             | 6.784                          | 0,00                 |
| (1.600)   | Sumitomo Realty & Development Co Ltd | BofA Securities             | 1.767                          | 0,00                 |
| 54.300    | Summit Hotel Properties Inc          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (12.671)  | Summit Materials Inc Class A         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 7.600     | Sun Communities Inc                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 19.900    | Sun Country Airlines Holdings Inc    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.900)   | Sundrug Co Ltd                       | BofA Securities             | 1.465                          | 0,00                 |
| (22.289)  | Sunnova Energy International Inc     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 13.700    | Sunoco LP                            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 16.000    | SunOpta Inc                          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (37.088)  | Sunrun Inc                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 7.800     | Sunstone Hotel Investors Inc         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (7.100)   | Super Micro Computer Inc             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 4.400     | Supernus Pharmaceuticals Inc         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (634.115) | Surgery Partners Inc                 | Goldman Sachs International | 126.033                        | 0,01                 |
| 500       | Surgery Partners Inc                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 3.800     | Suzuken Co Ltd                       | BofA Securities             | 6.600                          | 0,00                 |
| 3.100     | Suzuki Motor Corp                    | BofA Securities             | 8.582                          | 0,00                 |
| (1.897)   | SVB Financial Group                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 113.865   | Svenska Cellulosa AB SCA             | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (494.481) | Swedish Orphan Biovitrum AB          | Morgan Stanley              | 360                            | 0,00                 |
| (44.300)  | Sweetgreen Inc Class A               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 5.467.495 | Swiss Re AG                          | Goldman Sachs International | 58.812                         | 0,00                 |
| (12.627)  | Sylvamo Corp                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (16.400)  | Symbotic Inc                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 101.985   | Symrise AG                           | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 1.200     | Synaptics Inc                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung                     | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|---|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (12.100)    | Synchrony Financial                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (8.200)     | Syneos Health Inc                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (34.379)    | Synopsys Inc                              | Morgan Stanley              | 846                            | 0,00                 |
| (1.900)     | Synovus Financial Corp                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 94.204      | Synthomer Plc                             | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 300.836     | Sysco Corp                                | Goldman Sachs International | 1.009                          | 0,00                 |
| 16.400      | Sysco Corp                                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (31.400)    | Systema Corp                              | BofA Securities             | 3.705                          | 0,00                 |
| (9.400)     | T Rowe Price Group Inc                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 400         | Taisei Corp                               | BofA Securities             | 424                            | 0,00                 |
| 3.200       | Taisho Pharmaceutical Holdings Co Ltd     | BofA Securities             | 1.452                          | 0,00                 |
| (117.596)   | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd | Morgan Stanley              | 8.628                          | 0,00                 |
| (400)       | Takasago Thermal Engineering Co Ltd       | BofA Securities             | 71                             | 0,00                 |
| 20.900      | Takashimaya Co Ltd                        | BofA Securities             | 11.466                         | 0,00                 |
| (148.504)   | Take-Two Interactive Software Inc         | Morgan Stanley              | 30.914                         | 0,00                 |
| (900)       | Talos Energy Inc                          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 19.300      | Tandem Diabetes Care Inc                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (9.700)     | Tanger Factory Outlet Centers Inc         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.117.653) | Tapestry Inc                              | Morgan Stanley              | 13.659                         | 0,00                 |
| (1.007.252) | Tapestry Inc                              | JPMorgan Chase Bank         | 30.015                         | 0,00                 |
| (2.002.877) | Targa Resources Corp                      | Goldman Sachs International | 26.775                         | 0,00                 |
| (98.361)    | Targa Resources Corp                      | Morgan Stanley              | 1.822                          | 0,00                 |
| 1.360.260   | Target Corp                               | JPMorgan Chase Bank         | 61.077                         | 0,00                 |
| 13.265      | Target Corp                               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (37.900)    | Target Hospitality Corp                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 166.037     | Tate & Lyle Plc                           | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 9.100       | Taylor Morrison Home Corp                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (3.786.873) | Taylor Wimpey Plc                         | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (3.608)     | TBC Bank Group Plc                        | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (14.700)    | TD SYNEX Corp                             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 4.300       | TE Connectivity Ltd                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.507.268) | TechnipFMC Plc                            | Goldman Sachs International | 308.963                        | 0,02                 |
| 63.151      | TechnipFMC Plc                            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 16.400      | TechTarget Inc                            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 82.349      | Teck Resources Ltd                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (6.400)     | Tecnoglass Inc                            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (2.300)     | Teekay Tankers Ltd Class A                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (6.300)     | TEGNA Inc                                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 28.500      | Teijin Ltd                                | BofA Securities             | 8.305                          | 0,00                 |
| 28.600      | Teladoc Health Inc                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 7.538       | Telecom Plus Plc                          | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung             | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|-----------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (282.801)   | Teledyne Technologies Inc         | JPMorgan Chase Bank         | 175                            | 0,00                 |
| 1.420       | Teledyne Technologies Inc         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 1.300       | Teleflex Inc                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 446.223     | Teleflex Inc                      | Goldman Sachs International | 3.451                          | 0,00                 |
| (9.054)     | Teleperformance                   | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 22.000      | Telephone & Data Systems Inc      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (2.149.237) | Tempur Sealy International Inc    | JPMorgan Chase Bank         | 66.813                         | 0,00                 |
| 6.100       | Tempur Sealy International Inc    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 29.500      | Tenable Holdings Inc              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 4.912.720   | Tencent Holdings Ltd              | Goldman Sachs International | 18.202                         | 0,00                 |
| 1.631.249   | Tencent Holdings Ltd              | JPMorgan Chase Bank         | 13.714                         | 0,00                 |
| (171.565)   | Tencent Holdings Ltd              | Morgan Stanley              | 2.403                          | 0,00                 |
| 36.894      | Tencent Music Entertainment Group | JPMorgan Chase Bank         | 6.997                          | 0,00                 |
| (429.441)   | Tenet Healthcare Corp             | Morgan Stanley              | 73.416                         | 0,00                 |
| (1.800)     | Tennant Co                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 23.400      | Teradata Corp                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (100.667)   | Teradyne Inc                      | Morgan Stanley              | 4.880                          | 0,00                 |
| (3.300)     | Terex Corp                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 487.953     | Tesco Plc                         | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (38.142)    | Tesco Plc                         | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (21.000)    | Tesla Inc                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 2.900       | Tetra Tech Inc                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 5.300       | Texas Capital Bancshares Inc      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (65.511)    | Texas Instruments Inc             | Goldman Sachs International | 3.591                          | 0,00                 |
| 1.300       | Texas Pacific Land Corp           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (3.000)     | Texas Roadhouse Inc               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 19.800      | Textron Inc                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (33.600)    | TFS Financial Corp                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 10.556      | Thales SA                         | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (3.200)     | Theravance Biopharma Inc          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 414.924     | Thermo Fisher Scientific Inc      | Goldman Sachs International | 928                            | 0,00                 |
| 1.713.481   | Thermo Fisher Scientific Inc      | JPMorgan Chase Bank         | 79.889                         | 0,00                 |
| 3.500       | Thermo Fisher Scientific Inc      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (22.267)    | Theseus Pharmaceuticals Inc       | JPMorgan Chase Bank         | 341                            | 0,00                 |
| (53.338)    | Theseus Pharmaceuticals Inc       | Goldman Sachs International | 8.337                          | 0,00                 |
| 289.502     | THG Plc                           | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 500         | Thor Industries Inc               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (74.000)    | Thoughtworks Holding Inc          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (7.900)     | Tidewater Inc                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (47.109)    | Timken Co                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (9.500)     | TimkenSteel Corp                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung                | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|--------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (3.100)     | Titan Machinery Inc                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.258.340) | TJX Cos Inc                          | JPMorgan Chase Bank         | 93.109                         | 0,01                 |
| (10.900)    | TJX Cos Inc                          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (608.894)   | T-Mobile US Inc                      | Morgan Stanley              | 1.341                          | 0,00                 |
| (8.638.264) | T-Mobile US Inc                      | Goldman Sachs International | 648.611                        | 0,03                 |
| 96.451      | Toast Inc Class A                    | Goldman Sachs International | 184                            | 0,00                 |
| (70.100)    | Toast Inc Class A                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (400)       | Toho Co Ltd                          | BofA Securities             | 135                            | 0,00                 |
| 100         | Tokai Carbon Co Ltd                  | BofA Securities             | 29                             | 0,00                 |
| 8.800       | Tokai Tokyo Financial Holdings Inc   | BofA Securities             | 159                            | 0,00                 |
| (900)       | Tokuyama Corp                        | BofA Securities             | 533                            | 0,00                 |
| (100)       | Tokyo Century Corp                   | BofA Securities             | 115                            | 0,00                 |
| 9.000       | Tokyo Electric Power Co Holdings Inc | BofA Securities             | 610                            | 0,00                 |
| (400)       | Tokyo Electron Device Ltd            | BofA Securities             | 453                            | 0,00                 |
| 1.300       | Tokyo Electron Ltd                   | BofA Securities             | 7.749                          | 0,00                 |
| 500         | Tokyo Kiraboshi Financial Group Inc  | BofA Securities             | 55                             | 0,00                 |
| 100         | Tokyo Ohka Kogyo Co Ltd              | BofA Securities             | 557                            | 0,00                 |
| 2.700       | Tokyo Steel Manufacturing Co Ltd     | BofA Securities             | 107                            | 0,00                 |
| (13.100)    | Tokyo Tatemono Co Ltd                | BofA Securities             | 6.734                          | 0,00                 |
| 390.065.763 | Tokyu Corp                           | Société Générale            | 104.502                        | 0,01                 |
| (39.700)    | Tokyu Fudosan Holdings Corp          | BofA Securities             | 438                            | 0,00                 |
| (1.937.245) | Toll Brothers Inc                    | Morgan Stanley              | 517.894                        | 0,02                 |
| (1.009.714) | Toll Brothers Inc                    | Goldman Sachs International | 273.601                        | 0,01                 |
| (4.363)     | Tootsie Roll Industries Inc          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.103)     | TopBuild Corp                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (24.300)    | Topgolf Callaway Brands Corp         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.500)     | Toppan Inc                           | BofA Securities             | 396                            | 0,00                 |
| 40.500      | Toray Industries Inc                 | BofA Securities             | 2.022                          | 0,00                 |
| (20.435)    | Toro Co                              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 20.100      | Tosoh Corp                           | BofA Securities             | 4.644                          | 0,00                 |
| (79.147)    | TotalEnergies SE                     | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (34.700)    | Tower Semiconductor Ltd              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 21.600      | Towne Bank                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (2.200)     | Toyo Ink SC Holdings Co Ltd          | BofA Securities             | 1.237                          | 0,00                 |
| 300         | Toyo Seikan Group Holdings Ltd       | BofA Securities             | 17                             | 0,00                 |
| (4.800)     | Toyo Suisan Kaisha Ltd               | BofA Securities             | 2.456                          | 0,00                 |
| 15.600      | Toyobo Co Ltd                        | BofA Securities             | 122                            | 0,00                 |
| 100         | Toyota Motor Corp                    | BofA Securities             | 21                             | 0,00                 |
| 200         | Toyota Tsusho Corp                   | BofA Securities             | 151                            | 0,00                 |
| (5.123)     | TP ICAP Group Plc                    | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 20.500      | TPG Inc                              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung                | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|--------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (241.425) | Tractor Supply Co                    | Goldman Sachs International | 4.207                          | 0,00                 |
| 1.497.319 | Tractor Supply Co                    | JPMorgan Chase Bank         | 15.606                         | 0,00                 |
| (12.646)  | Tractor Supply Co                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 4.000     | Trade Desk Inc Class A               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (10.348)  | Tradeweb Markets Inc Class A         | JPMorgan Chase Bank         | 179                            | 0,00                 |
| (265.794) | Tradeweb Markets Inc Class A         | Morgan Stanley              | 20.067                         | 0,00                 |
| 33.189    | Trainline Plc                        | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 304       | Trane Technologies Plc               | Morgan Stanley              | 4.488                          | 0,00                 |
| 6.945     | TransDigm Group Inc                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (500)     | TransMedics Group Inc                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 218.500   | Transocean Ltd                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (8.500)   | TransUnion                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (742.886) | Travel + Leisure Co                  | Morgan Stanley              | 37.057                         | 0,00                 |
| 5.700     | Travelers Cos Inc                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (108.952) | Travis Perkins Plc                   | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 19.900    | Travis Perkins Plc                   | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 31.500    | Treace Medical Concepts Inc          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 11.000    | TreeHouse Foods Inc                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 12.200    | Trex Co Inc                          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 30.100    | Tri Pointe Homes Inc                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 4.600     | Trimble Inc                          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 6.300     | TriNet Group Inc                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 20.300    | Trinity Industries Inc               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 32.100    | Trinseo Plc                          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (73.746)  | TripAdvisor Inc                      | JPMorgan Chase Bank         | 2.387                          | 0,00                 |
| (33.379)  | TripAdvisor Inc                      | Goldman Sachs International | 1.442                          | 0,00                 |
| (6.300)   | TripAdvisor Inc                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (42.942)  | Tritax Big Box REIT Plc              | BofA Securities             | 1                              | 0,00                 |
| 238       | Tritium DCFC Ltd                     | Goldman Sachs International | 39                             | 0,00                 |
| (6.700)   | Triton International Ltd             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (6.100)   | Triumph Financial Inc                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (3.700)   | Triumph Group Inc                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (37.600)  | Tronox Holdings Plc Class A          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (17.500)  | Truist Financial Corp                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (11.500)  | Trupanion Inc                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 15.500    | Trustmark Corp                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (3.000)   | Tsubakimoto Chain Co                 | BofA Securities             | 173                            | 0,00                 |
| (21.368)  | TTM Technologies Inc                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 1.200.000 | TUI AG                               | UBS AG                      | 210.250                        | 0,01                 |
| 5.200     | TV Asahi Holdings Corp               | BofA Securities             | 582                            | 0,00                 |
| (454.000) | Twelve Seas Investment Co II Class A | Goldman Sachs International | 10.500                         | 0,00                 |



## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung             | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|-----------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 16.416      | Twelve Seas Investment Company II | Goldman Sachs International | 717                            | 0,00                 |
| 4.100       | Twilio Inc Class A                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (7.700)     | Two Harbors Investment Corp       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (2.800)     | Tyler Technologies Inc            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (263.774)   | Tyson Foods Inc Class A           | Morgan Stanley              | 11.749                         | 0,00                 |
| (211.835)   | Tyson Foods Inc Class A           | Goldman Sachs International | 8.942                          | 0,00                 |
| 48.812      | Uber Technologies Inc             | Goldman Sachs International | 106                            | 0,00                 |
| (300.390)   | Uber Technologies Inc             | Morgan Stanley              | 104.957                        | 0,01                 |
| (94.357)    | Uber Technologies Inc             | JPMorgan Chase Bank         | 8.537                          | 0,00                 |
| –           | Uber Technologies Inc1            | Goldman Sachs International | 2.755.683                      | 0,12                 |
| 2.100       | Ubiquiti Inc                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 4.500.000   | UBS Group AG                      | Société Générale            | 110.418                        | 0,01                 |
| 505.200     | UCB SA                            | JPMorgan Chase Bank         | 3.784                          | 0,00                 |
| 40.957      | UCB SA                            | Morgan Stanley              | 2.510                          | 0,00                 |
| 6.200       | Udemy Inc                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.500)     | UDR Inc                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (900)       | UFP Industries Inc                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (4.100)     | UFP Technologies Inc              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 25.600      | UGI Corp                          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.000)     | U-Haul Holding Co                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (62.872)    | UiPath Inc Class A                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (107.325)   | UK Commercial Property REIT Ltd   | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (1.595.230) | Ulta Beauty Inc                   | JPMorgan Chase Bank         | 67.136                         | 0,00                 |
| (1.114.572) | Ulta Beauty Inc                   | Goldman Sachs International | 99.235                         | 0,01                 |
| 610.080     | Ulta Beauty Inc                   | Morgan Stanley              | 146.451                        | 0,01                 |
| 400         | Ultra Clean Holdings Inc          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 1.200       | Ulvac Inc                         | BofA Securities             | 1.332                          | 0,00                 |
| (15.900)    | UMH Properties Inc                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (54.950)    | Umicore SA                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (60.300)    | Under Armour Inc Class A          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (66.300)    | Under Armour Inc Class C          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (30.323)    | Unibail-Rodamco-Westfield         | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (1.900)     | Unicharm Corp                     | BofA Securities             | 3.531                          | 0,00                 |
| 600         | UniFirst Corp                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 2.201       | Unilever Plc                      | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 172.774     | Unilever Plc                      | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (266.148)   | Union Pacific Corp                | Morgan Stanley              | 2.502                          | 0,00                 |
| (1.766.269) | Union Pacific Corp                | JPMorgan Chase Bank         | 38.008                         | 0,00                 |
| 11.000      | United Airlines Holdings Inc      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 14.200      | United Bankshares Inc             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (10.300)    | United Community Banks Inc        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung                 | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|---------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 20.900      | United Natural Foods Inc              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 3.400       | United Parcel Service Inc Class B     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (135.897)   | United Rentals Inc                    | Morgan Stanley              | 181.404                        | 0,01                 |
| 1.000       | United States Cellular Corp           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 31.480      | United States Steel Corp              | Morgan Stanley              | 39.467                         | 0,00                 |
| (139.930)   | United Therapeutics Corp              | JPMorgan Chase Bank         | 271                            | 0,00                 |
| 31.199      | United Utilities Group Plc            | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (443.117)   | UnitedHealth Group Inc                | Goldman Sachs International | 550                            | 0,00                 |
| (5.300)     | UnitedHealth Group Inc                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 4.300       | Unitil Corp                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (28.600)    | Unity Software Inc                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (2.100)     | Univar Solutions Inc                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (71.741)    | Universal Display Corp                | Morgan Stanley              | 4.029                          | 0,00                 |
| (466.692)   | Universal Display Corp                | JPMorgan Chase Bank         | 20.093                         | 0,00                 |
| (197.424)   | Universal Health Services Inc Class B | Goldman Sachs International | 24.719                         | 0,00                 |
| (915.513)   | Universal Health Services Inc Class B | JPMorgan Chase Bank         | 156.794                        | 0,01                 |
| (506.644)   | Universal Health Services Inc Class B | Morgan Stanley              | 102.494                        | 0,01                 |
| 32.900      | Upbound Group Inc                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (61.165)    | UPM-Kymmene OYJ                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (22.900)    | Upstart Holdings Inc                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (23.500)    | Upwork Inc                            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 600         | Urban Edge Properties                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 56.012      | Urban Logistics REIT Plc              | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 26.600      | Urban Outfitters Inc                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (3.700)     | US Bancorp                            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 6.700       | US Foods Holding Corp                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (3.900)     | US Physical Therapy Inc               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (7.641)     | US Silica Holdings Inc                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 2.400       | USANA Health Sciences Inc             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.300)     | Usen-Next Holdings Co Ltd             | BofA Securities             | 61                             | 0,00                 |
| (1.600)     | Ushio Inc                             | BofA Securities             | 153                            | 0,00                 |
| (5.600)     | USS Co Ltd                            | BofA Securities             | 1.173                          | 0,00                 |
| (15.400)    | Utz Brands Inc                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.700)     | Vail Resorts Inc                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (4.600)     | Valaris Ltd                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 139.829     | Valeo                                 | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (4.600)     | Valero Energy Corp                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (107.600)   | Valley National Bancorp               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (218.890)   | Valmet OYJ                            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 2.400       | Valmont Industries Inc                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (2.966.544) | Valvoline Inc                         | Morgan Stanley              | 198.786                        | 0,01                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung                | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|--------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (3.100)   | Varex Imaging Corp                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 1.700     | Varonis Systems Inc                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (9.131)   | Vaxcyte Inc                          | JPMorgan Chase Bank         | 168                            | 0,00                 |
| (36.383)  | Vaxcyte Inc                          | Goldman Sachs International | 1.350                          | 0,00                 |
| (3.300)   | Veeco Instruments Inc                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 4.800     | Veeva Systems Inc Class A            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 35.300    | Ventas Inc                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (16.900)  | Ventyx Biosciences Inc               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (27.300)  | Veradigm Inc                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (10.800)  | Verint Systems Inc                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 35.600    | Veris Residential Inc                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 4.600     | Verisk Analytics Inc                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 15.700    | Veritex Holdings Inc                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.400)   | Veritiv Corp                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 314.772   | Verizon Communications Inc           | JPMorgan Chase Bank         | 7.301                          | 0,00                 |
| (41.800)  | Verizon Communications Inc           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (23.900)  | Verra Mobility Corp                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 14.800    | Vertex Inc                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 140.640   | Vertiv Holdings Co                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (65.227)  | Vestas Wind Systems A/S              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 2.783     | Vesuvius Plc                         | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (9.400)   | VF Corp                              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (30.500)  | Viasat Inc                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (84.000)  | Viatis Inc                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 2.300     | Viavi Solutions Inc                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 72.193    | VICI Properties Inc                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (10.800)  | Vicor Corp                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 415.579   | Victoria's Secret & Co               | JPMorgan Chase Bank         | 7.869                          | 0,00                 |
| 8.400     | Victoria's Secret & Co               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 24.800    | Victory Capital Holdings Inc Class A | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 8.181     | Vicorex Plc                          | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 20.900    | Viper Energy Partners LP             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 3.284.948 | Virgin Galactic Holdings Inc         | Nomura                      | 1.289.030                      | 0,06                 |
| (40)      | Virgin Galactic Holdings Inc         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (113.516) | Virgin Money UK Plc                  | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 8.500     | Virtu Financial Inc Class A          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (100)     | Virtus Investment Partners Inc       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (12.500)  | Visa Inc Class A                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (34.900)  | Vishay Intertechnology Inc           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (6.500)   | Vision Inc                           | BofA Securities             | 2.108                          | 0,00                 |
| (28.700)  | Vista Outdoor Inc                    | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung            | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|----------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 55.737      | Visteon Corp                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (353.297)   | Vistra Corp                      | JPMorgan Chase Bank         | 4.748                          | 0,00                 |
| (361.090)   | Vistra Corp                      | Morgan Stanley              | 4.155                          | 0,00                 |
| 31.171      | Vistry Group Plc                 | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (3.800)     | Vita Coco Co Inc                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (7.500)     | Vital Energy Inc                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (23.344)    | Vital Farms Inc                  | JPMorgan Chase Bank         | 32                             | 0,00                 |
| (7.651)     | Vital Farms Inc                  | Morgan Stanley              | 141                            | 0,00                 |
| 37.095      | Vitesco Technologies Group AG    | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (117.332)   | Vodafone Group Plc               | BofA Securities             | 132                            | 0,00                 |
| (28.839)    | Volution Group Plc               | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 497.982     | Volvo AB Class B                 | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (223.144)   | Volvo Car AB                     | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (156.939)   | Vonovia SE                       | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 200         | Vontier Corp                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 15.200      | Vornado Realty Trust             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 12.500      | Voya Financial Inc               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (2.494.308) | Vulcan Materials Co              | Goldman Sachs International | 465.607                        | 0,02                 |
| (123.791)   | Vulcan Materials Co              | Morgan Stanley              | 32.864                         | 0,00                 |
| 23.400      | Wabash National Corp             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 48.953      | Wacker Chemie AG                 | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 500         | Wacoal Holdings Corp             | BofA Securities             | 48                             | 0,00                 |
| 702.160     | Walgreens Boots Alliance Inc     | JPMorgan Chase Bank         | 148.154                        | 0,01                 |
| 49.069      | Walgreens Boots Alliance Inc     | Goldman Sachs International | 357                            | 0,00                 |
| (5.200)     | Walker & Dunlop Inc              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.900.696) | Walmart Inc                      | JPMorgan Chase Bank         | 87.163                         | 0,01                 |
| (441.653)   | Walmart Inc                      | Morgan Stanley              | 20.574                         | 0,00                 |
| (108.451)   | Walmart Inc                      | Goldman Sachs International | 2.280                          | 0,00                 |
| (3.400)     | Walt Disney Co                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 115.203     | Walt Disney Co                   | JPMorgan Chase Bank         | 7.148                          | 0,00                 |
| 34.400      | Warby Parker Inc Class A         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 58.051      | Warner Bros Discovery Inc        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 9.000       | Warner Music Group Corp Class A  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (8.100)     | Warrior Met Coal Inc             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (526.136)   | Wartsila OYJ Abp                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 1.600       | Washington Federal Inc           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (5.500)     | Waste Management Inc             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (12.230)    | Watches of Switzerland Group Plc | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 287.302     | Waters Corp                      | JPMorgan Chase Bank         | 32.384                         | 0,00                 |
| 4.100       | Waters Corp                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (17.295)    | Watsco Inc                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung                    | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|--|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (3.200)     | Watts Water Technologies Inc Class A     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (300)       | WD-40 Co                                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (29.903)    | Weatherford International Plc            | Goldman Sachs International | 779                            | 0,00                 |
| (1.126.281) | Weatherford International Plc            | Morgan Stanley              | 126.020                        | 0,01                 |
| (3.263)     | Webster Financial Corp                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 12.000      | WEC Energy Group Inc                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (14.002)    | Weir Group Plc                           | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 2.400       | Weis Markets Inc                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 7.500       | Welcia Holdings Co Ltd                   | BofA Securities             | 1.525                          | 0,00                 |
| 39.210      | Wells Fargo & Co                         | Morgan Stanley              | 1.026                          | 0,00                 |
| (277.881)   | Wells Fargo & Co                         | Goldman Sachs International | 12.014                         | 0,00                 |
| (19.200)    | Welltower Inc                            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 38.500      | Wendy's Co                               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 14.400      | Werner Enterprises Inc                   | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 500         | WesBanco Inc                             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (4.600)     | WESCO International Inc                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (482.903)   | West Pharmaceutical Services Inc         | Goldman Sachs International | 35.896                         | 0,00                 |
| (400)       | West Pharmaceutical Services Inc         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (3.200)     | Westamerica BanCorp                      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (122.520)   | Western Digital Corp                     | Morgan Stanley              | 3.667                          | 0,00                 |
| 36.400      | Western Midstream Partners LP            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 54.100      | Western Union Co                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (3.800)     | Westinghouse Air Brake Technologies Corp | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (6.400)     | Westlake Corp                            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 18.000      | Westrock Co                              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 1.300       | WEX Inc                                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 9.700       | Weyerhaeuser Co                          | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (19.604)    | WH Smith Plc                             | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (5.400)     | Whirlpool Corp                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 7.755       | Whitbread Plc                            | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (100)       | White Mountains Insurance Group Ltd      | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 270.970     | Whitecap Resources Inc                   | Goldman Sachs International | 947                            | 0,00                 |
| 183.220     | Whitecap Resources Inc                   | JPMorgan Chase Bank         | 5.529                          | 0,00                 |
| (7.400)     | Williams-Sonoma, Inc                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (2.000)     | Wills Towers Watson Plc                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 56.700      | WillScot Mobile Mini Holdings Corp       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 8.600       | Wingstop Inc                             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 1.400       | Winmark Corp                             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (500)       | Winnebago Industries Inc                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 1.100       | Wintrust Financial Corp                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 33.600      | WisdomTree Inc                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung                     | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|---|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (982)       | Wise Plc Class A                          | JPMorgan Chase Bank         | 20                             | 0,00                 |
| 6.109       | Wise Plc Class A                          | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 9.700       | Wix.com Ltd                               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 2.842       | Wizz Air Holdings Plc                     | BofA Securities             | 23                             | 0,00                 |
| (23.901)    | Wizz Air Holdings Plc                     | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (65)        | Wolfspeed Inc                             | Morgan Stanley              | 4.178                          | 0,00                 |
| (120.176)   | Wolfspeed Inc                             | Goldman Sachs International | 32.949                         | 0,00                 |
| (35.529)    | Wolters Kluwer NV                         | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (47.856)    | Woodward Inc                              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (3.889.613) | Woolworths Holdings Ltd                   | Morgan Stanley              | 296                            | 0,00                 |
| (2.617.210) | Woolworths Holdings Ltd                   | Goldman Sachs International | 1.290                          | 0,00                 |
| (262.481)   | Workday Inc Class A                       | JPMorgan Chase Bank         | 21.779                         | 0,00                 |
| (281.797)   | Workday Inc Class A                       | Goldman Sachs International | 46.992                         | 0,00                 |
| (304.707)   | Workday Inc Class A                       | Morgan Stanley              | 53.688                         | 0,00                 |
| 3.400       | Workiva Inc                               | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 10.040      | Workspace Group Plc                       | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| (3.800)     | World Kinect Corp                         | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (370.541)   | World Wrestling Entertainment Inc         | Goldman Sachs International | 82.338                         | 0,01                 |
| (283.077)   | World Wrestling Entertainment Inc         | Morgan Stanley              | 21.278                         | 0,00                 |
| (23.068)    | World Wrestling Entertainment Inc         | JPMorgan Chase Bank         | 1.435                          | 0,00                 |
| (1.400)     | World Wrestling Entertainment Inc Class A | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 10.200      | Worthington Industries Inc                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (6.800)     | WP Carey Inc                              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (314.796)   | WPP Plc                                   | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (4.020)     | WSFS Financial Corp                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (1.600)     | WW Grainger Inc                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (10.646)    | WW International Inc                      | JPMorgan Chase Bank         | 119                            | 0,00                 |
| 15.900      | Wyndham Hotels & Resorts Inc              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (158.182)   | Wynn Resorts Ltd                          | Goldman Sachs International | 1.872                          | 0,00                 |
| 31.500      | Xcel Energy Inc                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 6.200       | Xenia Hotels & Resorts Inc                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (214.011)   | Xenon Pharmaceuticals Inc                 | Goldman Sachs International | 15.302                         | 0,00                 |
| (116.545)   | Xenon Pharmaceuticals Inc                 | JPMorgan Chase Bank         | 905                            | 0,00                 |
| 25.700      | Xerox Holdings Corp                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 7.200.000   | Xiaomi Best Time International Ltd        | Nomura                      | 4.176                          | 0,00                 |
| (3.780.064) | Xiaomi Corp Class B                       | Société Générale            | 50.728                         | 0,00                 |
| 24.200      | XP Inc Class A                            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (2.800)     | XPEL Inc                                  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (20)        | Xperi Inc                                 | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (129.853)   | XPO Inc                                   | Goldman Sachs International | 34.635                         | 0,00                 |
| (123.852)   | XPO Inc                                   | Morgan Stanley              | 28.798                         | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 4,43 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung                 | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (2.500)   | Xponential Fitness Inc Class A        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 6.500   | Xylem Inc                             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 600   | Yamaha Corp                           | BofA Securities             | 255                            | 0,00                 |
| (1.800)   | Yamato Holdings Co Ltd                | BofA Securities             | 287                            | 0,00                 |
| 300   | Yamazaki Baking Co Ltd                | BofA Securities             | 6                              | 0,00                 |
| 500   | Yaoko Co Ltd                          | BofA Securities             | 107                            | 0,00                 |
| 43.681  | Yara International ASA                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 9.366.917   | Yeahka Ltd                            | Nomura                      | 1.048.540                      | 0,05                 |
| 25.414  | Yellow Cake Plc                       | BofA Securities             | 0                              | 0,00                 |
| 6.000   | Yelp Inc                              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 12.700  | YETI Holdings Inc                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 91.100  | Yext Inc                              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (3.000)   | Yokogawa Electric Corp                | BofA Securities             | 2.118                          | 0,00                 |
| 9.600   | Yonex Co Ltd                          | BofA Securities             | 1.320                          | 0,00                 |
| (5.800)   | Yoshinoya Holdings Co Ltd             | BofA Securities             | 4.095                          | 0,00                 |
| 11.300  | Yum China Holdings Inc                | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 4.300   | Yum! Brands Inc                       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (4.500)   | Zebra Technologies Corp Class A       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 17.700  | Zeon Corp                             | BofA Securities             | 1.628                          | 0,00                 |
| (27.000)  | Zeta Global Holdings Corp Class A     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (600)   | Ziff Davis Inc                        | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 19.700  | Zillow Group Inc Class A              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 34.109  | Zillow Group Inc Class C              | Morgan Stanley              | 58.526                         | 0,00                 |
| 9.000.000   | Zillow Group Inc                      | BofA Securities             | 584.094                        | 0,03                 |
| (72.400)  | ZIM Integrated Shipping Services Ltd  | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (2.615.399)   | Zimmer Biomet Holdings Inc            | Goldman Sachs International | 144.725                        | 0,00                 |
| (9.600)   | Zimmer Biomet Holdings Inc            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (316.106)   | Zimmer Biomet Holdings Inc            | JPMorgan Chase Bank         | 36.429                         | 0,00                 |
| 2.000   | ZipRecruiter Inc Class A              | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (11.416)  | Zoetis Inc                            | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 25.300  | Zoom Video Communications Inc Class A | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (16.600)  | ZoomInfo Technologies Inc             | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| (6.700)   | Zscaler Inc                           | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 13.915.051  | ZTO Express Cayman Inc                | Goldman Sachs International | 1.684.337                      | 0,08                 |
| 47.200  | Zuora Inc Class A                     | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| 985.516   | Zur Rose Group AG                     | Société Générale            | 76.919                         | 0,00                 |
| (8.600)   | Zurn Elkay Water Solutions Corp       | Morgan Stanley              | 0                              | 0,00                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Differenzkontrakten <sup>∞</sup></b> |                                       |                             | <b>101.264.369</b>             | <b>4,43</b>          |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

**Gekaufte Swaptions 0,01 % (31. Dezember 2022: 0,04 %)**

| Nominalwert   | Fälligkeit | Beschreibung  | Gegenpartei                 | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|------------|---|-----------------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Call Swaptions</b>   |            |   |                             |                  |                              |
| 445.000.000 EUR   | 19.07.2023 | EUR Swaption, bei potenzieller Ausübung der Option geht das Portfolio ein Swappeschäft mit einem Nominalwert von 445.000.000 EUR ein, in dessen Rahmen er einen Satz von 1,00 % zahlt und iTraxx EUR S39 erhält, Ausübungssatz 1,05 % | JPMorgan Chase Bank         | 96.439           | 0,01                         |
| <b>Put-Swaptions</b>  |            |   |                             |                  |                              |
| 200.000.000 USD   | 03.07.2023 | Constant Maturity Swap auf Spread zwischen 10-jährigen und 2-jährigen USD Constant Maturity Swap-Sätzen, Ausübung 0,50 %  | Goldman Sachs International | 0                | 0,00                         |
| <b>Beizulegender Zeitwert aus gekauften Swaptions insgesamt <sup>∞</sup> (Prämie: 600.889 US\$)</b> |            |   |                             | <b>96.439</b>    | <b>0,01</b>                  |

**Credit-Default-Swap-Kontrakte 0,01 % (31. Dezember 2022: 0,05 %)**

| Nominalwert   | Datum der Schließung | Gegenpartei                 | Referenz-obligation                                     | Zeitwert<br>USD | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|----------------------|-----------------------------|---|-----------------|------------------------------|
| 17.700.000 USD  | 20.06.2025           | Goldman Sachs International | Buying default protection on Meituan, 2.13%, 28/10/2025 | 147.694         | 0,01                         |
| 1.000.000 USD   | 20.06.2025           | Goldman Sachs International | Buying default protection on Meituan, 2.13%, 28/10/2025 | 8.344           | 0,00                         |
| <b>Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten insgesamt <sup>±</sup></b> |                      |                             |   | <b>156.038</b>  | <b>0,01</b>                  |

**Zinsswap-Kontrakte 1,18 % (31. Dezember 2022: 2,10 %)**

| Nominalwert | Fälligkeit     | Gegenpartei | Erhalt/<br>(Zahlung) <sup>#</sup>        | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |      |
|-------------|----------------|-------------|--|-----------------|--------------------|--------------------------------------|------------------------------|------|
| EUR         | 348.000.000    | 20.12.2023  | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt          | (0,18 %)           | 12M EURIBOR                          | 5.682.620                    | 0,25 |
| EUR         | 347.900.000    | 20.12.2023  | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt          | (0,15 %)           | 1D EURIBOR                           | 5.627.481                    | 0,25 |
| EUR         | 1.020.000.000  | 20.03.2024  | Merrill Lynch International              | Erhalt          | 3,46 %             | 1D EURIBOR                           | 3.467.747                    | 0,15 |
| EUR         | 149.000.000    | 20.12.2023  | Merrill Lynch International              | Erhalt          | (0,18 %)           | 1D EURIBOR                           | 2.392.873                    | 0,11 |
| EUR         | 149.100.000    | 20.12.2023  | Merrill Lynch International              | Erhalt          | (0,15 %)           | 1D EURIBOR                           | 2.372.288                    | 0,10 |
| MXN         | 1.555.200.000  | 17.06.2026  | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)       | 9,50 %             | 28D MXIBTIIE                         | 1.155.634                    | 0,05 |
| MXN         | 2.883.200.000  | 27.11.2024  | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | Erhalt          | 9,93 %             | 28D MXIBTIIE                         | 1.048.362                    | 0,05 |
| JPY         | 15.695.000.000 | 15.03.2026  | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)       | 0,00 %             | 12M JPY LIBOR                        | 1.037.932                    | 0,05 |
| USD         | 95.000.000     | 12.06.2025  | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt          | 4,45 %             | 1D SOFR                              | 676.137                      | 0,03 |
| JPY         | 15.436.000.000 | 15.03.2026  | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)       | 0,29 %             | 12M JPY LIBOR                        | 486.110                      | 0,02 |
| JPY         | 14.600.000.000 | 15.03.2026  | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)       | 0,29 %             | 12M JPY LIBOR                        | 457.049                      | 0,02 |
| USD         | 57.024.000     | 12.06.2025  | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt          | 4,42 %             | 1D SOFR                              | 442.786                      | 0,02 |
| BRL         | 5.596.076.455  | 02.10.2023  | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)       | 13,47 %            | 1D BROIS                             | 228.564                      | 0,01 |
| GBP         | 986.400.000    | 03.08.2023  | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt          | 4,77 %             | 1D SONIA                             | 225.781                      | 0,01 |
| AUD         | 7.246.800.000  | 05.07.2023  | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt          | 3,88 %             | 1D AONIA                             | 210.994                      | 0,01 |



## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Zinsswap-Kontrakte 1,18 % (31. Dezember 2022: 2,10 %) (Fortsetzung)

|  | Nominalwert    | Fälligkeit | Gegenpartei                                 | Erhalt/<br>(Zahlung) <sup>#</sup> | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|----------------|------------|---|-----------------------------------|-----------------|--------------------|--------------------------------------|------------------------------|
| AUD  | 278.568.000    | 09.06.2024 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>               | Erhalt                            | 4,45 %          | 1D AONIA           | 208.294                              | 0,01                         |
| AUD  | 279.400.000    | 09.06.2024 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>               | Erhalt                            | 4,47 %          | 1D AONIA           | 183.660                              | 0,01                         |
| JPY  | 4.248.000.000  | 20.09.2033 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>               | Erhalt                            | 0,58 %          | 6M JPY LIBOR       | 120.092                              | 0,01                         |
| GBP  | 491.904.000    | 03.08.2023 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>               | Erhalt                            | 4,76 %          | 1D SONIA           | 114.626                              | 0,01                         |
| AUD  | 3.591.600.000  | 05.07.2023 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>               | Erhalt                            | 3,89 %          | 1D AONIA           | 101.296                              | 0,01                         |
| CZK  | 3.487.500.000  | 25.04.2024 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>               | (Zahlung)                         | 6,55 %          | 1D PRIBOR          | 96.341                               | 0,00                         |
| CZK  | 10.125.000.000 | 25.10.2023 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>               | (Zahlung)                         | 7,20 %          | 1D PRIBOR          | 89.204                               | 0,00                         |
| BRL  | 2.056.332.485  | 02.10.2023 | Chicago Mercantile<br>Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)                         | 13,47 %         | 1D BROIS           | 75.979                               | 0,00                         |
| BRL  | 3.364.656.234  | 02.10.2023 | Chicago Mercantile<br>Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)                         | 13,44 %         | 1D BROIS           | 70.627                               | 0,00                         |
| CZK  | 3.375.000.000  | 25.01.2024 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>               | (Zahlung)                         | 7,10 %          | 1D PRIBOR          | 59.835                               | 0,00                         |
| CZK  | 3.375.000.000  | 25.01.2024 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>               | (Zahlung)                         | 7,09 %          | 1D PRIBOR          | 56.015                               | 0,00                         |
| CAD  | 1.008.000.000  | 13.07.2023 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>               | Erhalt                            | 4,63 %          | 1D CAD BA          | 40.929                               | 0,00                         |
| JPY  | 4.550.400.000  | 20.09.2033 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>               | Erhalt                            | 0,61 %          | 12M JPY LIBOR      | 37.612                               | 0,00                         |
| USD  | 186.962.400    | 05.07.2024 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>               | (Zahlung)                         | 5,38 %          | 1D SOFR            | 19.706                               | 0,00                         |
| JPY  | 4.248.000.000  | 20.09.2033 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>               | Erhalt                            | 0,62 %          | 12M JPY LIBOR      | 19.296                               | 0,00                         |
| CZK  | 3.315.000.000  | 25.01.2024 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>               | (Zahlung)                         | 6,98 %          | 1D PRIBOR          | 13.729                               | 0,00                         |
| CZK  | 3.525.000.000  | 25.04.2024 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>               | (Zahlung)                         | 6,32 %          | 1D PRIBOR          | 7.825                                | 0,00                         |
| PLN  | 100.000        | 15.12.2026 | Intercontinental Exchange <sup>1</sup>      | Erhalt                            | 1,44 %          | 6M WIBOR           | 2.852                                | 0,00                         |
| USD  | 95.292.000     | 05.07.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>               | Erhalt                            | 4,80 %          | 1D SOFR            | 1.887                                | 0,00                         |
| AUD  | 284.400.000    | 03.07.2024 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>               | Erhalt                            | 4,57 %          | 1D AONIA           | 85                                   | 0,00                         |
| CZK  | 3.502.500.000  | 25.04.2024 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>               | (Zahlung)                         | 6,30 %          | 1D PRIBOR          | 39                                   | 0,00                         |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Zinsswapkontrakten <sup>∞</sup></b> |                |            |   |                                   |                 |                    | <b>26.832.287</b>                    | <b>1,18</b>                  |

<sup>#</sup>Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

### Total Return Swap-Kontrakte 0,08 % (31. Dezember 2022: 0,12 %)

|  | Nominalwert     | Datum der<br>Schließung | Variabler Zinssatz | Referenzunternehmen                          | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|-----------------|-------------------------|--------------------|--|--------------------------------------|------------------------------|
|  | 33.765.579 USD  | 28.04.2024              | 1,09 <sup>1</sup>  | Société Générale Basket SGBVRRU <sup>2</sup> | 1.126.984                            | 0,05                         |
|  | 94.615.852 USD  | 24.04.2025              | 0,00 <sup>3</sup>  | Goldman Sachs Basket GSVIDI1B <sup>4</sup>   | 473.301                              | 0,02                         |
|  | (2.026.255) USD | 06.11.2024              | 4,80 <sup>5</sup>  | Morgan Stanley Basket MSNBUXLP <sup>6</sup>  | 77.507                               | 0,01                         |
|  | (693.320) USD   | 06.11.2024              | 4,82 <sup>5</sup>  | Morgan Stanley Basket MSXXSTAP <sup>6</sup>  | 36.758                               | 0,00                         |
|  | (1.308.267) USD | 09.02.2024              | 4,66 <sup>7</sup>  | JPMorgan Basket JP1STP <sup>2</sup>          | 20.373                               | 0,00                         |
|  | 996.467 USD     | 06.11.2024              | 5,50 <sup>5</sup>  | Morgan Stanley Basket MSNBUIH <sup>6</sup>   | 18.482                               | 0,00                         |
|  | (1.425.518) USD | 06.11.2024              | 4,80 <sup>5</sup>  | Morgan Stanley Basket MSABSMBP <sup>6</sup>  | 16.940                               | 0,00                         |
|  | (1.623.607) USD | 06.11.2024              | 4,85 <sup>5</sup>  | Morgan Stanley Basket MSNBUXLP <sup>6</sup>  | 8.359                                | 0,00                         |
|  | (539.154) USD   | 25.06.2024              | 4,66 <sup>7</sup>  | JPMorgan Basket JP1STP <sup>8</sup>          | 5.235                                | 0,00                         |
|  | (329.771) USD   | 17.06.2033              | 5,06 <sup>1</sup>  | Goldman Sachs Basket GSXUEDEF <sup>4</sup>   | 3.490                                | 0,00                         |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Total Return Swap-Kontrakte 0,08 % (31. Dezember 2022: 0,12 %) (Fortsetzung)

| Nominalwert  | Datum der Schließung | Variabler Zinssatz | Referenzunternehmen                         | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|----------------------|--------------------|---|--------------------------------|----------------------|
| 284.827 USD  | 06.11.2024           | 4,79 <sup>5</sup>  | Morgan Stanley Basket MSNBUIWM <sup>6</sup> | 3.357                          | 0,00                 |
| (189.943) USD  | 04.06.2025           | 4,80 <sup>5</sup>  | Morgan Stanley Basket MSNBUXBI <sup>6</sup> | 2.903                          | 0,00                 |
| 2.524.339 USD  | 01.08.2023           | 4,30 <sup>1</sup>  | Goldman Sachs S&P 500 TR Index <sup>4</sup> | 542                            | 0,00                 |
| (8.306) USD  | 06.11.2024           | 4,80 <sup>5</sup>  | Morgan Stanley Basket MSNBUXBI <sup>6</sup> | 357                            | 0,00                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Total Return Swap-Kontrakten <sup>∞</sup></b> |                      |                    |   | <b>1.794.588</b>               | <b>0,08</b>          |

<sup>1</sup> Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist der 1-Tag-SOFR.

<sup>2</sup> Die Gegenpartei für die Total Return Swap-Kontrakte ist Société Générale.

<sup>3</sup> Fester Zinssatz.

<sup>4</sup> Die Gegenpartei für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist Goldman Sachs International.

<sup>5</sup> Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist der 1-Tag-FEDEF.

<sup>6</sup> Die Gegenpartei für die Total Return Swap-Kontrakte ist Morgan Stanley.

<sup>7</sup> Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist der 1-Tag-OBFR.

<sup>8</sup> Die Gegenpartei für die Total Return Swap-Kontrakte ist die JPMorgan Chase Bank.

### Correlation-Swap-Kontrakte 0,02 % (31. Dezember 2022: 0,02 %)

| Nominalwert   | Datum der Schließung | Gegenpartei | Referenzobligation  | Korrelation zum Ausübungszeitpunkt in Prozent | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|----------------------|-------------|---|---|--------------------------------|----------------------|
| 5.000.000 USD   | 20.12.2024           | BNP Paribas | Basket of S&P 500 /Nikkei 225 Index correlation swap 20/12/2024 | 80,50 %                                       | 397.208                        | 0,02                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Correlation-Swap-Kontrakten <sup>∞</sup></b> |                      |             |   |   | <b>397.208</b>                 | <b>0,02</b>          |

### Inflation-Swap-Kontrakte 0,14 % (31. Dezember 2022: 0,03 %)

| Vega Nominalwert            | Datum der Schließung | Gegenpartei                 | Referenzobligation                            | Variance-Ausübungssatz  | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------------------------|----------------------|-----------------------------|---|-------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 500.000 USD                 | 19.01.2024           | Citibank NA                 | CITI 19 Names US Basket                       | Verschiedene            | 914.819                        | 0,04                 |
| 200.000 USD                 | 15.12.2023           | BNP Paribas                 | Euro Stoxx Banks vs S&P 500 Synchronous close | 34,41 vs 27,62          | 732.860                        | 0,03                 |
| 400.000 USD                 | 20.12.2024           | UBS                         | UBS 35 Names US Basket                        | Verschiedene            | 312.405                        | 0,01                 |
| 884.638 USD                 | 20.11.2024           | Goldman Sachs International | GS 128 Pairwise Theta Flat CoVol              | Verschiedene            | 289.306                        | 0,01                 |
| 200.000 USD                 | 08.12.2023           | Goldman Sachs International | Nikkei 225 Index vs S&P 500 Index             | 27,00 vs 23,60          | 139.240                        | 0,01                 |
| 400.000 USD                 | 20.12.2024           | BNP Paribas                 | BNP US Geo Basket                             | Verschiedene            | 120.240                        | 0,01                 |
| 250.000 EUR                 | 21.03.2025           | BNP Paribas                 | Euro Stoxx 50 Index vs FTSE 100 Index         | 16,00 vs 15,05          | 118.260                        | 0,01                 |
| 125.000 USD                 | 13.06.2025           | BNP Paribas                 | S&P 500 Index vs Nikkei 225 Index             | 16,00 vs 19,60          | 116.723                        | 0,01                 |
| 400.000 USD                 | 20.12.2024           | UBS                         | UBS 38 Names US Basket                        | Verschiedene            | 107.562                        | 0,01                 |
| 250.000 USD                 | 20.12.2024           | UBS                         | UBS 50 Names Global Basket                    | Verschiedene            | 101.770                        | 0,00                 |
| 400.000 USD                 | 20.12.2024           | Goldman Sachs International | Russell 2000 Index vs S&P 500 Index           | 25,69 vs 28,15 vs 26,43 | 74.696                         | 0,00                 |
| 125.000 EUR/<br>150.000 EUR | 19.12.2025           | BNP Paribas                 | Euro Stoxx 50 Index                           | Verschiedene            | 59.584                         | 0,00                 |
| 100.000 USD                 | 23.02.2024           | Goldman Sachs International | GS 5 Index Thematic                           | Verschiedene            | 47.503                         | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Inflation-Swap-Kontrakte 0,14 % (31. Dezember 2022: 0,03 %) (Fortsetzung)

| Vega Nominalwert   | Datum der Schließung | Gegenpartei                 | Referenz-obligation                    | Variance-Ausübungssatz | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|----------------------|-----------------------------|--|------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 500.000 USD  | 20.12.2024           | Citibank NA                 | Russell 2000 Index vs Nasdaq-100 Index | 33,8 vs 34,00 vs 35,00 | 34.344                         | 0,00                 |
| 75.000 USD   | 17.01.2024           | Goldman Sachs International | GS 5 Index Thematic                    | Verschiedene           | 20.869                         | 0,00                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Variance-Swap-Kontrakten <sup>∞</sup></b> |                      |                             |  |                        | <b>3.190.181</b>               | <b>0,14</b>          |

### Inflation-Swap-Kontrakte 1,12 % (31. Dezember 2022: 1,03 %)

| Nominalwert                  | Datum der Schließung | Gegenpartei                 | Referenzobligation <sup>1</sup>       | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|------------------------------|----------------------|-----------------------------|---------------------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 100.000.000 EUR              | 21.06.2024           | BNP                         | BNP 30 Names Slider European Basket   | 3.231.031                      | 0,14                 |
| 110.000.000 EUR              | 20.06.2024           | BNP                         | BNP 20 Names Slider European Basket   | 3.170.989                      | 0,14                 |
| 75.000.000 EUR               | 21.06.2024           | BNP                         | BNP 19 Names EU and US Slider Basket  | 2.331.928                      | 0,10                 |
| 50.000.000 EUR               | 15.12.2023           | BNP                         | BNP 4 Names EU Down Geo Basket        | 2.102.861                      | 0,09                 |
| 75.000.000 EUR               | 15.12.2023           | BNP                         | BNP 8 Names EU Down Geo Basket        | 1.692.197                      | 0,08                 |
| 50.000.000 EUR <sup>2</sup>  | 15.12.2023           | BNP                         | BNP 10 Names Global Geo Basket        | 1.619.950                      | 0,07                 |
| 3.500.000 EUR                | 15.12.2023           | BofA Securities             | BAML 14 Names EU Basket               | 1.157.542                      | 0,05                 |
| 25.000.000 EUR               | 15.12.2023           | BNP                         | BNP 30 Names Slider European Basket   | 877.818                        | 0,04                 |
| 50.000.000 EUR               | 15.12.2023           | BNP                         | BNP 20 Names EU Basket                | 772.612                        | 0,04                 |
| 35.000.000 EUR               | 15.12.2023           | BofA Securities             | BAML 18 Names EU Basket               | 713.229                        | 0,03                 |
| 35.000.000 EUR               | 15.12.2023           | BNP                         | BNP 20 Names Slider European Basket   | 560.667                        | 0,03                 |
| 20.487.000 USD               | 21.06.2024           | Société Générale            | SG 15 Names Global Basket             | 477.000                        | 0,02                 |
| 50.000.000 USD               | 19.01.2024           | Citibank NA                 | CITI 18 Names US Basket               | 468.255                        | 0,02                 |
| 50.000.000 USD               | 17.01.2025           | Citibank NA                 | CITI 21 Names US Basket               | 362.945                        | 0,02                 |
| 30.000.000 USD               | 19.01.2024           | UBS                         | UBS 29 Names US Basket                | 360.414                        | 0,02                 |
| 35.000.000 EUR               | 15.12.2023           | BofA Securities             | BAML 14 Names EU Basket               | 312.442                        | 0,01                 |
| 30.000.000 EUR               | 15.12.2023           | BofA Securities             | BAML 12 Names EU Basket               | 297.383                        | 0,01                 |
| 20.000.000 USD               | 19.01.2024           | BofA Securities             | BAML 17 Names US Basket               | 296.941                        | 0,01                 |
| 20.000.000 EUR               | 20.12.2024           | BNP                         | BNP 15 Names EU Basket                | 293.264                        | 0,01                 |
| 6.000.000.000 EUR            | 20.12.2024           | BNP                         | BNP 5 Names EU Basket                 | 281.871                        | 0,01                 |
| 25.000.000 USD               | 17.01.2025           | BofA Securities             | BAML 17 Names US Basket               | 280.203                        | 0,01                 |
| 174.971.819 USD <sup>2</sup> | 12.01.2024           | Goldman Sachs International | GS 300 Pairwise Theta Flat CoVol      | 277.313                        | 0,01                 |
| 20.000.000 USD               | 17.01.2025           | Société Générale            | SG 13 Names US Basket                 | 272.000                        | 0,01                 |
| 26.666.700 USD               | 20.12.2024           | Société Générale            | SG 15 Names Global Basket             | 272.000                        | 0,01                 |
| 20.000.000 USD               | 17.01.2025           | UBS                         | UBS 17 Names US Basket                | 263.471                        | 0,01                 |
| 70.000.000 EUR <sup>2</sup>  | 15.12.2023           | BNP                         | Euro Stoxx 50 Index vs FTSE 100 Index | 247.534                        | 0,01                 |
| 25.000.000 USD               | 21.06.2024           | Société Générale            | SG 23 Names Global Basket             | 245.000                        | 0,01                 |
| 25.000.000 USD               | 17.01.2025           | UBS                         | UBS 39 Names US Basket                | 225.646                        | 0,01                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Volatility-Swap-Kontrakte 1,12 % (31. Dezember 2022: 1,03 %) (Fortsetzung)

| Nominalwert  | Datum der Schließung | Gegenpartei                 | Referenzobligation <sup>1</sup>    | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|----------------------|-----------------------------|------------------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 35.000.000 EUR   | 20.12.2024           | Société Générale            | SG 12 Names EU Basket              | 221.473                        | 0,01                 |
| 2.213.090 USD <sup>2</sup>   | 11.08.2023           | Goldman Sachs International | GS 296 Pairwise Theta Flat CoVol   | 183.541                        | 0,01                 |
| 20.000.000 USD   | 17.01.2025           | UBS                         | UBS 14 Names US Vanilla Basket     | 179.170                        | 0,01                 |
| 30.000.000 EUR   | 20.12.2024           | BNP                         | BNP 10 Names EU Basket             | 173.206                        | 0,01                 |
| 30.000.000 EUR   | 21.06.2024           | BofA Securities             | BAML 14 Names EU Basket            | 165.516                        | 0,01                 |
| 20.000.000 EUR   | 20.12.2024           | BNP                         | BNP 10 Names EU Down Geo Basket    | 163.005                        | 0,01                 |
| 60.000.000 EUR   | 20.12.2024           | BNP                         | BNP Down Pairwise EU Basket        | 159.524                        | 0,01                 |
| 2.870.000.000 JPY  | 15.12.2023           | BNP                         | BNP 29 Names Japan Corridor Basket | 153.000                        | 0,01                 |
| 10.000.000 EUR   | 21.06.2024           | Société Générale            | SG 10 Names EU Basket              | 116.427                        | 0,01                 |
| 15.000.000 USD   | 17.01.2025           | BofA Securities             | BAML 14 Names US Basket            | 92.880                         | 0,01                 |
| 20.000.000 EUR   | 21.06.2024           | BofA Securities             | BAML 9 Names EU Basket             | 81.842                         | 0,00                 |
| 15.000.000 USD   | 17.01.2025           | BofA Securities             | BAML 17 Names US Basket            | 61.801                         | 0,00                 |
| 20.000.000 USD   | 19.01.2024           | UBS                         | UBS 25 Names US Basket             | 52.627                         | 0,00                 |
| 40.000.000 EUR   | 15.12.2023           | BofA Securities             | BAML 15 Names EU Basket            | 43.337                         | 0,00                 |
| 7.500.000 USD  | 19.01.2024           | UBS                         | UBS 39 Names US Basket             | 36.700                         | 0,00                 |
| 25.000.000 EUR   | 20.12.2024           | BofA Securities             | BAML 16 Names EU Basket            | 34.839                         | 0,00                 |
| 20.000.000 USD   | 19.01.2024           | UBS                         | UBS 10 Names US Vanilla Basket     | 29.828                         | 0,00                 |
| 125.000 EUR  | 20.12.2024           | BNP                         | BNP 5 Names EU Down Geo Basket     | 21.717                         | 0,00                 |
| 125.000 EUR  | 20.12.2024           | BNP                         | BNP 5 Names EU Down Geo Basket     | 21.717                         | 0,00                 |
| 125.000 EUR  | 20.12.2024           | BNP                         | BNP 5 Names EU Down Geo Basket     | 21.717                         | 0,00                 |
| 14.000.000 USD   | 15.09.2023           | BNP                         | BNP Down Pairwise US Basket        | 18.169                         | 0,00                 |
| 1.000.000 EUR  | 19.01.2024           | BNP                         | BNP 5 Names EU Basket              | 17.295                         | 0,00                 |
| 62.500 EUR   | 20.12.2024           | BNP                         | BNP 5 Names EU Down Geo Basket     | 10.858                         | 0,00                 |
| 62.500 EUR   | 20.12.2024           | BNP                         | BNP 5 Names EU Down Geo Basket     | 10.858                         | 0,00                 |
| 9.513.000 EUR  | 21.06.2024           | Société Générale            | SG 15 Names Global Basket          | 3.273                          | 0,00                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Volatility-Swap-Kontrakten <sup>∞</sup></b> |                      |                             |                                    | <b>25.538.826</b>              | <b>1,12</b>          |

<sup>1</sup>Die Volatilitäten lauten auf verschiedene Fremdwährungen, je nach den Landeswährungen der Positionen in den Swaps.<sup>2</sup> Bei Volatilität gehandelter Dispersion-Swap.

|  | Zeitwert<br>US\$     | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|----------------------|------------------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> | <b>2.119.202.435</b> | <b>92,90</b>                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

## Devisenterminkontrakte (2,39 %) (31. Dezember 2022: (1,21 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 60.000 AUD         | 5.756.418 ¥         | 20.09.2023       | Barclays Bank Plc              | 1         | (291)                           | (0,00)               |
| 1.070.000 AUD      | 729.536 US\$        | 20.09.2023       | BNP Paribas                    | 2         | (15.728)                        | (0,00)               |
| 4.530.000 AUD      | 3.095.040 US\$      | 20.09.2023       | Citibank NA                    | 8         | (73.031)                        | (0,00)               |
| 910.000 AUD        | 86.745.841 ¥        | 20.09.2023       | Citibank NA                    | 1         | (491)                           | (0,00)               |
| 290.000 AUD        | 27.691.572 ¥        | 20.09.2023       | Deutsche Bank AG               | 1         | (488)                           | (0,00)               |
| 2.130.000 AUD      | 1.458.619 US\$      | 20.09.2023       | Deutsche Bank AG               | 7         | (37.674)                        | (0,00)               |
| 7.090.380 AUD      | 4.375.000 €         | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 4         | (54.073)                        | (0,00)               |
| 2.000.000 AUD      | 192.331.920 ¥       | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (512)                           | (0,00)               |
| 54.039.785 AUD     | 36.518.922 US\$     | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 7         | (540.322)                       | (0,02)               |
| 13.562.612 AUD     | 7.250.000 £         | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 8         | (187.942)                       | (0,01)               |
| 2.800.000 AUD      | 3.079.733 NZD       | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 6         | (22.536)                        | (0,00)               |
| 6.600.000 AUD      | 5.902.038 CAD       | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 7         | (66.570)                        | (0,00)               |
| 3.500.000 AUD      | 2.412.247 US\$      | 20.09.2023       | Morgan Stanley                 | 1         | (77.362)                        | (0,00)               |
| 170.000 AUD        | 16.203.839 ¥        | 20.09.2023       | Royal Bank of Scotland         | 1         | (82)                            | (0,00)               |
| 570.000 AUD        | 54.319.577 ¥        | 20.09.2023       | State Street Bank and Trust Co | 3         | (198)                           | (0,00)               |
| 2.910.000 AUD      | 1.981.465 US\$      | 20.09.2023       | State Street Bank and Trust Co | 9         | (40.175)                        | (0,00)               |
| 360.000 AUD        | 34.332.660 ¥        | 20.09.2023       | UBS AG                         | 1         | (303)                           | (0,00)               |
| 4.500.000 BRL      | 927.090 US\$        | 20.09.2023       | Deutsche Bank AG               | 4         | (7.270)                         | (0,00)               |
| 3.360.417 BRL      | 700.000 US\$        | 05.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 4         | (3.395)                         | (0,00)               |
| 3.290.000 BRL      | 674.878 US\$        | 20.09.2023       | State Street Bank and Trust Co | 3         | (2.386)                         | (0,00)               |
| 1.180.000 CAD      | 894.493 US\$        | 20.09.2023       | Barclays Bank Plc              | 3         | (1.663)                         | (0,00)               |
| 2.380.000 CAD      | 1.806.358 US\$      | 20.09.2023       | Citibank NA                    | 6         | (5.569)                         | (0,00)               |
| 910.000 CAD        | 691.393 US\$        | 20.09.2023       | Deutsche Bank AG               | 3         | (2.856)                         | (0,00)               |
| 1.054.584 CAD      | 1.200.000 AUD       | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 3         | (1.890)                         | (0,00)               |
| 33.541.899 CAD     | 23.375.000 €        | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 6         | (159.841)                       | (0,02)               |
| 2.000.000 CAD      | 218.404.900 ¥       | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (1.065)                         | (0,00)               |
| 13.299.999 CAD     | 10.063.404 US\$     | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 3         | (11.361)                        | (0,00)               |
| 380.000 CAD        | 288.955 US\$        | 20.09.2023       | Morgan Stanley                 | 1         | (1.434)                         | (0,00)               |
| 4.460.000 CAD      | 3.385.532 US\$      | 20.09.2023       | State Street Bank and Trust Co | 10        | (10.943)                        | (0,00)               |
| 1.720.000 CAD      | 1.306.131 US\$      | 20.09.2023       | UBS AG                         | 4         | (4.721)                         | (0,00)               |
| 1.530.000 CHF      | 1.732.728 US\$      | 20.09.2023       | BNP Paribas                    | 2         | (8.367)                         | (0,00)               |
| 1.050.000 CHF      | 1.185.761 US\$      | 20.09.2023       | Citibank NA                    | 2         | (2.376)                         | (0,00)               |
| 878.859 CHF        | 1.000.000 US\$      | 29.09.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | (8.533)                         | (0,00)               |
| 7.032.750 CHF      | 6.250.000 £         | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 6         | (79.952)                        | (0,01)               |
| 6.546.381 CHF      | 6.750.000 €         | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 5         | (44.401)                        | (0,00)               |
| 10.500.000 CHF     | 11.752.447 US\$     | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 3         | (7.941)                         | (0,00)               |
| 11.350.000 CHF     | 12.814.127 US\$     | 20.09.2023       | State Street Bank and Trust Co | 22        | (22.297)                        | (0,00)               |
| 1.510.000 CHF      | 1.708.352 US\$      | 20.09.2023       | UBS AG                         | 2         | (6.531)                         | (0,00)               |
| 165.300.000 CLP    | 204.544 US\$        | 20.09.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (429)                           | (0,00)               |
| 4.955.545.000 CLP  | 6.137.696 US\$      | 20.09.2023       | Citibank NA                    | 2         | (18.517)                        | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Devisenterminkontrakte (2,39 %) (31. Dezember 2022: (1,21 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 160.195.102 CLP    | 200.000 US\$        | 07.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (340)                           | (0,00)               |
| 80.267.551 CLP     | 100.000 US\$        | 17.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (95)                            | (0,00)               |
| 80.426.551 CLP     | 100.000 US\$        | 27.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (52)                            | (0,00)               |
| 240.354.955 CLP    | 300.000 US\$        | 31.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 4         | (1.489)                         | (0,00)               |
| 80.077.641 CLP     | 100.000 US\$        | 20.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (378)                           | (0,00)               |
| 79.529.552 CLP     | 100.000 US\$        | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (937)                           | (0,00)               |
| 240.450.453 CLP    | 300.000 US\$        | 10.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (420)                           | (0,00)               |
| 773.930.000 CLP    | 958.755 US\$        | 20.09.2023       | Morgan Stanley                 | 4         | (3.095)                         | (0,00)               |
| 464.580.000 CLP    | 575.274 US\$        | 20.09.2023       | State Street Bank and Trust Co | 2         | (1.604)                         | (0,00)               |
| 614.019.209 CNY    | 86.100.000 US\$     | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 10        | (1.651.141)                     | (0,07)               |
| 416.542.875 COP    | 100.000 US\$        | 07.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (310)                           | (0,00)               |
| 836.424.000 COP    | 200.000 US\$        | 31.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (1.504)                         | (0,00)               |
| 420.005.911 COP    | 100.000 US\$        | 24.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (73)                            | (0,00)               |
| 25.360.000 CZK     | 1.161.930 US\$      | 20.09.2023       | Barclays Bank Plc              | 2         | (1.345)                         | (0,00)               |
| 22.660.000 CZK     | 1.038.296 US\$      | 20.09.2023       | BNP Paribas                    | 2         | (1.274)                         | (0,00)               |
| 62.890.000 CZK     | 2.887.471 US\$      | 20.09.2023       | Citibank NA                    | 6         | (9.348)                         | (0,00)               |
| 126.530.000 CZK    | 5.824.559 US\$      | 20.09.2023       | Deutsche Bank AG               | 9         | (33.989)                        | (0,00)               |
| 6.482.301 CZK      | 300.000 US\$        | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 3         | (2.432)                         | (0,00)               |
| 43.940.000 CZK     | 2.017.420 US\$      | 20.09.2023       | Royal Bank of Scotland         | 2         | (6.531)                         | (0,00)               |
| 12.880.000 CZK     | 590.212 US\$        | 20.09.2023       | UBS AG                         | 1         | (766)                           | (0,00)               |
| 370.000 €          | 406.125 US\$        | 20.09.2023       | Barclays Bank Plc              | 3         | (865)                           | (0,00)               |
| 4.180.000 €        | 4.581.851 US\$      | 20.09.2023       | Citibank NA                    | 4         | (3.507)                         | (0,00)               |
| 193.872 €          | 870.000 PLN         | 20.09.2023       | Citibank NA                    | 2         | (959)                           | (0,00)               |
| 6.550.000 €        | 7.195.636 US\$      | 20.09.2023       | Deutsche Bank AG               | 10        | (21.438)                        | (0,00)               |
| 44.000.000 €       | 48.241.248 US\$     | 07.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | (232.729)                       | (0,01)               |
| 13.750.000 €       | 19.870.455 CAD      | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 5         | (11.731)                        | (0,01)               |
| 6.000.000 €        | 5.866.428 CHF       | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 6         | (13.576)                        | (0,00)               |
| 1.250.000 €        | 2.062.879 AUD       | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (9.222)                         | (0,00)               |
| 93.750.000 €       | 102.598.165 US\$    | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | (283.061)                       | (0,01)               |
| 500.000 €          | 187.874.612 HUF     | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 3         | (2.758)                         | (0,00)               |
| 1.000.000 €        | 4.475.781 PLN       | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 4         | (9.865)                         | (0,00)               |
| 5.250.000 €        | 62.092.982 NOK      | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 11        | (67.427)                        | (0,00)               |
| 50.300.000 €       | 43.347.545 £        | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 10        | (216.640)                       | (0,02)               |
| 11.000.000 €       | 12.114.766 US\$     | 20.09.2023       | Morgan Stanley                 | 1         | (66.494)                        | (0,00)               |
| 725.676 €          | 3.260.000 PLN       | 20.09.2023       | Morgan Stanley                 | 6         | (4.453)                         | (0,00)               |
| 330.000 €          | 362.032 US\$        | 20.09.2023       | Royal Bank of Scotland         | 1         | (584)                           | (0,00)               |
| 5.670.000 €        | 6.224.270 US\$      | 20.09.2023       | State Street Bank and Trust Co | 18        | (13.934)                        | (0,00)               |
| 1.250.000 €        | 1.373.713 US\$      | 20.09.2023       | UBS AG                         | 7         | (4.592)                         | (0,00)               |
| 1.217.140 €        | 5.450.000 PLN       | 20.09.2023       | UBS AG                         | 4         | (3.094)                         | (0,00)               |
| 180.000 £          | 230.818 US\$        | 20.09.2023       | Barclays Bank Plc              | 2         | (1.928)                         | (0,00)               |
| 1.300.000 £        | 1.657.262 US\$      | 20.09.2023       | Citibank NA                    | 5         | (4.172)                         | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Devisenterminkontrakte (2,39 %) (31. Dezember 2022: (1,21 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 1.770.000 £        | 2.256.874 US\$      | 20.09.2023       | Deutsche Bank AG               | 12        | (6.127)                         | (0,00)               |
| 3.080.181 £        | 3.600.000 €         | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 3         | (12.755)                        | (0,00)               |
| 6.000.000 £        | 6.845.540 CHF       | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 5         | (28.499)                        | (0,00)               |
| 2.750.000 £        | 5.252.220 AUD       | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (470)                           | (0,00)               |
| 750.000 £          | 956.301 US\$        | 20.09.2023       | State Street Bank and Trust Co | 8         | (2.595)                         | (0,00)               |
| 42.000.000 HKD     | 5.378.665 US\$      | 20.09.2023       | Morgan Stanley                 | 1         | (9.493)                         | (0,00)               |
| 161.870.000 HUF    | 471.490 US\$        | 20.09.2023       | Barclays Bank Plc              | 1         | (7.060)                         | (0,00)               |
| 427.450.000 HUF    | 1.238.085 US\$      | 20.09.2023       | Citibank NA                    | 4         | (11.666)                        | (0,00)               |
| 2.739.456.000 HUF  | 7.200.000 €         | 20.09.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | (26.222)                        | (0,00)               |
| 261.385.995 HUF    | 700.000 €           | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 3         | (923)                           | (0,00)               |
| 11.100.000 HUF     | 32.006 US\$         | 20.09.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (158)                           | (0,00)               |
| 2.380.000 ILS      | 669.700 US\$        | 20.09.2023       | Citibank NA                    | 1         | (26.486)                        | (0,00)               |
| 3.640.000 ILS      | 1.012.757 US\$      | 20.09.2023       | UBS AG                         | 3         | (29.017)                        | (0,00)               |
| 114.780.000 INR    | 1.395.688 US\$      | 20.09.2023       | Barclays Bank Plc              | 1         | (597)                           | (0,00)               |
| 112.990.000 INR    | 1.374.288 US\$      | 20.09.2023       | BNP Paribas                    | 2         | (954)                           | (0,00)               |
| 465.030.000 INR    | 5.657.256 US\$      | 20.09.2023       | Citibank NA                    | 5         | (5.060)                         | (0,00)               |
| 56.430.000 INR     | 686.502 US\$        | 20.09.2023       | Deutsche Bank AG               | 2         | (625)                           | (0,00)               |
| 188.456.250 INR    | 2.300.000 US\$      | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (3.951)                         | (0,00)               |
| 16.428.200 INR     | 200.000 US\$        | 07.08.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (31)                            | (0,00)               |
| 16.401.456 INR     | 200.000 US\$        | 26.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | (274)                           | (0,00)               |
| 65.659.639 INR     | 800.000 US\$        | 31.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 3         | (582)                           | (0,00)               |
| 8.196.050 INR      | 100.000 US\$        | 14.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (151)                           | (0,00)               |
| 8.202.300 INR      | 100.000 US\$        | 21.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (100)                           | (0,00)               |
| 155.772.956 INR    | 1.900.000 US\$      | 20.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | (2.690)                         | (0,00)               |
| 127.490.000 INR    | 1.551.709 US\$      | 20.09.2023       | Morgan Stanley                 | 1         | (2.135)                         | (0,00)               |
| 59.770.000 INR     | 727.395 US\$        | 20.09.2023       | Royal Bank of Scotland         | 1         | (922)                           | (0,00)               |
| 15.980.000 INR     | 194.234 US\$        | 20.09.2023       | UBS AG                         | 1         | (6)                             | (0,00)               |
| 25.120.000 ¥       | 180.100 US\$        | 20.09.2023       | Barclays Bank Plc              | 1         | (4.161)                         | (0,00)               |
| 256.250.000 ¥      | 1.811.697 US\$      | 20.09.2023       | Citibank NA                    | 7         | (16.941)                        | (0,00)               |
| 221.615.665 ¥      | 2.340.000 AUD       | 20.09.2023       | Citibank NA                    | 5         | (8.857)                         | (0,00)               |
| 21.844.094 ¥       | 230.000 AUD         | 20.09.2023       | Deutsche Bank AG               | 1         | (441)                           | (0,00)               |
| 227.930.000 ¥      | 1.621.771 US\$      | 20.09.2023       | Deutsche Bank AG               | 8         | (25.368)                        | (0,00)               |
| 164.504.648 ¥      | 1.730.000 AUD       | 20.09.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 4         | (1.921)                         | (0,00)               |
| 2.063.976.656 ¥    | 20.000.000 CAD      | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 8         | (820.958)                       | (0,04)               |
| 2.753.425.059 ¥    | 15.375.000 £        | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 7         | (477.838)                       | (0,03)               |
| 1.399.772.594 ¥    | 16.400.000 NZD      | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 12        | (352.352)                       | (0,02)               |
| 28.937.500.047 ¥   | 206.464.216 US\$    | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 12        | (6.045.958)                     | (0,26)               |
| 10.236.351.442 ¥   | 68.400.000 €        | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 7         | (3.753.146)                     | (0,16)               |
| 10.324.555.473 ¥   | 112.279.130 AUD     | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 11        | (3.246.333)                     | (0,14)               |
| 500.000.000 ¥      | 3.598.985 US\$      | 20.09.2023       | Morgan Stanley                 | 1         | (97.024)                        | (0,01)               |
| 37.955.780 ¥       | 400.000 AUD         | 20.09.2023       | Royal Bank of Scotland         | 2         | (1.005)                         | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Devisenterminkontrakte (2,39 %) (31. Dezember 2022: (1,21 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 179.553.688 ¥      | 1.900.000 AUD       | 20.09.2023       | State Street Bank and Trust Co | 8         | (9.930)                         | (0,00)               |
| 125.960.000 ¥      | 901.758 US\$        | 20.09.2023       | State Street Bank and Trust Co | 10        | (19.545)                        | (0,00)               |
| 7.594.830.000 KRW  | 5.980.652 US\$      | 20.09.2023       | Barclays Bank Plc              | 2         | (191.761)                       | (0,01)               |
| 3.671.460.000 KRW  | 2.879.993 US\$      | 20.09.2023       | BNP Paribas                    | 4         | (81.552)                        | (0,00)               |
| 2.559.137.594 KRW  | 2.000.000 US\$      | 20.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 14        | (56.210)                        | (0,00)               |
| 5.129.657.280 KRW  | 4.000.000 US\$      | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (105.340)                       | (0,01)               |
| 389.932.437 KRW    | 300.000 US\$        | 26.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (3.738)                         | (0,00)               |
| 9.776.283.771 KRW  | 7.500.000 US\$      | 07.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 19        | (79.628)                        | (0,00)               |
| 390.210.802 KRW    | 300.000 US\$        | 28.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 3         | (3.497)                         | (0,00)               |
| 128.048.772 KRW    | 100.000 US\$        | 21.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (2.736)                         | (0,00)               |
| 523.580.360 KRW    | 400.000 US\$        | 31.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | (2.095)                         | (0,00)               |
| 897.372.024 KRW    | 700.000 US\$        | 17.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 5         | (18.504)                        | (0,00)               |
| 1.034.182.859 KRW  | 800.000 US\$        | 13.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 6         | (14.764)                        | (0,00)               |
| 2.729.800.616 KRW  | 2.100.000 US\$      | 27.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 3         | (25.855)                        | (0,00)               |
| 127.154.503 KRW    | 100.000 US\$        | 05.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (3.499)                         | (0,00)               |
| 5.170.444.128 KRW  | 4.000.000 US\$      | 24.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 8         | (72.006)                        | (0,00)               |
| 4.095.689.644 KRW  | 3.215.974 US\$      | 03.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | (107.645)                       | (0,01)               |
| 6.897.892.106 KRW  | 5.400.000 US\$      | 10.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 4         | (163.443)                       | (0,01)               |
| 128.814.270 KRW    | 100.000 US\$        | 14.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (2.189)                         | (0,00)               |
| 174.670.000 KRW    | 137.925 US\$        | 20.09.2023       | Royal Bank Of Canada           | 1         | (4.789)                         | (0,00)               |
| 2.739.750.000 KRW  | 2.155.366 US\$      | 20.09.2023       | Royal Bank of Scotland         | 1         | (67.088)                        | (0,00)               |
| 822.170.000 KRW    | 647.093 US\$        | 20.09.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (20.423)                        | (0,00)               |
| 1.316.870.000 KRW  | 1.034.433 US\$      | 20.09.2023       | UBS AG                         | 2         | (30.696)                        | (0,00)               |
| 30.500.000 MXN     | 1.783.661 US\$      | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (7.679)                         | (0,00)               |
| 8.791.200.000 NGN  | 14.970.000 US\$     | 06.11.2023       | Goldman Sachs International    | 2         | (4.134.503)                     | (0,18)               |
| 7.718.400.010 NGN  | 15.020.146 US\$     | 07.08.2023       | Goldman Sachs International    | 3         | (5.080.159)                     | (0,23)               |
| 22.320.000 NOK     | 2.122.865 US\$      | 20.09.2023       | BNP Paribas                    | 6         | (33.803)                        | (0,00)               |
| 16.670.000 NOK     | 1.575.970 US\$      | 20.09.2023       | Citibank NA                    | 4         | (15.726)                        | (0,00)               |
| 11.720.000 NOK     | 1.116.896 US\$      | 20.09.2023       | Deutsche Bank AG               | 3         | (19.949)                        | (0,00)               |
| 7.230.477 NOK      | 625.000 €           | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 4         | (7.053)                         | (0,00)               |
| 5.920.000 NOK      | 560.056 US\$        | 20.09.2023       | Morgan Stanley                 | 2         | (5.968)                         | (0,00)               |
| 12.550.000 NOK     | 1.197.483 US\$      | 20.09.2023       | Royal Bank of Scotland         | 2         | (22.854)                        | (0,00)               |
| 13.870.000 NOK     | 1.322.124 US\$      | 20.09.2023       | State Street Bank and Trust Co | 6         | (23.948)                        | (0,00)               |
| 5.390.000 NOK      | 513.721 US\$        | 20.09.2023       | UBS AG                         | 1         | (9.239)                         | (0,00)               |
| 2.390.000 NZD      | 1.481.239 US\$      | 20.09.2023       | Barclays Bank Plc              | 3         | (17.482)                        | (0,00)               |
| 2.500.000 NZD      | 1.544.847 US\$      | 20.09.2023       | Citibank NA                    | 5         | (13.719)                        | (0,00)               |
| 7.220.000 NZD      | 4.490.791 US\$      | 20.09.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 7         | (68.897)                        | (0,00)               |
| 4.599.816 NZD      | 2.842.243 US\$      | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 5         | (24.283)                        | (0,00)               |
| 1.108.427 NZD      | 1.022.626 AUD       | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | (1.794)                         | (0,00)               |
| 2.520.000 NZD      | 1.568.803 US\$      | 20.09.2023       | Royal Bank of Scotland         | 2         | (25.427)                        | (0,00)               |
| 3.470.000 NZD      | 2.152.182 US\$      | 20.09.2023       | State Street Bank and Trust Co | 6         | (26.979)                        | (0,00)               |



## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Devisenterminkontrakte (2,39 %) (31. Dezember 2022: (1,21 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 33.950.000 PHP     | 613.104 US\$        | 20.09.2023       | Citibank NA                    | 1         | (479)                           | (0,00)               |
| 29.000.000 PHP     | 523.902 US\$        | 20.09.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (599)                           | (0,00)               |
| 29.010.000 PHP     | 523.888 US\$        | 20.09.2023       | UBS AG                         | 1         | (405)                           | (0,00)               |
| 60.000 PLN         | 14.777 US\$         | 20.09.2023       | Citibank NA                    | 1         | (66)                            | (0,00)               |
| 720.000 PLN        | 176.993 US\$        | 20.09.2023       | Deutsche Bank AG               | 1         | (464)                           | (0,00)               |
| 1.230.000 PLN      | 275.479 €           | 20.09.2023       | Morgan Stanley                 | 1         | (162)                           | (0,00)               |
| 460.000 PLN        | 103.073 €           | 20.09.2023       | UBS AG                         | 1         | (113)                           | (0,00)               |
| 9.030.000 SEK      | 850.746 US\$        | 20.09.2023       | BNP Paribas                    | 4         | (11.609)                        | (0,00)               |
| 22.350.000 SEK     | 2.106.770 US\$      | 20.09.2023       | Citibank NA                    | 7         | (29.837)                        | (0,00)               |
| 28.843.830 SEK     | 2.700.000 US\$      | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 4         | (28.800)                        | (0,00)               |
| 2.473.442 SEK      | 2.500.000 NOK       | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 5         | (4.340)                         | (0,00)               |
| 54.074.517 SEK     | 4.625.000 €         | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 10        | (39.753)                        | (0,00)               |
| 4.640.000 SEK      | 435.841 US\$        | 20.09.2023       | Royal Bank of Scotland         | 1         | (4.657)                         | (0,00)               |
| 4.510.000 SEK      | 422.249 US\$        | 20.09.2023       | State Street Bank and Trust Co | 3         | (3.144)                         | (0,00)               |
| 21.060.000 SGD     | 15.730.863 US\$     | 20.09.2023       | BNP Paribas                    | 2         | (123.232)                       | (0,01)               |
| 4.910.000 SGD      | 3.685.074 US\$      | 20.09.2023       | Citibank NA                    | 2         | (46.258)                        | (0,00)               |
| 37.923.840 SGD     | 28.800.000 US\$     | 17.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | (764.939)                       | (0,03)               |
| 1.339.240 SGD      | 1.000.000 US\$      | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 3         | (10.167)                        | (0,00)               |
| 9.550.000 SGD      | 7.167.614 US\$      | 20.09.2023       | Royal Bank of Scotland         | 4         | (90.079)                        | (0,00)               |
| 180.129 SGD        | 133.133 US\$        | 01.07.2023       | Société Générale               | 1         | (34)                            | (0,00)               |
| 1.300.000 SGD      | 972.897 US\$        | 20.09.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (9.463)                         | (0,00)               |
| 19.550.000 THB     | 566.591 US\$        | 20.09.2023       | BNP Paribas                    | 2         | (10.930)                        | (0,00)               |
| 38.210.000 THB     | 1.099.938 US\$      | 20.09.2023       | Citibank NA                    | 3         | (13.912)                        | (0,00)               |
| 25.510.000 THB     | 741.923 US\$        | 20.09.2023       | Deutsche Bank AG               | 2         | (16.864)                        | (0,00)               |
| 21.800.474 TRY     | 740.000 €           | 20.09.2023       | Barclays Bank Plc              | 1         | (4.528)                         | (0,00)               |
| 36.690.000 TRY     | 1.378.282 US\$      | 20.09.2023       | Barclays Bank Plc              | 1         | (21.804)                        | (0,00)               |
| 10.449.774 TRY     | 360.000 €           | 20.09.2023       | BNP Paribas                    | 1         | (7.965)                         | (0,00)               |
| 48.310.000 TRY     | 1.827.370 US\$      | 20.09.2023       | BNP Paribas                    | 2         | (41.285)                        | (0,00)               |
| 30.270.000 TRY     | 1.206.277 US\$      | 20.09.2023       | Citibank NA                    | 5         | (87.155)                        | (0,00)               |
| 22.207.645 TRY     | 810.000 €           | 20.09.2023       | Citibank NA                    | 3         | (66.145)                        | (0,00)               |
| 59.168.321 TRY     | 2.010.000 €         | 20.09.2023       | Deutsche Bank AG               | 4         | (14.018)                        | (0,00)               |
| 3.690.000 TRY      | 148.620 US\$        | 20.09.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (12.196)                        | (0,01)               |
| 15.516.340 TRY     | 600.000 US\$        | 13.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | (5.934)                         | (0,00)               |
| 293.443.915 TRY    | 11.900.000 US\$     | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 5         | (661.924)                       | (0,03)               |
| 20.451.282 TRY     | 720.000 €           | 20.09.2023       | Morgan Stanley                 | 2         | (32.503)                        | (0,00)               |
| 32.800.000 TRY     | 1.232.858 US\$      | 20.09.2023       | UBS AG                         | 3         | (20.199)                        | (0,00)               |
| 52.598.600 TRY     | 1.810.000 €         | 20.09.2023       | UBS AG                         | 2         | (37.848)                        | (0,01)               |
| 6.128.572 TWD      | 200.000 US\$        | 07.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (3.258)                         | (0,00)               |
| 3.071.204 TWD      | 100.000 US\$        | 14.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (1.452)                         | (0,00)               |
| 3.061.900 TWD      | 100.000 US\$        | 17.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (1.749)                         | (0,00)               |
| 3.105.281 TWD      | 100.000 US\$        | 28.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (350)                           | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Devisenterminkontrakte (2,39 %) (31. Dezember 2022: (1,21 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 12.269.721 TWD     | 400.868 US\$        | 03.07.2023       | JPMorgan Chase Bank         | 3         | (6.906)                         | (0,00)               |
| 1.485.529 US\$     | 1.360.000 €         | 20.09.2023       | Barclays Bank Plc           | 4         | (4.076)                         | (0,00)               |
| 766.521 US\$       | 622.950.000 CLP     | 20.09.2023       | Barclays Bank Plc           | 3         | (2.707)                         | (0,00)               |
| 820.408 US\$       | 15.680.000 ZAR      | 20.09.2023       | Barclays Bank Plc           | 2         | (3.029)                         | (0,00)               |
| 8.864.985 US\$     | 730.590.000 INR     | 20.09.2023       | Barclays Bank Plc           | 1         | (14.956)                        | (0,00)               |
| 219.103 US\$       | 330.000 AUD         | 20.09.2023       | Barclays Bank Plc           | 1         | (1.044)                         | (0,00)               |
| 1.442.030 US\$     | 31.550.000 CZK      | 20.09.2023       | BNP Paribas                 | 1         | (1.837)                         | (0,00)               |
| 2.028.356 US\$     | 2.740.000 SGD       | 20.09.2023       | BNP Paribas                 | 1         | (2.267)                         | (0,00)               |
| 762.566 US\$       | 1.150.000 AUD       | 20.09.2023       | BNP Paribas                 | 2         | (4.611)                         | (0,00)               |
| 970.543 US\$       | 343.350.000 HUF     | 20.09.2023       | BNP Paribas                 | 2         | (14.581)                        | (0,00)               |
| 295.359 US\$       | 270.000 €           | 20.09.2023       | BNP Paribas                 | 2         | (371)                           | (0,00)               |
| 444.113 US\$       | 360.880.000 CLP     | 20.09.2023       | BNP Paribas                 | 1         | (1.507)                         | (0,00)               |
| 2.272.754 US\$     | 2.987.670.000 KRW   | 20.09.2023       | BNP Paribas                 | 2         | (4.492)                         | (0,00)               |
| 962.915 US\$       | 3.980.000 PLN       | 20.09.2023       | BNP Paribas                 | 3         | (12.895)                        | (0,00)               |
| 7.312.731 US\$     | 409.820.000 PHP     | 20.09.2023       | Citibank NA                 | 4         | (82.436)                        | (0,00)               |
| 1.790.014 US\$     | 2.420.000 SGD       | 20.09.2023       | Citibank NA                 | 1         | (3.456)                         | (0,00)               |
| 399.761 US\$       | 1.960.000 BRL       | 20.09.2023       | Citibank NA                 | 2         | (872)                           | (0,00)               |
| 456.074 US\$       | 1.870.000 PLN       | 20.09.2023       | Citibank NA                 | 3         | (2.410)                         | (0,00)               |
| 408.503 US\$       | 4.430.000 SEK       | 20.09.2023       | Citibank NA                 | 1         | (3.166)                         | (0,00)               |
| 1.269.163 US\$     | 1.910.000 AUD       | 20.09.2023       | Citibank NA                 | 4         | (5.016)                         | (0,00)               |
| 192.357 US\$       | 27.480.000 ¥        | 20.09.2023       | Citibank NA                 | 1         | (111)                           | (0,00)               |
| 603.967 US\$       | 6.510.000 NOK       | 20.09.2023       | Citibank NA                 | 2         | (5.343)                         | (0,00)               |
| 2.163.769 US\$     | 37.790.000 MXN      | 20.09.2023       | Citibank NA                 | 3         | (6.800)                         | (0,00)               |
| 871.616 US\$       | 1.430.000 NZD       | 20.09.2023       | Citibank NA                 | 3         | (4.189)                         | (0,00)               |
| 1.411.263 US\$     | 1.260.000 CHF       | 20.09.2023       | Citibank NA                 | 3         | (8.799)                         | (0,00)               |
| 3.336.113 US\$     | 73.070.000 CZK      | 20.09.2023       | Citibank NA                 | 3         | (7.892)                         | (0,00)               |
| 2.736.623 US\$     | 2.510.000 €         | 20.09.2023       | Citibank NA                 | 3         | (12.574)                        | (0,00)               |
| 869.535 US\$       | 19.080.000 CZK      | 20.09.2023       | Deutsche Bank AG            | 1         | (3.650)                         | (0,00)               |
| 586.464 US\$       | 10.280.000 MXN      | 20.09.2023       | Deutsche Bank AG            | 2         | (3.995)                         | (0,00)               |
| 1.515.393 US\$     | 1.200.000 £         | 20.09.2023       | Deutsche Bank AG            | 1         | (10.536)                        | (0,00)               |
| 683.554 US\$       | 7.370.000 NOK       | 20.09.2023       | Deutsche Bank AG            | 3         | (6.248)                         | (0,00)               |
| 3.023.521 US\$     | 2.690.000 CHF       | 20.09.2023       | Deutsche Bank AG            | 8         | (8.200)                         | (0,00)               |
| 2.079.917 US\$     | 8.570.000 PLN       | 20.09.2023       | Deutsche Bank AG            | 7         | (21.264)                        | (0,00)               |
| 398.071 US\$       | 1.950.000 BRL       | 20.09.2023       | Deutsche Bank AG            | 2         | (519)                           | (0,00)               |
| 24.446.923 US\$    | 20.160.000 £        | 15.09.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (1.189.049)                     | (0,05)               |
| 3.119.748 US\$     | 2.500.000 £         | 29.09.2023       | Goldman Sachs International | 2         | (59.200)                        | (0,00)               |
| 77.294.493 US\$    | 72.000.000 €        | 07.07.2023       | Goldman Sachs International | 3         | (1.264.903)                     | (0,06)               |
| 2.141.742 US\$     | 2.000.000 €         | 14.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (41.223)                        | (0,00)               |
| 15.000.000 US\$    | 841.650.000 PHP     | 18.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (215.488)                       | (0,01)               |
| 30.000.000 US\$    | 1.663.800.000 PHP   | 17.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (78.936)                        | (0,00)               |
| 28.703.383 US\$    | 23.000.000 £        | 07.07.2023       | Goldman Sachs International | 3         | (538.019)                       | (0,02)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Devisenterminkontrakte (2,39 %) (31. Dezember 2022: (1,21 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei         | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|---------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 11.382.466 US\$    | 18.813.875 NZD      | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank | 4         | (143.370)                       | (0,01)               |
| 700.000 US\$       | 13.594.102 ZAR      | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank | 3         | (19.117)                        | (0,00)               |
| 100.000 US\$       | 8.252.644 INR       | 07.07.2023       | JPMorgan Chase Bank | 1         | (583)                           | (0,00)               |
| 46.927.420 US\$    | 42.375.000 CHF      | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank | 11        | (470.051)                       | (0,02)               |
| 200.000 US\$       | 160.606.378 CLP     | 07.07.2023       | JPMorgan Chase Bank | 1         | (172)                           | (0,00)               |
| 100.000 US\$       | 80.509.110 CLP      | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank | 1         | (283)                           | (0,00)               |
| 1.900.000 US\$     | 1.535.419.683 CLP   | 14.07.2023       | JPMorgan Chase Bank | 5         | (11.952)                        | (0,00)               |
| 17.709.384 US\$    | 2.562.500.000 ¥     | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank | 1         | (38.237)                        | (0,00)               |
| 300.000 US\$       | 24.775.884 INR      | 14.07.2023       | JPMorgan Chase Bank | 2         | (1.835)                         | (0,00)               |
| 2.300.000 US\$     | 190.169.617 INR     | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank | 1         | (16.924)                        | (0,00)               |
| 42.014.014 US\$    | 56.489.174 CAD      | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank | 7         | (680.097)                       | (0,04)               |
| 1.000.000 US\$     | 346.257.399 HUF     | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank | 5         | (10.784)                        | (0,00)               |
| 2.700.000 US\$     | 30.258.797 NOK      | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank | 2         | (124.997)                       | (0,01)               |
| 2.262.049 US\$     | 3.730.000 NZD       | 20.09.2023       | JPMorgan Chase Bank | 5         | (22.394)                        | (0,00)               |
| 400.000 US\$       | 32.834.926 INR      | 05.07.2023       | JPMorgan Chase Bank | 1         | (249)                           | (0,00)               |
| 9.683.218 US\$     | 48.388.387 BRL      | 05.07.2023       | JPMorgan Chase Bank | 44        | (347.539)                       | (0,02)               |
| 600.000 US\$       | 2.924.863 BRL       | 02.08.2023       | JPMorgan Chase Bank | 7         | (3.086)                         | (0,00)               |
| 42.630.204 US\$    | 65.300.000 AUD      | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank | 5         | (845.220)                       | (0,05)               |
| 1.000.000 US\$     | 1.317.919.395 KRW   | 07.08.2023       | JPMorgan Chase Bank | 6         | (1.971)                         | (0,00)               |
| 905.946 US\$       | 19.880.000 CZK      | 20.09.2023       | JPMorgan Chase Bank | 1         | (3.851)                         | (0,00)               |
| 400.000 US\$       | 323.605.793 CLP     | 05.07.2023       | JPMorgan Chase Bank | 1         | (3.423)                         | (0,00)               |
| 200.000 US\$       | 264.054.040 KRW     | 05.07.2023       | JPMorgan Chase Bank | 2         | (398)                           | (0,00)               |
| 41.033.400 US\$    | 32.937.500 £        | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank | 7         | (843.366)                       | (0,04)               |
| 100.000 US\$       | 80.579.530 CLP      | 24.07.2023       | JPMorgan Chase Bank | 1         | (185)                           | (0,00)               |
| 100.000 US\$       | 80.517.180 CLP      | 20.07.2023       | JPMorgan Chase Bank | 1         | (169)                           | (0,00)               |
| 3.483.744 US\$     | 60.760.000 MXN      | 20.09.2023       | JPMorgan Chase Bank | 8         | (6.168)                         | (0,00)               |
| 400.000 US\$       | 321.921.798 CLP     | 17.07.2023       | JPMorgan Chase Bank | 1         | (680)                           | (0,00)               |
| 100.000 US\$       | 80.830.130 CLP      | 27.07.2023       | JPMorgan Chase Bank | 1         | (450)                           | (0,00)               |
| 400.000 US\$       | 1.686.024.000 COP   | 17.07.2023       | JPMorgan Chase Bank | 1         | (2.154)                         | (0,00)               |
| 400.000 US\$       | 1.786.568.448 COP   | 05.07.2023       | JPMorgan Chase Bank | 2         | (27.841)                        | (0,00)               |
| 100.000 US\$       | 418.933.087 COP     | 10.07.2023       | JPMorgan Chase Bank | 1         | (169)                           | (0,00)               |
| 100.000 US\$       | 432.109.110 COP     | 07.07.2023       | JPMorgan Chase Bank | 1         | (3.416)                         | (0,00)               |
| 13.781.191 US\$    | 240.733.565 MXN     | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank | 7         | (236.464)                       | (0,01)               |
| 700.000 US\$       | 2.891.006 PLN       | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank | 7         | (11.307)                        | (0,00)               |
| 11.975.616 US\$    | 9.792.000 £         | 15.09.2023       | JPMorgan Chase Bank | 1         | (476.142)                       | (0,02)               |
| 2.301.860 US\$     | 1.857.287.372 CLP   | 03.07.2023       | JPMorgan Chase Bank | 3         | (13.526)                        | (0,00)               |
| 4.700.000 US\$     | 50.958.947 SEK      | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank | 2         | (19.261)                        | (0,00)               |
| 187.946.786 US\$   | 173.875.000 €       | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank | 12        | (1.813.627)                     | (0,09)               |
| 400.000 US\$       | 8.821.778 CZK       | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank | 4         | (4.962)                         | (0,00)               |
| 3.100.000 US\$     | 4.095.705.846 KRW   | 03.07.2023       | JPMorgan Chase Bank | 20        | (8.340)                         | (0,00)               |
| 595.658 US\$       | 207.900.000 HUF     | 20.09.2023       | Morgan Stanley      | 1         | (839)                           | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Devisenterminkontrakte (2,39 %) (31. Dezember 2022: (1,21 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag              | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 614.549 US\$                    | 6.590.000 NOK       | 20.09.2023       | Morgan Stanley                 | 1         | (2.248)                         | (0,00)               |
| 717.184 US\$                    | 586.470.000 CLP     | 20.09.2023       | Morgan Stanley                 | 2         | (6.998)                         | (0,00)               |
| 14.400.000 US\$                 | 577.440.000 EGP     | 20.03.2024       | Morgan Stanley                 | 1         | (594.006)                       | (0,03)               |
| 1.030.069 US\$                  | 22.620.000 CZK      | 20.09.2023       | Royal Bank of Scotland         | 1         | (5.122)                         | (0,00)               |
| 1.034.598 US\$                  | 1.362.710.000 KRW   | 20.09.2023       | Royal Bank of Scotland         | 2         | (4.080)                         | (0,00)               |
| 424.153 US\$                    | 4.600.000 SEK       | 20.09.2023       | Royal Bank of Scotland         | 1         | (3.314)                         | (0,00)               |
| 3.981.730 US\$                  | 3.550.000 CHF       | 20.09.2023       | State Street Bank and Trust Co | 8         | (19.239)                        | (0,00)               |
| 1.872.832 US\$                  | 1.720.000 €         | 20.09.2023       | State Street Bank and Trust Co | 2         | (11.078)                        | (0,00)               |
| 2.492.288 US\$                  | 12.270.000 BRL      | 20.09.2023       | State Street Bank and Trust Co | 4         | (15.758)                        | (0,00)               |
| 1.352.989 US\$                  | 2.040.000 AUD       | 20.09.2023       | State Street Bank and Trust Co | 4         | (7.917)                         | (0,00)               |
| 327.348 US\$                    | 1.340.000 PLN       | 20.09.2023       | State Street Bank and Trust Co | 2         | (1.192)                         | (0,00)               |
| 1.004.215 US\$                  | 1.330.000 CAD       | 20.09.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (2.108)                         | (0,00)               |
| 2.110.845 US\$                  | 1.670.000 £         | 20.09.2023       | State Street Bank and Trust Co | 3         | (12.740)                        | (0,00)               |
| 1.084.452 US\$                  | 18.900.000 MXN      | 20.09.2023       | State Street Bank and Trust Co | 2         | (1.120)                         | (0,00)               |
| 279.785 US\$                    | 98.250.000 HUF      | 20.09.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (2.110)                         | (0,00)               |
| 866.168 US\$                    | 9.290.000 NOK       | 20.09.2023       | State Street Bank and Trust Co | 5         | (3.340)                         | (0,00)               |
| 129.932 US\$                    | 2.840.000 CZK       | 20.09.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (39)                            | (0,00)               |
| 2.152.811 US\$                  | 3.550.000 NZD       | 20.09.2023       | State Street Bank and Trust Co | 5         | (21.389)                        | (0,00)               |
| 656.329 US\$                    | 7.070.000 SEK       | 20.09.2023       | UBS AG                         | 2         | (669)                           | (0,00)               |
| 335.075 US\$                    | 550.000 NZD         | 20.09.2023       | UBS AG                         | 1         | (1.773)                         | (0,00)               |
| 780.647 US\$                    | 3.210.000 PLN       | 20.09.2023       | UBS AG                         | 2         | (6.377)                         | (0,00)               |
| 72.541 US\$                     | 25.350.000 HUF      | 20.09.2023       | UBS AG                         | 2         | (192)                           | (0,00)               |
| 246.828 US\$                    | 13.790.000 PHP      | 20.09.2023       | UBS AG                         | 1         | (2.011)                         | (0,00)               |
| 721.308 US\$                    | 2.670.000 ILS       | 20.09.2023       | UBS AG                         | 1         | (281)                           | (0,00)               |
| 1.900.855 US\$                  | 1.690.000 CHF       | 20.09.2023       | UBS AG                         | 5         | (3.832)                         | (0,00)               |
| 477.053 US\$                    | 720.000 AUD         | 20.09.2023       | UBS AG                         | 1         | (3.266)                         | (0,00)               |
| 13.820.000 ZAR                  | 754.357 US\$        | 20.09.2023       | Barclays Bank Plc              | 2         | (28.599)                        | (0,00)               |
| 37.480.000 ZAR                  | 2.038.013 US\$      | 20.09.2023       | BNP Paribas                    | 4         | (69.747)                        | (0,00)               |
| 29.260.000 ZAR                  | 1.587.219 US\$      | 20.09.2023       | Citibank NA                    | 4         | (50.627)                        | (0,00)               |
| 11.940.000 ZAR                  | 646.491 US\$        | 20.09.2023       | Deutsche Bank AG               | 3         | (19.460)                        | (0,00)               |
| 37.340.000 ZAR                  | 2.013.502 US\$      | 20.09.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 7         | (52.589)                        | (0,00)               |
| 24.523.671 ZAR                  | 1.322.222 US\$      | 12.07.2023       | JPMorgan Chase Bank            | 6         | (24.940)                        | (0,00)               |
| 3.070.000 ZAR                   | 167.133 US\$        | 20.09.2023       | Morgan Stanley                 | 1         | (5.911)                         | (0,00)               |
| 11.320.000 ZAR                  | 609.955 US\$        | 20.09.2023       | Royal Bank of Scotland         | 2         | (15.485)                        | (0,00)               |
| 2.240.000 ZAR                   | 121.823 US\$        | 20.09.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (4.190)                         | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i> |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 25.906 CHF                      | 29.019 US\$         | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (16)                            | (0,00)               |
| 500.664 CHF                     | 566.181 US\$        | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 5         | (5.657)                         | (0,00)               |
| 493.060 US\$                    | 441.951 CHF         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 11        | (1.732)                         | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 1.300.219 €                     | 1.428.797 US\$      | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 2         | (9.155)                         | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (2,39 %) (31. Dezember 2022: (1,21 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR (Fortsetzung)</i>                                    |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 81.252.233 €   | 89.353.199 US\$     | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 3         | (638.073)                       | (0,03)               |
| 80.903.815 €   | 88.698.817 US\$     | 20.07.2023       | UBS AG                         | 2         | (364.109)                       | (0,02)               |
| 5.249.878 €  | 5.759.956 US\$      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 19        | (27.885)                        | (0,00)               |
| 596.669 US\$   | 555.913 €           | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | (10.304)                        | (0,00)               |
| 12.451.301 US\$  | 11.484.549 €        | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 42        | (88.086)                        | (0,01)               |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>  |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 9.273.036 £  | 11.858.457 US\$     | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (67.901)                        | (0,00)               |
| 2.700.772 £  | 3.442.283 US\$      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 6         | (8.285)                         | (0,00)               |
| 10.933.243 US\$  | 8.653.380 £         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 1         | (69.427)                        | (0,00)               |
| 15.741.411 US\$  | 12.609.008 £        | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (290.793)                       | (0,01)               |
| 408.211.545 US\$   | 326.671.909 £       | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 63        | (7.147.918)                     | (0,32)               |
| <i>Abgesicherte Klassen JPY</i>  |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 70.861.983 ¥   | 501.382 US\$        | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 3         | (9.926)                         | (0,00)               |
| 3.987.841.478 ¥  | 30.922.249 US\$     | 20.07.2023       | UBS AG                         | 2         | (3.264.997)                     | (0,14)               |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>  |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 6.294 SGD  | 4.757 US\$          | 20.07.2023       | Goldman Sachs International    | 3         | (105)                           | (0,00)               |
| 150 SGD  | 112 US\$            | 20.07.2023       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (1)                             | (0,00)               |
| 5.964 SGD  | 4.506 US\$          | 20.07.2023       | UBS AG                         | 1         | (97)                            | (0,00)               |
| 63.148 SGD   | 47.182 US\$         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp           | 31        | (495)                           | (0,00)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                                |           | <b>(54.994.415)</b>             | <b>(2,39)</b>        |

### Futures-Kontrakte (0,92 %) (31. Dezember 2022: (0,81 %))

| Anzahl Kontrakte | Beschreibung                               | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|------------------|--|---------------------------------|----------------------|
| 2.416            | 1 Month SOFR Future August 2023            | (40.832)                        | (0,00)               |
| (1.144)          | 1 Month SOFR Future July 2023              | (24.377)                        | (0,00)               |
| 1.907            | 3 Month SOFR Future December 2023          | (121.072)                       | (0,01)               |
| (500)            | 3 Month SONIA Future August 2023           | (889.796)                       | (0,04)               |
| (500)            | 3 Month SONIA Future August 2023           | (782.395)                       | (0,04)               |
| 1.000            | 3 Month SONIA Future August 2023           | (96.997)                        | (0,00)               |
| 6                | 3 Month SONIA Future June 2025             | (15.812)                        | (0,00)               |
| 250              | 3 Month SONIA Future September 2024        | (29.495)                        | (0,00)               |
| 2.747            | 30 Day Federal Funds Future November 2023  | (1.861.128)                     | (0,08)               |
| 950              | 3-Month Euro EURIBOR Future August 2023    | (7.472)                         | (0,00)               |
| 1.008            | 3-Month Euro EURIBOR Future June 2024      | (1.607.981)                     | (0,07)               |
| 499              | 3-Month Euro EURIBOR Future March 2024     | (616.604)                       | (0,03)               |
| 2.821            | 3-Month Euro EURIBOR Future September 2023 | (656.819)                       | (0,03)               |
| 1.000            | 3-Month Euro EURIBOR Future September 2023 | (131.356)                       | (0,00)               |
| 1.000            | 3-Month Euro EURIBOR Future September 2023 | (414.490)                       | (0,02)               |
| (12)             | BIST 30 Index Future August 2023           | (521)                           | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Futures-Kontrakte (0,92 %) (31. Dezember 2022: (0,81 %)) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte | Beschreibung                                       | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|------------------|--|---------------------------------|----------------------|
| 1                | Brazil Real Currency Future July 2023              | (5)                             | (0,00)               |
| 773              | British Pound Currency Future September 2023       | (233.413)                       | (0,02)               |
| (7)              | Canadian 5-Year Bond Future September 2023         | (280)                           | (0,00)               |
| 19               | Canadian Dollar Currency Future September 2023     | (6.770)                         | (0,00)               |
| 201              | CBOE VIX Index Future December 2023                | (289.100)                       | (0,01)               |
| 506              | CBOE VIX Index Future January 2024                 | (669.590)                       | (0,03)               |
| (50)             | DJIA Mini E-CBOT Future September 2023             | (120.292)                       | (0,01)               |
| 5                | Dollar Index Future September 2023                 | (2.155)                         | (0,00)               |
| (2)              | E-mini Euro Future September 2023                  | (444)                           | (0,00)               |
| (113)            | E-mini Russell 2000 Index Future September 2023    | (98.532)                        | (0,01)               |
| 1                | E-mini Utilities Future September 2023             | (360)                           | (0,00)               |
| (3)              | Euro Currency Future September 2023                | (119)                           | (0,00)               |
| (2.058)          | Euro FX Currency Future September 2023             | (1.346.931)                     | (0,06)               |
| 1.600            | Euro Stoxx 50 Dividend Index Future December 2023  | (668.400)                       | (0,03)               |
| (315)            | Euro Stoxx 50 Dividend Index Future December 2024  | (15.309)                        | (0,00)               |
| (315)            | Euro Stoxx 50 Dividend Index Future December 2024  | (42.442)                        | (0,00)               |
| 315              | Euro Stoxx 50 Dividend Index Future December 2024  | (1.376)                         | (0,00)               |
| (1)              | Euro Stoxx 50 Future September 2023                | (22)                            | (0,00)               |
| (630)            | Euro STOXX Bank Index Future December 2024         | (277.223)                       | (0,01)               |
| (420)            | Euro STOXX Bank Index Future December 2025         | (41.240)                        | (0,00)               |
| (1)              | Euro STOXX Bank Index Future September 2023        | (297)                           | (0,00)               |
| (561)            | Euro-BTP Future September 2023                     | (78.173)                        | (0,00)               |
| 596              | Euro-Bund Future September 2023                    | (551.619)                       | (0,02)               |
| 39               | Euro-Buxl 30-Year Bond Future September 2023       | (31.748)                        | (0,00)               |
| 9                | Euro-OAT Future September 2023                     | (9.023)                         | (0,00)               |
| 2.150            | Euro-Schatz Future September 2023                  | (1.645.970)                     | (0,07)               |
| (805)            | FTSE China A50 Index Future July 2023              | (42.520)                        | (0,00)               |
| 169              | Hang Seng China Enterprises Index Future July 2023 | (1.691)                         | (0,00)               |
| 21               | Hang Seng Index Future July 2023                   | (19.313)                        | (0,00)               |
| 4                | Indian Rupee Currency Future July 2023             | (145)                           | (0,00)               |
| 12               | Indian Rupee Currency Future July 2023             | (336)                           | (0,00)               |
| 4                | KOSPI 200 Index Future September 2023              | (3.785)                         | (0,00)               |
| (3)              | Mini-DAX Future September 2023                     | (3.317)                         | (0,00)               |
| 48               | MSCI Emerging Markets Index Future September 2023  | (61.180)                        | (0,00)               |
| (189)            | MSCI Singapore Index Future July 2023              | (16.614)                        | (0,00)               |
| (81)             | Nasdaq 100 E-mini Future September 2023            | (325.309)                       | (0,02)               |
| (97)             | Nikkei 225 (OSE) Future September 2023             | (822.486)                       | (0,04)               |
| (196)            | Nikkei 225 (SGX) Future September 2023             | (509.247)                       | (0,02)               |
| (31)             | OMXS30 Index Future July 2023                      | (13.497)                        | (0,00)               |
| (701)            | S&P 500 E-mini Future September 2023               | (3.327.593)                     | (0,15)               |
| 1                | S&P E-mini S&P MidCap 400 Future September 2023    | (520)                           | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Futures-Kontrakte (0,92 %) (31. Dezember 2022: (0,81 %)) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte   | Beschreibung  | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---|---------------------------------|----------------------|
| (49)   | SGX Nifty 50 Future July 2023                           | (43.199)                        | (0,00)               |
| 25   | South African Rand Currency (CME) Future September 2023 | (9.313)                         | (0,00)               |
| (641)  | Swiss Franc Currency Future September 2023              | (3.423)                         | (0,00)               |
| (20)   | TAIEX Future July 2023                                  | (3.680)                         | (0,00)               |
| 1.141  | US Treasury 10-Year Note (CBT) Future September 2023    | (1.165.165)                     | (0,05)               |
| (60)   | US Treasury 10-Year Ultra Future September 2023         | (9.578)                         | (0,00)               |
| 752  | US Treasury 2-Year Note (CBT) Future September 2023     | (665.110)                       | (0,03)               |
| 435  | US Treasury Long Bond (CBT) Future September 2023       | (470.335)                       | (0,02)               |
| (41)   | US Treasury Ultra Bond (CBT) Future September 2023      | (67.875)                        | (0,00)               |
| 39   | WIG 20 Index Future December 2049                       | (2.952)                         | (0,00)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten *</b> |   | <b>(21.016.163)</b>             | <b>(0,92)</b>        |

### Verkaufte Optionskontrakte (14,23 %) (31. Dezember 2022: (9,90 %))

| Anzahl Kontrakte/<br>Nominalwert | Fälligkeit | Art   | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|----------------------------------|------------|---|---------------|----------------------|
| <b>Kaufoptionen</b>              |            |   |               |                      |
| (125.000)                        | 15.08.2025 | Akamai Technologies Inc, Strike Price \$95.00 <sup>∞</sup>                                | (2.036.419)   | (0,09)               |
| (400.000)                        | 19.01.2024 | Apellis Pharmaceuticals Inc, Strike Price \$37.87 <sup>∞</sup>                            | (21.979.863)  | (0,96)               |
| (300.000)                        | 17.11.2023 | AppLovin Corp, Strike Price \$12.00 <sup>∞</sup>  | (4.241.844)   | (0,19)               |
| (450.000)                        | 19.01.2024 | Ceridian HCM Holding Inc, Strike Price \$92.30 <sup>∞</sup>                               | (585.422)     | (0,02)               |
| (117.000)                        | 20.11.2026 | Confluent Inc, Strike Price \$100.06 <sup>∞</sup>   | (719.688)     | (0,03)               |
| (117.000)                        | 18.12.2026 | Confluent Inc, Strike Price \$100.06 <sup>∞</sup>   | (747.283)     | (0,03)               |
| (116.000)                        | 15.01.2027 | Confluent Inc, Strike Price \$100.06 <sup>∞</sup>   | (762.695)     | (0,03)               |
| (210.000)                        | 15.01.2027 | Conmed Corp, Strike Price \$139.47 <sup>∞</sup>   | (8.310.725)   | (0,36)               |
| (1.395.000)                      | 20.12.2024 | Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR15.50 <sup>∞</sup>                                   | (7.636.107)   | (0,34)               |
| (1.395.000)                      | 21.03.2025 | Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR15.50 <sup>∞</sup>                                   | (7.850.324)   | (0,35)               |
| (47.396)                         | 21.06.2024 | Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR26.00 <sup>±</sup>                                   | (413.672)     | (0,02)               |
| (110.000)                        | 17.09.2027 | Envestnet Inc, Strike Price \$73.37 <sup>∞</sup>  | (1.869.865)   | (0,08)               |
| (110.000)                        | 15.10.2027 | Envestnet Inc, Strike Price \$73.37 <sup>∞</sup>  | (1.895.575)   | (0,08)               |
| (110.000)                        | 19.11.2027 | Envestnet Inc, Strike Price \$73.37 <sup>∞</sup>  | (1.927.499)   | (0,08)               |
| (35.000)                         | 20.12.2024 | Euro STOXX 50 Index, forward agreed volatility option, Strike Price EUR3,200 <sup>∞</sup> | (1.198.414)   | (0,05)               |
| (54.000.000) EUR                 | 13.09.2023 | Euro/United States Dollar Currency Option, Strike Price EUR1.15 <sup>∞</sup>              | (36.366)      | (0,00)               |
| (200.000)                        | 19.01.2024 | Guardant Health Inc, Strike Price \$94.61 <sup>∞</sup>                                    | (21.049)      | (0,00)               |
| (50.000)                         | 17.07.2026 | Insulet Corp, Strike Price \$225.00 <sup>∞</sup>  | (6.045.143)   | (0,27)               |
| (55)                             | 13.07.2023 | KOSPI 200 Index, Strike Price KRW342.50 <sup>±</sup>                                      | (14.192)      | (0,00)               |
| (80.000)                         | 15.12.2028 | Live Nation Entertainment Inc, Strike Price \$108.00 <sup>∞</sup>                         | (2.496.131)   | (0,11)               |
| (800.000)                        | 19.01.2024 | Lyft Inc, Strike Price \$32.49 <sup>∞</sup>   | (52.327)      | (0,00)               |
| (1.000.000)                      | 19.01.2024 | Lyft Inc, Strike Price \$40.00 <sup>∞</sup>   | (37.994)      | (0,00)               |
| (91)                             | 19.01.2024 | Lyft Inc, Strike Price \$47.50 <sup>±</sup>   | (227)         | (0,00)               |
| (278.850)                        | 19.01.2024 | Marriott Vacations Worldwide Corp, Strike Price \$135.29 <sup>∞</sup>                     | (1.606.233)   | (0,07)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Verkaufte Optionskontrakte (14,23 %) (31. Dezember 2022: (9,90 %)) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/<br>Nominalwert   | Fällig-<br>keit | Art  | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------------------------------|-----------------|--|------------------|------------------------------|
| <b>Kaufsoptionen (Fortsetzung)</b> |                 |  |                  |                              |
| (240.000)                          | 19.01.2024      | Match Group Inc, Strike Price \$110.53 <sup>∞</sup>                                    | (6.422)          | (0,00)                       |
| (11)                               | 19.01.2024      | Match Group Inc, Strike Price \$115.00 <sup>±</sup>                                    | (77)             | (0,00)                       |
| (400.000)                          | 19.01.2024      | Match Group Inc, Strike Price \$116.99 <sup>∞</sup>                                    | (7.772)          | (0,00)                       |
| (350.000)                          | 19.01.2024      | Match Group Inc, Strike Price \$144.62 <sup>∞</sup>                                    | (2.198)          | (0,00)                       |
| (18)                               | 17.11.2023      | Meta Platforms Inc, Strike Price \$240.00 <sup>±</sup>                                 | (109.035)        | (0,01)                       |
| (5)                                | 21.07.2023      | Meta Platforms Inc, Strike Price \$325.00 <sup>±</sup>                                 | (258)            | (0,00)                       |
| (112.500)                          | 18.07.2025      | Middleby Corp, Strike Price \$130.00 <sup>∞</sup>                                      | (4.853.634)      | (0,21)                       |
| (22)                               | 15.12.2023      | nCino Inc, Strike Price \$35.00 <sup>±</sup>   | (4.510)          | (0,00)                       |
| (3)                                | 14.07.2023      | Nikkei 225 Index, Strike Price JPY33,625.00 <sup>±</sup>                               | (5.604)          | (0,00)                       |
| (6)                                | 14.07.2023      | Nikkei 225 Index, Strike Price JPY34,000.00 <sup>±</sup>                               | (7.265)          | (0,00)                       |
| (11)                               | 21.07.2023      | NVIDIA Corp, Strike Price \$500.00 <sup>±</sup>  | (1.353)          | (0,00)                       |
| (200.000)                          | 19.01.2024      | Okta Inc, Strike Price \$172.18 <sup>∞</sup>   | (34.955)         | (0,00)                       |
| (250.000)                          | 19.01.2024      | Okta Inc, Strike Price \$173.89 <sup>∞</sup>   | (41.761)         | (0,00)                       |
| (133)                              | 19.01.2024      | Okta Inc, Strike Price \$250.00 <sup>±</sup>   | (665)            | (0,00)                       |
| (446.500)                          | 09.02.2029      | ON Semiconductor Corp, Strike Price \$103.87 <sup>∞</sup>                              | (18.527.013)     | (0,81)                       |
| (446.500)                          | 16.02.2029      | ON Semiconductor Corp, Strike Price \$103.87 <sup>∞</sup>                              | (18.563.637)     | (0,81)                       |
| (108.000.000)<br>GBP               | 13.09.2023      | Pound Sterling/United States Dollar Currency Option, Strike Price GBP1.30 <sup>∞</sup> | (791.122)        | (0,04)                       |
| (26)                               | 21.07.2023      | S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$4,320.00 <sup>±</sup>                            | (228.475)        | (0,01)                       |
| (215)                              | 15.09.2023      | S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$4,450.00 <sup>±</sup>                            | (1.260.438)      | (0,06)                       |
| (3)                                | 19.01.2024      | S&P 500 Index, Strike Price \$3,975.00 <sup>±</sup>                                    | (186.645)        | (0,01)                       |
| (5)                                | 19.01.2024      | S&P 500 Index, Strike Price \$4,025.00 <sup>±</sup>                                    | (289.500)        | (0,01)                       |
| (7)                                | 19.01.2024      | S&P 500 Index, Strike Price \$4,050.00 <sup>±</sup>                                    | (390.005)        | (0,02)                       |
| (2)                                | 15.09.2023      | S&P 500 Index, Strike Price \$4,100.00 <sup>±</sup>                                    | (81.130)         | (0,00)                       |
| (7)                                | 19.01.2024      | S&P 500 Index, Strike Price \$4,100.00 <sup>±</sup>                                    | (360.955)        | (0,02)                       |
| (50)                               | 15.12.2023      | S&P 500 Index, Strike Price \$4,150.00 <sup>±</sup>                                    | (2.209.000)      | (0,10)                       |
| (18)                               | 19.01.2024      | S&P 500 Index, Strike Price \$4,150.00 <sup>±</sup>                                    | (852.120)        | (0,04)                       |
| (3)                                | 19.01.2024      | S&P 500 Index, Strike Price \$4,275.00 <sup>±</sup>                                    | (111.765)        | (0,01)                       |
| (45)                               | 19.01.2024      | S&P 500 Index, Strike Price \$4,375.00 <sup>±</sup>                                    | (1.335.375)      | (0,06)                       |
| (14)                               | 19.01.2024      | S&P 500 Index, Strike Price \$4,425.00 <sup>±</sup>                                    | (364.210)        | (0,02)                       |
| (18)                               | 19.01.2024      | S&P 500 Index, Strike Price \$4,475.00 <sup>±</sup>                                    | (406.170)        | (0,02)                       |
| (17)                               | 19.01.2024      | S&P 500 Index, Strike Price \$4,500.00 <sup>±</sup>                                    | (356.320)        | (0,02)                       |
| (6)                                | 15.09.2023      | S&P 500 Index, Strike Price \$4,525.00 <sup>±</sup>                                    | (43.260)         | (0,00)                       |
| (32)                               | 19.01.2024      | S&P 500 Index, Strike Price \$4,550.00 <sup>±</sup>                                    | (571.840)        | (0,03)                       |
| (5)                                | 19.01.2024      | S&P 500 Index, Strike Price \$4,700.00 <sup>±</sup>                                    | (49.650)         | (0,00)                       |
| (13)                               | 19.01.2024      | S&P 500 Index, Strike Price \$4,750.00 <sup>±</sup>                                    | (103.480)        | (0,01)                       |
| (58)                               | 19.01.2024      | S&P 500 Index, Strike Price \$4,800.00 <sup>±</sup>                                    | (363.370)        | (0,02)                       |
| (13)                               | 19.01.2024      | S&P 500 Index, Strike Price \$4,850.00 <sup>±</sup>                                    | (63.505)         | (0,00)                       |
| (20)                               | 19.01.2024      | S&P 500 Index, Strike Price \$4,900.00 <sup>±</sup>                                    | (75.100)         | (0,00)                       |
| (6)                                | 15.09.2023      | S&P 500 Index, Strike Price \$4,925.00 <sup>±</sup>                                    | (1.140)          | (0,00)                       |



## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Verkaufte Optionskontrakte (14,23 %) (31. Dezember 2022: (9,90 %)) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/<br>Nominalwert  | Fällig-<br>keit | Art   | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|-----------------------------------|-----------------|---|------------------|------------------------------|
| <b>Kaufoptionen (Fortsetzung)</b> |                 |   |                  |                              |
| (28)                              | 19.01.2024      | S&P 500 Index, Strike Price \$4,950.00 ±  | (81.060)         | (0,00)                       |
| (51)                              | 19.01.2024      | S&P 500 Index, Strike Price \$5,200.00 ±  | (37.230)         | (0,00)                       |
| (400.000)                         | 19.01.2024      | Sarepta Therapeutics Inc, Strike Price \$72.73 ∞  | (20.079.395)     | (0,88)                       |
| (400.000)                         | 21.01.2028      | Semtech Corp, Strike Price \$37.00 ∞  | (4.453.662)      | (0,20)                       |
| (131)                             | 15.12.2023      | Shift4 Payments Inc, Strike Price \$100.00 ±  | (22.598)         | (0,00)                       |
| (2.090)                           | 19.07.2024      | Shift4 Payments Inc, Strike Price \$67.88 ∞   | (3.123.817)      | (0,14)                       |
| (28)                              | 21.07.2023      | Signet Jewelers Ltd, Strike Price \$70.00 ±   | (2.170)          | (0,00)                       |
| (70)                              | 21.07.2023      | Signet Jewelers Ltd, Strike Price \$80.00 ±   | (700)            | (0,00)                       |
| (894.454)                         | 28.02.2030      | Stem Inc, Strike Price \$7.13 ∞   | (3.549.732)      | (0,16)                       |
| (400.000)                         | 19.01.2024      | Sunnova Energy International Inc, Strike Price \$33.27 ∞  | (240.032)        | (0,01)                       |
| (97)                              | 19.07.2023      | Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD16,600.00 ±  | (49.521)         | (0,00)                       |
| (21)                              | 19.07.2023      | Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD16,700.00 ±  | (8.395)          | (0,00)                       |
| (4)                               | 19.07.2023      | Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD17,100.00 ±  | (494)            | (0,00)                       |
| (312.085)                         | 21.06.2024      | T-Mobile US Inc, Strike Price \$122.07 ∞  | (8.971.767)      | (0,39)                       |
| (180.000)                         | 19.01.2024      | Wayfair Inc, Strike Price \$164.89 ∞  | (274.208)        | (0,01)                       |
| (160.000)                         | 19.01.2024      | Wayfair Inc, Strike Price \$198.27 ∞  | (152.916)        | (0,01)                       |
| (200.000)                         | 19.01.2024      | Wayfair Inc, Strike Price \$199.22 ∞  | (188.899)        | (0,01)                       |
| (15)                              | 19.01.2024      | Wayfair Inc, Strike Price \$320.00 ±  | (472)            | (0,00)                       |
| (818.777)                         | 25.10.2028      | Wayfair Inc, Strike Price \$45.80 ∞   | (38.934.903)     | (1,71)                       |
| (120.000)                         | 19.10.2029      | Wolfspeed Inc, Strike Price \$120.00 ∞  | (2.795.552)      | (0,12)                       |
| (1)                               | 21.07.2023      | World Wrestling Entertainment Inc, Strike Price \$120.00 ±  | (23)             | (0,00)                       |
| 1.000.000 USD                     | 10.02.2025      | Worst of autocallable on S&P 500® Index ("SPX"), Russell 2000® Index ("RTY"), Nasdaq-100 Index® ("NDX") ∞ | (27.332)         | (0,00)                       |
| <b>Verkaufsoptionen</b>           |                 |   |                  |                              |
| (4.000)                           | 11.08.2023      | 3 Month SOFR Future, Strike Price \$94.63 ±   | (1.050.000)      | (0,05)                       |
| (750)                             | 15.09.2023      | 3 Month SOFR Future, Strike Price \$94.88 ±   | (637.500)        | (0,03)                       |
| (53.892)                          | 15.08.2025      | Akamai Technologies Inc, Strike Price \$104.07 ∞  | (865.937)        | (0,04)                       |
| (46.946)                          | 19.01.2024      | Apellis Pharmaceuticals Inc, Strike Price \$42.97 ∞   | (35.919)         | (0,00)                       |
| (75.133)                          | 17.11.2023      | AppLovin Corp, Strike Price \$13.76 ∞   | (22.384)         | (0,00)                       |
| (194)                             | 04.08.2023      | CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,100.00 ±   | (130.950)        | (0,01)                       |
| (126.665)                         | 19.01.2024      | Ceridian HCM Holding Inc, Strike Price \$105.13 ∞   | (4.515.918)      | (0,20)                       |
| (11.700)                          | 20.11.2026      | Confluent Inc, Strike Price \$76.14 ∞   | (453.866)        | (0,02)                       |
| (11.700)                          | 18.12.2026      | Confluent Inc, Strike Price \$76.28 ∞   | (455.747)        | (0,02)                       |
| (11.600)                          | 15.01.2027      | Confluent Inc, Strike Price \$76.41 ∞   | (453.264)        | (0,02)                       |
| (70.547)                          | 15.01.2027      | Conmed Corp, Strike Price \$110.88 ∞  | (985.770)        | (0,05)                       |
| (1.448.995)                       | 20.12.2024      | Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR10.99 ∞  | (274.494)        | (0,01)                       |
| (1.448.995)                       | 21.03.2025      | Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR10.99 ∞  | (306.555)        | (0,01)                       |
| (1.448.995)                       | 20.12.2024      | Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR11.83 ∞  | (337.968)        | (0,01)                       |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Verkaufte Optionskontrakte (14,23 %) (31. Dezember 2022: (9,90 %)) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/<br>Nominalwert      | Fällig-<br>keit | Art  | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---------------------------------------|-----------------|--|------------------|------------------------------|
| <b>Verkaufsoptionen (Fortsetzung)</b> |                 |  |                  |                              |
| (1.448.995)                           | 21.03.2025      | Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR11.83 <sup>∞</sup>                  | (375.376)        | (0,02)                       |
| (92.400)                              | 15.10.2027      | Envestnet Inc, Strike Price \$72.69 <sup>∞</sup>                         | (1.662.038)      | (0,07)                       |
| (29.267)                              | 19.01.2024      | Guardant Health Inc, Strike Price \$107.62 <sup>∞</sup>                  | (2.007.808)      | (0,09)                       |
| (2)                                   | 21.07.2023      | Hang Seng China Enterprises Index, Strike Price HKD6,800.00 <sup>±</sup> | (6.049)          | (0,00)                       |
| (3)                                   | 21.07.2023      | Hang Seng Index Future, Strike Price HKD20,000.00 <sup>±</sup>           | (24.022)         | (0,00)                       |
| (10.659)                              | 17.07.2026      | Insulet Corp, Strike Price \$321.48 <sup>∞</sup>                         | (642.462)        | (0,03)                       |
| (2.274)                               | 11.01.2024      | L&F Co Ltd, Strike Price KRW253,500.00 <sup>∞</sup>                      | (78.056)         | (0,00)                       |
| (5.180)                               | 11.01.2024      | L&F Co Ltd, Strike Price KRW289,775.90 <sup>∞</sup>                      | (270.291)        | (0,01)                       |
| (12.952)                              | 15.12.2028      | Live Nation Entertainment Inc, Strike Price \$101.56 <sup>∞</sup>        | (281.771)        | (0,01)                       |
| (168.821)                             | 19.01.2024      | Lyft Inc, Strike Price \$41.56 <sup>∞</sup>                              | (5.190.360)      | (0,23)                       |
| (214.527)                             | 19.01.2024      | Lyft Inc, Strike Price \$56.35 <sup>∞</sup>                              | (9.669.394)      | (0,42)                       |
| (77.370)                              | 19.01.2024      | Marriott Vacations Worldwide Corp, Strike Price \$151.20 <sup>∞</sup>    | (2.114.093)      | (0,09)                       |
| (76.632)                              | 19.01.2024      | Match Group Inc, Strike Price \$125.67 <sup>∞</sup>                      | (6.132.424)      | (0,27)                       |
| (124.502)                             | 19.01.2024      | Match Group Inc, Strike Price \$132.97 <sup>∞</sup>                      | (10.844.350)     | (0,48)                       |
| (103.560)                             | 19.01.2024      | Match Group Inc, Strike Price \$163.96 <sup>∞</sup>                      | (12.132.608)     | (0,53)                       |
| (20)                                  | 17.11.2023      | Meta Platforms Inc, Strike Price \$165.00 <sup>±</sup>                   | (2.030)          | (0,00)                       |
| (45.713)                              | 18.07.2025      | Middleby Corp, Strike Price \$150.83 <sup>∞</sup>                        | (859.403)        | (0,04)                       |
| (12)                                  | 14.07.2023      | Nikkei 225 Index, Strike Price JPY33,375.00 <sup>±</sup>                 | (46.079)         | (0,00)                       |
| (5)                                   | 14.07.2023      | Nikkei 225 Index, Strike Price JPY33,500.00 <sup>±</sup>                 | (22.140)         | (0,00)                       |
| (49.339)                              | 19.01.2024      | Okta Inc, Strike Price \$220.35 <sup>∞</sup>                             | (7.121.955)      | (0,31)                       |
| (64.205)                              | 19.01.2024      | Okta Inc, Strike Price \$222.80 <sup>∞</sup>                             | (9.420.233)      | (0,41)                       |
| (151.810)                             | 28.02.2024      | ON Semiconductor Corp, Strike Price \$82.83 <sup>∞</sup>                 | (911.155)        | (0,04)                       |
| (75.000)                              | 21.11.2025      | Palo Alto Networks Inc, Strike Price \$193.96 <sup>∞</sup>               | (1.284.810)      | (0,06)                       |
| (750.000)                             | 16.05.2025      | Palo Alto Networks Inc, Strike Price \$99.20 <sup>∞</sup>                | (1.009.375)      | (0,04)                       |
| (44)                                  | 15.09.2023      | S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$4,350.00 <sup>±</sup>              | (117.700)        | (0,01)                       |
| (1)                                   | 21.07.2023      | S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$4,300.00 <sup>±</sup>              | (338)            | (0,00)                       |
| (264)                                 | 31.07.2023      | S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$3,750.00 <sup>±</sup>              | (23.100)         | (0,00)                       |
| (86)                                  | 19.01.2024      | S&P 500 Index, Strike Price \$2,300.00 <sup>±</sup>                      | (41.710)         | (0,00)                       |
| (12)                                  | 19.01.2024      | S&P 500 Index, Strike Price \$2,550.00 <sup>±</sup>                      | (8.040)          | (0,00)                       |
| (21)                                  | 19.01.2024      | S&P 500 Index, Strike Price \$2,775.00 <sup>±</sup>                      | (18.690)         | (0,00)                       |
| (23)                                  | 19.01.2024      | S&P 500 Index, Strike Price \$2,825.00 <sup>±</sup>                      | (21.850)         | (0,00)                       |
| (27)                                  | 19.01.2024      | S&P 500 Index, Strike Price \$2,850.00 <sup>±</sup>                      | (26.460)         | (0,00)                       |
| (8)                                   | 15.09.2023      | S&P 500 Index, Strike Price \$2,875.00 <sup>±</sup>                      | (1.420)          | (0,00)                       |
| (27)                                  | 19.01.2024      | S&P 500 Index, Strike Price \$2,875.00 <sup>±</sup>                      | (27.405)         | (0,00)                       |
| (66)                                  | 19.01.2024      | S&P 500 Index, Strike Price \$2,900.00 <sup>±</sup>                      | (69.300)         | (0,00)                       |
| (10)                                  | 19.01.2024      | S&P 500 Index, Strike Price \$3,000.00 <sup>±</sup>                      | (12.000)         | (0,00)                       |
| (134)                                 | 19.01.2024      | S&P 500 Index, Strike Price \$3,050.00 <sup>±</sup>                      | (172.860)        | (0,01)                       |
| (18)                                  | 19.01.2024      | S&P 500 Index, Strike Price \$3,375.00 <sup>±</sup>                      | (37.530)         | (0,00)                       |
| (19)                                  | 19.01.2024      | S&P 500 Index, Strike Price \$3,425.00 <sup>±</sup>                      | (42.750)         | (0,00)                       |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Verkaufte Optionskontrakte (14,23 %) (31. Dezember 2022: (9,90 %)) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/<br>Nominalwert  | Fällig-<br>keit | Art  | Zeitwert<br>US\$     | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-----------------|--|----------------------|------------------------------|
| <b>Verkaufsoptionen (Fortsetzung)</b>   |                 |  |                      |                              |
| (22)  | 19.01.2024      | S&P 500 Index, Strike Price \$3,450.00 ±                 | (51.370)             | (0,00)                       |
| (23)  | 19.01.2024      | S&P 500 Index, Strike Price \$3,475.00 ±                 | (56.005)             | (0,00)                       |
| (8)   | 15.09.2023      | S&P 500 Index, Strike Price \$3,500.00 ±                 | (4.320)              | (0,00)                       |
| (50)  | 19.01.2024      | S&P 500 Index, Strike Price \$3,525.00 ±                 | (131.750)            | (0,01)                       |
| (7)   | 19.01.2024      | S&P 500 Index, Strike Price \$3,625.00 ±                 | (21.770)             | (0,00)                       |
| (91)  | 19.01.2024      | S&P 500 Index, Strike Price \$3,725.00 ±                 | (335.790)            | (0,02)                       |
| (11)  | 19.01.2024      | S&P 500 Index, Strike Price \$3,975.00 ±                 | (62.755)             | (0,00)                       |
| (11)  | 19.01.2024      | S&P 500 Index, Strike Price \$4,025.00 ±                 | (68.585)             | (0,00)                       |
| (14)  | 19.01.2024      | S&P 500 Index, Strike Price \$4,050.00 ±                 | (91.140)             | (0,00)                       |
| (53)  | 15.09.2023      | S&P 500 Index, Strike Price \$4,100.00 ±                 | (125.875)            | (0,01)                       |
| (37)  | 19.01.2024      | S&P 500 Index, Strike Price \$4,100.00 ±                 | (263.810)            | (0,01)                       |
| (20)  | 19.01.2024      | S&P 500 Index, Strike Price \$4,150.00 ±                 | (155.900)            | (0,01)                       |
| (4)   | 19.01.2024      | S&P 500 Index, Strike Price \$4,275.00 ±                 | (39.380)             | (0,00)                       |
| (40)  | 19.01.2024      | S&P 500 Index, Strike Price \$4,375.00 ±                 | (477.600)            | (0,02)                       |
| (48.561)  | 19.01.2024      | Sarepta Therapeutics Inc, Strike Price \$82.73 ∞         | (436.752)            | (0,02)                       |
| (58.277)  | 21.01.2028      | Semtech Corp, Strike Price \$41.74 ∞                     | (1.037.731)          | (0,05)                       |
| (1.050)   | 21.06.2024      | Shift4 Payments Inc, Strike Price \$66.42 ∞              | (1.065.404)          | (0,05)                       |
| (1.050)   | 19.07.2024      | Shift4 Payments Inc, Strike Price \$66.42 ∞              | (1.098.054)          | (0,05)                       |
| (1.050)   | 16.08.2024      | Shift4 Payments Inc, Strike Price \$66.42 ∞              | (1.129.460)          | (0,05)                       |
| (48.585)  | 11.01.2024      | SK Hynix Inc, Strike Price KRW88,200.00 ∞                | (68.229)             | (0,00)                       |
| (89.445)  | 01.04.2024      | Stem Inc, Strike Price \$5.87 ∞                          | (137.041)            | (0,01)                       |
| (67.492)  | 19.01.2024      | Sunnova Energy International Inc, Strike Price \$37.85 ∞ | (1.264.403)          | (0,05)                       |
| (19)  | 19.07.2023      | Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD16,400.00 ± | (2.105)              | (0,00)                       |
| (109)   | 19.07.2023      | Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD16,600.00 ± | (21.349)             | (0,00)                       |
| (147)   | 19.07.2023      | Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD17,100.00 ± | (93.927)             | (0,00)                       |
| (5)   | 21.07.2023      | The Walt Disney Company, Strike Price \$80.00 ±          | (53)                 | (0,00)                       |
| (400.000)   | 21.06.2024      | T-Mobile US Inc, Strike Price \$116.39 ∞                 | (1.530.496)          | (0,07)                       |
| (41.564)  | 19.01.2024      | Wayfair Inc, Strike Price \$210.42 ∞                     | (5.816.905)          | (0,26)                       |
| (37.717)  | 19.01.2024      | Wayfair Inc, Strike Price \$252.89 ∞                     | (6.821.257)          | (0,30)                       |
| (49.550)  | 19.01.2024      | Wayfair Inc, Strike Price \$253.24 ∞                     | (8.978.035)          | (0,39)                       |
| (114.629)   | 13.05.2024      | Wayfair Inc, Strike Price \$38.47 ∞                      | (522.995)            | (0,02)                       |
| (21.739)  | 19.10.2029      | Wolfspeed Inc, Strike Price \$107.31 ∞                   | (1.150.347)          | (0,05)                       |
| <b>Beizulegender Zeitwert aus verkauften Optionskontrakten insgesamt (Prämie: 410.592.784 US\$)</b> |                 |  | <b>(324.456.969)</b> | <b>(14,23)</b>               |

Die Gegenparteien von OTC-Optionskontrakten sind Goldman Sachs International, JPMorgan Chase Bank und UBS AG.

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

**Differenzkontrakte(6,09 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %))**

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung         | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|-------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| (4.900)     | 77 Bank Ltd                   | BofA Securities             | (2.060)                         | (0,00)               |
| (346.790)   | 89bio Inc                     | Morgan Stanley              | (517)                           | (0,00)               |
| 803.668     | Abbott Laboratories           | Goldman Sachs International | (38.456)                        | (0,00)               |
| (136.360)   | AbbVie Inc                    | Goldman Sachs International | (8.648)                         | (0,00)               |
| (35.246)    | AbbVie Inc                    | JPMorgan Chase Bank         | (3.552)                         | (0,00)               |
| 2.200       | ABC-Mart Inc                  | BofA Securities             | (380)                           | (0,00)               |
| 2.605.394   | Absa Group Ltd                | Goldman Sachs International | (2.575)                         | (0,00)               |
| 8.797.152   | Absa Group Ltd                | JPMorgan Chase Bank         | (41.553)                        | (0,00)               |
| (1.970.743) | Academy Sports & Outdoors Inc | Morgan Stanley              | (9.185)                         | (0,00)               |
| 24.746      | ACADIA Pharmaceuticals Inc    | Goldman Sachs International | (2.518)                         | (0,00)               |
| 38.121      | ACADIA Pharmaceuticals Inc    | Morgan Stanley              | (1.124)                         | (0,00)               |
| 163.599     | Accenture Plc Class A         | Morgan Stanley              | (9.876)                         | (0,00)               |
| 258.521     | Accenture Plc Class A         | Goldman Sachs International | (14.917)                        | (0,00)               |
| 451.207     | Acuity Brands Inc             | JPMorgan Chase Bank         | (26.929)                        | (0,00)               |
| 700.855     | Acuity Brands Inc             | Goldman Sachs International | (12.622)                        | (0,00)               |
| 1.272.035   | Acuity Brands Inc             | Morgan Stanley              | (20.877)                        | (0,00)               |
| 846.814     | Acushnet Holdings Corp        | Morgan Stanley              | (42.503)                        | (0,00)               |
| (4.800)     | Adastria Co Ltd               | BofA Securities             | (3.955)                         | (0,00)               |
| 333.349     | Addus HomeCare Corp           | Goldman Sachs International | (42.896)                        | (0,00)               |
| (7.500)     | ADEKA Corp                    | BofA Securities             | (9.292)                         | (0,00)               |
| 10.586      | Adobe Inc                     | Morgan Stanley              | (150)                           | (0,00)               |
| 682.189     | Adobe Inc                     | Goldman Sachs International | (60.044)                        | (0,00)               |
| 55.259      | Advanced Micro Devices Inc    | Morgan Stanley              | (2.664)                         | (0,00)               |
| 42.952.575  | Advantest Corp                | Goldman Sachs International | (12.065)                        | (0,00)               |
| (300)       | Advantest Corp                | BofA Securities             | (1.643)                         | (0,00)               |
| 6.189       | Adyen NV                      | Morgan Stanley              | (163)                           | (0,00)               |
| 29.351      | Adyen NV                      | Goldman Sachs International | (830)                           | (0,00)               |
| 50.094      | Adyen NV                      | JPMorgan Chase Bank         | (9.322)                         | (0,00)               |
| 290.771     | AECOM                         | Goldman Sachs International | (8.923)                         | (0,00)               |
| (1.900)     | Aeon Co Ltd                   | BofA Securities             | (137)                           | (0,00)               |
| 553.854     | AeroVironment Inc             | Goldman Sachs International | (20.708)                        | (0,00)               |
| 3.000       | AGC Inc                       | BofA Securities             | (1.797)                         | (0,00)               |
| 27.406      | AGCO Corp                     | Goldman Sachs International | (1.548)                         | (0,00)               |
| 772.865     | Agilent Technologies Inc      | JPMorgan Chase Bank         | (829)                           | (0,00)               |
| 394.590     | Agilent Technologies Inc      | Goldman Sachs International | (12.052)                        | (0,00)               |
| 322.757     | Agilent Technologies Inc      | Morgan Stanley              | (6.970)                         | (0,00)               |
| 47.208      | Agios Pharmaceuticals Inc     | Goldman Sachs International | (5.793)                         | (0,00)               |
| 10.155      | Agios Pharmaceuticals Inc     | Morgan Stanley              | (2.522)                         | (0,00)               |
| 275.147.992 | Aica Kogyo Co Ltd             | Société Générale            | (57.499)                        | (0,00)               |
| (1.100)     | Aica Kogyo Co Ltd             | BofA Securities             | (157)                           | (0,00)               |
| 92.700      | Aiful Corp                    | BofA Securities             | (2.909)                         | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte (6,09 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile       | Wertpapierbezeichnung         | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------|-------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 3.800         | Ain Holdings Inc              | BofA Securities             | (4.232)                         | (0,00)               |
| (6.700)       | Air Water Inc                 | BofA Securities             | (1.392)                         | (0,00)               |
| 35.192        | Airbnb Inc Class A            | Goldman Sachs International | (540)                           | (0,00)               |
| 137.397       | Airbnb Inc Class A            | Morgan Stanley              | (6.294)                         | (0,00)               |
| (113.072)     | Airbnb Inc Class A            | JPMorgan Chase Bank         | (27)                            | (0,00)               |
| 58.770        | Airtel Africa Plc             | BofA Securities             | (132)                           | (0,00)               |
| (600)         | Aisin Corp                    | BofA Securities             | (454)                           | (0,00)               |
| 12.174.610    | Akamai Technologies Inc       | Goldman Sachs International | (193.961)                       | (0,01)               |
| 184.383       | Alarm.com Holdings Inc        | Goldman Sachs International | (8.100)                         | (0,00)               |
| 17.051        | Alarm.com Holdings Inc        | Morgan Stanley              | (890)                           | (0,00)               |
| 278.149       | Albemarle Corp                | JPMorgan Chase Bank         | (36.774)                        | (0,00)               |
| (305.011)     | Alibaba Group Holding Ltd     | Morgan Stanley              | (1.469)                         | (0,00)               |
| 1.180.917     | Align Technology Inc          | Goldman Sachs International | (103.398)                       | (0,00)               |
| 423.351       | Allegion Plc                  | Goldman Sachs International | (11.310)                        | (0,00)               |
| 2.234.983     | Allegion Plc                  | JPMorgan Chase Bank         | (244.560)                       | (0,02)               |
| 28.710        | Allegro MicroSystems Inc      | Morgan Stanley              | (2.188)                         | (0,00)               |
| 32.810        | Allegro MicroSystems Inc      | Goldman Sachs International | (2.502)                         | (0,00)               |
| (1.754.605)   | Allegro.eu SA                 | Goldman Sachs International | (50.962)                        | (0,00)               |
| 9.600.000     | Alliant Energy Corp           | Nomura                      | (107.434)                       | (0,01)               |
| (22.335)      | Alnylam Pharmaceuticals Inc   | JPMorgan Chase Bank         | (1.174)                         | (0,00)               |
| 89.908        | Alnylam Pharmaceuticals Inc   | Goldman Sachs International | (1.727)                         | (0,00)               |
| 139.038       | Alphabet Inc Class A          | JPMorgan Chase Bank         | (18.358)                        | (0,00)               |
| 41.103        | Alphabet Inc Class A          | Morgan Stanley              | (205)                           | (0,00)               |
| 275.999       | Alphabet Inc Class A          | Goldman Sachs International | (24.550)                        | (0,00)               |
| 57.323.755    | Alps Alpine Co Ltd            | Goldman Sachs International | (20.292)                        | (0,00)               |
| (400)         | Alps Alpine Co Ltd            | BofA Securities             | (5)                             | (0,00)               |
| 4.700         | Amada Co Ltd                  | BofA Securities             | (188)                           | (0,00)               |
| (3.900)       | Amano Corp                    | BofA Securities             | (1.138)                         | (0,00)               |
| 3.981         | Amedisys Inc                  | Goldman Sachs International | (631)                           | (0,00)               |
| 20.743.688    | American Airlines Group Inc   | Goldman Sachs International | (3.858.613)                     | (0,17)               |
| 23.500.000    | American Airlines Group Inc   | Nomura                      | (705.681)                       | (0,03)               |
| 760.069       | American Eagle Outfitters Inc | Morgan Stanley              | (9.279)                         | (0,00)               |
| 36.435        | American Express Co           | Morgan Stanley              | (1.323)                         | (0,00)               |
| 227.913       | American Express Co           | Goldman Sachs International | (15.260)                        | (0,00)               |
| 288.149       | AmerisourceBergen Corp        | Goldman Sachs International | (5.122)                         | (0,00)               |
| 146.810       | Amgen Inc                     | Goldman Sachs International | (3.483)                         | (0,00)               |
| 28.274        | Amicus Therapeutics Inc       | Morgan Stanley              | (4.510)                         | (0,00)               |
| 129.180       | AMN Healthcare Services Inc   | Goldman Sachs International | (36.676)                        | (0,00)               |
| 150.731       | Amphenol Corp Class A         | Morgan Stanley              | (15.994)                        | (0,00)               |
| 3.162.146.669 | ANA Holdings Inc              | Société Générale            | (3.790.526)                     | (0,17)               |
| 335.256       | Analog Devices Inc            | Goldman Sachs International | (7.400)                         | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte (6,09 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung              | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|------------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 129.613   | Anheuser-Busch InBev SA            | Goldman Sachs International | (3.502)                         | (0,00)               |
| 151.909   | Anheuser-Busch InBev SA            | Morgan Stanley              | (6.112)                         | (0,00)               |
| 26.300    | Annaly Capital Management Inc      | Morgan Stanley              | (86.577)                        | (0,01)               |
| (8.900)   | Anritsu Corp                       | BofA Securities             | (515)                           | (0,00)               |
| 2.535.057 | Apellis Pharmaceuticals Inc        | Goldman Sachs International | (173.259)                       | (0,01)               |
| 17.400    | Apollo Strategic Growth Capital II | Goldman Sachs International | (148)                           | (0,00)               |
| 91.242    | Apple Inc                          | JPMorgan Chase Bank         | (12.576)                        | (0,00)               |
| 2.644.792 | Apple Inc                          | Goldman Sachs International | (179.903)                       | (0,01)               |
| 70.605    | Apple Inc                          | Morgan Stanley              | (2.337)                         | (0,00)               |
| 27.942    | Applied Materials Inc              | Morgan Stanley              | (49)                            | (0,00)               |
| 1.223.878 | Applied Materials Inc              | Goldman Sachs International | (43.436)                        | (0,00)               |
| 1.289.515 | AppLovin Corp Class A              | Goldman Sachs International | (123.112)                       | (0,01)               |
| (20.237)  | Aptiv Plc                          | Morgan Stanley              | (18)                            | (0,00)               |
| (22.362)  | Arcus Biosciences Inc              | JPMorgan Chase Bank         | (465)                           | (0,00)               |
| (1.600)   | Ariake Japan Co Ltd                | BofA Securities             | (298)                           | (0,00)               |
| 135.255   | Arista Networks Inc                | Morgan Stanley              | (1.485)                         | (0,00)               |
| 12.250    | Arqit Quantum Inc                  | Goldman Sachs International | (4.000)                         | (0,00)               |
| 380.173   | Arrow Electronics Inc              | Goldman Sachs International | (28.027)                        | (0,00)               |
| 956       | Arrow Electronics Inc              | Morgan Stanley              | (40)                            | (0,00)               |
| 12.100    | Asahi Holdings Inc                 | BofA Securities             | (2.733)                         | (0,00)               |
| 27.100    | Asahi Kasei Corp                   | BofA Securities             | (1.281)                         | (0,00)               |
| 342       | Ascential Plc                      | BofA Securities             | (46)                            | (0,00)               |
| (36.739)  | Ashtead Group Plc                  | Goldman Sachs International | (352)                           | (0,00)               |
| (2.200)   | Asics Corp                         | BofA Securities             | (1.504)                         | (0,00)               |
| (4.300)   | ASKUL Corp                         | BofA Securities             | (704)                           | (0,00)               |
| 89.071    | ASML Holding NV                    | Morgan Stanley              | (12.978)                        | (0,00)               |
| 10.000    | Astellas Pharma Inc                | BofA Securities             | (3.183)                         | (0,00)               |
| (445.524) | AstraZeneca Plc                    | Goldman Sachs International | (19.846)                        | (0,00)               |
| (81.950)  | AstraZeneca Plc                    | JPMorgan Chase Bank         | (2.830)                         | (0,00)               |
| (154.760) | Atlassian Corp Class A             | JPMorgan Chase Bank         | (10.636)                        | (0,00)               |
| 129.496   | Autodesk Inc                       | Morgan Stanley              | (11.168)                        | (0,00)               |
| (281.981) | Autodesk Inc                       | Goldman Sachs International | (185)                           | (0,00)               |
| (716.510) | Autoliv Inc                        | JPMorgan Chase Bank         | (1.497)                         | (0,00)               |
| 18.531    | Automatic Data Processing Inc      | Morgan Stanley              | (503)                           | (0,00)               |
| 161.082   | Automatic Data Processing Inc      | Goldman Sachs International | (4.324)                         | (0,00)               |
| 159.182   | Automatic Data Processing Inc      | JPMorgan Chase Bank         | (4.035)                         | (0,00)               |
| (990.440) | AutoZone Inc                       | JPMorgan Chase Bank         | (25.897)                        | (0,00)               |
| 7.280     | AvidXchange Holdings Inc           | Morgan Stanley              | (177)                           | (0,00)               |
| 64.215    | AvidXchange Holdings Inc           | Goldman Sachs International | (4.465)                         | (0,00)               |
| 55.859    | Axcelis Technologies Inc           | Morgan Stanley              | (4.492)                         | (0,00)               |
| 55.022    | Axcelis Technologies Inc           | Goldman Sachs International | (2.412)                         | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte (6,09 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung             | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|-----------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 3.900       | AZ-COM MARUWA Holdings Inc        | BofA Securities             | (404)                           | (0,00)               |
| 176.524     | Azenta Inc                        | JPMorgan Chase Bank         | (27.026)                        | (0,00)               |
| 149.543     | Azenta Inc                        | Goldman Sachs International | (3.120)                         | (0,00)               |
| 252.033     | BAE Systems Plc                   | Goldman Sachs International | (3)                             | (0,00)               |
| (30.762)    | Baidu Inc                         | Morgan Stanley              | (47)                            | (0,00)               |
| (2.000.000) | Basic-Fit NV                      | Société Générale            | (44.428)                        | (0,00)               |
| 454.546     | Bath & Body Works Inc             | JPMorgan Chase Bank         | (11.267)                        | (0,00)               |
| (60.021)    | Baytex Energy Corp                | JPMorgan Chase Bank         | (735)                           | (0,00)               |
| (234.140)   | Beauty Health Co                  | Morgan Stanley              | (31.045)                        | (0,00)               |
| (105.205)   | Beauty Health Co                  | Goldman Sachs International | (20.906)                        | (0,00)               |
| 544.185     | Becton Dickinson & Co             | Goldman Sachs International | (27.599)                        | (0,00)               |
| (11.291)    | Beiersdorf AG                     | Goldman Sachs International | (38.022)                        | (0,00)               |
| (65.763)    | BeiGene Ltd                       | Goldman Sachs International | (17.005)                        | (0,00)               |
| (17.895)    | BeiGene Ltd                       | JPMorgan Chase Bank         | (5.838)                         | (0,00)               |
| 2.700       | Bell System24 Holdings Inc        | BofA Securities             | (35)                            | (0,00)               |
| 9.300       | Benefit One Inc                   | BofA Securities             | (5.713)                         | (0,00)               |
| (200)       | Benesse Holdings Inc              | BofA Securities             | (8)                             | (0,00)               |
| 1.138.634   | Best Buy Co Inc                   | Morgan Stanley              | (135.438)                       | (0,01)               |
| 669.880     | Best Buy Co Inc                   | JPMorgan Chase Bank         | (78.988)                        | (0,01)               |
| (100)       | Bic Camera Inc                    | BofA Securities             | (2)                             | (0,00)               |
| 7.944.833   | Bid Corp Ltd                      | Goldman Sachs International | (6.329)                         | (0,00)               |
| (1.466.086) | Biogen Inc                        | JPMorgan Chase Bank         | (83.169)                        | (0,01)               |
| (546.743)   | BioMarin Pharmaceutical Inc       | Goldman Sachs International | (39.347)                        | (0,00)               |
| (274.102)   | BioMarin Pharmaceutical Inc       | Morgan Stanley              | (9.608)                         | (0,00)               |
| (644.780)   | Bio-Rad Laboratories Inc          | Morgan Stanley              | (108.227)                       | (0,01)               |
| (230.351)   | Bio-Techne Corp                   | JPMorgan Chase Bank         | (1.685)                         | (0,00)               |
| (403.393)   | Bio-Techne Corp                   | Goldman Sachs International | (3.065)                         | (0,00)               |
| 1.700       | BIPROGY Inc                       | BofA Securities             | (73)                            | (0,00)               |
| (966.653)   | BJ's Wholesale Club Holdings Inc  | Morgan Stanley              | (107.939)                       | (0,01)               |
| 358.621     | BlackRock Inc                     | JPMorgan Chase Bank         | (18.195)                        | (0,00)               |
| 250.655     | BlackRock Inc                     | Morgan Stanley              | (17.809)                        | (0,00)               |
| 144.730     | BlackRock Inc                     | Goldman Sachs International | (1.579)                         | (0,00)               |
| 88.336      | Blueprint Medicines Corp          | JPMorgan Chase Bank         | (57.274)                        | (0,00)               |
| 11.600.000  | BNP Paribas SA                    | Société Générale            | (31.813)                        | (0,00)               |
| 1.002.533   | Booking Holdings Inc              | Morgan Stanley              | (50.205)                        | (0,00)               |
| (229.610)   | Boston Scientific Corp            | Morgan Stanley              | (49)                            | (0,00)               |
| 202.067     | BP Plc                            | Goldman Sachs International | (1.511)                         | (0,00)               |
| 25.977      | Braze Inc Class A                 | Morgan Stanley              | (2.008)                         | (0,00)               |
| 77.057      | Braze Inc Class A                 | Goldman Sachs International | (5.698)                         | (0,00)               |
| 4.600       | Bridgestone Corp                  | BofA Securities             | (848)                           | (0,00)               |
| (383.811)   | BrightSphere Investment Group Inc | Goldman Sachs International | (30.336)                        | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte (6,09 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung            | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|----------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| (431.213)   | Bristol-Myers Squibb Co          | JPMorgan Chase Bank         | (11.462)                        | (0,00)               |
| (724.388)   | Bristol-Myers Squibb Co          | Morgan Stanley              | (17.648)                        | (0,00)               |
| 89.459      | British Land Co Plc              | BofA Securities             | (70)                            | (0,00)               |
| 3.879.796   | Broadcom Inc                     | Goldman Sachs International | (802.392)                       | (0,04)               |
| 546.447     | Brown-Forman Corp Class B        | Goldman Sachs International | (13.209)                        | (0,00)               |
| 91.431      | Brown-Forman Corp Class B        | Morgan Stanley              | (1.846)                         | (0,00)               |
| (174.082)   | Bruker Corp                      | JPMorgan Chase Bank         | (2.210)                         | (0,00)               |
| 445.504     | Brunswick Corp                   | JPMorgan Chase Bank         | (58.402)                        | (0,00)               |
| (331.517)   | Bunge Ltd                        | JPMorgan Chase Bank         | (591)                           | (0,00)               |
| 784.235     | Burlington Stores Inc            | JPMorgan Chase Bank         | (47.134)                        | (0,00)               |
| 300.290     | Cadence Design Systems Inc       | Goldman Sachs International | (484)                           | (0,00)               |
| 53.999      | Cadence Design Systems Inc       | Morgan Stanley              | (1.579)                         | (0,00)               |
| 2.700       | Calbee Inc                       | BofA Securities             | (1.402)                         | (0,00)               |
| 94.131      | Campbell Soup Co                 | Morgan Stanley              | (967)                           | (0,00)               |
| 1.062.904   | Canadian National Railway Co     | Morgan Stanley              | (49.921)                        | (0,00)               |
| 2.924.638   | Canadian National Railway Co     | Goldman Sachs International | (107.731)                       | (0,00)               |
| (1.382.084) | Canadian Natural Resources Ltd   | Morgan Stanley              | (96.066)                        | (0,01)               |
| (629.734)   | Canadian Natural Resources Ltd   | Goldman Sachs International | (46.320)                        | (0,00)               |
| 538.674     | Canadian Pacific Kansas City Ltd | JPMorgan Chase Bank         | (631)                           | (0,00)               |
| 110.550     | Canadian Pacific Kansas City Ltd | Morgan Stanley              | (2.694)                         | (0,00)               |
| (6.500)     | Canon Inc                        | BofA Securities             | (845)                           | (0,00)               |
| 4.954.934   | Capitec Bank Holdings Ltd        | JPMorgan Chase Bank         | (35.134)                        | (0,00)               |
| 3.094.787   | Capitec Bank Holdings Ltd        | Goldman Sachs International | (16.323)                        | (0,00)               |
| 146.717     | Cardinal Health Inc              | JPMorgan Chase Bank         | (19.276)                        | (0,00)               |
| 1.980.747   | Cardinal Health Inc              | Goldman Sachs International | (228.627)                       | (0,01)               |
| 147.438     | Cardinal Health Inc              | Morgan Stanley              | (18.368)                        | (0,00)               |
| 13.816.844  | Carnival Corp                    | Goldman Sachs International | (10.846.360)                    | (0,48)               |
| 16.800.000  | Carnival Corp                    | Nomura                      | (78.658)                        | (0,01)               |
| 2.748.490   | Carrier Global Corp              | Goldman Sachs International | (284.682)                       | (0,01)               |
| 816.611     | Carrier Global Corp              | Morgan Stanley              | (79.264)                        | (0,01)               |
| 420.236     | Carrier Global Corp              | JPMorgan Chase Bank         | (78.652)                        | (0,01)               |
| 18.300      | Casio Computer Co Ltd            | BofA Securities             | (2.465)                         | (0,00)               |
| 680.334     | Catalent Inc                     | Goldman Sachs International | (54.867)                        | (0,00)               |
| 332         | CATCHA INVT Corp                 | Goldman Sachs International | (1)                             | (0,00)               |
| 1.760.298   | Caterpillar Inc                  | Goldman Sachs International | (236.369)                       | (0,02)               |
| 143.757     | Caterpillar Inc                  | Morgan Stanley              | (14.791)                        | (0,00)               |
| 2.915.969   | Caterpillar Inc                  | JPMorgan Chase Bank         | (417.202)                       | (0,02)               |
| 278.834     | CDW Corp                         | Morgan Stanley              | (4.588)                         | (0,00)               |
| 155.521     | CDW Corp                         | Goldman Sachs International | (4.531)                         | (0,00)               |
| 789.391     | Celanese Corp                    | Goldman Sachs International | (72.757)                        | (0,01)               |
| 30.521      | Celanese Corp                    | JPMorgan Chase Bank         | (2.656)                         | (0,00)               |



## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte (6,09 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung                        | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|--|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 75.361      | Celanese Corp                                | Morgan Stanley              | (6.032)                         | (0,00)               |
| 10.500.000  | Cellnex Telecom SA                           | Société Générale            | (52.651)                        | (0,00)               |
| 171.021     | Cellnex Telecom SA                           | JPMorgan Chase Bank         | (5.148)                         | (0,00)               |
| 18.335      | Cellnex Telecom SA                           | Morgan Stanley              | (179)                           | (0,00)               |
| 829.168     | Cenovus Energy Inc                           | JPMorgan Chase Bank         | (28.759)                        | (0,00)               |
| (712.482)   | Centene Corp                                 | JPMorgan Chase Bank         | (5.321)                         | (0,00)               |
| 965.503     | Centene Corp                                 | Goldman Sachs International | (8.720)                         | (0,00)               |
| 14.246      | Ceridian HCM Holding Inc                     | JPMorgan Chase Bank         | (1.454)                         | (0,00)               |
| 11.343      | Ceridian HCM Holding Inc                     | Morgan Stanley              | (400)                           | (0,00)               |
| 50.480      | Ceridian HCM Holding Inc                     | Goldman Sachs International | (2.560)                         | (0,00)               |
| 284.193     | CH Robinson Worldwide Inc                    | Goldman Sachs International | (5.005)                         | (0,00)               |
| 816.362     | Charles River Laboratories International Inc | JPMorgan Chase Bank         | (58.094)                        | (0,00)               |
| 92.992      | Charter Communications Inc Class A           | Morgan Stanley              | (4.096)                         | (0,00)               |
| 304.738     | Charter Communications Inc Class A           | Goldman Sachs International | (20.965)                        | (0,00)               |
| 151.188     | Charter Communications Inc Class A           | JPMorgan Chase Bank         | (5.618)                         | (0,00)               |
| 537.239     | Chemours Co                                  | Goldman Sachs International | (42.779)                        | (0,00)               |
| (217.929)   | Chesapeake Energy Corp                       | Goldman Sachs International | (315)                           | (0,00)               |
| 797.315     | Chevron Corp                                 | Goldman Sachs International | (19.614)                        | (0,00)               |
| (580.009)   | Chevron Corp                                 | JPMorgan Chase Bank         | (38.413)                        | (0,00)               |
| 61.800      | Chiba Bank Ltd                               | BofA Securities             | (7.716)                         | (0,00)               |
| 624.848     | Chipotle Mexican Grill Inc                   | Goldman Sachs International | (12.276)                        | (0,00)               |
| 61.000      | Chiyoda Corp                                 | BofA Securities             | (1.603)                         | (0,00)               |
| 15.793      | Choice Hotels International Inc              | Morgan Stanley              | (520)                           | (0,00)               |
| 27.102      | Choice Hotels International Inc              | Goldman Sachs International | (281)                           | (0,00)               |
| (14.000)    | Chugai Pharmaceutical Co Ltd                 | BofA Securities             | (657)                           | (0,00)               |
| (55.000)    | Chugoku Electric Power Co Inc                | BofA Securities             | (8.345)                         | (0,00)               |
| (344.847)   | Ciena Corp                                   | Morgan Stanley              | (12.221)                        | (0,00)               |
| 7.509       | Cigna Corp                                   | Morgan Stanley              | (7.935)                         | (0,00)               |
| 107.919     | Cigna Corp                                   | Goldman Sachs International | (6.437)                         | (0,00)               |
| 236.652     | Cisco Systems Inc                            | Morgan Stanley              | (15.170)                        | (0,00)               |
| 555.993     | Cisco Systems Inc                            | Goldman Sachs International | (31.932)                        | (0,00)               |
| (3.981.299) | Clicks Group Ltd                             | Goldman Sachs International | (9.020)                         | (0,00)               |
| (2.607.543) | Clicks Group Ltd                             | Morgan Stanley              | (728)                           | (0,00)               |
| 22.737      | Cloudflare Inc Class A                       | Morgan Stanley              | (4.620)                         | (0,00)               |
| 154.281     | CME Group Inc                                | Morgan Stanley              | (2.366)                         | (0,00)               |
| 4.000.000   | CMS Energy Corp                              | Nomura                      | (9.404)                         | (0,00)               |
| 60.297      | CNX Resources Corp                           | JPMorgan Chase Bank         | (6.348)                         | (0,00)               |
| 552.885     | CNX Resources Corp                           | Goldman Sachs International | (16.130)                        | (0,00)               |
| 213.771     | Cognizant Technology Solutions Corp Class A  | Morgan Stanley              | (14.101)                        | (0,00)               |
| 269.712     | Cognizant Technology Solutions Corp Class A  | Goldman Sachs International | (38.832)                        | (0,00)               |
| 31.370      | Coinbase Global Inc Class A                  | Morgan Stanley              | (518)                           | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

**Differenzkontrakte (6,09 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)**

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung            | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|----------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 1.955     | Colonnade Acquisition Corp II    | Goldman Sachs International | (37)                            | (0,00)               |
| 4.500     | Colowide Co Ltd                  | BofA Securities             | (911)                           | (0,00)               |
| 120.867   | Comcast Corp Class A             | JPMorgan Chase Bank         | (17.571)                        | (0,00)               |
| 7.129     | Comcast Corp Class A             | Goldman Sachs International | (373)                           | (0,00)               |
| 127.612   | Comstock Resources Inc           | Goldman Sachs International | (31.398)                        | (0,00)               |
| 35.404    | Comstock Resources Inc           | JPMorgan Chase Bank         | (5.035)                         | (0,00)               |
| 54.223    | Confluent Inc Class A            | Morgan Stanley              | (18.171)                        | (0,00)               |
| 362.218   | Confluent Inc Class A            | Goldman Sachs International | (94.997)                        | (0,01)               |
| 1.404.001 | CONMED Corp                      | Goldman Sachs International | (212.790)                       | (0,01)               |
| 166.906   | ConocoPhillips                   | JPMorgan Chase Bank         | (5.376)                         | (0,00)               |
| (4.300)   | Contra Abiomed Inc               | Morgan Stanley              | (3.139)                         | (0,00)               |
| 12.800    | CinCor Pharma Inc                | Morgan Stanley              | (19.968)                        | (0,00)               |
| (228.672) | ConvaTec Group Plc               | BofA Securities             | (2.269)                         | (0,00)               |
| (220.186) | Cooper Cos Inc                   | Goldman Sachs International | (2.201)                         | (0,00)               |
| 21.494    | Copart Inc                       | Morgan Stanley              | (336)                           | (0,00)               |
| 159.295   | Copart Inc                       | JPMorgan Chase Bank         | (48.458)                        | (0,00)               |
| 79.970    | Copart Inc                       | Goldman Sachs International | (412)                           | (0,00)               |
| 125.745   | Core Laboratories Inc            | Goldman Sachs International | (457)                           | (0,00)               |
| 4.300     | Cosmo Energy Holdings Co Ltd     | BofA Securities             | (333)                           | (0,00)               |
| 64.222    | Coterra Energy Inc               | Morgan Stanley              | (3.842)                         | (0,00)               |
| 953.617   | Coterra Energy Inc               | Goldman Sachs International | (97.333)                        | (0,01)               |
| 809.229   | Coterra Energy Inc               | JPMorgan Chase Bank         | (44.479)                        | (0,00)               |
| 12.900    | Create Restaurants Holdings Inc  | BofA Securities             | (1.655)                         | (0,00)               |
| 4.050.000 | Credit Agricole SA               | Société Générale            | (88.496)                        | (0,01)               |
| (8.100)   | Credit Saison Co Ltd             | BofA Securities             | (9.427)                         | (0,00)               |
| 262       | Crest Nicholson Holdings Plc     | BofA Securities             | (80)                            | (0,00)               |
| 200.069   | Cross Country Healthcare Inc     | Goldman Sachs International | (46.034)                        | (0,00)               |
| 7.480     | Crowdstrike Holdings Inc Class A | Morgan Stanley              | (105)                           | (0,00)               |
| 75.646    | Crowdstrike Holdings Inc Class A | Goldman Sachs International | (1.227)                         | (0,00)               |
| 995.956   | CSX Corp                         | Goldman Sachs International | (66.223)                        | (0,00)               |
| (3.700)   | CubeSmart                        | Morgan Stanley              | (213)                           | (0,00)               |
| 1.101.856 | CVS Health Corp                  | Goldman Sachs International | (14.578)                        | (0,00)               |
| 19.030    | CVS Health Corp                  | Morgan Stanley              | (6.722)                         | (0,00)               |
| 1.500     | CyberAgent Inc                   | BofA Securities             | (498)                           | (0,00)               |
| 81.530    | CyberArk Software Ltd            | Morgan Stanley              | (6.387)                         | (0,00)               |
| 7.700     | Cybozu Inc                       | BofA Securities             | (7.919)                         | (0,00)               |
| (7.321)   | Cytokinetics Inc                 | JPMorgan Chase Bank         | (1.281)                         | (0,00)               |
| (28.145)  | Cytokinetics Inc                 | Goldman Sachs International | (3.545)                         | (0,00)               |
| 63.239    | D and Z Media Acquisition Corp   | Goldman Sachs International | (3.353)                         | (0,00)               |
| 1.600     | Dai Nippon Printing Co Ltd       | BofA Securities             | (281)                           | (0,00)               |
| (17.900)  | Daicel Corp                      | BofA Securities             | (6.969)                         | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte (6,09 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung      | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|----------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| (700)       | Daido Steel Co Ltd         | BofA Securities             | (204)                           | (0,00)               |
| (3.100)     | Daihen Corp                | BofA Securities             | (6.696)                         | (0,00)               |
| (4.300)     | Dai-ichi Life Holdings Inc | BofA Securities             | (180)                           | (0,00)               |
| 6.400       | Daiichi Sankyo Co Ltd      | BofA Securities             | (7.041)                         | (0,00)               |
| 100         | Daikin Industries Ltd      | BofA Securities             | (76)                            | (0,00)               |
| (8.700)     | Daio Paper Corp            | BofA Securities             | (452)                           | (0,00)               |
| (28.100)    | Daiwa Securities Group Inc | BofA Securities             | (2.183)                         | (0,00)               |
| 84.461      | Danaher Corp               | Morgan Stanley              | (862)                           | (0,00)               |
| 144.274     | Danaher Corp               | Goldman Sachs International | (4.862)                         | (0,00)               |
| 1.806.368   | Danaher Corp               | JPMorgan Chase Bank         | (45.165)                        | (0,00)               |
| 70.554      | Datadog Inc Class A        | Goldman Sachs International | (3.649)                         | (0,00)               |
| 2.157.038   | Davide Campari-Milano NV   | Société Générale            | (26.988)                        | (0,00)               |
| 17.900      | DCM Holdings Co Ltd        | BofA Securities             | (9.654)                         | (0,00)               |
| 598.367     | Deere & Co                 | JPMorgan Chase Bank         | (45.508)                        | (0,00)               |
| 1.323.223   | Deere & Co                 | Goldman Sachs International | (5.754)                         | (0,00)               |
| 152.214     | Dell Technologies Inc      | Goldman Sachs International | (7.806)                         | (0,00)               |
| 200         | Dell Technologies Inc      | Morgan Stanley              | (12)                            | (0,00)               |
| 193.808     | Denali Therapeutics Inc    | JPMorgan Chase Bank         | (68.114)                        | (0,01)               |
| (700)       | Denso Corp                 | BofA Securities             | (2.750)                         | (0,00)               |
| 642.379     | DENTSPLY SIRONA Inc        | Goldman Sachs International | (436)                           | (0,00)               |
| 1.300       | Dentsu Group Inc           | BofA Securities             | (770)                           | (0,00)               |
| (148.492)   | Deutsche Telekom AG        | JPMorgan Chase Bank         | (337)                           | (0,00)               |
| 399.392     | Devon Energy Corp          | Goldman Sachs International | (4.655)                         | (0,00)               |
| 49.670      | Dexcom Inc                 | Goldman Sachs International | (59)                            | (0,00)               |
| (17.731)    | Diageo Plc                 | BofA Securities             | (25)                            | (0,00)               |
| 4.500       | DIC Corp                   | BofA Securities             | (1.714)                         | (0,00)               |
| 6.700       | Digital Garage Inc         | BofA Securities             | (2.815)                         | (0,00)               |
| 324.949     | Dino Polska SA             | Goldman Sachs International | (9.815)                         | (0,00)               |
| 572.911     | Dino Polska SA             | JPMorgan Chase Bank         | (20.969)                        | (0,00)               |
| (1.300)     | Dip Corp                   | BofA Securities             | (622)                           | (0,00)               |
| (2.322.284) | DISH Network Corp Class A  | Goldman Sachs International | (524.707)                       | (0,03)               |
| 17.500.000  | DISH Network Corp          | Nomura                      | (154.805)                       | (0,01)               |
| 1.080.033   | Dollar General Corp        | JPMorgan Chase Bank         | (68.515)                        | (0,01)               |
| 401.020     | Dollar Tree Inc            | JPMorgan Chase Bank         | (33.605)                        | (0,00)               |
| 1.687.659   | Domino's Pizza Inc         | Morgan Stanley              | (74.945)                        | (0,01)               |
| 253.117     | Domino's Pizza Inc         | Goldman Sachs International | (4.923)                         | (0,00)               |
| 40.227      | DoorDash Inc Class A       | Goldman Sachs International | (2.309)                         | (0,00)               |
| 619.379     | DoorDash Inc Class A       | Morgan Stanley              | (103.295)                       | (0,01)               |
| 120.597     | DoubleVerify Holdings Inc  | Goldman Sachs International | (13.792)                        | (0,00)               |
| 286.807     | DoubleVerify Holdings Inc  | Morgan Stanley              | (19.245)                        | (0,00)               |
| (1.600)     | Dowa Holdings Co Ltd       | BofA Securities             | (3.916)                         | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte (6,09 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile    | Wertpapierbezeichnung             | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|------------|-----------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 63.935     | Duolingo Inc                      | Goldman Sachs International | (1.358)                         | (0,00)               |
| 97.389     | DuPont de Nemours Inc             | Morgan Stanley              | (2.495)                         | (0,00)               |
| 179.511    | DuPont de Nemours Inc             | JPMorgan Chase Bank         | (1.801)                         | (0,00)               |
| 688.952    | DuPont de Nemours Inc             | Goldman Sachs International | (28.691)                        | (0,00)               |
| 2.900      | Duskin Co Ltd                     | BofA Securities             | (482)                           | (0,00)               |
| 337.911    | Eagle Materials Inc               | Goldman Sachs International | (10.493)                        | (0,00)               |
| 12.147     | Earthstone Energy Inc Class A     | Morgan Stanley              | (2.220)                         | (0,00)               |
| 70.701     | Earthstone Energy Inc Class A     | Goldman Sachs International | (4.680)                         | (0,00)               |
| 120.530    | Earthstone Energy Inc Class A     | JPMorgan Chase Bank         | (15.866)                        | (0,00)               |
| 46.543     | eBay Inc                          | Goldman Sachs International | (817)                           | (0,00)               |
| (15.400)   | EDION Corp                        | BofA Securities             | (2.094)                         | (0,00)               |
| 1.243.907  | Edwards Lifesciences Corp         | Goldman Sachs International | (86.699)                        | (0,01)               |
| 17.747     | Edwards Lifesciences Corp         | Morgan Stanley              | (1.199)                         | (0,00)               |
| (100)      | eGuarantee Inc                    | BofA Securities             | (0)                             | (0,00)               |
| 59.271     | Elastic NV                        | Goldman Sachs International | (5.049)                         | (0,00)               |
| 31.199     | Elastic NV                        | Morgan Stanley              | (4.590)                         | (0,00)               |
| 17.200     | Electric Power Development Co Ltd | BofA Securities             | (1.107)                         | (0,00)               |
| 127.448    | Electronic Arts Inc               | Morgan Stanley              | (18.497)                        | (0,00)               |
| (521.635)  | Elevance Health Inc               | Goldman Sachs International | (9.635)                         | (0,00)               |
| 6.600.000  | ELM BV for Swiss Prime Site AG    | Société Générale            | (5.379)                         | (0,00)               |
| 27.000.000 | ELM BV for Swiss Re Ltd           | Société Générale            | (1.806)                         | (0,00)               |
| 257.310    | Encompass Health Corp             | Goldman Sachs International | (19.403)                        | (0,00)               |
| (49.500)   | ENEOS Holdings Inc                | BofA Securities             | (1.156)                         | (0,00)               |
| 22.497     | Energizer Holdings Inc            | Morgan Stanley              | (603)                           | (0,00)               |
| (586.295)  | Energy Transfer LP                | JPMorgan Chase Bank         | (30.124)                        | (0,00)               |
| 925.037    | Enphase Energy Inc                | Goldman Sachs International | (16.574)                        | (0,00)               |
| 64.263     | Entegris Inc                      | Morgan Stanley              | (13.600)                        | (0,00)               |
| (518.901)  | Envista Holdings Corp             | Goldman Sachs International | (9.815)                         | (0,00)               |
| 389.333    | EOG Resources Inc                 | Goldman Sachs International | (12.811)                        | (0,00)               |
| 625.360    | EOG Resources Inc                 | JPMorgan Chase Bank         | (5.593)                         | (0,00)               |
| 834.219    | EQT Corp                          | JPMorgan Chase Bank         | (8.952)                         | (0,00)               |
| 8.500      | eRex Co Ltd                       | BofA Securities             | (2.749)                         | (0,00)               |
| (86.182)   | Erste Group Bank AG               | Morgan Stanley              | (611)                           | (0,00)               |
| 294        | ESM Acquisition Corp              | Goldman Sachs International | (38)                            | (0,00)               |
| (481.156)  | Estee Lauder Cos Inc Class A      | JPMorgan Chase Bank         | (9.899)                         | (0,00)               |
| (208.028)  | Etsy Inc                          | Goldman Sachs International | (3.267)                         | (0,00)               |
| 20.775     | Etsy Inc                          | Morgan Stanley              | (21.976)                        | (0,00)               |
| 120.819    | Euronet Worldwide Inc             | Goldman Sachs International | (4.861)                         | (0,00)               |
| 3.346      | Euronet Worldwide Inc             | JPMorgan Chase Bank         | (145)                           | (0,00)               |
| 10.379     | Euronet Worldwide Inc             | Morgan Stanley              | (327)                           | (0,00)               |
| 406.985    | Evercore Inc Class A              | Goldman Sachs International | (38.753)                        | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte (6,09 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung                      | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|--|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 418.855     | Evercore Inc Class A                       | JPMorgan Chase Bank         | (21.979)                        | (0,00)               |
| (701.661)   | Evolent Health Inc Class A                 | Goldman Sachs International | (34.646)                        | (0,00)               |
| 221.893     | Evraz Plc                                  | Morgan Stanley              | (228.194)                       | (0,01)               |
| 20.959      | Expedia Group Inc                          | Morgan Stanley              | (177)                           | (0,00)               |
| 84.914      | Expedia Group Inc                          | JPMorgan Chase Bank         | (15.671)                        | (0,00)               |
| 150.568     | Expedia Group Inc                          | Goldman Sachs International | (3.996)                         | (0,00)               |
| 140.284     | Exxon Mobil Corp                           | JPMorgan Chase Bank         | (2.516)                         | (0,00)               |
| (1.969.894) | Exxon Mobil Corp                           | Morgan Stanley              | (11.282)                        | (0,00)               |
| 101.461     | F5 Inc                                     | Morgan Stanley              | (1.529)                         | (0,00)               |
| 135.695     | FactSet Research Systems Inc               | Goldman Sachs International | (985)                           | (0,00)               |
| 3.042       | FactSet Research Systems Inc               | Morgan Stanley              | (17.134)                        | (0,00)               |
| 100         | Fast Retailing Co Ltd                      | BofA Securities             | (2)                             | (0,00)               |
| 701.729     | Fastenal Co                                | Morgan Stanley              | (50.285)                        | (0,00)               |
| 1.195.089   | Fastenal Co                                | JPMorgan Chase Bank         | (175.968)                       | (0,01)               |
| (5.085.846) | Fastighets AB Balder                       | Société Générale            | (127.340)                       | (0,01)               |
| 9.170       | Fathom Digital Manufacturing Corporation   | Goldman Sachs International | (700)                           | (0,00)               |
| (200)       | FCC Co Ltd                                 | BofA Securities             | (129)                           | (0,00)               |
| (303.727)   | Federated Hermes Inc                       | JPMorgan Chase Bank         | (2.797)                         | (0,00)               |
| (617.646)   | Federated Hermes Inc                       | Goldman Sachs International | (60.673)                        | (0,00)               |
| (328.331)   | Federated Hermes Inc                       | Morgan Stanley              | (43.502)                        | (0,00)               |
| (197.922)   | FedEx Corp                                 | Morgan Stanley              | (402)                           | (0,00)               |
| 611.573     | FedEx Corp                                 | Goldman Sachs International | (17.281)                        | (0,00)               |
| (1.669)     | FibroGen Inc                               | Morgan Stanley              | (1.485)                         | (0,00)               |
| (308.612)   | Fidelity National Information Services Inc | Morgan Stanley              | (4.026)                         | (0,00)               |
| 3.837.355   | FirstEnergy Corp                           | Goldman Sachs International | (40.572)                        | (0,00)               |
| 12.000.000  | FirstEnergy Corp                           | Nomura                      | (12.744)                        | (0,00)               |
| 214.388     | Fiserv Inc                                 | Morgan Stanley              | (16.389)                        | (0,00)               |
| (57.539)    | Fisker Inc                                 | JPMorgan Chase Bank         | (398)                           | (0,00)               |
| (382.874)   | Fisker Inc                                 | Goldman Sachs International | (19.232)                        | (0,00)               |
| 805.594     | Five Below Inc                             | JPMorgan Chase Bank         | (26.234)                        | (0,00)               |
| 636.756     | Floor & Decor Holdings Inc Class A         | JPMorgan Chase Bank         | (93.334)                        | (0,01)               |
| 984.201     | Floor & Decor Holdings Inc Class A         | Morgan Stanley              | (132.400)                       | (0,01)               |
| 49.494      | Flowers Foods Inc                          | Morgan Stanley              | (1.298)                         | (0,00)               |
| 9.700       | Food & Life Cos Ltd                        | BofA Securities             | (13.175)                        | (0,00)               |
| (404.522)   | Foot Locker Inc                            | Goldman Sachs International | (22.690)                        | (0,00)               |
| 1.019.840   | Ford Motor Co                              | Nomura                      | (234.508)                       | (0,01)               |
| 149.591     | Fortinet Inc                               | Morgan Stanley              | (30.320)                        | (0,00)               |
| 266.891     | Fortinet Inc                               | Goldman Sachs International | (6.780)                         | (0,00)               |
| 81.135      | Fortive Corp                               | Morgan Stanley              | (9.918)                         | (0,00)               |
| 69.424      | Fox Corp Class A                           | Morgan Stanley              | (767)                           | (0,00)               |
| 632.403     | Franklin Resources Inc                     | JPMorgan Chase Bank         | (34.540)                        | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte (6,09 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung       | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|-----------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| (21.297)    | Frasers Group Plc           | BofA Securities             | (42)                            | (0,00)               |
| 4.100       | Freee KK                    | BofA Securities             | (2.688)                         | (0,00)               |
| 62.566      | Freshworks Inc Class A      | Goldman Sachs International | (4.019)                         | (0,00)               |
| 13.393      | Freshworks Inc Class A      | Morgan Stanley              | (949)                           | (0,00)               |
| 575.784     | FTI Consulting Inc          | Goldman Sachs International | (9.033)                         | (0,00)               |
| 1.300       | Fuji Oil Holdings Inc       | BofA Securities             | (164)                           | (0,00)               |
| (4.000)     | Fuji Soft Inc               | BofA Securities             | (1.541)                         | (0,00)               |
| (32.400)    | Fujikura Ltd                | BofA Securities             | (8.845)                         | (0,00)               |
| (9.500)     | Fujimi Inc                  | BofA Securities             | (23.046)                        | (0,00)               |
| 2.600       | Fujitec Co Ltd              | BofA Securities             | (1.366)                         | (0,00)               |
| 7.500       | Fujitsu General Ltd         | BofA Securities             | (6.112)                         | (0,00)               |
| 700         | Fujitsu Ltd                 | BofA Securities             | (406)                           | (0,00)               |
| (4.400)     | Fukuoka Financial Group Inc | BofA Securities             | (446)                           | (0,00)               |
| (2.800)     | Fuso Chemical Co Ltd        | BofA Securities             | (8.465)                         | (0,00)               |
| 6.130       | Gartner Inc                 | JPMorgan Chase Bank         | (507)                           | (0,00)               |
| 49.790      | Gartner Inc                 | Goldman Sachs International | (1.209)                         | (0,00)               |
| (200.132)   | General Mills Inc           | Morgan Stanley              | (25.374)                        | (0,00)               |
| (340.391)   | General Mills Inc           | JPMorgan Chase Bank         | (18.364)                        | (0,00)               |
| 952.578     | Gildan Activewear Inc       | Morgan Stanley              | (63.753)                        | (0,00)               |
| 85.829      | Glencore Plc                | Morgan Stanley              | (2.093)                         | (0,00)               |
| (312.699)   | Global Payments Inc         | Morgan Stanley              | (8.631)                         | (0,00)               |
| 113.749     | GlobalFoundries Inc         | Morgan Stanley              | (12.394)                        | (0,00)               |
| 57.083      | GlobalFoundries Inc         | JPMorgan Chase Bank         | (11.456)                        | (0,00)               |
| 100         | GLP J-Reit                  | BofA Securities             | (6.642)                         | (0,00)               |
| 155.748.770 | GMO Payment Gateway Inc     | Société Générale            | (2.987)                         | (0,00)               |
| 1.200       | GMO Payment Gateway Inc     | BofA Securities             | (688)                           | (0,00)               |
| (1.138.309) | Goldman Sachs Group Inc     | Morgan Stanley              | (21.601)                        | (0,00)               |
| 2.000       | Goldwin Inc                 | BofA Securities             | (319)                           | (0,00)               |
| (1.700)     | Gree Inc                    | BofA Securities             | (25)                            | (0,00)               |
| 1.002.512   | Grocery Outlet Holding Corp | JPMorgan Chase Bank         | (78.549)                        | (0,01)               |
| (9.100)     | GS Yuasa Corp               | BofA Securities             | (2.065)                         | (0,00)               |
| 51.134      | GSK Plc                     | Goldman Sachs International | (40)                            | (0,00)               |
| 1.690.876   | Guardant Health Inc         | Goldman Sachs International | (367.823)                       | (0,02)               |
| 103.820     | Guidewire Software Inc      | Goldman Sachs International | (1.217)                         | (0,00)               |
| (3.000)     | Gunma Bank Ltd              | BofA Securities             | (20)                            | (0,00)               |
| 3.900       | H.U. Group Holdings Inc     | BofA Securities             | (2.340)                         | (0,00)               |
| 5.000       | H2O Retailing Corp          | BofA Securities             | (1.212)                         | (0,00)               |
| 1.041.449   | Halliburton Co              | Goldman Sachs International | (44.004)                        | (0,00)               |
| 46.497      | Halliburton Co              | JPMorgan Chase Bank         | (2.064)                         | (0,00)               |
| 5.200       | Hamamatsu Photonics KK      | BofA Securities             | (10.122)                        | (0,00)               |
| (19.500)    | Hankyu Hanshin Holdings Inc | BofA Securities             | (13.181)                        | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte (6,09 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung                 | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|---------------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 4.600       | Hanwa Co Ltd                          | BofA Securities             | (2.364)                         | (0,00)               |
| (72.460)    | Hanwha Solutions Corp                 | JPMorgan Chase Bank         | (9.340)                         | (0,00)               |
| (445.072)   | Hanwha Solutions Corp                 | Goldman Sachs International | (35.101)                        | (0,00)               |
| 511.219     | Harley-Davidson Inc                   | JPMorgan Chase Bank         | (22.389)                        | (0,00)               |
| (20.700)    | Hazama Ando Corp                      | BofA Securities             | (4.495)                         | (0,00)               |
| 1.361.385   | HCA Healthcare Inc                    | Goldman Sachs International | (104.131)                       | (0,01)               |
| 131.200     | Healthcare Realty Trust Inc           | Morgan Stanley              | (83.968)                        | (0,00)               |
| (17.885)    | HeidelbergCement AG                   | Goldman Sachs International | (550)                           | (0,00)               |
| 68.796      | Helen of Troy Ltd                     | JPMorgan Chase Bank         | (7.081)                         | (0,00)               |
| (100)       | Helios Technologies Inc               | Morgan Stanley              | (9)                             | (0,00)               |
| 932.776     | Henry Schein Inc                      | Goldman Sachs International | (59.102)                        | (0,00)               |
| 8.550.000   | Herbalife Ltd                         | Nomura                      | (249.694)                       | (0,01)               |
| (1.553.870) | Hershey Co                            | Goldman Sachs International | (26.106)                        | (0,00)               |
| 163.800     | Hess Corp                             | Goldman Sachs International | (164)                           | (0,00)               |
| 37.263      | Hewlett Packard Enterprise Co         | Morgan Stanley              | (7.546)                         | (0,00)               |
| 586.806     | Hilton Worldwide Holdings Inc         | JPMorgan Chase Bank         | (28.254)                        | (0,00)               |
| (20.081)    | Hims & Hers Health Inc                | Morgan Stanley              | (4.021)                         | (0,00)               |
| 200         | Hirose Electric Co Ltd                | BofA Securities             | (187)                           | (0,00)               |
| (500)       | Hisamitsu Pharmaceutical Co Inc       | BofA Securities             | (67)                            | (0,00)               |
| (2.800)     | Hitachi Construction Machinery Co Ltd | BofA Securities             | (2.877)                         | (0,00)               |
| (2.000)     | Hitachi Zosen Corp                    | BofA Securities             | (89)                            | (0,00)               |
| (13.600)    | Hokuhoku Financial Group Inc          | BofA Securities             | (4.246)                         | (0,00)               |
| 1.083.423   | Home Depot Inc                        | JPMorgan Chase Bank         | (57.600)                        | (0,00)               |
| 4.500       | Hoshizaki Corp                        | BofA Securities             | (1.628)                         | (0,00)               |
| 84.364.164  | Hosiden Corp                          | Société Générale            | (3.707)                         | (0,00)               |
| 8.800       | Hosiden Corp                          | BofA Securities             | (485)                           | (0,00)               |
| 782.543     | Host Hotels & Resorts Inc             | JPMorgan Chase Bank         | (10.951)                        | (0,00)               |
| (184.571)   | Hostess Brands Inc                    | JPMorgan Chase Bank         | (12.142)                        | (0,00)               |
| (175.423)   | Hostess Brands Inc                    | Morgan Stanley              | (2.994)                         | (0,00)               |
| 95.848      | HP Inc                                | Morgan Stanley              | (9.474)                         | (0,00)               |
| 105.215     | HP Inc                                | Goldman Sachs International | (1.504)                         | (0,00)               |
| (9.800)     | Hulic Co Ltd                          | BofA Securities             | (834)                           | (0,00)               |
| (2.800)     | Ibiden Co Ltd                         | BofA Securities             | (6.453)                         | (0,00)               |
| 6.369       | Ibstock Plc                           | BofA Securities             | (38)                            | (0,00)               |
| 200         | Ichigo Office REIT Investment Corp    | BofA Securities             | (5.942)                         | (0,00)               |
| (55.200)    | Ichigo Inc                            | BofA Securities             | (123)                           | (0,00)               |
| 959.008     | ICON Plc                              | Goldman Sachs International | (200.519)                       | (0,01)               |
| 2.500       | IDOM Inc                              | BofA Securities             | (74)                            | (0,00)               |
| 5.183.519   | Idorsia Ltd                           | Société Générale            | (220.699)                       | (0,01)               |
| (3.300)     | IHI Corp                              | BofA Securities             | (484)                           | (0,00)               |
| (1.500)     | Inabata & Co Ltd                      | BofA Securities             | (1.954)                         | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte (6,09 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung                         | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|---|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 9.939     | Independence Holdings Corp                    | Goldman Sachs International | (58)                            | (0,00)               |
| 2.100     | Information Services International-Dentsu Ltd | BofA Securities             | (2.300)                         | (0,00)               |
| (28)      | INFRONEER Holdings Inc                        | BofA Securities             | (16)                            | (0,00)               |
| 406       | Innovid Corp                                  | Goldman Sachs International | (169)                           | (0,00)               |
| (25.200)  | Inpex Corp                                    | BofA Securities             | (743)                           | (0,00)               |
| 92.459    | Insight Enterprises Inc                       | Goldman Sachs International | (3.175)                         | (0,00)               |
| 5.472.170 | Insmed Inc                                    | Nomura                      | (79.082)                        | (0,00)               |
| (426.080) | Integral Ad Science Holding Corp              | JPMorgan Chase Bank         | (25.573)                        | (0,00)               |
| 22.524    | Intel Corp                                    | Goldman Sachs International | (4.985)                         | (0,00)               |
| 62.905    | Intel Corp                                    | Morgan Stanley              | (6.063)                         | (0,00)               |
| 5.365.893 | InterDigital Inc                              | Goldman Sachs International | (783.705)                       | (0,04)               |
| 6.000.000 | InterDigital Inc                              | Nomura                      | (40.217)                        | (0,00)               |
| 4.842.389 | International Consolidated Airlines Group SA  | Société Générale            | (349.421)                       | (0,02)               |
| 54.079    | International Flavors & Fragrances Inc        | Goldman Sachs International | (1.641)                         | (0,00)               |
| 2.300     | Internet Initiative Japan Inc                 | BofA Securities             | (330)                           | (0,00)               |
| (56.166)  | Ionis Pharmaceuticals Inc                     | JPMorgan Chase Bank         | (204)                           | (0,00)               |
| 4.200     | Iriso Electronics Co Ltd                      | BofA Securities             | (5.849)                         | (0,00)               |
| 63.478    | Ironwood Pharmaceuticals Inc                  | Goldman Sachs International | (3.578)                         | (0,00)               |
| 16.274    | Ironwood Pharmaceuticals Inc                  | Morgan Stanley              | (220)                           | (0,00)               |
| 29.300    | Isuzu Motors Ltd                              | BofA Securities             | (4.190)                         | (0,00)               |
| (100)     | Ito En Ltd                                    | BofA Securities             | (17)                            | (0,00)               |
| (4.500)   | ITOCHU Corp                                   | BofA Securities             | (1.375)                         | (0,00)               |
| 2.300     | Itochu Techno-Solutions Corp                  | BofA Securities             | (661)                           | (0,00)               |
| (7.400)   | Itoham Yonekyu Holdings Inc                   | BofA Securities             | (17)                            | (0,00)               |
| 829.511   | ITT Inc                                       | Goldman Sachs International | (43.534)                        | (0,00)               |
| (4.300)   | Izumi Co Ltd                                  | BofA Securities             | (499)                           | (0,00)               |
| (4.223)   | J M Smucker Co                                | Goldman Sachs International | (263)                           | (0,00)               |
| (662.806) | J M Smucker Co                                | Morgan Stanley              | (42.832)                        | (0,00)               |
| 56.566    | Jabil Inc                                     | Morgan Stanley              | (19.355)                        | (0,00)               |
| (1.200)   | Jaccs Co Ltd                                  | BofA Securities             | (464)                           | (0,00)               |
| (401.861) | Jacobs Solutions Inc                          | Morgan Stanley              | (2.568)                         | (0,00)               |
| 557.967   | Janus Henderson Group Plc                     | Morgan Stanley              | (16.882)                        | (0,00)               |
| (12.700)  | Japan Airlines Co Ltd                         | BofA Securities             | (11.869)                        | (0,00)               |
| 2.500     | Japan Airport Terminal Co Ltd                 | BofA Securities             | (2.824)                         | (0,00)               |
| 10.600    | Japan Elevator Service Holdings Co Ltd        | BofA Securities             | (2.906)                         | (0,00)               |
| (3.500)   | Japan Exchange Group Inc                      | BofA Securities             | (1.474)                         | (0,00)               |
| 200       | Japan Hotel REIT Investment Corp              | BofA Securities             | (311)                           | (0,00)               |
| (1.100)   | Japan Material Co Ltd                         | BofA Securities             | (54)                            | (0,00)               |
| 100       | Japan Metropolitan Fund Invest                | BofA Securities             | (1.123)                         | (0,00)               |
| 8.800     | Japan Petroleum Exploration Co Ltd            | BofA Securities             | (1.261)                         | (0,00)               |
| 14.100    | Japan Post Holdings Co Ltd                    | BofA Securities             | (119)                           | (0,00)               |



## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte (6,09 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung              | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|------------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| (18.500)  | Japan Steel Works Ltd              | BofA Securities             | (11.649)                        | (0,00)               |
| 11.688    | Jaws Mustang                       | Goldman Sachs International | (187)                           | (0,00)               |
| 80.981    | JB Hi-Fi Ltd                       | JPMorgan Chase Bank         | (1.138)                         | (0,00)               |
| (9.400)   | JFE Holdings Inc                   | BofA Securities             | (3.765)                         | (0,00)               |
| (7.300)   | JGC Holdings Corp                  | BofA Securities             | (867)                           | (0,00)               |
| 20.600    | John Wiley & Sons Inc Class A      | Morgan Stanley              | (66.726)                        | (0,00)               |
| 43.784    | Johnson & Johnson                  | Morgan Stanley              | (637)                           | (0,00)               |
| 1.926.434 | Johnson & Johnson                  | JPMorgan Chase Bank         | (56.690)                        | (0,00)               |
| 1.235.321 | Johnson & Johnson                  | Goldman Sachs International | (50.403)                        | (0,00)               |
| 2.317     | Johnson Matthey Plc                | BofA Securities             | (19)                            | (0,00)               |
| 631.899   | JPMorgan Chase & Co                | Morgan Stanley              | (33.825)                        | (0,00)               |
| (600)     | JSR Corp                           | BofA Securities             | (2.783)                         | (0,00)               |
| (15.200)  | JTEKT Corp                         | BofA Securities             | (5.743)                         | (0,00)               |
| (3.300)   | JTOWER Inc                         | BofA Securities             | (1.028)                         | (0,00)               |
| (310.045) | Juniper Networks Inc               | Morgan Stanley              | (406)                           | (0,00)               |
| (2.100)   | Kaga Electronics Co Ltd            | BofA Securities             | (2.845)                         | (0,00)               |
| 8.300     | Kagome Co Ltd                      | BofA Securities             | (10.215)                        | (0,00)               |
| (6.300)   | Kamigumi Co Ltd                    | BofA Securities             | (1.466)                         | (0,00)               |
| 900       | Kanamoto Co Ltd                    | BofA Securities             | (267)                           | (0,00)               |
| (13.700)  | Kandenko Co Ltd                    | BofA Securities             | (1.317)                         | (0,00)               |
| (10.600)  | Kansai Electric Power Co Inc       | BofA Securities             | (2.517)                         | (0,00)               |
| (1.200)   | KAO Corp                           | BofA Securities             | (182)                           | (0,00)               |
| (4.500)   | Kawasaki Heavy Industries Ltd      | BofA Securities             | (1.995)                         | (0,00)               |
| (300)     | Kawasaki Kisen Kaisha Ltd          | BofA Securities             | (61)                            | (0,00)               |
| 135.763   | KBC Group NV                       | Goldman Sachs International | (7.365)                         | (0,00)               |
| 4.100     | KeePer Technical Laboratory Co Ltd | BofA Securities             | (4.549)                         | (0,00)               |
| (1.600)   | Keihan Holdings Co Ltd             | BofA Securities             | (138)                           | (0,00)               |
| 26.000    | Keikyu Corp                        | BofA Securities             | (4.266)                         | (0,00)               |
| 3.100     | Keio Corp                          | BofA Securities             | (6.053)                         | (0,00)               |
| (9.500)   | Keisei Electric Railway Co Ltd     | BofA Securities             | (23.301)                        | (0,00)               |
| 137.192   | Kellogg Co                         | Goldman Sachs International | (4.040)                         | (0,00)               |
| 626.079   | Kellogg Co                         | Morgan Stanley              | (8.838)                         | (0,00)               |
| 325.796   | Kennametal Inc                     | JPMorgan Chase Bank         | (38.327)                        | (0,00)               |
| 342.252   | Kennametal Inc                     | Goldman Sachs International | (19.324)                        | (0,00)               |
| 408.332   | Kennametal Inc                     | Morgan Stanley              | (8.516)                         | (0,00)               |
| 613.278   | Kenvue Inc                         | Morgan Stanley              | (17.519)                        | (0,00)               |
| (779.831) | Keurig Dr Pepper Inc               | Morgan Stanley              | (61.251)                        | (0,00)               |
| (622.237) | Keurig Dr Pepper Inc               | Goldman Sachs International | (44.322)                        | (0,00)               |
| 700       | Keyence Corp                       | BofA Securities             | (10.237)                        | (0,00)               |
| 96.846    | Keysight Technologies Inc          | Morgan Stanley              | (15.316)                        | (0,00)               |
| 292.680   | Keysight Technologies Inc          | Goldman Sachs International | (16.584)                        | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte (6,09 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile       | Wertpapierbezeichnung                    | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------|--|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 192.001       | KGHM Polska Miedz SA                     | JPMorgan Chase Bank         | (753)                           | (0,00)               |
| 800           | KH Neochem Co Ltd                        | BofA Securities             | (35)                            | (0,00)               |
| 1.100         | Kikkoman Corp                            | BofA Securities             | (1.847)                         | (0,00)               |
| (7.000)       | Kinden Corp                              | BofA Securities             | (1.907)                         | (0,00)               |
| 895.806       | Kinder Morgan Inc                        | Goldman Sachs International | (24.193)                        | (0,00)               |
| 18.138.472    | Kingsoft Corp Ltd                        | Société Générale            | (457.062)                       | (0,02)               |
| 10.100        | Kirin Holdings Co Ltd                    | BofA Securities             | (2.577)                         | (0,00)               |
| 56.066        | KLA Corp                                 | Goldman Sachs International | (1.048)                         | (0,00)               |
| 138.826       | KLA Corp                                 | Morgan Stanley              | (33.001)                        | (0,00)               |
| (552.602)     | Knight-Swift Transportation Holdings Inc | Goldman Sachs International | (11.040)                        | (0,00)               |
| (155.035)     | Knight-Swift Transportation Holdings Inc | JPMorgan Chase Bank         | (302)                           | (0,00)               |
| 1.300         | Kobayashi Pharmaceutical Co Ltd          | BofA Securities             | (284)                           | (0,00)               |
| 4.900         | Kobe Bussan Co Ltd                       | BofA Securities             | (1.105)                         | (0,00)               |
| 458.728.473   | Koei Tecmo Holdings Co Ltd               | Société Générale            | (267.904)                       | (0,01)               |
| 12.900        | Koito Manufacturing Co Ltd               | BofA Securities             | (6.194)                         | (0,00)               |
| 2.100         | Kose Corp                                | BofA Securities             | (9.760)                         | (0,00)               |
| 1.076.642     | Kroger Co                                | Morgan Stanley              | (31.912)                        | (0,00)               |
| (10.500)      | K's Holdings Corp                        | BofA Securities             | (778)                           | (0,00)               |
| (20.000)      | Kumiai Chemical Industry Co Ltd          | BofA Securities             | (2.944)                         | (0,00)               |
| 1.500         | Kureha Corp                              | BofA Securities             | (2.685)                         | (0,00)               |
| 9.100         | Kurita Water Industries Ltd              | BofA Securities             | (18.938)                        | (0,00)               |
| (2.900)       | Kusuri no Aoki Holdings Co Ltd           | BofA Securities             | (8.291)                         | (0,00)               |
| 1.500         | Kyocera Corp                             | BofA Securities             | (1.165)                         | (0,00)               |
| 1.348.734.682 | Kyoritsu Maintenance Co Ltd              | Société Générale            | (72.397)                        | (0,01)               |
| (4.700)       | Kyoritsu Maintenance Co Ltd              | BofA Securities             | (2.224)                         | (0,00)               |
| 1.070.000.000 | Kyoritsu Maintenance Co Ltd              | Nomura                      | (14.880)                        | (0,00)               |
| 4.500         | Kyowa Kirin Co Ltd                       | BofA Securities             | (3.423)                         | (0,00)               |
| (1.000)       | Kyushu Electric Power Co Inc             | BofA Securities             | (22)                            | (0,00)               |
| (56.400)      | Kyushu Financial Group Inc               | BofA Securities             | (24.487)                        | (0,00)               |
| 2.700         | Kyushu Railway Co                        | BofA Securities             | (550)                           | (0,00)               |
| 1.489.779     | Laboratory Corp of America Holdings      | Goldman Sachs International | (133.650)                       | (0,01)               |
| 6.600.000     | Lagfin SCA                               | Société Générale            | (53.882)                        | (0,00)               |
| 2.368.598     | Lam Research Corp                        | Goldman Sachs International | (95.503)                        | (0,01)               |
| 28.170        | Lam Research Corp                        | Morgan Stanley              | (713)                           | (0,00)               |
| 1.035.961     | Lantheus Holdings Inc                    | Nomura                      | (79.396)                        | (0,01)               |
| 12.525        | Las Vegas Sands Corp                     | Morgan Stanley              | (4.011)                         | (0,00)               |
| 500           | Lasertec Corp                            | BofA Securities             | (587)                           | (0,00)               |
| 19.860        | Lazard Growth Acquisition Corp I         | Goldman Sachs International | (128)                           | (0,00)               |
| 29.473        | Legalzoom.com Inc                        | Goldman Sachs International | (3.346)                         | (0,00)               |
| (38.500)      | Leonardo DRS Inc                         | Morgan Stanley              | (6.276)                         | (0,00)               |
| 94.000        | Leopalace21 Corp                         | BofA Securities             | (18.330)                        | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte (6,09 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung                     | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|---|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 159.449     | LG Innotek Co Ltd                         | Goldman Sachs International | (29.264)                        | (0,00)               |
| (1.100)     | Life Corp                                 | BofA Securities             | (21)                            | (0,00)               |
| (9.100)     | Lifenet Insurance Co                      | BofA Securities             | (10.186)                        | (0,00)               |
| (500)       | Lintec Corp                               | BofA Securities             | (39)                            | (0,00)               |
| 5.900       | Lion Corp                                 | BofA Securities             | (2.411)                         | (0,00)               |
| 21.040.781  | Live Nation Entertainment Inc             | Goldman Sachs International | (4.185.514)                     | (0,18)               |
| 78.555      | Live Nation Entertainment Inc             | JPMorgan Chase Bank         | (12.096)                        | (0,00)               |
| 27.694      | Live Nation Entertainment Inc             | Morgan Stanley              | (2.854)                         | (0,00)               |
| 35.100.000  | Live Nation Entertainment Inc             | Société Générale            | (445.450)                       | (0,02)               |
| 19.100      | Lixil Corp                                | BofA Securities             | (3.877)                         | (0,00)               |
| 6.500.000   | Lloyds Banking Group Plc                  | Société Générale            | (173.975)                       | (0,01)               |
| 245.198     | Lockheed Martin Corp                      | JPMorgan Chase Bank         | (5.624)                         | (0,00)               |
| 159.471     | Lockheed Martin Corp                      | Morgan Stanley              | (3.149)                         | (0,00)               |
| 1.019.366   | Louisiana-Pacific Corp                    | Goldman Sachs International | (86.561)                        | (0,01)               |
| 7.329       | Lululemon Athletica Inc                   | Morgan Stanley              | (668)                           | (0,00)               |
| 61.023      | Lumentum Holdings Inc                     | Morgan Stanley              | (2.120)                         | (0,00)               |
| 606.907     | Luminar Technologies Inc                  | Goldman Sachs International | (385.084)                       | (0,02)               |
| 200         | Mabuchi Motor Co Ltd                      | BofA Securities             | (49)                            | (0,00)               |
| (2.000)     | Macnica Holdings Inc                      | BofA Securities             | (7.115)                         | (0,00)               |
| 119.401     | MACOM Technology Solutions Holdings Inc   | JPMorgan Chase Bank         | (25.985)                        | (0,00)               |
| 657.314     | Magnolia Oil & Gas Corp Class A           | JPMorgan Chase Bank         | (48.141)                        | (0,00)               |
| (2.900)     | Makino Milling Machine Co Ltd             | BofA Securities             | (2.020)                         | (0,00)               |
| (1.615.058) | Marathon Oil Corp                         | JPMorgan Chase Bank         | (81.034)                        | (0,00)               |
| (320.098)   | Marathon Oil Corp                         | Goldman Sachs International | (609)                           | (0,00)               |
| (55.535)    | Maravai LifeSciences Holdings Inc Class A | Goldman Sachs International | (4.340)                         | (0,00)               |
| 13.585      | Marriott International Inc Class A        | Morgan Stanley              | (482)                           | (0,00)               |
| 1.399.421   | Marriott International Inc Class A        | JPMorgan Chase Bank         | (77.628)                        | (0,01)               |
| 21.329      | Marriott International Inc Class A        | Goldman Sachs International | (2.420)                         | (0,00)               |
| 33.250.000  | Marriott Vacations Worldwide Corp         | Goldman Sachs International | (1.865.248)                     | (0,08)               |
| 7.400       | Maruha Nichiro Corp                       | BofA Securities             | (6.528)                         | (0,00)               |
| (7.400)     | Marui Group Co Ltd                        | BofA Securities             | (3.469)                         | (0,00)               |
| (500)       | Maruwa Co Ltd                             | BofA Securities             | (2.477)                         | (0,00)               |
| 27.645      | Marvell Technology Inc                    | Morgan Stanley              | (14.030)                        | (0,00)               |
| 492.700     | Masco Corp                                | JPMorgan Chase Bank         | (66.928)                        | (0,00)               |
| 52.935      | MasTec Inc                                | Goldman Sachs International | (12.803)                        | (0,00)               |
| 6.225       | Mastercard Inc Class A                    | Goldman Sachs International | (444)                           | (0,00)               |
| 111.302     | Mastercard Inc Class A                    | JPMorgan Chase Bank         | (10.703)                        | (0,00)               |
| 85.999      | Mastercard Inc Class A                    | Morgan Stanley              | (9.722)                         | (0,00)               |
| 212.426     | Matador Resources Co                      | Goldman Sachs International | (10.200)                        | (0,00)               |
| (24.675)    | Match Group Inc                           | Morgan Stanley              | (369)                           | (0,00)               |
| 13.692.128  | Match Group Inc                           | Goldman Sachs International | (391.196)                       | (0,02)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte (6,09 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile       | Wertpapierbezeichnung            | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------|----------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 17.500        | Matsui Securities Co Ltd         | BofA Securities             | (1.131)                         | (0,00)               |
| (4.200)       | Maxell Ltd                       | BofA Securities             | (300)                           | (0,00)               |
| (3.800)       | Mazda Motor Corp                 | BofA Securities             | (56)                            | (0,00)               |
| (186.689)     | McCormick & Co Inc               | JPMorgan Chase Bank         | (3.278)                         | (0,00)               |
| (16.900)      | Mebuki Financial Group Inc       | BofA Securities             | (186)                           | (0,00)               |
| 243.313       | Medifast Inc                     | Goldman Sachs International | (15.216)                        | (0,00)               |
| (28.700)      | Medipal Holdings Corp            | BofA Securities             | (8.719)                         | (0,00)               |
| (2.700)       | Medley Inc                       | BofA Securities             | (4.511)                         | (0,00)               |
| 289.302       | Medtronic Plc                    | Goldman Sachs International | (19.467)                        | (0,00)               |
| 497.784       | Medtronic Plc                    | Morgan Stanley              | (27.081)                        | (0,00)               |
| 42.811        | Medtronic Plc                    | JPMorgan Chase Bank         | (3.527)                         | (0,00)               |
| 2.800         | Megmilk Snow Brand Co Ltd        | BofA Securities             | (35)                            | (0,00)               |
| 7.600         | MEIJI Holdings Co Ltd            | BofA Securities             | (1.662)                         | (0,00)               |
| (400)         | Meitec Corp                      | BofA Securities             | (199)                           | (0,00)               |
| 35.900.000    | Meituan                          | Société Générale            | (2.395)                         | (0,00)               |
| (101.319.956) | Meituan Class B                  | Société Générale            | (113.009)                       | (0,01)               |
| 10.100        | Menicon Co Ltd                   | BofA Securities             | (5.448)                         | (0,00)               |
| (271.812)     | MercadoLibre Inc                 | JPMorgan Chase Bank         | (19.705)                        | (0,00)               |
| (115.453)     | MercadoLibre Inc                 | Morgan Stanley              | (1.828)                         | (0,00)               |
| (85.146)      | MercadoLibre Inc                 | Goldman Sachs International | (3.477)                         | (0,00)               |
| (4.300)       | Mercari Inc                      | BofA Securities             | (8.657)                         | (0,00)               |
| (328.690)     | Merck & Co Inc                   | JPMorgan Chase Bank         | (5.539)                         | (0,00)               |
| 153.038       | Merck KGaA                       | Goldman Sachs International | (242)                           | (0,00)               |
| 111.462       | Meta Platforms Inc Class A       | Goldman Sachs International | (70)                            | (0,00)               |
| 138.796       | Mettler-Toledo International Inc | Goldman Sachs International | (132)                           | (0,00)               |
| 37.943        | MGM Resorts International        | Morgan Stanley              | (1.801)                         | (0,00)               |
| 116.467       | MGM Resorts International        | Goldman Sachs International | (7.228)                         | (0,00)               |
| 131.341       | Microchip Technology Inc         | Morgan Stanley              | (19.351)                        | (0,00)               |
| 860.238       | Microchip Technology Inc         | Goldman Sachs International | (171.836)                       | (0,01)               |
| (428.649)     | Micron Technology Inc            | JPMorgan Chase Bank         | (3.134)                         | (0,00)               |
| (161.422)     | Micron Technology Inc            | Morgan Stanley              | (2.918)                         | (0,00)               |
| 24.559.950    | Middleby Corp                    | Goldman Sachs International | (1.378.744)                     | (0,06)               |
| 23.542.716    | MINEBEA MITSUMI Inc              | Goldman Sachs International | (24.504)                        | (0,00)               |
| (33.658)      | Mirati Therapeutics Inc          | Goldman Sachs International | (2.673)                         | (0,00)               |
| (63.540)      | Mirati Therapeutics Inc          | Morgan Stanley              | (3.819)                         | (0,00)               |
| (329.091)     | Mirati Therapeutics Inc          | JPMorgan Chase Bank         | (22.968)                        | (0,00)               |
| (33.569)      | Mirum Pharmaceuticals Inc        | Goldman Sachs International | (467)                           | (0,00)               |
| (8.915)       | Mirum Pharmaceuticals Inc        | Morgan Stanley              | (758)                           | (0,00)               |
| 16.200        | MISUMI Group Inc                 | BofA Securities             | (25.005)                        | (0,00)               |
| (5.000)       | Mitsubishi Corp                  | BofA Securities             | (17.952)                        | (0,00)               |
| (5.000)       | Mitsubishi Heavy Industries Ltd  | BofA Securities             | (17.652)                        | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte (6,09 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung                  | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|--|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 3.100       | Mitsubishi Logistics Corp              | BofA Securities             | (198)                           | (0,00)               |
| (2.600)     | Mitsubishi Materials Corp              | BofA Securities             | (310)                           | (0,00)               |
| (40.100)    | Mitsubishi UFJ Financial Group Inc     | BofA Securities             | (9.060)                         | (0,00)               |
| (8.000)     | Mitsui Chemicals Inc                   | BofA Securities             | (9.809)                         | (0,00)               |
| 100         | Mitsui Fudosan Co Ltd                  | BofA Securities             | (41)                            | (0,00)               |
| (6.100)     | Mitsui OSK Lines Ltd                   | BofA Securities             | (3.532)                         | (0,00)               |
| 3.900       | Miura Co Ltd                           | BofA Securities             | (2.208)                         | (0,00)               |
| 2.400       | Mixi Inc                               | BofA Securities             | (150)                           | (0,00)               |
| (5.700)     | Mizuho Leasing Co Ltd                  | BofA Securities             | (15.378)                        | (0,00)               |
| 55.895      | Moderna Inc                            | Goldman Sachs International | (1.583)                         | (0,00)               |
| 73.000.886  | MOL Hungarian Oil & Gas Plc            | Morgan Stanley              | (3.481)                         | (0,00)               |
| 882.945     | Molina Healthcare Inc                  | Goldman Sachs International | (30.985)                        | (0,00)               |
| 637.425     | Molson Coors Beverage Co Class B       | Morgan Stanley              | (12.596)                        | (0,00)               |
| 87.288      | Molson Coors Beverage Co Class B       | Goldman Sachs International | (506)                           | (0,00)               |
| (4.100)     | Mondelez International Inc Class A     | Morgan Stanley              | (1.591)                         | (0,00)               |
| 384.882     | Monolithic Power Systems Inc           | Goldman Sachs International | (81.552)                        | (0,01)               |
| 11.000      | MonotaRO Co Ltd                        | BofA Securities             | (6.967)                         | (0,00)               |
| (40.176)    | Monster Beverage Corp                  | JPMorgan Chase Bank         | (160)                           | (0,00)               |
| 310.979     | Monster Beverage Corp                  | Morgan Stanley              | (30.539)                        | (0,00)               |
| (15.571)    | Morgan Advanced Materials Plc          | BofA Securities             | (7)                             | (0,00)               |
| (1.188.493) | Morgan Stanley                         | Goldman Sachs International | (27.655)                        | (0,00)               |
| 5.100       | Morinaga Milk Industry Co Ltd          | BofA Securities             | (6.702)                         | (0,00)               |
| 4.200       | Nabtesco Corp                          | BofA Securities             | (2.003)                         | (0,00)               |
| (1.000)     | Nagase & Co Ltd                        | BofA Securities             | (258)                           | (0,00)               |
| 205.152.610 | Nagoya Railroad Co Ltd                 | Société Générale            | (339.917)                       | (0,02)               |
| 5.300       | Nagoya Railroad Co Ltd                 | BofA Securities             | (39)                            | (0,00)               |
| (5.500)     | Nakanishi Inc                          | BofA Securities             | (3.058)                         | (0,00)               |
| 2.200       | Nankai Electric Railway Co Ltd         | BofA Securities             | (40)                            | (0,00)               |
| 71.749      | Nasdaq Inc                             | Morgan Stanley              | (452)                           | (0,00)               |
| (30.185)    | National Bank of Greece SA             | Morgan Stanley              | (448)                           | (0,00)               |
| 509.248     | National Vision Holdings Inc           | Morgan Stanley              | (14.544)                        | (0,00)               |
| 5.800.000   | NatWest Group Plc                      | Société Générale            | (130.100)                       | (0,01)               |
| 4.000.000   | NCL Corp Ltd                           | Goldman Sachs International | (3.014)                         | (0,00)               |
| (1.000)     | NEC Corp                               | BofA Securities             | (1.538)                         | (0,00)               |
| (11.400)    | NEC Networks & System Integration Corp | BofA Securities             | (1.977)                         | (0,00)               |
| (6.531.685) | Nedbank Group Ltd                      | JPMorgan Chase Bank         | (1.417)                         | (0,00)               |
| (2.390.935) | Nedbank Group Ltd                      | Goldman Sachs International | (758)                           | (0,00)               |
| 7.900       | NET One Systems Co Ltd                 | BofA Securities             | (2.875)                         | (0,00)               |
| 129.059     | NetApp Inc                             | Morgan Stanley              | (31.317)                        | (0,00)               |
| 45.765      | NetEase Inc                            | Morgan Stanley              | (7.152)                         | (0,00)               |
| 35.816      | NetEase Inc                            | Goldman Sachs International | (8.392)                         | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte (6,09 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile       | Wertpapierbezeichnung               | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------|-------------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 1.052.097     | Netflix Inc                         | Goldman Sachs International | (65.966)                        | (0,00)               |
| 26.373        | Netflix Inc                         | Morgan Stanley              | (5.271)                         | (0,00)               |
| (230.394)     | Neurocrine Biosciences Inc          | Goldman Sachs International | (230.394)                       | (0,01)               |
| 7.351         | New York Times Co Class A           | Morgan Stanley              | (363)                           | (0,00)               |
| 48.969        | New York Times Co Class A           | Goldman Sachs International | (3.305)                         | (0,00)               |
| 53.070        | New York Times Co Class A           | JPMorgan Chase Bank         | (1.890)                         | (0,00)               |
| (674.811)     | Nexi SpA                            | Goldman Sachs International | (30.791)                        | (0,00)               |
| 8.400.000     | Nexi SpA                            | Société Générale            | (26.155)                        | (0,00)               |
| 9.000         | Nexon Co Ltd                        | BofA Securities             | (9.592)                         | (0,00)               |
| 42.718        | NEXTracker Inc                      | Morgan Stanley              | (12.315)                        | (0,00)               |
| 6.600         | NGK Insulators Ltd                  | BofA Securities             | (1.004)                         | (0,00)               |
| (1.600)       | Nichias Corp                        | BofA Securities             | (375)                           | (0,00)               |
| (16.700)      | Nichicon Corp                       | BofA Securities             | (4.780)                         | (0,00)               |
| (2.000)       | Nidec Corp                          | BofA Securities             | (840)                           | (0,00)               |
| 3.900         | Nihon Kohden Corp                   | BofA Securities             | (1.101)                         | (0,00)               |
| (1.500)       | Nihon M&A Center Holdings Inc       | BofA Securities             | (142)                           | (0,00)               |
| (38.700)      | Nikon Corp                          | BofA Securities             | (50.299)                        | (0,00)               |
| (2.700)       | Nippon Gas Co Ltd                   | BofA Securities             | (505)                           | (0,00)               |
| 11.200        | Nippon Kayaku Co Ltd                | BofA Securities             | (2.252)                         | (0,00)               |
| (7.500)       | Nippon Light Metal Holdings Co Ltd  | BofA Securities             | (295)                           | (0,00)               |
| (3.500)       | Nippon Pillar Packing Co Ltd        | BofA Securities             | (5.628)                         | (0,00)               |
| (8.300)       | Nippon Sanso Holdings Corp          | BofA Securities             | (5.024)                         | (0,00)               |
| 3.000         | Nippon Shinyaku Co Ltd              | BofA Securities             | (7.452)                         | (0,00)               |
| 4.600         | Nippon Shokubai Co Ltd              | BofA Securities             | (612)                           | (0,00)               |
| (3.000)       | Nippon Soda Co Ltd                  | BofA Securities             | (8.992)                         | (0,00)               |
| 2.105.184.703 | Nippon Steel Corp                   | Société Générale            | (102.055)                       | (0,01)               |
| (76.200)      | Nippon Telegraph & Telephone Corp   | BofA Securities             | (273)                           | (0,00)               |
| (1.100)       | Nishimatsu Construction Co Ltd      | BofA Securities             | (70)                            | (0,00)               |
| (2.600)       | Nishi-Nippon Financial Holdings Inc | BofA Securities             | (142)                           | (0,00)               |
| 1.100         | Nishi-Nippon Railroad Co Ltd        | BofA Securities             | (6)                             | (0,00)               |
| 4.400         | Nissan Chemical Corp                | BofA Securities             | (4.585)                         | (0,00)               |
| 1.100         | Nissin Electric Co Ltd              | BofA Securities             | (415)                           | (0,00)               |
| 2.800         | Nissin Foods Holdings Co Ltd        | BofA Securities             | (8.092)                         | (0,00)               |
| (55.000)      | Nissui Corp                         | BofA Securities             | (88)                            | (0,00)               |
| 2.100         | Nitori Holdings Co Ltd              | BofA Securities             | (13.000)                        | (0,00)               |
| (1.600)       | Nitto Denko Corp                    | BofA Securities             | (1.571)                         | (0,00)               |
| 2.987         | NMC Health Plc                      | Morgan Stanley              | (418)                           | (0,00)               |
| 5.800         | NOF Corp                            | BofA Securities             | (295)                           | (0,00)               |
| (800)         | NOK Corp                            | BofA Securities             | (669)                           | (0,00)               |
| (600)         | Nomura Co Ltd                       | BofA Securities             | (48)                            | (0,00)               |
| 4.600         | Nomura Real Estate Holdings Inc     | BofA Securities             | (2.122)                         | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte (6,09 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung              | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|------------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| (7.100)   | Nomura Research Institute Ltd      | BofA Securities             | (2.126)                         | (0,00)               |
| (1.400)   | Noritsu Koki Co Ltd                | BofA Securities             | (277)                           | (0,00)               |
| 5.000.000 | Northern Oil & Gas Inc             | Nomura                      | (38.527)                        | (0,00)               |
| 3.510.941 | Northern Oil and Gas Inc           | Nomura                      | (233.227)                       | (0,01)               |
| 7.976.311 | Norwegian Cruise Line Holdings Ltd | Goldman Sachs International | (2.389.186)                     | (0,11)               |
| (92.160)  | Novartis AG                        | Goldman Sachs International | (1.842)                         | (0,00)               |
| (22.949)  | Novartis AG                        | JPMorgan Chase Bank         | (769)                           | (0,00)               |
| 108.157   | Novo Nordisk A/S                   | Morgan Stanley              | (1.207)                         | (0,00)               |
| 1.900     | NS Solutions Corp                  | BofA Securities             | (1.387)                         | (0,00)               |
| (6.600)   | NSD Co Ltd                         | BofA Securities             | (2.224)                         | (0,00)               |
| (2.900)   | NSK Ltd                            | BofA Securities             | (554)                           | (0,00)               |
| 136.494   | Nu Skin Enterprises Inc Class A    | Goldman Sachs International | (485)                           | (0,00)               |
| 66.937    | Nu Skin Enterprises Inc Class A    | Morgan Stanley              | (1.552)                         | (0,00)               |
| 774.427   | NVIDIA Corp                        | Goldman Sachs International | (51.045)                        | (0,00)               |
| 131.413   | NXP Semiconductors NV              | Morgan Stanley              | (27.457)                        | (0,00)               |
| 386.181   | NXP Semiconductors NV              | Goldman Sachs International | (59.878)                        | (0,00)               |
| 1.500     | OBIC Business Consultants Co Ltd   | BofA Securities             | (1.041)                         | (0,00)               |
| 200       | Obic Co Ltd                        | BofA Securities             | (289)                           | (0,00)               |
| 15.600    | Oji Holdings Corp                  | BofA Securities             | (1.024)                         | (0,00)               |
| (359.870) | Okta Inc                           | JPMorgan Chase Bank         | (22.221)                        | (0,00)               |
| (70.348)  | Okta Inc                           | Morgan Stanley              | (1.452)                         | (0,00)               |
| (3.700)   | OKUMA Corp                         | BofA Securities             | (10.943)                        | (0,00)               |
| (5.600)   | Okumura Corp                       | BofA Securities             | (4.696)                         | (0,00)               |
| 9.041     | Olaplex Holdings Inc               | Morgan Stanley              | (602)                           | (0,00)               |
| 333.414   | On Holding AG Class A              | JPMorgan Chase Bank         | (52.282)                        | (0,00)               |
| 5.030.339 | ON Semiconductor Corp              | Goldman Sachs International | (463.649)                       | (0,02)               |
| 183.131   | ONEOK Inc                          | Goldman Sachs International | (2.004)                         | (0,00)               |
| 4.300     | Open House Group Co Ltd            | BofA Securities             | (10.176)                        | (0,00)               |
| 310.506   | Option Care Health Inc             | Goldman Sachs International | (33.932)                        | (0,00)               |
| (2.150)   | Orient Corp                        | BofA Securities             | (47)                            | (0,00)               |
| 125.828   | Orion Oyj                          | Morgan Stanley              | (1.982)                         | (0,00)               |
| 9.100.000 | Ormat Technologies Inc             | Nomura                      | (624.839)                       | (0,03)               |
| 9.400     | Osaka Gas Co Ltd                   | BofA Securities             | (4.235)                         | (0,00)               |
| (5.500)   | Osaka Soda Co Ltd                  | BofA Securities             | (2.804)                         | (0,00)               |
| 54.110    | Oscar Health Inc Class A           | JPMorgan Chase Bank         | (7.714)                         | (0,00)               |
| (900)     | OSG Corp                           | BofA Securities             | (87)                            | (0,00)               |
| 819.054   | Ovintiv Inc                        | JPMorgan Chase Bank         | (67.364)                        | (0,00)               |
| (26.836)  | Pacira BioSciences Inc             | Goldman Sachs International | (1.441)                         | (0,00)               |
| (67.554)  | Pacira BioSciences Inc             | Morgan Stanley              | (1.096)                         | (0,00)               |
| 89.646    | Packaging Corp of America          | Goldman Sachs International | (3.346)                         | (0,00)               |
| 628.357   | Packaging Corp of America          | JPMorgan Chase Bank         | (22.722)                        | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte (6,09 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile    | Wertpapierbezeichnung             | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|------------|-----------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| (1.800)    | PAL GROUP Holdings Co Ltd         | BofA Securities             | (1.179)                         | (0,00)               |
| 11.661     | Palantir Technologies Inc Class A | Goldman Sachs International | (1.064)                         | (0,00)               |
| 12.806     | Palantir Technologies Inc Class A | JPMorgan Chase Bank         | (1.711)                         | (0,00)               |
| 90.481.609 | Palo Alto Networks Inc            | Goldman Sachs International | (53.534.401)                    | (2,35)               |
| 28.458     | Palo Alto Networks Inc            | Morgan Stanley              | (1.320)                         | (0,00)               |
| 4.200      | PALTAC Corp                       | BofA Securities             | (7.104)                         | (0,00)               |
| (38.600)   | Panasonic Holdings Corp           | BofA Securities             | (22.760)                        | (0,00)               |
| 4.981      | Paramount Global                  | Morgan Stanley              | (104)                           | (0,00)               |
| 29.643     | Paramount Global                  | JPMorgan Chase Bank         | (579)                           | (0,00)               |
| 4.500      | Park24 Co Ltd                     | BofA Securities             | (2.126)                         | (0,00)               |
| 340.492    | Parker-Hannifin Corp              | Goldman Sachs International | (42.323)                        | (0,00)               |
| 479.760    | Parker-Hannifin Corp              | JPMorgan Chase Bank         | (103.022)                       | (0,01)               |
| 28.020     | Patterson Cos Inc                 | Goldman Sachs International | (1.014)                         | (0,00)               |
| 691.515    | Patterson Cos Inc                 | JPMorgan Chase Bank         | (134.180)                       | (0,01)               |
| 158.383    | Paychex Inc                       | JPMorgan Chase Bank         | (8.033)                         | (0,00)               |
| 19.200     | Paychex Inc                       | Morgan Stanley              | (202)                           | (0,00)               |
| 183.954    | Paychex Inc                       | Goldman Sachs International | (3.749)                         | (0,00)               |
| 158.007    | Paycom Software Inc               | Goldman Sachs International | (14.283)                        | (0,00)               |
| 8.576      | Paycom Software Inc               | Morgan Stanley              | (71)                            | (0,00)               |
| (6.176)    | Payoneer Global Inc               | Goldman Sachs International | (46)                            | (0,00)               |
| (313.442)  | PBF Energy Inc Class A            | JPMorgan Chase Bank         | (4.786)                         | (0,00)               |
| 4.702.941  | Peabody Energy Corp               | Goldman Sachs International | (375.205)                       | (0,02)               |
| 5.750.000  | Peabody Energy Corp               | Nomura                      | (79.482)                        | (0,01)               |
| (17.400)   | Penta-Ocean Construction Co Ltd   | BofA Securities             | (871)                           | (0,00)               |
| 65.782     | Persimmon Plc                     | Goldman Sachs International | (202)                           | (0,00)               |
| 11.500     | Persol Holdings Co Ltd            | BofA Securities             | (7.433)                         | (0,00)               |
| 394.450    | Petropavlovsk Plc                 | Morgan Stanley              | (6.018)                         | (0,00)               |
| (3.200)    | Physicians Realty Trust           | Morgan Stanley              | (29)                            | (0,00)               |
| 7.200      | Pigeon Corp                       | BofA Securities             | (2.616)                         | (0,00)               |
| 200        | Pilot Corp                        | BofA Securities             | (95)                            | (0,00)               |
| (24.662)   | Pinterest Inc Class A             | Goldman Sachs International | (245)                           | (0,00)               |
| (655.214)  | Pioneer Natural Resources Co      | JPMorgan Chase Bank         | (63.683)                        | (0,00)               |
| (376.882)  | Pioneer Natural Resources Co      | Goldman Sachs International | (34.623)                        | (0,00)               |
| (864.307)  | Pioneer Natural Resources Co      | Morgan Stanley              | (72.118)                        | (0,00)               |
| (7.100)    | Pola Orbis Holdings Inc           | BofA Securities             | (4.147)                         | (0,00)               |
| 1.080.029  | Polaris Inc                       | Morgan Stanley              | (25.245)                        | (0,00)               |
| 170.816    | Pool Corp                         | JPMorgan Chase Bank         | (16.004)                        | (0,00)               |
| 380.526    | Pool Corp                         | Goldman Sachs International | (28.610)                        | (0,00)               |
| 124.536    | Pool Corp                         | Morgan Stanley              | (7.732)                         | (0,00)               |
| 4.914.560  | POSCO Holdings Inc                | Goldman Sachs International | (98.739)                        | (0,01)               |
| 16.000.000 | POSCO Holdings Inc                | Société Générale            | (9.197)                         | (0,00)               |



## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte (6,09 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile      | Wertpapierbezeichnung                       | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------|---|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 21.100.000   | Poseidon Finance 1 Ltd                      | Nomura                      | (82.184)                        | (0,01)               |
| (12.480.114) | Postal Savings Bank of China Co Ltd         | Société Générale            | (90.615)                        | (0,01)               |
| (7.010.598)  | Postal Savings Bank of China Co Ltd         | Nomura                      | (289.771)                       | (0,01)               |
| 1.163.201    | Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA | JPMorgan Chase Bank         | (38.174)                        | (0,00)               |
| 1.263.672    | Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA | Goldman Sachs International | (23.031)                        | (0,00)               |
| (44.061)     | Powszechny Zaklad Ubezpieczen SA            | JPMorgan Chase Bank         | (200)                           | (0,00)               |
| 4.000.000    | PPL Capital Funding Inc                     | Nomura                      | (23.732)                        | (0,00)               |
| 147.133      | PROCEPT BioRobotics Corp                    | Goldman Sachs International | (12.422)                        | (0,00)               |
| (1.213.403)  | Procter & Gamble Co                         | Goldman Sachs International | (37.782)                        | (0,00)               |
| 12.353       | ProSiebenSat.1 Media SE                     | JPMorgan Chase Bank         | (198)                           | (0,00)               |
| (39.493)     | Protagonist Therapeutics Inc                | JPMorgan Chase Bank         | (1.746)                         | (0,00)               |
| (62.188)     | Protagonist Therapeutics Inc                | Morgan Stanley              | (1.814)                         | (0,00)               |
| (69.767)     | PTC Therapeutics Inc                        | Goldman Sachs International | (17.521)                        | (0,00)               |
| (229.025)    | PTC Therapeutics Inc                        | JPMorgan Chase Bank         | (9.729)                         | (0,00)               |
| 58.955       | Qorvo Inc                                   | Goldman Sachs International | (148)                           | (0,00)               |
| (1.039.217)  | Quest Diagnostics Inc                       | Goldman Sachs International | (9.404)                         | (0,00)               |
| 50.371       | R1 RCM Inc                                  | JPMorgan Chase Bank         | (5.451)                         | (0,00)               |
| (6.300)      | Rakus Co Ltd                                | BofA Securities             | (358)                           | (0,00)               |
| 69.400       | Rakuten Group Inc                           | BofA Securities             | (18.866)                        | (0,00)               |
| 149.407      | Range Resources Corp                        | Goldman Sachs International | (2.533)                         | (0,00)               |
| 627.766      | Range Resources Corp                        | JPMorgan Chase Bank         | (37.646)                        | (0,00)               |
| 37.562       | Reata Pharmaceuticals Inc Class A           | Morgan Stanley              | (5.346)                         | (0,00)               |
| 58.836       | Redfin Corp                                 | Goldman Sachs International | (10.506)                        | (0,00)               |
| 5.687        | Redfin Corp                                 | Morgan Stanley              | (993)                           | (0,00)               |
| 1.800        | Relia Inc                                   | BofA Securities             | (85)                            | (0,00)               |
| 10.600       | Relo Group Inc                              | BofA Securities             | (1.500)                         | (0,00)               |
| 4.747        | RELX Plc                                    | Morgan Stanley              | (23)                            | (0,00)               |
| 45.675       | RELX Plc                                    | Goldman Sachs International | (2.667)                         | (0,00)               |
| 2.053.244    | Remgro Ltd                                  | Morgan Stanley              | (8.794)                         | (0,00)               |
| 321.008      | Remgro Ltd                                  | JPMorgan Chase Bank         | (967)                           | (0,00)               |
| (259.575)    | Remitly Global Inc                          | JPMorgan Chase Bank         | (2.076)                         | (0,00)               |
| (6.100)      | Renesas Electronics Corp                    | BofA Securities             | (10.415)                        | (0,00)               |
| (3.700)      | Rengo Co Ltd                                | BofA Securities             | (303)                           | (0,00)               |
| (3.200)      | RENOVA Inc                                  | BofA Securities             | (189)                           | (0,00)               |
| (14.300)     | Resolute Forest Products Inc                | Morgan Stanley              | (8.294)                         | (0,00)               |
| 15.900       | Resorttrust Inc                             | BofA Securities             | (2.064)                         | (0,00)               |
| 1.502.051    | RH  | Goldman Sachs International | (172.680)                       | (0,01)               |
| 11.703.239   | Rheinmetall AG                              | Société Générale            | (1.279.417)                     | (0,06)               |
| 9.533        | Rightmove Plc                               | Morgan Stanley              | (196)                           | (0,00)               |
| (2.515.499)  | Rio Tinto Plc                               | Morgan Stanley              | (67.645)                        | (0,00)               |
| 123.672      | Robert Half International Inc               | Goldman Sachs International | (7.846)                         | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte (6,09 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung           | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|---------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 12.655      | Robert Half International Inc   | Morgan Stanley              | (482)                           | (0,00)               |
| (5.600)     | Rohto Pharmaceutical Co Ltd     | BofA Securities             | (1.306)                         | (0,00)               |
| 800         | Rorze Corp                      | BofA Securities             | (651)                           | (0,00)               |
| 7.400       | Royal Holdings Co Ltd           | BofA Securities             | (7.098)                         | (0,00)               |
| 235.383     | RPC Inc                         | Morgan Stanley              | (8.796)                         | (0,00)               |
| 589.657     | S&P Global Inc                  | Goldman Sachs International | (70.162)                        | (0,01)               |
| 8.500.000   | Sacyr SA                        | Société Générale            | (47.265)                        | (0,00)               |
| 6.230.774   | Sacyr SA                        | Société Générale            | (84.083)                        | (0,01)               |
| 11.529.751  | Safran SA                       | Goldman Sachs International | (2.116.523)                     | (0,09)               |
| 52.140      | Salesforce Inc                  | Morgan Stanley              | (7.363)                         | (0,00)               |
| 363.766     | Sally Beauty Holdings Inc       | Morgan Stanley              | (6.403)                         | (0,00)               |
| (27.413)    | Samsung Electronics Co Ltd      | Goldman Sachs International | (386)                           | (0,00)               |
| (172.170)   | Samsung Electronics Co Ltd      | JPMorgan Chase Bank         | (5.703)                         | (0,00)               |
| (71.837)    | Samsung Electronics Co Ltd      | Morgan Stanley              | (582)                           | (0,00)               |
| (1.200)     | San-In Godo Bank Ltd            | BofA Securities             | (36)                            | (0,00)               |
| 1.400       | Sankyo Co Ltd                   | BofA Securities             | (1.924)                         | (0,00)               |
| 300         | Sankyu Inc                      | BofA Securities             | (222)                           | (0,00)               |
| 5.145.117   | Sanlam Ltd                      | Goldman Sachs International | (348)                           | (0,00)               |
| 1.091.164   | Sanlam Ltd                      | JPMorgan Chase Bank         | (5.011)                         | (0,00)               |
| (364.011)   | Sanofi                          | JPMorgan Chase Bank         | (3.289)                         | (0,00)               |
| (181.303)   | Sanofi                          | Goldman Sachs International | (2.343)                         | (0,00)               |
| 4.000       | Sansan Inc                      | BofA Securities             | (2.598)                         | (0,00)               |
| 800         | Santen Pharmaceutical Co Ltd    | BofA Securities             | (220)                           | (0,00)               |
| (24.400)    | Sanwa Holdings Corp             | BofA Securities             | (26.836)                        | (0,00)               |
| (2.500)     | Sanyo Special Steel Co Ltd      | BofA Securities             | (3.216)                         | (0,00)               |
| 100.412     | SAP SE                          | Morgan Stanley              | (15.027)                        | (0,00)               |
| 2.700       | Sapporo Holdings Ltd            | BofA Securities             | (228)                           | (0,00)               |
| 34.400.000  | Sasol Financing USA LLC         | BofA Securities             | (4.954.065)                     | (0,22)               |
| 2.306.386   | Sasol Ltd                       | JPMorgan Chase Bank         | (268)                           | (0,00)               |
| 4.716.821   | Sasol Ltd                       | Goldman Sachs International | (761.612)                       | (0,04)               |
| 750.000.000 | SBI Holdings Inc                | Nomura                      | (5.812)                         | (0,00)               |
| 4.300       | SBI Shinsei Bank Ltd            | BofA Securities             | (94)                            | (0,00)               |
| (737.374)   | Schlumberger NV                 | Goldman Sachs International | (48.199)                        | (0,00)               |
| (289.409)   | Scotts Miracle-Gro Co           | Goldman Sachs International | (26.980)                        | (0,00)               |
| (1.500)     | SCREEN Holdings Co Ltd          | BofA Securities             | (2.993)                         | (0,00)               |
| 64.785      | Sea Ltd                         | Morgan Stanley              | (1.211)                         | (0,00)               |
| 85.264      | Seagate Technology Holdings Plc | Morgan Stanley              | (1.050)                         | (0,00)               |
| 1.400       | Sealed Air Corp                 | Morgan Stanley              | (74)                            | (0,00)               |
| (800)       | Secom Co Ltd                    | BofA Securities             | (560)                           | (0,00)               |
| (4.300)     | Sega Sammy Holdings Inc         | BofA Securities             | (1.308)                         | (0,00)               |
| 895.796     | SEI Investments Co              | JPMorgan Chase Bank         | (18.559)                        | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte (6,09 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung                   | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|---|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 17.000      | Seibu Holdings Inc                      | BofA Securities             | (2.473)                         | (0,00)               |
| (15.400)    | Seino Holdings Co Ltd                   | BofA Securities             | (22.847)                        | (0,00)               |
| (5.300)     | Seiren Co Ltd                           | BofA Securities             | (3.067)                         | (0,00)               |
| (400)       | Sekisui House Reit Inc                  | BofA Securities             | (4.960)                         | (0,00)               |
| 26.865      | Semtech Corp                            | Morgan Stanley              | (37.756)                        | (0,00)               |
| (700)       | Senko Group Holdings Co Ltd             | BofA Securities             | (310)                           | (0,00)               |
| (25.900)    | Septeni Holdings Co Ltd                 | BofA Securities             | (3.258)                         | (0,00)               |
| 705.479     | ServiceNow Inc                          | Goldman Sachs International | (23.782)                        | (0,00)               |
| 4.800       | Seven Bank Ltd                          | BofA Securities             | (0)                             | (0,00)               |
| 4.100       | SG Holdings Co Ltd                      | BofA Securities             | (1.390)                         | (0,00)               |
| 22.700      | Sharp Corp                              | BofA Securities             | (1.140)                         | (0,00)               |
| (1.607.325) | Shell Plc                               | Goldman Sachs International | (123.180)                       | (0,01)               |
| 570.611     | Sherwin-Williams Co                     | Goldman Sachs International | (25.088)                        | (0,00)               |
| (2.200)     | Shibaura Machine Co Ltd                 | BofA Securities             | (931)                           | (0,00)               |
| 3.800       | Shiga Bank Ltd                          | BofA Securities             | (1.840)                         | (0,00)               |
| 1.700       | Shimadzu Corp                           | BofA Securities             | (1.522)                         | (0,00)               |
| (17.600)    | Shimizu Corp                            | BofA Securities             | (626)                           | (0,00)               |
| 3.500       | Shin Nippon Biomedical Laboratories Ltd | BofA Securities             | (3.737)                         | (0,00)               |
| 47.048.144  | Shin-Etsu Chemical Co Ltd               | JPMorgan Chase Bank         | (68.082)                        | (0,01)               |
| (3.200)     | Shinko Electric Industries Co Ltd       | BofA Securities             | (14.041)                        | (0,00)               |
| 1.700       | Shionogi & Co Ltd                       | BofA Securities             | (2.923)                         | (0,00)               |
| 7.500       | Ship Healthcare Holdings Inc            | BofA Securities             | (3.578)                         | (0,00)               |
| 2.200       | SHO-BOND Holdings Co Ltd                | BofA Securities             | (2.664)                         | (0,00)               |
| 1.400       | Shochiku Co Ltd                         | BofA Securities             | (5.022)                         | (0,00)               |
| 11.519      | Shopify Inc Class A                     | Morgan Stanley              | (57)                            | (0,00)               |
| 102.823     | Shopify Inc Class A                     | Goldman Sachs International | (2.498)                         | (0,00)               |
| (408.568)   | SICC CO Ltd                             | Morgan Stanley              | (39.646)                        | (0,00)               |
| 455.317     | Siemens Energy AG                       | BofA Securities             | (74.712)                        | (0,01)               |
| 75.000.000  | Siemens Energy Finance BV               | Société Générale            | (9.044.198)                     | (0,40)               |
| (3.246.797) | Signet Jewelers Ltd                     | Morgan Stanley              | (120.805)                       | (0,01)               |
| 99.597      | Simply Good Foods Co                    | Goldman Sachs International | (1.336)                         | (0,00)               |
| 100.732     | Sirius XM Holdings Inc                  | Morgan Stanley              | (9.923)                         | (0,00)               |
| 29.535      | Sirius XM Holdings Inc                  | JPMorgan Chase Bank         | (8.014)                         | (0,00)               |
| 75.493      | Sirius XM Holdings Inc                  | Goldman Sachs International | (25.144)                        | (0,00)               |
| 10.540.736  | SK Hynix Inc                            | Goldman Sachs International | (2.475.635)                     | (0,11)               |
| (13.570)    | SK Innovation Co Ltd                    | Morgan Stanley              | (1.426)                         | (0,00)               |
| (294.935)   | SK Innovation Co Ltd                    | Goldman Sachs International | (40.038)                        | (0,00)               |
| (253.696)   | SKF AB Class B                          | Goldman Sachs International | (20.364)                        | (0,00)               |
| 41.517      | Snap Inc Class A                        | Morgan Stanley              | (1.973)                         | (0,00)               |
| 8.700       | Snow Peak Inc                           | BofA Securities             | (3.472)                         | (0,00)               |
| (123.807)   | Snowflake Inc Class A                   | Morgan Stanley              | (3.596)                         | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte (6,09 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile    | Wertpapierbezeichnung              | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|------------|------------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| (16.806)   | Snowflake Inc Class A              | JPMorgan Chase Bank         | (8)                             | (0,00)               |
| (48.877)   | Snowflake Inc Class A              | Goldman Sachs International | (233)                           | (0,00)               |
| 124.940    | Societe Generale SA                | Morgan Stanley              | (10.576)                        | (0,00)               |
| (12.300)   | Sohgo Security Services Co Ltd     | BofA Securities             | (233)                           | (0,00)               |
| (497.702)  | SolarEdge Technologies Inc         | Goldman Sachs International | (48.450)                        | (0,00)               |
| (3.100)    | Sompo Holdings Inc                 | BofA Securities             | (405)                           | (0,00)               |
| 765.899    | Sonos Inc                          | Morgan Stanley              | (37.133)                        | (0,00)               |
| 2.700      | Sony Group Corp                    | BofA Securities             | (8.544)                         | (0,00)               |
| 3.600      | Sotetsu Holdings Inc               | BofA Securities             | (430)                           | (0,00)               |
| 189.060    | Sovos Brands Inc                   | JPMorgan Chase Bank         | (60.962)                        | (0,00)               |
| 9.776      | Splunk Inc                         | Morgan Stanley              | (208)                           | (0,00)               |
| 46.533     | Splunk Inc                         | JPMorgan Chase Bank         | (3.069)                         | (0,00)               |
| 44.006     | Splunk Inc                         | Goldman Sachs International | (1.813)                         | (0,00)               |
| 82.967     | Spotify Technology SA              | Goldman Sachs International | (4.945)                         | (0,00)               |
| 23.166     | Spotify Technology SA              | Morgan Stanley              | (607)                           | (0,00)               |
| 171.199    | SpringWorks Therapeutics Inc       | Morgan Stanley              | (953)                           | (0,00)               |
| 10.305     | Sprout Social Inc Class A          | Morgan Stanley              | (308)                           | (0,00)               |
| 241.288    | Sprouts Farmers Market Inc         | JPMorgan Chase Bank         | (2.676)                         | (0,00)               |
| 72.335     | Sprouts Farmers Market Inc         | Morgan Stanley              | (3.662)                         | (0,00)               |
| 38.927     | Squarespace Inc Class A            | Morgan Stanley              | (4.379)                         | (0,00)               |
| 39.902     | SSAB AB Class B                    | Goldman Sachs International | (11.726)                        | (0,00)               |
| 654.773    | Steel Dynamics Inc                 | Goldman Sachs International | (33.928)                        | (0,00)               |
| 100.686    | Stem Inc                           | Goldman Sachs International | (15.464)                        | (0,00)               |
| 53.565     | STMicroelectronics NV              | Morgan Stanley              | (1.989)                         | (0,00)               |
| 447.399    | STMicroelectronics NV              | Goldman Sachs International | (72.140)                        | (0,01)               |
| 17.253     | Stryker Corp                       | Morgan Stanley              | (992)                           | (0,00)               |
| 122.025    | Stryker Corp                       | Goldman Sachs International | (4.780)                         | (0,00)               |
| (34.900)   | Subaru Corp                        | BofA Securities             | (41.508)                        | (0,00)               |
| (1.500)    | Sugi Holdings Co Ltd               | BofA Securities             | (1.926)                         | (0,00)               |
| 32.912.749 | SUMCO Corp                         | JPMorgan Chase Bank         | (18.612)                        | (0,00)               |
| 15.200     | SUMCO Corp                         | BofA Securities             | (5.257)                         | (0,00)               |
| 13.821.081 | SUMCO Corp                         | Goldman Sachs International | (3.473)                         | (0,00)               |
| 18.484.920 | SUMCO Corp                         | Morgan Stanley              | (6.596)                         | (0,00)               |
| (4.700)    | Sumitomo Forestry Co Ltd           | BofA Securities             | (5.791)                         | (0,00)               |
| 6.700      | Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc | BofA Securities             | (137)                           | (0,00)               |
| 54.600     | Sumitomo Pharma Co Ltd             | BofA Securities             | (6.871)                         | (0,00)               |
| (25.000)   | Sumitomo Rubber Industries Ltd     | BofA Securities             | (14.214)                        | (0,00)               |
| (5.200)    | Sumitomo Warehouse Co Ltd          | BofA Securities             | (1.786)                         | (0,00)               |
| 314.571    | Suncor Energy Inc                  | Goldman Sachs International | (6.691)                         | (0,00)               |
| 1.648.026  | Suncor Energy Inc                  | JPMorgan Chase Bank         | (16.867)                        | (0,00)               |
| 677.663    | Suncor Energy Inc                  | Morgan Stanley              | (5.019)                         | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte (6,09 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung                     | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|---|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 904.516     | Sunnova Energy International Inc          | Goldman Sachs International | (30.622)                        | (0,00)               |
| 3.500       | Suntory Beverage & Food Ltd               | BofA Securities             | (5.387)                         | (0,00)               |
| (20.100)    | Suruga Bank Ltd                           | BofA Securities             | (1.404)                         | (0,00)               |
| (5.394.408) | Swedish Orphan Biovitrum AB               | Goldman Sachs International | (64.233)                        | (0,00)               |
| (3.112.712) | Swedish Orphan Biovitrum AB               | JPMorgan Chase Bank         | (29.368)                        | (0,00)               |
| 2.673.999   | Swiss Prime Site AG                       | Société Générale            | (1.471)                         | (0,00)               |
| 10.511.263  | Swiss Re AG                               | Société Générale            | (520.779)                       | (0,02)               |
| (540.462)   | Synopsys Inc                              | JPMorgan Chase Bank         | (9.613)                         | (0,00)               |
| 50.676      | Sysco Corp                                | Morgan Stanley              | (1.223)                         | (0,00)               |
| 374.691     | Sysco Corp                                | JPMorgan Chase Bank         | (166)                           | (0,00)               |
| 300         | Sysmex Corp                               | BofA Securities             | (451)                           | (0,00)               |
| 86.384      | T Rowe Price Group Inc                    | Goldman Sachs International | (322)                           | (0,00)               |
| (12.200)    | T&D Holdings Inc                          | BofA Securities             | (8.276)                         | (0,00)               |
| (4.600)     | Tadano Ltd                                | BofA Securities             | (448)                           | (0,00)               |
| (13.300)    | Taiheiyo Cement Corp                      | BofA Securities             | (14.378)                        | (0,00)               |
| (259.311)   | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd | Morgan Stanley              | (3.841)                         | (0,00)               |
| (393.732)   | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd | JPMorgan Chase Bank         | (2.746)                         | (0,00)               |
| 1.700       | Taiyo Yuden Co Ltd                        | BofA Securities             | (2.783)                         | (0,00)               |
| 1.400       | Takara Bio Inc                            | BofA Securities             | (439)                           | (0,00)               |
| (18.800)    | Takara Holdings Inc                       | BofA Securities             | (12.347)                        | (0,00)               |
| 5.900       | Takeda Pharmaceutical Co Ltd              | BofA Securities             | (4.795)                         | (0,00)               |
| 423.468     | Take-Two Interactive Software Inc         | Goldman Sachs International | (9.401)                         | (0,00)               |
| (700)       | Takeuchi Manufacturing Co Ltd             | BofA Securities             | (2.473)                         | (0,00)               |
| 10.200      | Tama Home Co Ltd                          | BofA Securities             | (1.261)                         | (0,00)               |
| (205.477)   | Tandem Diabetes Care Inc                  | Goldman Sachs International | (39.614)                        | (0,00)               |
| 79.496      | Tanger Factory Outlet Centers Inc         | Goldman Sachs International | (801)                           | (0,00)               |
| 444.285     | Targa Resources Corp                      | Goldman Sachs International | (11.722)                        | (0,00)               |
| (16.100)    | TBS Holdings Inc                          | BofA Securities             | (26.048)                        | (0,00)               |
| (1.600)     | TDK Corp                                  | BofA Securities             | (848)                           | (0,00)               |
| 2.300       | TechnoPro Holdings Inc                    | BofA Securities             | (2.036)                         | (0,00)               |
| (262.487)   | Teledyne Technologies Inc                 | Morgan Stanley              | (17.651)                        | (0,00)               |
| (593.831)   | Teledyne Technologies Inc                 | Goldman Sachs International | (31.570)                        | (0,00)               |
| (585.998)   | Temple & Webster Group Ltd                | JPMorgan Chase Bank         | (122.882)                       | (0,01)               |
| 112.838     | Tenaris SA                                | Morgan Stanley              | (10.316)                        | (0,00)               |
| 90.187      | Tenaris SA                                | JPMorgan Chase Bank         | (12.441)                        | (0,00)               |
| 173.705     | Tenaris SA                                | Goldman Sachs International | (11.024)                        | (0,00)               |
| 52.530      | Tencent Music Entertainment Group         | Morgan Stanley              | (1.681)                         | (0,00)               |
| 1.409.258   | Tenet Healthcare Corp                     | Goldman Sachs International | (107.352)                       | (0,00)               |
| (4.500)     | Terumo Corp                               | BofA Securities             | (3.097)                         | (0,00)               |
| 274.323     | Tesla Inc                                 | Morgan Stanley              | (2.614)                         | (0,00)               |
| 207.530     | Tesla Inc                                 | Goldman Sachs International | (69.930)                        | (0,01)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

**Differenzkontrakte (6,09 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)**

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung        | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 196.929     | Texas Instruments Inc        | Goldman Sachs International | (4.468)                         | (0,00)               |
| 209.011     | Texas Instruments Inc        | Morgan Stanley              | (17.481)                        | (0,00)               |
| 246.316     | Texas Instruments Inc        | JPMorgan Chase Bank         | (18.813)                        | (0,00)               |
| 138.224     | Textron Inc                  | Morgan Stanley              | (3.498)                         | (0,00)               |
| 329.918     | Textron Inc                  | JPMorgan Chase Bank         | (766)                           | (0,00)               |
| 65.884      | Thermo Fisher Scientific Inc | Morgan Stanley              | (251)                           | (0,00)               |
| (163.227)   | Theseus Pharmaceuticals Inc  | Morgan Stanley              | (9.297)                         | (0,00)               |
| 8.300       | THK Co Ltd                   | BofA Securities             | (5.558)                         | (0,00)               |
| 278.638     | Timken Co                    | Morgan Stanley              | (12.869)                        | (0,00)               |
| 549.641     | Timken Co                    | Goldman Sachs International | (134.585)                       | (0,01)               |
| 13.100      | TIS Inc                      | BofA Securities             | (11.431)                        | (0,00)               |
| (100)       | TKP Corp                     | BofA Securities             | (0)                             | (0,00)               |
| 402         | T-Mobile US Inc              | Morgan Stanley              | (12)                            | (0,00)               |
| 319.710     | T-Mobile US Inc              | Goldman Sachs International | (7.113)                         | (0,00)               |
| 11.140      | Toast Inc Class A            | Morgan Stanley              | (465)                           | (0,00)               |
| (13.200)    | Tobu Railway Co Ltd          | BofA Securities             | (2.855)                         | (0,00)               |
| 17.200      | Toda Corp                    | BofA Securities             | (927)                           | (0,00)               |
| 500         | Toei Animation Co Ltd        | BofA Securities             | (259)                           | (0,00)               |
| 3.600       | Toho Gas Co Ltd              | BofA Securities             | (706)                           | (0,00)               |
| 175.855.303 | Toho Holdings Co Ltd         | Société Générale            | (53.659)                        | (0,00)               |
| 10.800      | Toho Holdings Co Ltd         | BofA Securities             | (70)                            | (0,00)               |
| 3.500       | Toho Titanium Co Ltd         | BofA Securities             | (5.020)                         | (0,00)               |
| (8.300)     | Tohoku Electric Power Co Inc | BofA Securities             | (1.403)                         | (0,00)               |
| (9.000)     | Tokai Rika Co Ltd            | BofA Securities             | (11.301)                        | (0,00)               |
| 1.300       | Token Corp                   | BofA Securities             | (594)                           | (0,00)               |
| (2.900)     | Tokyo Gas Co Ltd             | BofA Securities             | (988)                           | (0,00)               |
| (5.800)     | Tokyo Seimitsu Co Ltd        | BofA Securities             | (39.336)                        | (0,00)               |
| 3.500       | Tokyotokeiba Co Ltd          | BofA Securities             | (4.103)                         | (0,00)               |
| 50.000      | Tokyu Corp                   | BofA Securities             | (33.332)                        | (0,00)               |
| (11.300)    | Tomy Co Ltd                  | BofA Securities             | (8.203)                         | (0,00)               |
| (7.800)     | Topcon Corp                  | BofA Securities             | (3.334)                         | (0,00)               |
| (3.400)     | Toridoll Holdings Corp       | BofA Securities             | (838)                           | (0,00)               |
| 2.800       | Toshiba Corp                 | BofA Securities             | (2.329)                         | (0,00)               |
| 7.000       | TOTO Ltd                     | BofA Securities             | (3.405)                         | (0,00)               |
| (800)       | Toyo Construction Co Ltd     | BofA Securities             | (160)                           | (0,00)               |
| 2.300       | Toyo Tanso Co Ltd            | BofA Securities             | (334)                           | (0,00)               |
| (13.900)    | Toyo Tire Corp               | BofA Securities             | (7.991)                         | (0,00)               |
| (7.700)     | Toyoda Gosei Co Ltd          | BofA Securities             | (5.247)                         | (0,00)               |
| (13.400)    | Toyota Boshoku Corp          | BofA Securities             | (7.705)                         | (0,00)               |
| (4.100)     | Toyota Industries Corp       | BofA Securities             | (11.253)                        | (0,00)               |
| 47.369      | Trade Desk Inc Class A       | Morgan Stanley              | (6.748)                         | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte (6,09 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung                 | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|---------------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 34.277      | Trade Desk Inc Class A                | Goldman Sachs International | (632)                           | (0,00)               |
| (691.918)   | Tradeweb Markets Inc Class A          | Goldman Sachs International | (39.319)                        | (0,00)               |
| (35.993)    | Trane Technologies Plc                | Morgan Stanley              | (1.482)                         | (0,00)               |
| 341.110.147 | Transcosmos Inc                       | Société Générale            | (240.478)                       | (0,01)               |
| 793.983     | TransDigm Group Inc                   | JPMorgan Chase Bank         | (92.935)                        | (0,01)               |
| 46.596      | Travel + Leisure Co                   | JPMorgan Chase Bank         | (5.963)                         | (0,00)               |
| 12.454      | Travel + Leisure Co                   | Goldman Sachs International | (1.001)                         | (0,00)               |
| 6.406       | Travel + Leisure Co                   | Morgan Stanley              | (164)                           | (0,00)               |
| (1.154.227) | TreeHouse Foods Inc                   | Goldman Sachs International | (33.894)                        | (0,00)               |
| (59.129)    | TreeHouse Foods Inc                   | Morgan Stanley              | (3.132)                         | (0,00)               |
| (122.311)   | TreeHouse Foods Inc                   | JPMorgan Chase Bank         | (3.305)                         | (0,00)               |
| (400)       | Trend Micro Inc                       | BofA Securities             | (135)                           | (0,00)               |
| (3.300)     | Tri Chemical Laboratories Inc         | BofA Securities             | (6.015)                         | (0,00)               |
| (23.555)    | TripAdvisor Inc                       | Morgan Stanley              | (506)                           | (0,00)               |
| 2.314.049   | Truworths International Ltd           | Goldman Sachs International | (1.891)                         | (0,00)               |
| 14.800      | TS Tech Co Ltd                        | BofA Securities             | (2.651)                         | (0,00)               |
| 2.300       | Tsumura & Co                          | BofA Securities             | (47)                            | (0,00)               |
| (2.500)     | Tsuruha Holdings Inc                  | BofA Securities             | (4.146)                         | (0,00)               |
| 600         | TTEC Holdings Inc                     | Morgan Stanley              | (34)                            | (0,00)               |
| (100)       | UACJ Corp                             | BofA Securities             | (35)                            | (0,00)               |
| (19.400)    | UBE Corp                              | BofA Securities             | (15.387)                        | (0,00)               |
| (13.947)    | Uber Technologies Inc                 | Goldman Sachs International | (31)                            | (0,00)               |
| 30.620.365  | Ubisoft Entertainment SA              | Société Générale            | (851.418)                       | (0,04)               |
| 10.300.000  | UBS Group AG                          | Société Générale            | (216.005)                       | (0,01)               |
| 46.741      | UCB SA                                | Morgan Stanley              | (1.767)                         | (0,00)               |
| 32.562      | UiPath Inc Class A                    | Goldman Sachs International | (1.817)                         | (0,00)               |
| 77.384      | UiPath Inc Class A                    | Morgan Stanley              | (1.681)                         | (0,00)               |
| (330.156)   | Ultragenyx Pharmaceutical Inc         | JPMorgan Chase Bank         | (28.146)                        | (0,00)               |
| (225.055)   | Ultragenyx Pharmaceutical Inc         | Morgan Stanley              | (19.172)                        | (0,00)               |
| (238.964)   | uniQure NV                            | Morgan Stanley              | (125.975)                       | (0,01)               |
| 401.752     | United Parcel Service Inc Class B     | Goldman Sachs International | (1.449)                         | (0,00)               |
| 242.215     | United Rentals Inc                    | Morgan Stanley              | (8.854)                         | (0,00)               |
| 1.041.205   | United Rentals Inc                    | Goldman Sachs International | (172.814)                       | (0,02)               |
| 329.530     | United States Steel Corp              | Goldman Sachs International | (16.526)                        | (0,00)               |
| 1.963.848   | UnitedHealth Group Inc                | Goldman Sachs International | (74.143)                        | (0,01)               |
| 169.467     | UnitedHealth Group Inc                | Morgan Stanley              | (326)                           | (0,00)               |
| 15.541      | Unity Software Inc                    | Morgan Stanley              | (8.554)                         | (0,00)               |
| 8.000       | Universal Entertainment Corp          | BofA Securities             | (515)                           | (0,00)               |
| 1.112.258   | Universal Health Services Inc Class B | Goldman Sachs International | (150.995)                       | (0,01)               |
| 640.052     | Unum Group                            | Goldman Sachs International | (35.697)                        | (0,00)               |
| 774.925     | Urban Outfitters Inc                  | JPMorgan Chase Bank         | (113.438)                       | (0,01)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte (6,09 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile    | Wertpapierbezeichnung           | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|------------|---------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| (300)      | UT Group Co Ltd                 | BofA Securities             | (291)                           | (0,00)               |
| (54.918)   | Vale SA                         | JPMorgan Chase Bank         | (2.754)                         | (0,00)               |
| (442.580)  | Vale SA                         | Morgan Stanley              | (54.455)                        | (0,00)               |
| 637.483    | Valero Energy Corp              | Goldman Sachs International | (49.152)                        | (0,00)               |
| (7.635)    | Ventyx Biosciences Inc          | JPMorgan Chase Bank         | (1.180)                         | (0,00)               |
| (27.573)   | Ventyx Biosciences Inc          | Goldman Sachs International | (1.433)                         | (0,00)               |
| 665.341    | VeriSign Inc                    | Goldman Sachs International | (35.890)                        | (0,00)               |
| 5.909      | VeriSign Inc                    | Morgan Stanley              | (166)                           | (0,00)               |
| 6.520      | VeriSign Inc                    | JPMorgan Chase Bank         | (229)                           | (0,00)               |
| 15.914     | Verizon Communications Inc      | Goldman Sachs International | (734)                           | (0,00)               |
| 132.821    | Verizon Communications Inc      | Morgan Stanley              | (2.204)                         | (0,00)               |
| 819.261    | Vertex Pharmaceuticals Inc      | Goldman Sachs International | (34.853)                        | (0,00)               |
| 361.892    | VF Corp                         | JPMorgan Chase Bank         | (414)                           | (0,00)               |
| 154.448    | Viatris Inc                     | Goldman Sachs International | (8.754)                         | (0,00)               |
| (120.549)  | Vir Biotechnology Inc           | Morgan Stanley              | (240)                           | (0,00)               |
| (282.590)  | Vir Biotechnology Inc           | Goldman Sachs International | (889)                           | (0,00)               |
| 12.700.000 | Virgin Galactic Holdings Inc    | Nomura                      | (74.700)                        | (0,01)               |
| (12.201)   | Viridian Therapeutics Inc       | Morgan Stanley              | (715)                           | (0,00)               |
| (213.886)  | Viridian Therapeutics Inc       | Goldman Sachs International | (17.095)                        | (0,00)               |
| 185.914    | Visa Inc Class A                | Morgan Stanley              | (7.763)                         | (0,00)               |
| 338.149    | Visa Inc Class A                | Goldman Sachs International | (18.936)                        | (0,00)               |
| 525.210    | Visa Inc Class A                | JPMorgan Chase Bank         | (23.896)                        | (0,00)               |
| 18.978     | Vishay Intertechnology Inc      | Morgan Stanley              | (788)                           | (0,00)               |
| 1.500.625  | Vishay Intertechnology Inc      | Goldman Sachs International | (234.019)                       | (0,01)               |
| (131.835)  | Vital Farms Inc                 | Goldman Sachs International | (22.748)                        | (0,00)               |
| 56.723     | VMware Inc Class A              | Goldman Sachs International | (1.209)                         | (0,00)               |
| 72.864     | VMware Inc Class A              | Morgan Stanley              | (1.335)                         | (0,00)               |
| (44.057)   | Volkswagen AG                   | Goldman Sachs International | (74.836)                        | (0,01)               |
| 9.500      | Wacom Co Ltd                    | BofA Securities             | (2.358)                         | (0,00)               |
| 127.353    | Walgreens Boots Alliance Inc    | Goldman Sachs International | (778)                           | (0,00)               |
| 324.464    | Walmart Inc                     | Goldman Sachs International | (3.046)                         | (0,00)               |
| 417.747    | Walmart Inc                     | Morgan Stanley              | (43.297)                        | (0,00)               |
| 5.835      | Walt Disney Co                  | Goldman Sachs International | (79)                            | (0,00)               |
| 11.323     | Walt Disney Co                  | Morgan Stanley              | (65)                            | (0,00)               |
| 2.763      | Warby Parker Inc Class A        | Morgan Stanley              | (134)                           | (0,00)               |
| 28.879     | Warby Parker Inc Class A        | Goldman Sachs International | (144)                           | (0,00)               |
| (188.806)  | Warner Bros Discovery Inc       | Morgan Stanley              | (9.774)                         | (0,00)               |
| 8.936      | Warner Bros Discovery Inc       | JPMorgan Chase Bank         | (366)                           | (0,00)               |
| 454        | Warner Bros Discovery Inc       | Goldman Sachs International | (53)                            | (0,00)               |
| (136.935)  | Warner Music Group Corp Class A | Morgan Stanley              | (1.750)                         | (0,00)               |
| 8.444.257  | Wayfair Inc Class A             | Goldman Sachs International | (4.249.502)                     | (0,19)               |



## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte (6,09 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile  | Wertpapierbezeichnung                    | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|--|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 212.168  | Wayfair Inc Class A                      | Morgan Stanley              | (171.252)                       | (0,01)               |
| 2.400  | West Holdings Corp                       | BofA Securities             | (1.698)                         | (0,00)               |
| 9.900  | West Japan Railway Co                    | BofA Securities             | (5.013)                         | (0,00)               |
| 360.286  | Westinghouse Air Brake Technologies Corp | Goldman Sachs International | (35.708)                        | (0,00)               |
| 68.922   | Whitcap Resources Inc                    | Morgan Stanley              | (1.087)                         | (0,00)               |
| 96.618   | Williams Cos Inc                         | Goldman Sachs International | (5.547)                         | (0,00)               |
| 1.420.788  | Williams-Sonoma Inc                      | Morgan Stanley              | (84.534)                        | (0,01)               |
| 673.545  | Williams-Sonoma Inc                      | JPMorgan Chase Bank         | (30.577)                        | (0,00)               |
| 456.853  | Winnebago Industries Inc                 | Goldman Sachs International | (15.458)                        | (0,00)               |
| (50.500)   | Wise Plc Class A                         | Goldman Sachs International | (518)                           | (0,00)               |
| (13.900)   | Wolverine World Wide Inc                 | Morgan Stanley              | (1.470)                         | (0,00)               |
| (2.632.698)  | Woolworths Holdings Ltd                  | JPMorgan Chase Bank         | (52)                            | (0,00)               |
| (28.518)   | Workday Inc Class A                      | Morgan Stanley              | (182)                           | (0,00)               |
| 2.600  | Workman Co Ltd                           | BofA Securities             | (2.981)                         | (0,00)               |
| (18.704.930)   | W-Scope Corp                             | Morgan Stanley              | (5.044)                         | (0,00)               |
| (428.837)  | WW International Inc                     | Goldman Sachs International | (31.938)                        | (0,00)               |
| (53.693)   | WW International Inc                     | Morgan Stanley              | (8.613)                         | (0,00)               |
| (408.963)  | Wyndham Hotels & Resorts Inc             | Morgan Stanley              | (2.124)                         | (0,00)               |
| (1.304.545)  | Wynn Resorts Ltd                         | Morgan Stanley              | (11.042)                        | (0,00)               |
| 3.500  | Yakult Honsha Co Ltd                     | BofA Securities             | (7.804)                         | (0,00)               |
| 38.100   | Yamada Holdings Co Ltd                   | BofA Securities             | (566)                           | (0,00)               |
| (20.000)   | Yamaguchi Financial Group Inc            | BofA Securities             | (3.782)                         | (0,00)               |
| (4.200)  | Yamaha Motor Co Ltd                      | BofA Securities             | (2.276)                         | (0,00)               |
| (600)  | Yamato Kogyo Co Ltd                      | BofA Securities             | (348)                           | (0,00)               |
| 775.192.362  | Yaoko Co Ltd                             | Société Générale            | (211.514)                       | (0,01)               |
| (1.400)  | Yaskawa Electric Corp                    | BofA Securities             | (819)                           | (0,00)               |
| 3.200.000  | Yeahka Ltd                               | Nomura                      | (6.101)                         | (0,00)               |
| 753.933  | YETI Holdings Inc                        | JPMorgan Chase Bank         | (24.096)                        | (0,00)               |
| 5.700  | Yokohama Rubber Co Ltd                   | BofA Securities             | (1.142)                         | (0,00)               |
| 6.900  | Z Holdings Corp                          | BofA Securities             | (454)                           | (0,00)               |
| (51.992)   | Zai Lab Ltd                              | JPMorgan Chase Bank         | (2.568)                         | (0,00)               |
| 3.900  | Zenkoku Hoshu Co Ltd                     | BofA Securities             | (1.812)                         | (0,00)               |
| (6.300)  | Zensho Holdings Co Ltd                   | BofA Securities             | (20.585)                        | (0,00)               |
| (4.008)  | Ziff Davis Inc                           | Goldman Sachs International | (4.008)                         | (0,00)               |
| 6.857.485  | Zillow Group Inc                         | Goldman Sachs International | (756.781)                       | (0,04)               |
| 1.000.000  | ZUR Rose Finance BV                      | Société Générale            | (16.379)                        | (0,00)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Differenzkontrakten <sup>∞</sup></b> |  |                             | <b>(139.138.180)</b>            | <b>(6,09)</b>        |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Verkaufte Swaptions (0,00 %) (31. Dezember 2022: (0,02 %))

| Nominalwert  | Fälligkeit | Beschreibung  | Gegenpartei         | Zeitwert US\$   | % des Nettovermögens |
|--|------------|---|---------------------|-----------------|----------------------|
| <b>Call Swaptions</b>  |            |   |                     |                 |                      |
| (445.000.000) EUR  | 19.07.2023 | EUR Swaption, bei potenzieller Ausübung der Option geht das Portfolio ein Swapgeschäft mit einem Nominalwert von 445.000.000 EUR ein, in dessen Rahmen er einen Satz von 1,00 % zahlt und iTraxx EUR S39 erhält, Ausübungssatz 1,05 % | JPMorgan Chase Bank | (43.457)        | (0,00)               |
| <b>Beizulegender Zeitwert aus verkauften Swaptions insgesamt <sup>∞</sup> (Prämie: 288.427 US\$)</b> |            |   |                     | <b>(43.457)</b> | <b>(0,00)</b>        |

### Credit-Default-Swap-Kontrakte (0,02 %) (31. Dezember 2022: (0,02 %))

| Nominalwert   | Datum der Schließung | Gegenpartei                 | Referenzobligation   | Zeitwert US\$    | % des Nettovermögens |
|---|----------------------|-----------------------------|--|------------------|----------------------|
| 13.000.000 EUR  | 20.12.2024           | Nomura International Plc    | Buying default protection on POSCO Holdings Inc, 2.75%, 15/07/2024 | (130.026)        | (0,01)               |
| 1.250.000.000 JPY   | 20.06.2025           | JPMorgan Chase Bank         | Buying default protection on ANA Holdings Inc, 1.22%, 06/03/2024   | (129.443)        | (0,01)               |
| 500.000.000 JPY   | 20.12.2026           | Goldman Sachs International | Buying default protection on ANA Holdings Inc, 1.22%, 06/03/2024   | (73.121)         | (0,00)               |
| 750.000.000 JPY   | 20.12.2026           | JPMorgan Chase Bank         | Buying default protection on ANA Holdings Inc, 1.22%, 06/03/2024   | (109.682)        | (0,00)               |
| <b>Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten insgesamt <sup>∞</sup></b> |                      |                             |  | <b>(442.272)</b> | <b>(0,02)</b>        |

### Zinsswap-Kontrakte (0,53 %) (31. Dezember 2022: 0,76 %)

| Nominalwert   | Fälligkeit | Gegenpartei                              | Erhalt/ (Zahlung) <sup>#</sup> | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|------------|--|--------------------------------|-----------------|--------------------|---------------------------------|----------------------|
| CZK 3.375.000.000   | 25.04.2024 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                         | 7,03 %          | 3M PRIBOR          | (21.812)                        | (0,00)               |
| CZK 3.375.000.000   | 25.04.2024 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                         | 7,05 %          | 3M PRIBOR          | (40.041)                        | (0,00)               |
| AUD 144.000.000   | 03.07.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                      | 4,38 %          | 1D AONIA           | (50.556)                        | (0,00)               |
| CZK 3.375.000.000   | 24.04.2024 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                         | 7,01 %          | 3M PRIBOR          | (79.445)                        | (0,00)               |
| BRL 3.706.976.756   | 02.10.2023 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | Erhalt                         | 13,43 %         | 1D BROIS           | (93.458)                        | (0,01)               |
| BRL 7.076.622.866   | 02.10.2023 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | Erhalt                         | 13,41 %         | 1D BROIS           | (133.963)                       | (0,01)               |
| AUD 5.760.000.000   | 05.07.2023 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                      | 3,88 %          | 1D AONIA           | (167.705)                       | (0,01)               |
| MXN 475.791.468   | 27.11.2024 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)                      | 9,93 %          | 28D MXIBTIIE       | (173.003)                       | (0,01)               |
| USD 111.816.000   | 12.06.2024 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                      | 5,10 %          | 1D SOFR            | (305.040)                       | (0,01)               |
| AUD 142.600.000   | 09.06.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                      | 4,24 %          | 1D AONIA           | (320.054)                       | (0,01)               |
| AUD 142.776.000   | 09.06.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                      | 4,23 %          | 1D AONIA           | (333.419)                       | (0,02)               |
| USD 186.500.000   | 12.06.2024 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                      | 5,13 %          | 1D SOFR            | (457.510)                       | (0,02)               |
| JPY 15.436.000.000  | 15.03.2026 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                         | 0,29 %          | 12M JPY LIBOR      | (486.110)                       | (0,02)               |
| MXN 2.407.408.532   | 27.11.2024 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                      | 9,93 %          | 28D MXIBTIIE       | (875.359)                       | (0,04)               |
| JPY 30.872.000.000  | 15.03.2026 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                         | 0,29 %          | 12M JPY LIBOR      | (966.438)                       | (0,04)               |
| JPY 15.695.000.000  | 15.03.2026 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                         | 0,48 %          | 12M JPY LIBOR      | (1.037.932)                     | (0,05)               |
| MXN 1.555.000.000   | 17.06.2026 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | Erhalt                         | 9,50 %          | 28D MXIBTIIE       | (1.155.485)                     | (0,05)               |
| JPY 31.609.000.000  | 15.03.2026 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                         | 0,48 %          | 12M JPY LIBOR      | (2.111.062)                     | (0,09)               |
| EUR 1.025.000.000   | 20.03.2024 | Merrill Lynch International              | (Zahlung)                      | 3,38 %          | 3M EURIBOR         | (3.198.859)                     | (0,14)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Zinsswapkontrakten <sup>∞</sup></b> |            |  |                                |                 |                    | <b>(12.007.251)</b>             | <b>(0,53)</b>        |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Zinsswap-Kontrakte (0,53 %) (31. Dezember 2022: 0,76 %) (Fortsetzung)

<sup>#</sup>Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

### Total Return Swap-Kontrakte (0,22 %) (31. Dezember 2022: (0,04 %))

| Nominalwert     | Datum der Schließung | Variabler Zinssatz  | Referenzunternehmen                         | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------------|----------------------|---------------------|---|---------------------------------|----------------------|
| (2.998) USD     | 06.11.2024           | 4,76 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUXRT <sup>2</sup> | (85)                            | (0,00)               |
| (28.192) USD    | 17.07.2025           | 5,06 <sup>3</sup>   | Goldman Sachs Basket GSXUNPTC <sup>4</sup>  | (99)                            | (0,00)               |
| (4.213) USD     | 06.11.2024           | 4,85 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUSPY <sup>2</sup> | (165)                           | (0,00)               |
| (55.972) USD    | 06.11.2024           | 3,54 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUIAR <sup>2</sup> | (179)                           | (0,00)               |
| (28.273) USD    | 06.11.2024           | 4,82 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUMGK <sup>2</sup> | (688)                           | (0,00)               |
| (28.201) USD    | 06.11.2024           | 4,77 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUXLK <sup>2</sup> | (808)                           | (0,00)               |
| (1.809.745) USD | 10.06.2024           | 4,66 <sup>5</sup>   | JPMorgan Basket JPAYBIO <sup>16</sup>       | (1.084)                         | (0,00)               |
| 2.648.883 USD   | 22.01.2024           | 4,61 <sup>5</sup>   | JPMorgan Basket JPABKXS <sup>6</sup>        | (1.117)                         | (0,00)               |
| (56.639) USD    | 06.11.2024           | 4,85 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUSPY <sup>2</sup> | (1.432)                         | (0,00)               |
| (55.923) USD    | 06.11.2024           | 4,77 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUIWP <sup>2</sup> | (1.543)                         | (0,00)               |
| (126.158) USD   | 06.11.2024           | 4,52 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSXXSHRT <sup>2</sup> | (1.910)                         | (0,00)               |
| (257.751) USD   | 06.11.2024           | 4,79 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUIWM <sup>2</sup> | (3.701)                         | (0,00)               |
| (176.997) USD   | 05.03.2025           | 4,73 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUKWE <sup>2</sup> | (3.759)                         | (0,00)               |
| (139.806) USD   | 06.11.2024           | 4,77 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUXLI <sup>2</sup> | (4.247)                         | (0,00)               |
| (147.981) USD   | 06.11.2024           | 4,85 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUSOX <sup>2</sup> | (6.764)                         | (0,00)               |
| (318.530) USD   | 06.11.2024           | 4,82 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUXLV <sup>2</sup> | (7.235)                         | (0,00)               |
| (206.782) USD   | 06.11.2024           | 4,77 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUXLC <sup>2</sup> | (7.966)                         | (0,00)               |
| (294.897) USD   | 06.11.2024           | 4,76 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUIGV <sup>2</sup> | (11.127)                        | (0,00)               |
| (1.524.463) USD | 06.11.2024           | 4,85 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUXLP <sup>2</sup> | (12.785)                        | (0,00)               |
| (7.198.155) USD | 06.11.2024           | 3,77 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSACHDGE <sup>2</sup> | (15.505)                        | (0,00)               |
| (716.596) USD   | 05.03.2025           | 4,77 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUXLC <sup>2</sup> | (16.575)                        | (0,00)               |
| (131.247) USD   | 06.11.2024           | 4,73 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUSMH <sup>2</sup> | (18.682)                        | (0,00)               |
| (301.829) USD   | 06.11.2024           | 4,73 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUSMH <sup>2</sup> | (18.852)                        | (0,00)               |
| (375.586) USD   | 06.11.2024           | 4,79 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUIWM <sup>2</sup> | (19.400)                        | (0,00)               |
| (423.660) USD   | 06.11.2024           | 4,85 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUIQQ <sup>2</sup> | (19.965)                        | (0,00)               |
| (455.283) USD   | 05.03.2025           | 4,77 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUXLK <sup>2</sup> | (20.497)                        | (0,00)               |
| (882.644) USD   | 20.11.2024           | 4,85 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUSPY <sup>2</sup> | (22.539)                        | (0,00)               |
| 77.731 USD      | 01.05.2025           | (1,63) <sup>1</sup> | Morgan Stanley Basket MSABKRBM <sup>2</sup> | (23.550)                        | (0,00)               |
| (1.585.617) USD | 06.11.2024           | 4,83 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUIOH <sup>2</sup> | (28.042)                        | (0,00)               |
| (835.406) USD   | 06.11.2024           | 4,85 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUIQQ <sup>2</sup> | (28.613)                        | (0,00)               |
| (690.189) USD   | 06.11.2024           | 4,79 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUMDY <sup>2</sup> | (29.585)                        | (0,00)               |
| (601.812) USD   | 06.11.2024           | 4,76 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUXRT <sup>2</sup> | (30.116)                        | (0,00)               |
| (502.788) USD   | 29.04.2025           | 4,85 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUSPY <sup>2</sup> | (30.794)                        | (0,00)               |
| (471.560) USD   | 06.11.2024           | 4,85 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUIQQ <sup>2</sup> | (35.196)                        | (0,00)               |
| (390.216) USD   | 06.11.2024           | 4,85 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUSOX <sup>2</sup> | (36.237)                        | (0,00)               |
| (590.628) USD   | 06.11.2024           | 4,76 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUXRT <sup>2</sup> | (38.444)                        | (0,00)               |
| (752.166) USD   | 06.11.2024           | 4,79 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUIWM <sup>2</sup> | (39.027)                        | (0,00)               |
| (775.731) USD   | 06.11.2024           | 4,76 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUXRT <sup>2</sup> | (39.129)                        | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Total Return Swap-Kontrakte (0,22 %) (31. Dezember 2022: (0,04 %)) (Fortsetzung)

| Nominalwert   | Datum der Schließung | Variabler Zinssatz | Referenzunternehmen   | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|----------------------|--------------------|---|---------------------------------|----------------------|
| (454.283) USD   | 28.05.2025           | 3,42 <sup>1</sup>  | Morgan Stanley Basket MSLYT23S <sup>2</sup>                                   | (41.373)                        | (0,00)               |
| (841.131) EUR   | 12.06.2024           | 3,10 <sup>7</sup>  | JPMorgan Basket JPECND <sup>6</sup>   | (42.237)                        | (0,00)               |
| (706.742) USD   | 06.11.2024           | 4,85 <sup>1</sup>  | Morgan Stanley Basket MSNBUSPY <sup>2</sup>                                   | (43.285)                        | (0,00)               |
| (1.357.763) USD   | 06.11.2024           | 4,85 <sup>1</sup>  | Morgan Stanley Basket MSNBUSPY <sup>2</sup>                                   | (46.751)                        | (0,00)               |
| (1.252.191) USD   | 06.11.2024           | 4,28 <sup>1</sup>  | Morgan Stanley Basket MSNBUAML <sup>2</sup>                                   | (49.036)                        | (0,00)               |
| (1.244.674) USD   | 06.11.2024           | 4,77 <sup>1</sup>  | Morgan Stanley Basket MSNBUXLC <sup>2</sup>                                   | (63.552)                        | (0,00)               |
| 7.501.163 USD   | 17.10.2024           | 5,64 <sup>3</sup>  | Morgan Stanley Basket MSSOCNCU <sup>2</sup>                                   | (86.436)                        | (0,01)               |
| (1.596.956) USD   | 06.11.2024           | 4,79 <sup>1</sup>  | Morgan Stanley Basket MSNBUIWM <sup>2</sup>                                   | (93.941)                        | (0,01)               |
| (958.624) USD   | 06.11.2024           | 4,77 <sup>1</sup>  | Morgan Stanley Basket MSNBUXLY <sup>2</sup>                                   | (113.262)                       | (0,01)               |
| (2.067.920) USD   | 06.11.2024           | 4,85 <sup>1</sup>  | Morgan Stanley Basket MSNBUSPY <sup>2</sup>                                   | (119.841)                       | (0,01)               |
| (2.054.749) USD   | 06.11.2024           | 4,85 <sup>1</sup>  | Morgan Stanley Basket MSNBUSPY <sup>2</sup>                                   | (130.308)                       | (0,01)               |
| (851.442) USD   | 06.11.2024           | 4,85 <sup>1</sup>  | Morgan Stanley Basket MSNBUQQQ <sup>2</sup>                                   | (137.001)                       | (0,01)               |
| (996.045) USD   | 06.11.2024           | 4,77 <sup>1</sup>  | Morgan Stanley Basket MSNBUXLK <sup>2</sup>                                   | (194.625)                       | (0,01)               |
| 17.019.750 EUR  | 03.05.2024           | 0,00 <sup>8</sup>  | UBS Basket UBSCFVPR <sup>9</sup>  | (426.636)                       | (0,02)               |
| 6.946.780 USD   | 02.05.2025           | 4,29 <sup>3</sup>  | JPMorgan Basket JPSOCSE <sup>6</sup>  | (1.026.678)                     | (0,05)               |
| (53.172.225) EUR  | 10.10.2023           | 3,40 <sup>7</sup>  | Goldman Sachs STOXX Europe 600 Industrial Goods & Services Index <sup>4</sup> | (1.725.420)                     | (0,08)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Total Return Swap-Kontrakten <sup>∞</sup></b> |                      |                    |   | <b>(4.917.824)</b>              | <b>(0,22)</b>        |

<sup>1</sup> Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist der 1-Tag-FEDEF.

<sup>2</sup> Die Gegenpartei für die Total Return Swap-Kontrakte ist Morgan Stanley.

<sup>3</sup> Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist der 1-Tag-SOFR.

<sup>4</sup> Die Gegenpartei für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist Goldman Sachs International.

<sup>5</sup> Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist der 1-Tag-OBFR.

<sup>6</sup> Die Gegenpartei für die Total Return Swap-Kontrakte ist die JPMorgan Chase Bank.

<sup>7</sup> Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist der 1-Tag-ESTR.

<sup>8</sup> Fester Zinssatz.

<sup>9</sup> Die Gegenpartei für die Total Return Swap-Kontrakte ist UBS AG.

### Variance-Swap-Kontrakte (0,02 %) (31. Dezember 2022: (0,01 %))

| Vega Nominalwert   | Datum der Schließung | Gegenpartei                 | Referenzobligation                   | Variance-Ausübungssatz | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|----------------------|-----------------------------|--------------------------------------|------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 240.000 USD  | 20.12.2024           | Goldman Sachs International | Euro Stoxx 50 Index vs S&P 500 Index | 22,00 vs 24,35         | (106.005)                       | (0,00)               |
| 125.000 USD  | 21.06.2024           | Goldman Sachs International | GS 34 Names Global Basket            | Variance               | (231.915)                       | (0,01)               |
| 300.000 USD  | 20.12.2024           | UBS                         | UBS 24 Names US Basket               | Variance               | (196.694)                       | (0,01)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Inflation-Swap-Kontrakten <sup>∞</sup></b> |                      |                             |                                      |                        | <b>(534.614)</b>                | <b>(0,02)</b>        |

### Volatility-Swap-Kontrakte (0,04 %) (31. Dezember 2022: (0,14 %))

| Nominalwert   | Datum der Schließung | Gegenpartei | Referenzobligation <sup>1</sup> | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------|----------------------|-------------|---------------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 3.500.000 EUR | 20.12.2024           | BNP         | BNP 20 Names EU Basket          | (4.724)                         | (0,00)               |
| 6.500.000 EUR | 20.12.2024           | BNP         | BNP 20 Names EU Basket          | (8.751)                         | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Volatility-Swap-Kontrakte (0,04 %) (31. Dezember 2022: (0,14 %)) (Fortsetzung)

| Nominalwert   | Datum der Schließung | Gegenpartei      | Referenzobligation <sup>1</sup> | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|----------------------|------------------|---------------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 10.000.000 EUR  | 20.12.2024           | BofA Securities  | BAML 12 Names EU Basket         | (15.633)                        | (0,00)               |
| 40.000.000 USD  | 17.01.2025           | Citibank NA      | CITI 24 Names US Basket         | (27.637)                        | (0,00)               |
| 21.551.100 EUR  | 20.12.2024           | Société Générale | SG 15 Names Global Basket       | (86.995)                        | (0,01)               |
| 30.000.000 EUR  | 20.12.2024           | BofA Securities  | BAML 22 Names US Basket         | (101.396)                       | (0,01)               |
| 20.000.000 USD  | 20.12.2024           | UBS              | UBS 10 Names US Geo Basket      | (115.425)                       | (0,01)               |
| 40.000.000 EUR  | 20.12.2024           | BNP              | BNP 15 Names EU Basket          | (248.409)                       | (0,01)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Volatility-Swap-Kontrakten <sup>∞</sup></b> |                      |                  |                                 | <b>(608.970)</b>                | <b>(0,04)</b>        |

<sup>1</sup>Die Volatilitäten lauten auf verschiedene Fremdwährungen, je nach den Landeswährungen der Positionen in den Swaps.

|   | Zeitwert US\$        | % des Nettovermögens |
|---|----------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(558.160.115)</b> | <b>(24,46)</b>       |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>1.561.042.320</b> | <b>68,44</b>         |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>720.675.579</b>   | <b>31,56</b>         |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>2.281.717.899</b> | <b>100,00</b>        |

## Portfolioanalyse

|   | US\$                 | % des Gesamtvermögens |
|---|----------------------|-----------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 357.500.861          | 11,93                 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden            | 1.205.215.051        | 40,22                 |
| ± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden                          | 75.321.463           | 2,51                  |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap                            | (76.995.055)         | -2,57                 |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>1.561.042.320</b> | <b>52,09</b>          |

## US Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der<br>Anteile                               | Wertpapierbezeichnung        | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|------------------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Aktien 104,27 % (31. Dezember 2022: 85,83 %)</b> |                              |                  |                              |
| <b>US-Dollar</b>                                    |                              |                  |                              |
| 5.212   | AbbVie Inc                   | 702.213          | 1,84                         |
| 6.335   | Activision Blizzard Inc      | 534.040          | 1,40                         |
| 1.734   | Adobe Inc                    | 847.909          | 2,22                         |
| 14.378  | Alphabet Inc Class A         | 1.721.047        | 4,50                         |
| 17.023  | Amazon.com Inc               | 2.219.118        | 5,80                         |
| 4.269   | Analog Devices Inc           | 831.644          | 2,17                         |
| 11.041  | Apple Inc                    | 2.141.623        | 5,60                         |
| 1.752   | Atlassian Corp Class A       | 294.003          | 0,77                         |
| 2.256   | Avery Dennison Corp          | 387.581          | 1,01                         |
| 9.958   | Boston Scientific Corp       | 538.628          | 1,41                         |
| 3.597   | CDW Corp                     | 660.049          | 1,73                         |
| 6.255   | Chewy Inc Class A            | 246.885          | 0,65                         |
| 4.104   | CME Group Inc Class A        | 760.430          | 1,99                         |
| 1.176   | Costco Wholesale Corp        | 633.135          | 1,66                         |
| 5.156   | Dollar Tree Inc              | 739.886          | 1,93                         |
| 3.426   | Equifax Inc                  | 806.138          | 2,11                         |
| 811   | Home Depot Inc               | 251.929          | 0,66                         |
| 1.581   | Intuit Inc                   | 724.398          | 1,89                         |
| 4.435   | Johnson & Johnson            | 734.081          | 1,92                         |
| 20.160  | Keurig Dr Pepper Inc         | 630.403          | 1,65                         |
| 2.458   | Mastercard Inc Class A       | 966.731          | 2,53                         |
| 17.089  | Match Group Inc              | 715.175          | 1,87                         |
| 2.941   | McDonald's Corp              | 877.624          | 2,30                         |
| 5.570   | Meta Platforms Inc Class A   | 1.598.479        | 4,18                         |
| 11.360  | Microsoft Corp               | 3.868.534        | 10,12                        |
| 1.342   | Netflix Inc                  | 591.138          | 1,55                         |
| 10.777  | NextEra Energy Inc           | 799.653          | 2,09                         |
| 3.966   | NIKE Inc Class B             | 437.727          | 1,14                         |
| 4.182   | NVIDIA Corp                  | 1.769.070        | 4,63                         |
| 6.638   | Okta Inc Class A             | 460.345          | 1,20                         |
| 17.804  | Paycor HCM Inc               | 421.421          | 1,10                         |
| 4.453   | Progressive Corp             | 589.444          | 1,54                         |
| 2.261   | S&P Global Inc               | 906.412          | 2,37                         |
| 5.686   | Salesforce Inc               | 1.201.224        | 3,14                         |
| 1.848   | ServiceNow Inc               | 1.038.521        | 2,72                         |
| 15.437  | Sweetgreen Inc Class A       | 197.902          | 0,52                         |
| 4.416   | TE Connectivity Ltd          | 618.947          | 1,62                         |
| 1.357   | Thermo Fisher Scientific Inc | 708.015          | 1,85                         |
| 10.203  | TJX Cos Inc                  | 865.112          | 2,26                         |
| 2.664   | Union Pacific Corp           | 545.108          | 1,43                         |

## US Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile   | Wertpapierbezeichnung  | Zeitwert US\$     | % des Nettovermögens |
|--|------------------------|-------------------|----------------------|
| <b>Aktien 104,27% (31. Dezember 2022: 85,83 %) (Fortsetzung)</b> |                        |                   |                      |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>                                   |                        |                   |                      |
| 2.874  | UnitedHealth Group Inc | 1.381.359         | 3,61                 |
| 4.402  | Visa Inc Class A       | 1.045.387         | 2,73                 |
| 2.437  | Walmart Inc            | 383.048           | 1,00                 |
| 3.697  | Waste Management Inc   | 641.134           | 1,68                 |
| 3.698  | Workday Inc Class A    | 835.341           | 2,18                 |
| <b>Aktien insgesamt *</b>  |                        | <b>39.867.991</b> | <b>104,27</b>        |
| <b>Anlagen insgesamt</b>   |                        | <b>39.867.991</b> | <b>104,27</b>        |

Devisenterminkontrakte 0,38 % (31. Dezember 2022: 6,86 %)

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei          | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|----------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen JPY</i>   |                     |                  |                      |           |                                |                      |
| 370.828 US\$  | 53.186.081 ¥        | 20.07.2023       | Citibank NA          | 2         | 1.961                          | 0,00                 |
| 403.884 US\$  | 55.116.147 ¥        | 20.07.2023       | Royal Bank of Canada | 3         | 21.632                         | 0,06                 |
| 780.201 US\$  | 106.900.363 ¥       | 20.07.2023       | UBS AG               | 3         | 38.805                         | 0,10                 |
| 1.239.060 US\$  | 166.718.763 ¥       | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp | 5         | 82.800                         | 0,22                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                      |           | <b>145.198</b>                 | <b>0,38</b>          |

|  |  |  |  |  | Zeitwert US\$     | % des Nettovermögens |
|--|--|--|--|--|-------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> |  |  |  |  | <b>40.013.189</b> | <b>104,65</b>        |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (7,07 %) (31. Dezember 2022: (1,74 %))

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei          | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|----------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen JPY</i>  |                     |                  |                      |           |                                 |                      |
| 49.498.169 ¥   | 350.300 US\$        | 20.07.2023       | Citibank NA          | 2         | (7.011)                         | (0,02)               |
| 3.226.435.558 ¥  | 24.946.869 US\$     | 20.07.2023       | Royal Bank of Canada | 6         | (2.570.267)                     | (6,72)               |
| 125.813.844 ¥  | 918.373 US\$        | 20.07.2023       | UBS AG               | 3         | (45.804)                        | (0,12)               |
| 216.220.851 ¥  | 1.578.630 US\$      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp | 5         | (79.054)                        | (0,21)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                      |           | <b>(2.702.136)</b>              | <b>(7,07)</b>        |

## US Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

|   | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------|------------------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(2.702.136)</b> | <b>(7,07)</b>                |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>37.311.053</b>  | <b>97,58</b>                 |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>924.255</b>     | <b>2,42</b>                  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>38.235.308</b>  | <b>100,00</b>                |

| <b>Portfolioanalyse</b>   | US\$              | % des<br>Gesamtver-<br>mögens |
|---|-------------------|-------------------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 39.867.991        | 97,30                         |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente   | (2.556.938)       | (6,24)                        |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>37.311.053</b> | <b>91,06</b>                  |



## US Equity Index PutWrite - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung            | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|----------------------------------|--------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 92,34 % (31. Dezember 2022: 92,92 %)</b> |                                  |        |                       |                    |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |                                  |        |                       |                    |                              |
| 81.800.000   | United States Treasury Note/Bond | 0,13 % | 15.09.2023            | 80.966.309         | 11,91                        |
| 77.900.000   | United States Treasury Note/Bond | 0,13 % | 15.12.2023            | 76.130.668         | 11,19                        |
| 86.400.000   | United States Treasury Note/Bond | 0,25 % | 15.03.2024            | 83.351.844         | 12,26                        |
| 90.000.000   | United States Treasury Note/Bond | 0,25 % | 15.06.2024            | 85.697.322         | 12,60                        |
| 90.000.000   | United States Treasury Note/Bond | 0,38 % | 15.09.2024            | 84.847.852         | 12,48                        |
| 87.100.000   | United States Treasury Note/Bond | 1,00 % | 15.12.2024            | 81.989.679         | 12,06                        |
| 75.600.000   | United States Treasury Note/Bond | 1,75 % | 15.03.2025            | 71.527.641         | 10,52                        |
| 65.900.000   | United States Treasury Note/Bond | 2,88 % | 15.06.2025            | 63.405.582         | 9,32                         |
| <b>Staatsanleihen insgesamt *</b>                          |                                  |        |                       | <b>627.916.897</b> | <b>92,34</b>                 |
| <b>Anlagen insgesamt</b>                                   |                                  |        |                       | <b>627.916.897</b> | <b>92,34</b>                 |

## Devisenterminkontrakte 0,80 % (31. Dezember 2022: 2,44 %)

| Geforderter<br>Betrag  | Zu zahlender<br>Betrag | Fälligkeits-<br>datum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens          |
|--|------------------------|-----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------------|---------------------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>  |                        |                       |                             |           |                                      |                                       |
| 138.734 €  | 149.200 US\$           | 20.07.2023            | Goldman Sachs International | 3         | 2.277                                | 0,00                                  |
| 73.054 €   | 79.077 US\$            | 20.07.2023            | Westpac Banking Corp        | 6         | 688                                  | 0,00                                  |
| 142.684 US\$   | 129.282 €              | 20.07.2023            | Goldman Sachs International | 3         | 1.527                                | 0,00                                  |
| 57.114 US\$  | 51.662 €               | 20.07.2023            | Westpac Banking Corp        | 10        | 708                                  | 0,00                                  |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>  |                        |                       |                             |           |                                      |                                       |
| 5.128.840 £  | 6.410.154 US\$         | 20.07.2023            | Goldman Sachs International | 2         | 111.105                              | 0,02                                  |
| 225.170.653 £  | 280.991.432 US\$       | 20.07.2023            | Westpac Banking Corp        | 74        | 5.310.387                            | 0,78                                  |
| 1.699.162 US\$   | 1.332.805 £            | 20.07.2023            | Westpac Banking Corp        | 7         | 4.517                                | 0,00                                  |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>  |                        |                       |                             |           |                                      |                                       |
| 2.000 SGD  | 1.478 US\$             | 20.07.2023            | Westpac Banking Corp        | 1         | 0                                    | 0,00                                  |
| 2.245 US\$   | 2.981 SGD              | 20.07.2023            | Goldman Sachs International | 2         | 41                                   | 0,00                                  |
| 1.355 US\$   | 1.833 SGD              | 20.07.2023            | Westpac Banking Corp        | 1         | 0                                    | 0,00                                  |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>o</sup></b>                        |                        |                       |                             |           | <b>5.431.250</b>                     | <b>0,80</b>                           |
|  |                        |                       |                             |           | <b>Zeitwert<br/>US\$</b>             | <b>% des<br/>Netto-<br/>vermögens</b> |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> |                        |                       |                             |           | <b>633.348.147</b>                   | <b>93,14</b>                          |

## US Equity Index PutWrite - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

## Devisenterminkontrakte (0,04 %) (31. Dezember 2022: (0,20 %))

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>   |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 79.687 €  | 87.586 US\$         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 2         | (579)                           | (0,00)               |
| 6.652.496 €   | 7.306.865 US\$      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 8         | (43.346)                        | (0,01)               |
| 57.332 US\$   | 53.325 €            | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 2         | (891)                           | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>   |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 1.287.562 €   | 1.650.099 US\$      | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (12.979)                        | (0,00)               |
| 367.452 €   | 469.368 US\$        | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 6         | (2.157)                         | (0,00)               |
| 1.725.815 US\$  | 1.381.548 €         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (30.807)                        | (0,01)               |
| 8.729.747 US\$  | 6.986.981 €         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 36        | (154.117)                       | (0,02)               |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>   |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 220.750 SGD   | 166.836 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 8         | (3.629)                         | (0,00)               |
| 13.179 SGD  | 9.911 US\$          | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 9         | (167)                           | (0,00)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>oo</sup></b> |                     |                  |                             |           | <b>(248.672)</b>                | <b>(0,04)</b>        |

## Verkaufte Optionskontrakte (0,46 %) (31. Dezember 2022: (1,90 %))

| Anzahl Kontrakte  | Fälligkeit | Art                                      | Zeitwert US\$      | % des Nettovermögens |
|---|------------|--|--------------------|----------------------|
| <b>Verkaufsoptionen</b>   |            |  |                    |                      |
| (4)   | 07.07.2023 | CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,300 | (380)              | (0,00)               |
| (187)   | 07.07.2023 | CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,320 | (21.505)           | (0,00)               |
| (8)   | 14.07.2023 | CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,320 | (4.280)            | (0,00)               |
| (97)  | 14.07.2023 | CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,330 | (57.715)           | (0,01)               |
| (61)  | 28.07.2023 | CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,355 | (130.540)          | (0,02)               |
| (2)   | 28.07.2023 | CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,375 | (5.000)            | (0,00)               |
| (51)  | 14.07.2023 | CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,380 | (57.630)           | (0,01)               |
| (82)  | 28.07.2023 | CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,385 | (236.160)          | (0,04)               |
| (36)  | 14.07.2023 | CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,390 | (46.620)           | (0,01)               |
| (101)   | 28.07.2023 | CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,390 | (284.315)          | (0,04)               |
| (13)  | 07.07.2023 | CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,400 | (10.075)           | (0,00)               |
| (39)  | 28.07.2023 | CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,400 | (126.165)          | (0,02)               |
| (101)   | 14.07.2023 | CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,430 | (234.825)          | (0,04)               |
| (86)  | 14.07.2023 | CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,435 | (213.710)          | (0,03)               |
| (184)   | 07.07.2023 | CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,465 | (548.320)          | (0,08)               |
| (9)   | 14.07.2023 | CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,465 | (30.501)           | (0,00)               |
| (91)  | 28.07.2023 | CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,465 | (458.913)          | (0,07)               |
| (304)   | 21.07.2023 | S&P 500 Index, Strike Price \$4,375      | (487.920)          | (0,07)               |
| (24)  | 21.07.2023 | S&P 500 Index, Strike Price \$4,380      | (41.040)           | (0,01)               |
| (41)  | 21.07.2023 | S&P 500 Index, Strike Price \$4,385      | (74.415)           | (0,01)               |
| (12)  | 21.07.2023 | S&P 500 Index, Strike Price \$4,410      | (28.260)           | (0,00)               |
| (9)   | 21.07.2023 | S&P 500 Index, Strike Price \$4,435      | (27.945)           | (0,00)               |
| <b>Beizulegender Zeitwert aus verkauften Optionskontrakten insgesamt * (Prämie: 7.731.416 US\$)</b> |            |  | <b>(3.126.234)</b> | <b>(0,46)</b>        |

## US Equity Index PutWrite - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

|   | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------|------------------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(3.374.906)</b> | <b>(0,50)</b>                |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>629.973.241</b> | <b>92,64</b>                 |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>50.021.636</b>  | <b>7,36</b>                  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>679.994.877</b> | <b>100,00</b>                |

| Portfolioanalyse  | US\$               | % des<br>Gesamtver-<br>mögens |
|---|--------------------|-------------------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 627.916.897        | 91,71                         |
| ± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden                          | (3.126.234)        | (0,46)                        |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente   | 5.182.578          | 0,76                          |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>629.973.241</b> | <b>92,01</b>                  |

## US Large Cap Value - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der<br>Anteile                              | Wertpapierbezeichnung            | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|----------------------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Aktien 95,19 % (31. Dezember 2022: 95,51 %)</b> |                                  |                  |                              |
| <b>US-Dollar</b>                                   |                                  |                  |                              |
| 192.374  | 3M Co                            | 19.254.714       | 1,03                         |
| 72.997   | Activision Blizzard Inc          | 6.153.647        | 0,33                         |
| 87.362   | Advanced Micro Devices Inc       | 9.951.405        | 0,53                         |
| 60.724   | Air Products & Chemicals Inc     | 18.188.660       | 0,97                         |
| 451.303  | American Electric Power Co Inc   | 37.999.713       | 2,04                         |
| 45.873   | Amgen Inc                        | 10.184.723       | 0,55                         |
| 40.654   | Analog Devices Inc               | 7.919.806        | 0,42                         |
| 43.816   | Aon Plc Class A                  | 15.125.283       | 0,81                         |
| 26.386   | Applied Materials Inc            | 3.813.832        | 0,20                         |
| 141.404  | Bank of America Corp             | 4.056.881        | 0,22                         |
| 102.493  | Becton Dickinson & Co            | 27.059.177       | 1,45                         |
| 216.104  | Berkshire Hathaway Inc Class B   | 73.691.464       | 3,95                         |
| 34.551   | Biogen Inc                       | 9.841.852        | 0,53                         |
| 23.636   | Boeing Co                        | 4.990.978        | 0,27                         |
| 634.585  | Boston Scientific Corp           | 34.324.703       | 1,84                         |
| 463.205  | Bristol-Myers Squibb Co          | 29.621.960       | 1,59                         |
| 32.314   | Caterpillar Inc                  | 7.950.860        | 0,43                         |
| 313.266  | Chevron Corp                     | 49.292.405       | 2,64                         |
| 403.227  | Citigroup Inc                    | 18.564.571       | 0,99                         |
| 92.327   | CME Group Inc Class A            | 17.107.270       | 0,92                         |
| 512.874  | Comcast Corp Class A             | 21.309.915       | 1,14                         |
| 108.815  | Constellation Brands Inc Class A | 26.782.636       | 1,43                         |
| 404.683  | DTE Energy Co                    | 44.523.224       | 2,39                         |
| 552.108  | Duke Energy Corp                 | 49.546.172       | 2,65                         |
| 19.030   | Eaton Corp Plc                   | 3.826.933        | 0,21                         |
| 102.832  | Emerson Electric Co              | 9.294.984        | 0,50                         |
| 41.561   | Estee Lauder Cos Inc Class A     | 8.161.749        | 0,44                         |
| 1.004.671  | Exelon Corp                      | 40.930.297       | 2,19                         |
| 584.840  | Exxon Mobil Corp                 | 62.724.090       | 3,36                         |
| 69.823   | Fiserv Inc                       | 8.808.171        | 0,47                         |
| 145.939  | Franco-Nevada Corp               | 20.810.901       | 1,12                         |
| 291.127  | Freeport-McMoRan Inc             | 11.645.080       | 0,62                         |
| 107.816  | General Electric Co              | 11.843.588       | 0,63                         |
| 291.784  | Gilead Sciences Inc              | 22.487.793       | 1,20                         |
| 28.771   | Illinois Tool Works Inc          | 7.197.353        | 0,39                         |
| 519.778  | Johnson & Johnson                | 86.033.655       | 4,61                         |
| 442.653  | JPMorgan Chase & Co              | 64.379.452       | 3,45                         |
| 225.701  | Kenvue Inc                       | 5.963.020        | 0,32                         |

## US Large Cap Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile  | Wertpapierbezeichnung              | Zeitwert US\$        | % des Nettovermögens |
|---|------------------------------------|----------------------|----------------------|
| <b>Aktien 95,19% (31. Dezember 2022: 95,51 %) (Fortsetzung)</b> |                                    |                      |                      |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>                                  |                                    |                      |                      |
| 683.086   | Keurig Dr Pepper Inc               | 21.360.099           | 1,14                 |
| 571.915   | Kroger Co                          | 26.880.005           | 1,44                 |
| 57.522  | Lockheed Martin Corp               | 26.481.978           | 1,42                 |
| 97.691  | McDonald's Corp                    | 29.151.971           | 1,56                 |
| 352.875   | Medtronic Plc                      | 31.088.287           | 1,67                 |
| 578.045   | Merck & Co Inc                     | 66.700.613           | 3,57                 |
| 637.679   | Mondelez International Inc Class A | 46.512.306           | 2,49                 |
| 306.848   | Mosaic Co                          | 10.739.680           | 0,58                 |
| 1.000.030   | Newmont Corp                       | 42.661.280           | 2,29                 |
| 507.545   | NextEra Energy Inc                 | 37.659.839           | 2,02                 |
| 139.331   | Oracle Corp                        | 16.592.929           | 0,89                 |
| 208.411   | PepsiCo Inc                        | 38.601.885           | 2,07                 |
| 1.066.572   | Pfizer Inc                         | 39.121.861           | 2,10                 |
| 322.946   | Philip Morris International Inc    | 31.525.988           | 1,69                 |
| 104.449   | Phillips 66                        | 9.962.346            | 0,53                 |
| 277.236   | PNC Financial Services Group Inc   | 34.917.874           | 1,87                 |
| 540.317   | Procter & Gamble Co                | 81.987.702           | 4,39                 |
| 191.161   | Raytheon Technologies Corp         | 18.726.132           | 1,00                 |
| 28.482  | Regeneron Pharmaceuticals Inc      | 20.465.456           | 1,10                 |
| 487.786   | Rio Tinto Plc ADR                  | 31.140.258           | 1,67                 |
| 306.595   | Sempra Energy                      | 44.637.166           | 2,39                 |
| 26.254  | Thermo Fisher Scientific           | 13.698.024           | 0,73                 |
| 64.373  | T-Mobile US Inc                    | 8.941.410            | 0,48                 |
| 68.144  | Truist Financial Corp              | 2.068.170            | 0,11                 |
| 760.909   | Verizon Communications Inc         | 28.298.206           | 1,52                 |
| 322.359   | Walmart Inc                        | 50.668.388           | 2,71                 |
| 487.900   | Wheaton Precious Metals Corp       | 21.087.038           | 1,13                 |
| 230.826   | Zimmer Biomet Holdings Inc         | 33.608.266           | 1,80                 |
|   | <b>Aktien insgesamt *</b>          | <b>1.776.648.074</b> | <b>95,19</b>         |
|   | <b>Anlagen insgesamt</b>           | <b>1.776.648.074</b> | <b>95,19</b>         |

Devisenterminkontrakte 0,00 % (31. Dezember 2022: 0,06 %)

| Geforderter Betrag              | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei             | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|-------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> |                     |                  |                         |           |                                |                      |
| 313.715 €                       | 337.626 US\$        | 20.07.2023       | JPMorgan Chase Bank     | 2         | 4.904                          | 0,00                 |
| 374.402 €                       | 402.101 US\$        | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank | 1         | 6.689                          | 0,00                 |
| 3.384.771 €                     | 3.672.874 US\$      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp    | 24        | 22.782                         | 0,00                 |

## US Large Cap Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 0,00 % (31. Dezember 2022: 0,06 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei             | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens        |
|--|---------------------|------------------|-------------------------|-----------|--------------------------------|-----------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR (Fortsetzung)</i>  |                     |                  |                         |           |                                |                             |
| 255.916 US\$   | 234.381 €           | 20.07.2023       | Citibank NA             | 1         | 7                              | 0,00                        |
| 961.854 US\$   | 868.676 €           | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank | 4         | 13.390                         | 0,00                        |
| 2.172.849 US\$   | 1.965.588 €         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp    | 44        | 26.724                         | 0,00                        |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>  |                     |                  |                         |           |                                |                             |
| 61.303 £   | 76.381 US\$         | 20.07.2023       | JPMorgan Chase Bank     | 2         | 1.566                          | 0,00                        |
| 6.775 £  | 8.472 US\$          | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank | 5         | 142                            | 0,00                        |
| 145.520 £  | 181.879 US\$        | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp    | 15        | 3.146                          | 0,00                        |
| 2.309 US\$   | 1.811 £             | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank | 1         | 6                              | 0,00                        |
| 2.694 US\$   | 2.118 £             | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp    | 2         | 1                              | 0,00                        |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>                        |                     |                  |                         |           | <b>79.357</b>                  | <b>0,00</b>                 |
|  |                     |                  |                         |           | <b>Zeitwert US\$</b>           | <b>% des Nettovermögens</b> |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> |                     |                  |                         |           | <b>1.776.727.431</b>           | <b>95,19</b>                |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,01 %) (31. Dezember 2022: (0,01 %))

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei             | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens        |
|---|---------------------|------------------|-------------------------|-----------|---------------------------------|-----------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>   |                     |                  |                         |           |                                 |                             |
| 12.973.661 €  | 14.222.727 US\$     | 20.07.2023       | JPMorgan Chase Bank     | 2         | (57.455)                        | (0,00)                      |
| 536.281 €   | 591.012 US\$        | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank | 2         | (5.474)                         | (0,00)                      |
| 13.435.569 €  | 14.778.182 US\$     | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp    | 20        | (108.578)                       | (0,01)                      |
| 559.379 US\$  | 514.010 €           | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank | 2         | (1.842)                         | (0,00)                      |
| 2.788.007 US\$  | 2.580.675 €         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp    | 31        | (29.699)                        | (0,00)                      |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>   |                     |                  |                         |           |                                 |                             |
| 2.497 £   | 3.200 US\$          | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank | 1         | (25)                            | (0,00)                      |
| 30.815 £  | 39.425 US\$         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp    | 3         | (244)                           | (0,00)                      |
| 9.249 US\$  | 7.397 £             | 20.07.2023       | Standard Chartered Bank | 5         | (157)                           | (0,00)                      |
| 8.626 US\$  | 6.958 £             | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp    | 7         | (221)                           | (0,00)                      |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>                          |                     |                  |                         |           | <b>(203.695)</b>                | <b>(0,01)</b>               |
|   |                     |                  |                         |           | <b>Zeitwert US\$</b>            | <b>% des Nettovermögens</b> |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> |                     |                  |                         |           | <b>(203.695)</b>                | <b>(0,01)</b>               |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              |                     |                  |                         |           | <b>1.776.523.736</b>            | <b>95,18</b>                |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  |                     |                  |                         |           | <b>89.915.177</b>               | <b>4,82</b>                 |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   |                     |                  |                         |           | <b>1.866.438.913</b>            | <b>100,00</b>               |

## US Large Cap Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

| Portfolioanalyse  | US\$                 | % des<br>Gesamtver-<br>mögens |
|---|----------------------|-------------------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 1.776.648.074        | 94,53                         |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente   | (124.338)            | (0,01)                        |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>1.776.523.736</b> | <b>94,52</b>                  |

## US Long Short Equity – Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der<br>Anteile                              | Wertpapierbezeichnung            | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|----------------------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Aktien 79,41 % (31. Dezember 2022: 71,33 %)</b> |                                  |                  |                              |
| <b>Euro</b>  |                                  |                  |                              |
| 10.679   | Airbus SE                        | 1.542.098        | 0,70                         |
| <b>Euro insgesamt</b>                              |                                  | <b>1.542.098</b> | <b>0,70</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>                                   |                                  |                  |                              |
| 9.428  | AbbVie Inc                       | 1.270.234        | 0,57                         |
| 25.407   | Activision Blizzard Inc          | 2.141.810        | 0,96                         |
| 9.135  | Adobe Inc                        | 4.466.924        | 2,01                         |
| 45.851   | Alphabet Inc Class A             | 5.488.365        | 2,47                         |
| 41.468   | Amazon.com Inc                   | 5.405.768        | 2,43                         |
| 23.649   | Amphenol Corp Class A            | 2.008.983        | 0,90                         |
| 13.866   | Analog Devices Inc               | 2.701.235        | 1,21                         |
| 31.906   | Apple Inc                        | 6.188.807        | 2,78                         |
| 8.056  | Asbury Automotive Group Inc      | 1.936.824        | 0,87                         |
| 16.666   | Ashland Inc                      | 1.448.442        | 0,65                         |
| 1.993  | ASML Holding NV                  | 1.444.427        | 0,65                         |
| 3.716  | Atlassian Corp Class A           | 623.582          | 0,28                         |
| 10.853   | Avery Dennison Corp              | 1.864.545        | 0,84                         |
| 6.106  | Boeing Co                        | 1.289.343        | 0,58                         |
| 36.748   | Boston Scientific Corp           | 1.987.699        | 0,89                         |
| 67.301   | Brookfield Corp                  | 2.264.679        | 1,02                         |
| 11.010   | CDW Corp                         | 2.020.335        | 0,91                         |
| 83.063   | CenterPoint Energy Inc           | 2.421.286        | 1,09                         |
| 18.256   | Chevron Corp                     | 2.872.582        | 1,29                         |
| 29.152   | Chewy Inc Class A                | 1.150.629        | 0,52                         |
| 20.579   | CME Group Inc Class A            | 3.813.083        | 1,71                         |
| 3.738  | Costco Wholesale Corp            | 2.012.464        | 0,90                         |
| 20.784   | Dollar Tree Inc                  | 2.982.504        | 1,34                         |
| 68.691   | Enbridge Inc                     | 2.551.871        | 1,15                         |
| 12.091   | Equifax Inc                      | 2.845.012        | 1,28                         |
| 22.712   | European Wax Center Inc Class A  | 423.125          | 0,19                         |
| 28.650   | First Watch Restaurant Group Inc | 484.185          | 0,22                         |
| 7.783  | Fresh Market Escrow Inc          | 0                | 0,00                         |
| 7.732  | Freshpet Inc                     | 508.843          | 0,23                         |
| 4.692  | Home Depot Inc                   | 1.457.523        | 0,66                         |
| 3.188  | Humana Inc                       | 1.425.450        | 0,64                         |
| 1.978  | Intuit Inc                       | 906.300          | 0,41                         |
| 13.202   | Jacobs Solutions Inc             | 1.569.586        | 0,71                         |
| 13.429   | Johnson & Johnson                | 2.222.768        | 1,00                         |
| 24.726   | JPMorgan Chase & Co              | 3.596.149        | 1,62                         |
| 21.981   | Kenvue Inc                       | 580.738          | 0,26                         |



## US Long Short Equity – Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile  | Wertpapierbezeichnung              | Zeitwert US\$      | % des Nettovermögens |
|---|------------------------------------|--------------------|----------------------|
| <b>Aktien 79,41% (31. Dezember 2022: 71,33 %) (Fortsetzung)</b> |                                    |                    |                      |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>                                  |                                    |                    |                      |
| 115.194   | Keurig Dr Pepper Inc               | 3.602.116          | 1,62                 |
| 3.968   | Marriott International Inc Class A | 728.882            | 0,33                 |
| 7.702   | Mastercard Inc Class A             | 3.029.197          | 1,36                 |
| 59.218  | Match Group Inc                    | 2.478.273          | 1,11                 |
| 17.115  | McDonald's Corp                    | 5.107.287          | 2,30                 |
| 19.840  | Meta Platforms Inc Class A         | 5.693.683          | 2,56                 |
| 26.998  | Microsoft Corp                     | 9.193.899          | 4,13                 |
| 19.651  | Mondelez International Inc Class A | 1.433.344          | 0,64                 |
| 3.947   | Netflix Inc                        | 1.738.614          | 0,78                 |
| 64.830  | NextEra Energy Inc                 | 4.810.386          | 2,16                 |
| 12.927  | NIKE Inc Class B                   | 1.426.753          | 0,64                 |
| 39.036  | nVent Electric Plc                 | 2.016.990          | 0,91                 |
| 3.607   | NVIDIA Corp                        | 1.525.833          | 0,69                 |
| 14.866  | Okta Inc Class A                   | 1.030.957          | 0,46                 |
| 71.699  | Paycor HCM Inc                     | 1.697.115          | 0,76                 |
| 8.055   | Procter & Gamble Co                | 1.222.266          | 0,55                 |
| 23.354  | Progressive Corp                   | 3.091.369          | 1,39                 |
| 106.626   | Repay Holdings Corp Class A        | 834.882            | 0,38                 |
| 9.508   | S&P Global Inc                     | 3.811.662          | 1,71                 |
| 22.816  | Salesforce Inc                     | 4.820.108          | 2,17                 |
| 1.200   | Savers Value Village Inc           | 28.440             | 0,01                 |
| 4.890   | ServiceNow Inc                     | 2.748.033          | 1,24                 |
| 10.742  | Splunk Inc                         | 1.139.619          | 0,51                 |
| 77.807  | Sweetgreen Inc Class A             | 997.486            | 0,45                 |
| 15.016  | TE Connectivity Ltd                | 2.104.643          | 0,95                 |
| 3.726   | Thermo Fisher Scientific Inc       | 1.944.041          | 0,87                 |
| 61.626  | TJX Cos Inc                        | 5.225.269          | 2,35                 |
| 16.900  | TransUnion                         | 1.323.777          | 0,60                 |
| 22.691  | Uber Technologies Inc              | 979.570            | 0,44                 |
| 21.424  | Union Pacific Corp                 | 4.383.779          | 1,97                 |
| 8.917   | UnitedHealth Group Inc             | 4.285.867          | 1,93                 |
| 13.441  | Visa Inc Class A                   | 3.191.969          | 1,43                 |
| 12.127  | Walmart Inc                        | 1.906.122          | 0,86                 |
| 13.986  | Waste Management Inc               | 2.425.452          | 1,09                 |
| 27.095  | WEC Energy Group Inc               | 2.390.863          | 1,07                 |
| 10.324  | Workday Inc Class A                | 2.332.088          | 1,05                 |
|   | <b>US-Dollar insgesamt</b>         | <b>175.076.734</b> | <b>78,71</b>         |
|   | <b>Aktien insgesamt *</b>          | <b>176.618.832</b> | <b>79,41</b>         |

## US Long Short Equity – Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile   | Wertpapierbezeichnung                             |         |                  | Zeitwert US\$      | % des Nettovermögens |
|--|---|---------|------------------|--------------------|----------------------|
| <b>Immobilienaktiengesellschaften 1,06 % (31. Dezember 2022: 0,79 %)</b> |   |         |                  |                    |                      |
| <b>US-Dollar</b>   |   |         |                  |                    |                      |
| 1.154  | Equinix Inc                                       |         |                  | 904.667            | 0,41                 |
| 6.225  | SBA Communications Corp Class A                   |         |                  | 1.442.706          | 0,65                 |
|  | <b>Immobilienaktiengesellschaften insgesamt *</b> |         |                  | <b>2.347.373</b>   | <b>1,06</b>          |
| Kapitalbetrag  | Wertpapierbezeichnung                             | Kupon   | Fälligkeitsdatum | Zeitwert US\$      | % des Nettovermögens |
| <b>Unternehmensanleihen 4,75 % (31. Dezember 2022: 3,79 %)</b>           |   |         |                  |                    |                      |
| <b>US-Dollar</b>   |   |         |                  |                    |                      |
| 939.000  | Activision Blizzard Inc**                         | 2,50 %  | 15.09.2050       | 604.651            | 0,27                 |
| 749.000  | Alphabet Inc**                                    | 2,25 %  | 15.08.2060       | 456.213            | 0,20                 |
| 905.000  | Amazon.com Inc**                                  | 3,25 %  | 12.05.2061       | 655.894            | 0,29                 |
| 1.042.971  | Anagram International Inc/Anagram Holdings LLC**  | 10,00 % | 15.08.2026       | 818.732            | 0,37                 |
| 402.606  | Anagram International Inc/Anagram Holdings LLC†   | 15,00 % | 15.08.2025       | 389.702            | 0,18                 |
| 883.014  | Anagram International Inc/Anagram Holdings LLC**  | 15,00 % | 15.08.2025       | 854.713            | 0,38                 |
| 974.000  | Apple Inc**                                       | 2,85 %  | 05.08.2061       | 663.794            | 0,30                 |
| 250.000  | CDW LLC/CDW Finance Corp**                        | 2,67 %  | 01.12.2026       | 224.755            | 0,10                 |
| 550.000  | Florida Power & Light Co*                         | 2,88 %  | 04.12.2051       | 380.910            | 0,17                 |
| 943.000  | Johnson & Johnson*                                | 2,45 %  | 01.09.2060       | 610.672            | 0,27                 |
| 138.000  | Mastercard Inc*                                   | 2,95 %  | 15.03.2051       | 100.826            | 0,05                 |
| 954.000  | Meta Platforms Inc**                              | 4,65 %  | 15.08.2062       | 838.730            | 0,38                 |
| 253.000  | Meta Platforms Inc**                              | 5,60 %  | 15.05.2053       | 260.023            | 0,12                 |
| 18.000   | Meta Platforms Inc**                              | 5,75 %  | 15.05.2063       | 18.643             | 0,01                 |
| 780.000  | Microsoft Corp**                                  | 2,68 %  | 01.06.2060       | 523.785            | 0,24                 |
| 125.000  | nVent Finance Sarl**                              | 4,55 %  | 15.04.2028       | 117.035            | 0,05                 |
| 670.000  | Oracle Corp*                                      | 3,85 %  | 01.04.2060       | 472.640            | 0,21                 |
| 200.000  | Oracle Corp*                                      | 6,90 %  | 09.11.2052       | 224.678            | 0,10                 |
| 545.000  | PepsiCo Inc**                                     | 2,75 %  | 21.10.2051       | 391.606            | 0,18                 |
| 125.000  | SBA Communications Corp**                         | 3,88 %  | 15.02.2027       | 115.263            | 0,05                 |
| 410.000  | Uber Technologies Inc**                           | 8,00 %  | 01.11.2026       | 418.318            | 0,19                 |
| 564.000  | UnitedHealth Group Inc*                           | 3,13 %  | 15.05.2060       | 394.142            | 0,18                 |
| 185.000  | UnitedHealth Group Inc*                           | 5,05 %  | 15.04.2053       | 184.021            | 0,08                 |
| 943.000  | Walmart Inc*                                      | 2,65 %  | 22.09.2051       | 670.599            | 0,30                 |
| 190.000  | Walmart Inc*                                      | 4,50 %  | 15.04.2053       | 185.452            | 0,08                 |
|  | <b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>             |         |                  | <b>10.575.797</b>  | <b>4,75</b>          |
|  | <b>Anlagen insgesamt</b>                          |         |                  | <b>189.542.002</b> | <b>85,22</b>         |

## US Long Short Equity – Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 0,05 % (31. Dezember 2022: 3,02 %)

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>   |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 896.094 €   | 964.404 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 2         | 13.995                         | 0,01                 |
| 1.362.197 €   | 1.476.213 US\$      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 20        | 11.100                         | 0,01                 |
| 573.365 US\$  | 517.182 €           | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | 8.680                          | 0,00                 |
| 6.981.313 US\$  | 6.350.086 €         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 39        | 47.977                         | 0,02                 |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>   |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 8.333 £   | 10.432 US\$         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | 164                            | 0,00                 |
| 3.436 £   | 4.308 US\$          | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | 61                             | 0,00                 |
| 861.213 £   | 1.075.653 US\$      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 12        | 19.369                         | 0,01                 |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>   |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 49.783 US\$   | 65.848 SGD          | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 2         | 1.100                          | 0,00                 |
| 48.286 US\$   | 63.938 SGD          | 20.07.2023       | UBS AG                      | 2         | 1.015                          | 0,00                 |
| 57.444 US\$   | 77.155 SGD          | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 8         | 398                            | 0,00                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                             |           | <b>103.859</b>                 | <b>0,05</b>          |

### Gekaufte Optionskontrakte 0,00 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)

| Anzahl Kontrakte   | Fälligkeit | Art                                   | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|--|------------|---------------------------------------|---------------|----------------------|
| <b>Kaufoptionen</b>  |            |                                       |               |                      |
| 95   | 21.07.2023 | Match Group Inc, Strike Price \$42.50 | 11.733        | 0,00                 |
| <b>Beizulegender Zeitwert aus gekauften Optionskontrakten insgesamt <sup>*</sup> (Prämie: (14.775) US\$)</b> |            |                                       | <b>11.733</b> | <b>0,00</b>          |

### Differenzkontrakte 0,30 % (31. Dezember 2022: 1,43 %)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung  | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---------|------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 124.888 | 3M Co                  | Goldman Sachs International | 3.785                          | 0,00                 |
| 32.676  | Bill Holdings Inc      | JPMorgan Chase Bank         | 122                            | 0,00                 |
| 771.297 | Burlington Stores Inc  | Goldman Sachs International | 39.392                         | 0,02                 |
| 447.599 | Campbell Soup Co       | Goldman Sachs International | 72.840                         | 0,03                 |
| 104.013 | Cava Group Inc         | Goldman Sachs International | 542                            | 0,00                 |
| 296.949 | Conagra Brands Inc     | JPMorgan Chase Bank         | 6.689                          | 0,00                 |
| 226.233 | Conagra Brands Inc     | Goldman Sachs International | 7.107                          | 0,00                 |
| 73.216  | Cricut Inc Class A     | JPMorgan Chase Bank         | 14.976                         | 0,01                 |
| 299.303 | DocuSign Inc           | JPMorgan Chase Bank         | 13.389                         | 0,01                 |
| 12.854  | Dutch Bros Inc Class A | JPMorgan Chase Bank         | 7                              | 0,00                 |
| 445.455 | Etsy Inc               | Goldman Sachs International | 49.060                         | 0,02                 |
| 65.607  | Etsy Inc               | JPMorgan Chase Bank         | 224                            | 0,00                 |
| 14.215  | Fubotv Inc             | JPMorgan Chase Bank         | 1.422                          | 0,00                 |
| 107.203 | Fubotv Inc             | Goldman Sachs International | 25.469                         | 0,01                 |

## US Long Short Equity – Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 0,30 % (31. Dezember 2022: 1,43 %) (Fortsetzung)

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung                | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|--------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 96.862  | G-iii Apparel Group Ltd              | JPMorgan Chase Bank         | 3.228                          | 0,00                 |
| 87.147  | Hawaiian Electric Industries Inc     | JPMorgan Chase Bank         | 3.653                          | 0,00                 |
| 78.294  | iHeartMedia Inc Class A              | Goldman Sachs International | 26.344                         | 0,01                 |
| 443.848   | International Business Machines Corp | Goldman Sachs International | 44.356                         | 0,02                 |
| 208.164   | Interpublic Group of Cos Inc         | JPMorgan Chase Bank         | 10.569                         | 0,01                 |
| 803.313   | Iron Mountain Inc                    | JPMorgan Chase Bank         | 4.863                          | 0,00                 |
| 532.813   | Lamar Advertising Co Class A         | Goldman Sachs International | 27.710                         | 0,01                 |
| 105.354   | Lemonade Inc                         | Goldman Sachs International | 760                            | 0,00                 |
| 45.217  | McCormick & Co Inc                   | JPMorgan Chase Bank         | 2.361                          | 0,00                 |
| 130.643   | Omnicom Group Inc                    | JPMorgan Chase Bank         | 621                            | 0,00                 |
| 314.745   | Outfront Media Inc                   | Goldman Sachs International | 20.448                         | 0,01                 |
| 122.097   | Packaging Corp of America            | Goldman Sachs International | 7.857                          | 0,01                 |
| 41.015  | Paycom Software Inc                  | JPMorgan Chase Bank         | 344                            | 0,00                 |
| 902.002   | Paylocity Holding Corp               | Goldman Sachs International | 126.037                        | 0,06                 |
| 219.668   | Renaissancere Holdings Ltd           | JPMorgan Chase Bank         | 2.609                          | 0,00                 |
| 105.239   | Sofi Technologies Inc                | JPMorgan Chase Bank         | 3.991                          | 0,00                 |
| 282.056   | Sonic Automotive Inc Class A         | Goldman Sachs International | 19.164                         | 0,01                 |
| 164.145   | Southern Co                          | JPMorgan Chase Bank         | 1.200                          | 0,00                 |
| 116.047   | Steelcase Inc Class A                | Goldman Sachs International | 43.250                         | 0,02                 |
| 903.690   | T Rowe Price Group Inc               | Goldman Sachs International | 69.264                         | 0,03                 |
| 542.642   | T Rowe Price Group Inc               | JPMorgan Chase Bank         | 12.744                         | 0,01                 |
| 354.045   | Trade Desk Inc Class A               | JPMorgan Chase Bank         | 232                            | 0,00                 |
| 6.561   | Udemy Inc                            | JPMorgan Chase Bank         | 3                              | 0,00                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Differenzkontrakten <sup>o</sup></b> |                                      |                             | <b>666.632</b>                 | <b>0,30</b>          |

|  | Zeitwert US\$      | % des Nettovermögens |
|--|--------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> | <b>190.324.226</b> | <b>85,57</b>         |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,26 %) (31. Dezember 2022: (0,37 %))

| Geforderter Betrag              | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 1.392.933 €                     | 1.529.431 US\$      | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 2         | (8.560)                         | (0,00)               |
| 40.117.574 €                    | 43.991.898 US\$     | 20.07.2023       | UBS AG                      | 2         | (189.585)                       | (0,09)               |
| 42.578.864 €                    | 46.823.849 US\$     | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 19        | (334.182)                       | (0,15)               |
| 589.591 US\$                    | 545.768 €           | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (6.305)                         | (0,00)               |
| 2.500.742 US\$                  | 2.318.883 €         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 34        | (31.127)                        | (0,02)               |

## US Long Short Equity – Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Devisenterminkontrakte (0,26 %) (31. Dezember 2022: (0,37 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>   |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 6.745 £   | 8.644 US\$          | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (68)                            | (0,00)               |
| 23.374 £  | 29.770 US\$         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 1         | (50)                            | (0,00)               |
| 8.456 US\$  | 6.729 £             | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (100)                           | (0,00)               |
| 91.975 US\$   | 73.680 £            | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 5         | (1.709)                         | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>   |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 218.968 SGD   | 165.653 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 2         | (3.763)                         | (0,00)               |
| 223.067 SGD   | 168.480 US\$        | 20.07.2023       | UBS AG                      | 4         | (3.558)                         | (0,00)               |
| 15.229 SGD  | 11.452 US\$         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 13        | (194)                           | (0,00)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>oo</sup></b> |                     |                  |                             |           | <b>(579.201)</b>                | <b>(0,26)</b>        |

## Futures-Kontrakte (0,41 %) (31. Dezember 2022: (0,00 %))

| Anzahl Kontrakte  | Beschreibung                            | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens    |
|---|---|---------------------------------|-------------------------|
| (30)  | Nasdaq 100 E-mini Future September 2023 | (352.321)                       | (0,16)                  |
| (78)  | S&P 500 E-mini Future September 2023    | (542.880)                       | (0,25)                  |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten <sup>*</sup></b> |   |                                 | <b>(895.201) (0,41)</b> |

## Verkaufte Optionskontrakte (0,02 %) (31. Dezember 2022: (0,03 %))

| Anzahl Kontrakte  | Fälligkeit | Art  | Zeitwert US\$   | % des Nettovermögens |
|---|------------|--|-----------------|----------------------|
| <b>Kaufoptionen</b>   |            |  |                 |                      |
| 45  | 21.07.2023 | Amazon.com Inc, Strike Price \$135.00              | (7.065)         | (0,00)               |
| 16  | 21.07.2023 | Asbury Automotive Group Inc, Strike Price \$240.00 | (12.640)        | (0,01)               |
| 34  | 21.07.2023 | TE Connectivity Ltd, Strike Price \$135.00         | (20.400)        | (0,01)               |
| <b>Verkaufsoptionen</b>   |            |  |                 |                      |
| (68)  | 18.08.2023 | Chewy Inc, Strike Price \$32.50                    | (2.482)         | (0,00)               |
| (37)  | 21.07.2023 | Freshpet Inc, Strike Price \$60.00                 | (2.313)         | (0,00)               |
| (95)  | 15.09.2023 | Match Group Inc, Strike Price \$35.00              | (8.787)         | (0,00)               |
| (110)   | 21.07.2023 | Sweetgreen Inc, Strike Price \$10.00               | (550)           | (0,00)               |
| <b>Beizulegender Zeitwert aus verkauften Optionskontrakten insgesamt <sup>*</sup> (Prämie: 57.455 US\$)</b> |            |  | <b>(54.237)</b> | <b>(0,02)</b>        |

## Differenzkontrakte (1,39 %) (31. Dezember 2022: (0,58 %))

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---------|-----------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 62.502  | Aaron's Co Inc        | Goldman Sachs International | (9.860)                         | (0,00)               |
| 108.088 | Affirm Holdings Inc   | Goldman Sachs International | (791)                           | (0,00)               |
| 311.371 | Agilon Health Inc     | Goldman Sachs International | (7.880)                         | (0,00)               |
| 231.319 | Align Technology Inc  | Goldman Sachs International | (37.746)                        | (0,02)               |

## US Long Short Equity – Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte (1,39 %) (31. Dezember 2022: (0,58 %)) (Fortsetzung)

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung                      | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|--|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 271.262   | Allegion Plc                               | JPMorgan Chase Bank         | (2.484)                         | (0,00)               |
| 652.151   | Best Buy Co Inc                            | Goldman Sachs International | (112.422)                       | (0,05)               |
| 338.121   | Best Buy Co Inc                            | JPMorgan Chase Bank         | (12.878)                        | (0,01)               |
| 336.959   | Bill.com Holdings Inc                      | Goldman Sachs International | (147.873)                       | (0,07)               |
| 87.276    | Carmax Inc                                 | JPMorgan Chase Bank         | (3.115)                         | (0,00)               |
| 351.908   | Centene Corp                               | Goldman Sachs International | (3.932)                         | (0,00)               |
| 487.089   | Church & Dwight Co Inc                     | Goldman Sachs International | (76.637)                        | (0,03)               |
| 244.163   | Coinbase Global Inc Class A                | Goldman Sachs International | (132.010)                       | (0,06)               |
| 89.607    | Cricut Inc Class A                         | Goldman Sachs International | (26.437)                        | (0,01)               |
| 494.429   | Darden Restaurants Inc                     | JPMorgan Chase Bank         | (656)                           | (0,00)               |
| 184.552   | Darden Restaurants Inc                     | Goldman Sachs International | (32.681)                        | (0,02)               |
| 517.579   | Davita Healthcare Partner Inc              | Goldman Sachs International | (158.916)                       | (0,07)               |
| 276.966   | Descartes Systems Group                    | Goldman Sachs International | (78.237)                        | (0,04)               |
| 355.114   | DocuSign Inc                               | Goldman Sachs International | (20.411)                        | (0,01)               |
| 63.272    | Dutch Bros Inc Class A                     | Goldman Sachs International | (2.690)                         | (0,00)               |
| 411.369   | Eaton Corp Plc                             | JPMorgan Chase Bank         | (8.841)                         | (0,00)               |
| 441.265   | Expeditors International of Washington Inc | JPMorgan Chase Bank         | (6.940)                         | (0,00)               |
| 121.638   | Figs Inc Class A                           | JPMorgan Chase Bank         | (600)                           | (0,00)               |
| 134.892   | Figs Inc Class A                           | Goldman Sachs International | (10.071)                        | (0,01)               |
| 403.302   | Floor & Decor Holdings Inc Class A         | JPMorgan Chase Bank         | (28.924)                        | (0,01)               |
| 358.621   | Floor & Decor Holdings Inc Class A         | Goldman Sachs International | (53.734)                        | (0,02)               |
| 248.519   | Ford Motor Co                              | Goldman Sachs International | (32.145)                        | (0,01)               |
| 256.841   | G-iii Apparel Group Ltd                    | Goldman Sachs International | (38.896)                        | (0,02)               |
| 153.682   | Grocery Outlet Holding Corp                | JPMorgan Chase Bank         | (5.176)                         | (0,00)               |
| 277.674   | Grocery Outlet Holding Corp                | Goldman Sachs International | (6.167)                         | (0,00)               |
| 419.066   | Hawaiian Electric Industries Inc           | Goldman Sachs International | (2.525)                         | (0,00)               |
| 570.922   | HubSpot Inc                                | JPMorgan Chase Bank         | (13.277)                        | (0,01)               |
| 338.845   | Illinois Tool Works Inc                    | Goldman Sachs International | (95.690)                        | (0,04)               |
| 484.718   | Illinois Tool Works Inc                    | JPMorgan Chase Bank         | (6.626)                         | (0,00)               |
| 319.452   | Ingersoll Rand Inc                         | Goldman Sachs International | (135.701)                       | (0,06)               |
| 937.400   | Interpublic Group of Cos Inc               | Goldman Sachs International | (31.187)                        | (0,01)               |
| 62.593    | Iron Mountain Inc                          | Goldman Sachs International | (18.122)                        | (0,01)               |
| 670.073   | Lamar Advertising Co Class A               | JPMorgan Chase Bank         | (25.045)                        | (0,01)               |
| 117.883   | Landstar System Inc                        | Goldman Sachs International | (38.030)                        | (0,02)               |
| 310.079   | McCormick & Co Inc                         | Goldman Sachs International | (24.498)                        | (0,01)               |
| 186.240   | Old Dominion Freight Line                  | Goldman Sachs International | (38.329)                        | (0,02)               |
| 934.882   | Omnicom Group Inc                          | Goldman Sachs International | (188.610)                       | (0,09)               |
| 91.038    | Opendoor Technologies Inc                  | Goldman Sachs International | (24.954)                        | (0,01)               |
| 618.834   | Palantir Technologies Inc Class A          | Goldman Sachs International | (624.107)                       | (0,28)               |
| 1.016.432 | Paycom Software Inc                        | Goldman Sachs International | (25.308)                        | (0,01)               |
| 339.379   | Ralph Lauren Corp                          | JPMorgan Chase Bank         | (4.651)                         | (0,00)               |

## US Long Short Equity – Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte (1,39 %) (31. Dezember 2022: (0,58 %)) (Fortsetzung)

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung        | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 154.241   | Ralph Lauren Corp            | Goldman Sachs International | (16.857)                        | (0,01)               |
| 370.964   | Redfin Corp                  | JPMorgan Chase Bank         | (57.389)                        | (0,03)               |
| 473.951   | ROBLOX Corp Class A          | Goldman Sachs International | (56.953)                        | (0,03)               |
| 646.928   | Ryan Specialty Holdings Inc  | JPMorgan Chase Bank         | (33.323)                        | (0,02)               |
| 278.782   | SAP SE                       | Goldman Sachs International | (189.898)                       | (0,09)               |
| 441.019   | Shutterstock Inc             | Goldman Sachs International | (11.417)                        | (0,01)               |
| 263.138   | Sonic Automotive Inc Class A | JPMorgan Chase Bank         | (10.815)                        | (0,01)               |
| 279.571   | Southern Co                  | Goldman Sachs International | (12.802)                        | (0,01)               |
| 262.861   | Sprouts Farmers Market Inc   | Goldman Sachs International | (10.259)                        | (0,01)               |
| 165.037   | Sprouts Farmers Market Inc   | JPMorgan Chase Bank         | (5.932)                         | (0,00)               |
| 30.306  | Steelcase Inc Class A        | JPMorgan Chase Bank         | (707)                           | (0,00)               |
| 335.448   | Tesla Inc                    | JPMorgan Chase Bank         | (7.725)                         | (0,00)               |
| 580.678   | Texas Instruments Inc        | JPMorgan Chase Bank         | (6.328)                         | (0,00)               |
| 205.697   | Timken Co                    | Goldman Sachs International | (47.787)                        | (0,02)               |
| 75.542  | Topbuild Corp                | JPMorgan Chase Bank         | (6.879)                         | (0,00)               |
| 149.462   | TopBuild Corp                | Goldman Sachs International | (42.943)                        | (0,02)               |
| 620.771   | Trade Desk Inc Class A       | Goldman Sachs International | (161.552)                       | (0,07)               |
| 96.396  | Udemy Inc                    | Goldman Sachs International | (23.021)                        | (0,01)               |
| 121.036   | Upbound Group Inc            | Goldman Sachs International | (3.793)                         | (0,00)               |
| 120.587   | Upstart Holdings Inc         | Goldman Sachs International | (9.359)                         | (0,00)               |
| 787.850   | Warner Bros Discovery Inc    | Goldman Sachs International | (25.027)                        | (0,01)               |
| <b>Gesamtverlust aus Differenzkontrakten <sup>∞</sup></b> |                              |                             | <b>(3.096.576)</b>              | <b>(1,39)</b>        |

## Total Return Swap-Kontrakte (1,69 %) (31. Dezember 2022: (0,32 %))

| Nominalwert     | Datum der Schließung | Variabler Zinssatz | Referenzunternehmen                                  | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------------|----------------------|--------------------|--|---------------------------------|----------------------|
| USD (111.720)   | 19.11.2024           | 4,32 <sup>1</sup>  | S&P Retail Select Industry Index <sup>2</sup>        | (2.812)                         | (0,00)               |
| EUR (384.065)   | 07.07.2023           | 3,00 <sup>3</sup>  | Goldman Sachs GSCBECS1 Index <sup>4</sup>            | (30.168)                        | (0,01)               |
| USD (335.047)   | 19.01.2024           | 4,68 <sup>5</sup>  | Goldman Sachs GSCBOEC1 Index <sup>4</sup>            | (42.417)                        | (0,02)               |
| USD (516.735)   | 23.11.2024           | 4,64 <sup>6</sup>  | Goldman Sachs GSNBLIPO Index <sup>4</sup>            | (48.322)                        | (0,02)               |
| EUR (672.634)   | 07.07.2023           | 3,00 <sup>3</sup>  | Goldman Sachs GSCBECS1 Index <sup>4</sup>            | (80.730)                        | (0,04)               |
| EUR (803.639)   | 07.07.2023           | 3,00 <sup>3</sup>  | Goldman Sachs GSCBECS1 Index <sup>4</sup>            | (105.898)                       | (0,05)               |
| EUR (386.926)   | 07.07.2023           | 3,00 <sup>3</sup>  | Goldman Sachs GSCBECS1 Index <sup>4</sup>            | (122.140)                       | (0,05)               |
| USD (1.660.913) | 19.11.2024           | 4,32 <sup>1</sup>  | S&P Retail Select Industry Index <sup>2</sup>        | (124.442)                       | (0,06)               |
| EUR (594.984)   | 07.07.2023           | 3,00 <sup>3</sup>  | Goldman Sachs GSCBECS1 Index <sup>4</sup>            | (195.789)                       | (0,09)               |
| USD (3.498.340) | 01.11.2024           | 4,42 <sup>1</sup>  | JPMorgan Basket JPNBGCND <sup>2</sup>                | (228.095)                       | (0,10)               |
| USD (1.077.372) | 19.01.2024           | 4,68 <sup>5</sup>  | Goldman Sachs GSCBOEC1 Index <sup>4</sup>            | (249.808)                       | (0,11)               |
| USD (6.926.763) | 04.11.2023           | 5,22 <sup>1</sup>  | S&P 500 Equal Weight Total Return Index <sup>2</sup> | (613.493)                       | (0,28)               |
| USD (4.058.170) | 19.07.2024           | 5,10 <sup>1</sup>  | JPMorgan Basket JPNBLQGS <sup>2</sup>                | (625.181)                       | (0,28)               |

## US Long Short Equity – Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Total Return Swap-Kontrakte (1,69 %) (31. Dezember 2022: (0,32 %)) (Fortsetzung)

|   | Nominalwert | Datum der Schließung | Variabler Zinssatz | Referenzunternehmen                       | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|-------------|----------------------|--------------------|---|---------------------------------|----------------------|
| USD   | (4.380.446) | 19.01.2024           | 4,68 <sup>5</sup>  | Goldman Sachs GSCBOEC1 Index <sup>4</sup> | (1.296.472)                     | (0,58)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Total Return Swap-Kontrakten <sup>∞</sup></b> |             |                      |                    |   | <b>(3.765.767)</b>              | <b>(1,69)</b>        |

<sup>1</sup> Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist die 1-Tages-Overnight Bank Funding Rate.

<sup>2</sup> Die Gegenpartei für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist die JPMorgan Chase Bank.

<sup>3</sup> Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist die 1-Tages-Euro Short Term Rate (€STR).

<sup>4</sup> Kontrahent für diese Total Return Swap-Kontrakte ist Goldman Sachs International.

<sup>5</sup> Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist die 1-Tages-Overnight Fed Funds Effective Rate.

<sup>6</sup> Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist die USD Secured Overnight Financing Rate.

|   | Zeitwert US\$      | % des Nettovermögens |
|---|--------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(8.390.982)</b> | <b>(3,77)</b>        |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>181.933.244</b> | <b>81,80</b>         |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>40.491.612</b>  | <b>18,20</b>         |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>222.424.856</b> | <b>100,00</b>        |

| Portfolioanalyse  | US\$               | % des Gesamtvermögens |
|---|--------------------|-----------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 182.190.145        | 77,31                 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden            | 6.962.155          | 2,95                  |
| † Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente  | 389.702            | 0,17                  |
| ± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden                          | (937.705)          | (0,40)                |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente   | (6.671.053)        | (2,83)                |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>181.933.244</b> | <b>77,20</b>          |



## US Multi Cap Opportunities - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der<br>Anteile                               | Wertpapierbezeichnung              | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|------------------------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Aktien 100,25 % (31. Dezember 2022: 99,48 %)</b> |                                    |                  |                              |
| <b>US-Dollar</b>                                    |                                    |                  |                              |
| 159.000   | Alphabet Inc Class C               | 19.234.230       | 4,65                         |
| 92.000  | Amazon.com Inc                     | 11.993.120       | 2,90                         |
| 124.800   | Apollo Global Management Inc       | 9.585.888        | 2,32                         |
| 98.000  | Apple Inc                          | 19.009.060       | 4,60                         |
| 338.000   | Aramark                            | 14.550.900       | 3,52                         |
| 19.500  | Avery Dennison Corp                | 3.350.100        | 0,81                         |
| 83.000  | Ball Corp                          | 4.831.430        | 1,17                         |
| 36.600  | Becton Dickinson & Co              | 9.662.766        | 2,34                         |
| 62.000  | Berkshire Hathaway Inc Class B     | 21.142.000       | 5,11                         |
| 103.900   | BJ's Wholesale Club Holdings Inc   | 6.546.739        | 1,58                         |
| 1.300   | Booking Holdings Inc               | 3.510.429        | 0,85                         |
| 357.700   | Brookfield Corp                    | 12.036.605       | 2,91                         |
| 210.500   | Brookfield Renewable Corp Class A  | 6.634.960        | 1,60                         |
| 87.100  | Charles Schwab Corp                | 4.936.828        | 1,19                         |
| 46.800  | Chubb Ltd                          | 9.011.808        | 2,18                         |
| 46.800  | Columbia Sportswear Co             | 3.614.832        | 0,87                         |
| 407.000   | CSX Corp                           | 13.878.700       | 3,36                         |
| 13.900  | Deere & Co                         | 5.632.141        | 1,36                         |
| 58.700  | Dollar Tree Inc                    | 8.423.450        | 2,04                         |
| 48.000  | Eagle Materials Inc                | 8.948.160        | 2,16                         |
| 43.000  | Electronic Arts Inc                | 5.577.100        | 1,35                         |
| 36.000  | EOG Resources Inc                  | 4.119.840        | 1,00                         |
| 725.000   | Graphic Packaging Holding Co       | 17.421.750       | 4,21                         |
| 49.500  | HCA Healthcare Inc                 | 15.022.260       | 3,63                         |
| 67.900  | Intercontinental Exchange Inc      | 7.678.132        | 1,86                         |
| 89.100  | JPMorgan Chase & Co                | 12.958.704       | 3,13                         |
| 34.000  | Lowe's Cos Inc                     | 7.673.800        | 1,86                         |
| 31.000  | McDonald's Corp                    | 9.250.710        | 2,24                         |
| 52.000  | Microsoft Corp                     | 17.708.080       | 4,28                         |
| 120.000   | Mondelez International Inc Class A | 8.752.800        | 2,12                         |
| 42.000  | Motorola Solutions Inc             | 12.317.760       | 2,98                         |
| 51.000  | NIKE Inc Class B                   | 5.628.870        | 1,36                         |
| 39.000  | Nordson Corp                       | 9.679.020        | 2,34                         |
| 156.600   | Pfizer Inc                         | 5.744.088        | 1,39                         |
| 45.000  | QUALCOMM Inc                       | 5.356.800        | 1,30                         |
| 29.200  | Raytheon Technologies Corp         | 2.860.432        | 0,69                         |
| 19.500  | Rockwell Automation Inc            | 6.424.275        | 1,55                         |
| 168.000   | Simply Good Foods Co               | 6.147.120        | 1,49                         |
| 80.000  | TJX Cos Inc                        | 6.783.200        | 1,64                         |
| 89.900  | T-Mobile US Inc                    | 12.487.110       | 3,02                         |

## US Multi Cap Opportunities - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile   | Wertpapierbezeichnung                    | Zeitwert US\$      | % des Nettovermögens |
|--|--|--------------------|----------------------|
| <b>Aktien 100,25% (31. Dezember 2022: 99,48 %) (Fortsetzung)</b> |  |                    |                      |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>                                   |  |                    |                      |
| 53.000   | TransUnion                               | 4.151.490          | 1,00                 |
| 262.000  | US Foods Holding Corp                    | 11.528.000         | 2,79                 |
| 30.800   | Verisk Analytics Inc Class A             | 6.961.724          | 1,68                 |
| 62.000   | Walt Disney Co                           | 5.535.360          | 1,34                 |
| 19.100   | WD-40 Co                                 | 3.603.215          | 0,87                 |
| 60.800   | Westinghouse Air Brake Technologies Corp | 6.667.936          | 1,61                 |
| <b>Aktien insgesamt *</b>  |  | <b>414.573.722</b> | <b>100,25</b>        |
| <b>Anlagen insgesamt</b>   |  | <b>414.573.722</b> | <b>100,25</b>        |

**Devisenterminkontrakte 0,11 % (31. Dezember 2022: 0,62 %)**

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i>   |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 186.488 AUD   | 123.449 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 4         | 745                            | 0,00                 |
| 59.533 AUD  | 39.421 US\$         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 9         | 224                            | 0,00                 |
| 63.796 US\$   | 94.564 AUD          | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 3         | 820                            | 0,00                 |
| 1.823.454 US\$  | 2.707.290 AUD       | 20.07.2023       | UBS AG                      | 2         | 20.509                         | 0,01                 |
| 58.901 US\$   | 87.448 AUD          | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 20        | 663                            | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>   |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 356.811 €   | 384.084 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 4         | 5.499                          | 0,00                 |
| 86.592 €  | 93.704 US\$         | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | 841                            | 0,00                 |
| 90.091 €  | 97.074 US\$         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 7         | 1.291                          | 0,00                 |
| 71.521 US\$   | 64.661 €            | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | 921                            | 0,00                 |
| 334.962 US\$  | 303.919 €           | 20.07.2023       | UBS AG                      | 3         | 3.128                          | 0,00                 |
| 333.947 US\$  | 302.480 €           | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 8         | 3.686                          | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>   |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 117.529 SGD   | 86.860 US\$         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 5         | 33                             | 0,00                 |
| 665.969 US\$  | 885.330 SGD         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 3         | 11.414                         | 0,01                 |
| 1.171.412 US\$  | 1.571.225 SGD       | 20.07.2023       | UBS AG                      | 5         | 9.751                          | 0,00                 |
| 16.726.320 US\$   | 22.222.489 SGD      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 61        | 296.487                        | 0,07                 |
| <i>Abgesicherte Klassen ZAR</i>   |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 367.018 US\$  | 6.783.776 ZAR       | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 4         | 8.487                          | 0,00                 |
| 132.930 US\$  | 2.450.731 ZAR       | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | 3.405                          | 0,00                 |
| 1.501.961 US\$  | 27.882.618 ZAR      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 36        | 28.328                         | 0,01                 |
| 7.740.038 ZAR   | 397.689 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 4         | 11.381                         | 0,00                 |
| 2.004.301 ZAR   | 102.471 US\$        | 20.07.2023       | UBS AG                      | 2         | 3.459                          | 0,00                 |
| 28.685.092 ZAR  | 1.468.797 US\$      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 23        | 47.247                         | 0,01                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>~</sup></b> |                     |                  |                             |           | <b>458.319</b>                 | <b>0,11</b>          |

## US Multi Cap Opportunities - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

|  | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------|------------------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> | <b>415.032.041</b> | <b>100,36</b>                |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,34 %) (31. Dezember 2022: (0,13 %))

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i>   |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 118.370 AUD   | 80.572 US\$         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 3         | (1.741)                         | (0,00)               |
| 6.058.485 AUD   | 4.080.559 US\$      | 20.07.2023       | UBS AG                      | 4         | (45.854)                        | (0,01)               |
| 232.658 AUD   | 156.715 US\$        | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 24        | (1.774)                         | (0,00)               |
| 114.048 US\$  | 173.392 AUD         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 4         | (1.424)                         | (0,00)               |
| 30.765 US\$   | 46.640 AUD          | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 7         | (296)                           | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>   |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 382.273 €   | 419.890 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 4         | (2.506)                         | (0,00)               |
| 2.352.230 €   | 2.581.526 US\$      | 20.07.2023       | UBS AG                      | 4         | (13.248)                        | (0,01)               |
| 7.111.543 €   | 7.813.996 US\$      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 9         | (49.270)                        | (0,01)               |
| 168.618 US\$  | 155.487 €           | 20.07.2023       | UBS AG                      | 2         | (1.150)                         | (0,00)               |
| 374.931 US\$  | 347.711 €           | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 7         | (4.717)                         | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>   |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 23.442.427 SGD  | 17.733.500 US\$     | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 4         | (401.720)                       | (0,10)               |
| 24.714.570 SGD  | 18.657.580 US\$     | 20.07.2023       | UBS AG                      | 7         | (385.261)                       | (0,09)               |
| 3.279.310 SGD   | 2.462.883 US\$      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 47        | (38.379)                        | (0,01)               |
| 51.037 US\$   | 69.043 SGD          | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 3         | (9)                             | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen ZAR</i>   |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 254.958 US\$  | 4.974.855 ZAR       | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 2         | (7.969)                         | (0,00)               |
| 91.976 US\$   | 1.826.633 ZAR       | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | (4.564)                         | (0,00)               |
| 206.534 US\$  | 3.985.246 ZAR       | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 17        | (4.090)                         | (0,00)               |
| 177.914.050 ZAR   | 9.802.728 US\$      | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 9         | (399.740)                       | (0,10)               |
| 4.864.556 ZAR   | 263.807 US\$        | 20.07.2023       | UBS AG                      | 2         | (6.709)                         | (0,00)               |
| 10.699.159 ZAR  | 586.027 US\$        | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 27        | (20.562)                        | (0,01)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>oo</sup></b> |                     |                  |                             |           | <b>(1.390.983)</b>              | <b>(0,34)</b>        |

|   | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------|------------------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(1.390.983)</b> | <b>(0,34)</b>                |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>413.641.058</b> | <b>100,02</b>                |
| <b>Sonstige Nettverbindlichkeiten</b>   | <b>(110.489)</b>   | <b>(0,02)</b>                |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>413.530.569</b> | <b>100,00</b>                |

## US Multi Cap Opportunities - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

| Portfolioanalyse  | US\$               | % des<br>Gesamtver-<br>mögens |
|---|--------------------|-------------------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 414.573.722        | 99,24                         |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente   | (932.664)          | (0,22)                        |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>413.641.058</b> | <b>99,02</b>                  |

## US Real Estate Securities - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der<br>Anteile  | Wertpapierbezeichnung               | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|-------------------------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Immobilienaktiengesellschaften 97,60 % (31. Dezember 2022: 96,38 %)</b> |                                     |                    |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |                                     |                    |                              |
| 285.991  | American Homes 4 Rent Class A       | 10.138.381         | 1,81                         |
| 228.853  | American Tower Corp                 | 44.383.751         | 7,94                         |
| 492.220  | Apartment Income REIT Corp          | 17.764.220         | 3,18                         |
| 100.945  | Boston Properties Inc               | 5.813.422          | 1,04                         |
| 282.716  | Crown Castle Inc                    | 32.212.661         | 5,76                         |
| 56.060   | EastGroup Properties Inc            | 9.732.016          | 1,74                         |
| 32.639   | Equinix Inc                         | 25.587.018         | 4,58                         |
| 240.700  | Equity LifeStyle Properties Inc     | 16.100.423         | 2,88                         |
| 216.547  | Equity Residential                  | 14.285.606         | 2,55                         |
| 77.312   | Essex Property Trust Inc            | 18.114.202         | 3,24                         |
| 98.718   | Extra Space Storage Inc             | 14.694.174         | 2,63                         |
| 446.718  | Healthpeak Properties Inc           | 8.979.032          | 1,60                         |
| 479.267  | Invitation Homes Inc                | 16.486.785         | 2,95                         |
| 334.751  | Iron Mountain Inc                   | 19.020.552         | 3,40                         |
| 805.243  | Kimco Realty Corp                   | 15.879.392         | 2,84                         |
| 50.383   | Life Storage Inc                    | 6.698.924          | 1,20                         |
| 171.748  | Omega Healthcare Investors Inc      | 5.270.946          | 0,94                         |
| 363.319  | Prologis Inc                        | 44.553.809         | 7,97                         |
| 131.753  | Public Storage                      | 38.456.066         | 6,88                         |
| 504.167  | Realty Income Corp                  | 30.144.145         | 5,39                         |
| 97.659   | Regency Centers Corp                | 6.032.396          | 1,08                         |
| 370.513  | Retail Opportunity Investments Corp | 5.005.631          | 0,89                         |
| 130.852  | Rexford Industrial Realty Inc       | 6.833.091          | 1,22                         |
| 54.886   | SBA Communications Corp Class A     | 12.720.379         | 2,27                         |
| 157.262  | Simon Property Group Inc            | 18.160.616         | 3,25                         |
| 81.113   | Sun Communities Inc                 | 10.582.002         | 1,89                         |
| 273.434  | UDR Inc                             | 11.746.725         | 2,10                         |
| 364.850  | Urban Edge Properties               | 5.629.635          | 1,01                         |
| 336.991  | Ventas Inc                          | 15.929.564         | 2,85                         |
| 629.953  | VICI Properties Inc Class A         | 19.799.423         | 3,54                         |
| 262.459  | Welltower Inc                       | 21.230.308         | 3,80                         |
| 530.342  | Weyerhaeuser Co                     | 17.771.760         | 3,18                         |
| <b>Immobilienaktiengesellschaften insgesamt *</b>                          |                                     | <b>545.757.055</b> | <b>97,60</b>                 |
| <b>Anlagen insgesamt</b>   |                                     | <b>545.757.055</b> | <b>97,60</b>                 |

### Devisenterminkontrakte 0,03 % (31. Dezember 2022: 0,63 %)

| Geforderter<br>Betrag           | Zu zahlender<br>Betrag | Fälligkeits-<br>datum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---------------------------------|------------------------|-----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------------|------------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> |                        |                       |                             |           |                                      |                              |
| 1.177.357 AUD                   | 779.600 US\$           | 20.07.2023            | Goldman Sachs International | 5         | 4.472                                | 0,00                         |

## US Real Estate Securities - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Devisenterminkontrakte 0,03 % (31. Dezember 2022: 0,63 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen AUD (Fortsetzung)</i>                                    |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 190.276 AUD  | 126.024 US\$        | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | 692                            | 0,00                 |
| 209.666 AUD  | 138.369 US\$        | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 15        | 1.259                          | 0,00                 |
| 1.262.505 US\$   | 1.882.366 AUD       | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 8         | 8.925                          | 0,00                 |
| 1.677.386 US\$   | 2.501.019 AUD       | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 44        | 11.811                         | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 35.179 CHF   | 39.206 US\$         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 2         | 179                            | 0,00                 |
| 44.841 CHF   | 49.938 US\$         | 20.07.2023       | UBS AG                      | 4         | 264                            | 0,00                 |
| 1.665.151 CHF  | 1.860.811 US\$      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 4         | 3.432                          | 0,00                 |
| 14.889 US\$  | 13.221 CHF          | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | 87                             | 0,00                 |
| 159.371 US\$   | 141.619 CHF         | 20.07.2023       | UBS AG                      | 7         | 820                            | 0,00                 |
| 192.882 US\$   | 170.717 CHF         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 5         | 1.753                          | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 504.257 €  | 542.937 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 3         | 7.636                          | 0,00                 |
| 128.517 €  | 138.203 US\$        | 20.07.2023       | UBS AG                      | 2         | 2.118                          | 0,00                 |
| 118.612 €  | 128.079 US\$        | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 18        | 1.427                          | 0,00                 |
| 384.608 US\$   | 347.467 €           | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 3         | 5.227                          | 0,00                 |
| 741.362 US\$   | 673.830 €           | 20.07.2023       | UBS AG                      | 6         | 5.642                          | 0,00                 |
| 2.879.275 US\$   | 2.620.774 €         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 33        | 17.785                         | 0,01                 |
| <i>Abgesicherte Klassen HKD</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 507.415 HKD  | 64.764 US\$         | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | 3                              | 0,00                 |
| 310.848 US\$   | 2.431.808 HKD       | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 5         | 451                            | 0,00                 |
| 1.137.723 US\$   | 8.899.763 HKD       | 20.07.2023       | UBS AG                      | 15        | 1.754                          | 0,00                 |
| 696.469 US\$   | 5.449.384 HKD       | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 32        | 906                            | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 1.162 SGD  | 859 US\$            | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 4         | 0                              | 0,00                 |
| 41.058 US\$  | 54.971 SGD          | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 6         | 416                            | 0,00                 |
| 21.670 US\$  | 29.112 SGD          | 20.07.2023       | UBS AG                      | 6         | 145                            | 0,00                 |
| 241.402 US\$   | 324.587 SGD         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 27        | 1.426                          | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen ZAR</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 1.667.203 US\$   | 30.799.444 ZAR      | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 8         | 39.413                         | 0,01                 |
| 497.526 US\$   | 9.268.066 ZAR       | 20.07.2023       | UBS AG                      | 2         | 7.697                          | 0,00                 |
| 670.698 US\$   | 12.418.623 ZAR      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 40        | 14.359                         | 0,00                 |
| 12.091.793 ZAR   | 622.897 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 4         | 16.169                         | 0,01                 |
| 4.705.004 ZAR  | 241.059 US\$        | 20.07.2023       | UBS AG                      | 2         | 7.607                          | 0,00                 |
| 345.655 ZAR  | 17.914 US\$         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 16        | 355                            | 0,00                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>an</sup></b> |                     |                  |                             |           | <b>164.230</b>                 | <b>0,03</b>          |

## US Real Estate Securities - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

|  | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------|------------------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> | <b>545.921.285</b> | <b>97,63</b>                 |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,22 %) (31. Dezember 2022: (0,19 %))

| Geforderter Betrag              | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 696.473 AUD                     | 471.950 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 4         | (8.127)                         | (0,00)               |
| 20.979.470 AUD                  | 14.131.062 US\$     | 20.07.2023       | UBS AG                      | 5         | (159.586)                       | (0,03)               |
| 1.338.159 AUD                   | 898.277 US\$        | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 27        | (7.117)                         | (0,00)               |
| 576.193 US\$                    | 876.284 AUD         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 4         | (7.377)                         | (0,00)               |
| 218.184 US\$                    | 327.972 AUD         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 17        | (232)                           | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i> |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 18.896 CHF                      | 21.331 US\$         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 2         | (176)                           | (0,00)               |
| 64.812 CHF                      | 72.791 US\$         | 20.07.2023       | UBS AG                      | 3         | (230)                           | (0,00)               |
| 86.089 CHF                      | 97.269 US\$         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 5         | (886)                           | (0,00)               |
| 14.864 US\$                     | 13.293 CHF          | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 1         | (19)                            | (0,00)               |
| 53.125 US\$                     | 47.733 CHF          | 20.07.2023       | UBS AG                      | 4         | (315)                           | (0,00)               |
| 120.182 US\$                    | 107.717 CHF         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 5         | (413)                           | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 913.867 €                       | 1.003.245 US\$      | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 7         | (5.441)                         | (0,00)               |
| 544.115 €                       | 600.766 US\$        | 20.07.2023       | UBS AG                      | 4         | (6.675)                         | (0,00)               |
| 13.794.253 €                    | 15.151.567 US\$     | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 16        | (90.332)                        | (0,02)               |
| 800.438 US\$                    | 736.631 €           | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 5         | (3.851)                         | (0,00)               |
| 154.056 US\$                    | 141.099 €           | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | (3)                             | (0,00)               |
| 579.238 US\$                    | 537.324 €           | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 24        | (7.438)                         | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen HKD</i> |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 33.125.135 HKD                  | 4.238.931 US\$      | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 9         | (10.830)                        | (0,00)               |
| 3.197.706 HKD                   | 408.903 US\$        | 20.07.2023       | UBS AG                      | 7         | (747)                           | (0,00)               |
| 29.974.802 HKD                  | 3.836.947 US\$      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 33        | (10.956)                        | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i> |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 442.314 SGD                     | 334.247 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 8         | (7.230)                         | (0,00)               |
| 455.189 SGD                     | 343.331 US\$        | 20.07.2023       | UBS AG                      | 9         | (6.796)                         | (0,00)               |
| 57.709 SGD                      | 43.434 US\$         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 38        | (768)                           | (0,00)               |
| 1.850 US\$                      | 2.502 SGD           | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 1         | (0)                             | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen ZAR</i> |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 1.127.056 US\$                  | 21.822.699 ZAR      | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 6         | (26.301)                        | (0,01)               |
| 314.736 US\$                    | 6.250.648 ZAR       | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | (15.619)                        | (0,00)               |
| 582.781 US\$                    | 11.342.071 ZAR      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 24        | (16.664)                        | (0,00)               |
| 368.661.364 ZAR                 | 20.308.042 US\$     | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 8         | (823.814)                       | (0,15)               |
| 18.379.329 ZAR                  | 995.170 US\$        | 20.07.2023       | UBS AG                      | 4         | (23.799)                        | (0,01)               |

## US Real Estate Securities - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (0,22 %) (31. Dezember 2022: (0,19 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei          | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens         |
|---|---------------------|------------------|----------------------|-----------|---------------------------------|------------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen ZAR (Fortsetzung)</i>   |                     |                  |                      |           |                                 |                              |
| 13.417.977 ZAR  | 721.171 US\$        | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp | 27        | (12.014)                        | (0,00)                       |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>                          |                     |                  |                      |           | <b>(1.253.756)</b>              | <b>(0,22)</b>                |
|   |                     |                  |                      |           | <b>Zeitwert US\$</b>            | <b>% des Nettovermögens</b>  |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> |                     |                  |                      |           | <b>(1.253.756)</b>              | <b>(0,22)</b>                |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              |                     |                  |                      |           | <b>544.667.529</b>              | <b>97,41</b>                 |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  |                     |                  |                      |           | <b>14.484.222</b>               | <b>2,59</b>                  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   |                     |                  |                      |           | <b>559.151.751</b>              | <b>100,00</b>                |
| <b>Portfolioanalyse</b>   |                     |                  |                      |           | <b>US\$</b>                     | <b>% des Gesamtvermögens</b> |
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind   |                     |                  |                      |           | 545.757.055                     | 96,47                        |
| <sup>∞</sup> OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente  |                     |                  |                      |           | (1.089.526)                     | (0,19)                       |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  |                     |                  |                      |           | <b>544.667.529</b>              | <b>96,28</b>                 |



## US Small Cap - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der<br>Anteile                              | Wertpapierbezeichnung                          | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|------------------|------------------------------|
| <b>Aktien 99,39 % (31. Dezember 2022: 97,70 %)</b> |  |                  |                              |
| <b>US-Dollar</b>                                   |  |                  |                              |
| 189.224  | Abcam Plc ADR*                                 | 4.630.311        | 0,74                         |
| 38.243   | Advanced Energy Industries Inc*                | 4.262.182        | 0,68                         |
| 133.718  | American Software Inc Class A*                 | 1.405.376        | 0,22                         |
| 51.258   | AMERISAFE Inc*                                 | 2.733.077        | 0,43                         |
| 68.436   | Amphastar Pharmaceuticals Inc*                 | 3.933.017        | 0,63                         |
| 40.775   | AptarGroup Inc*                                | 4.724.191        | 0,75                         |
| 22.372   | Arcosa Inc*                                    | 1.695.126        | 0,27                         |
| 22.707   | Artisan Partners Asset Management Inc Class A* | 892.612          | 0,14                         |
| 47.955   | Asbury Automotive Group Inc*                   | 11.529.341       | 1,83                         |
| 34.733   | Aspen Technology Inc*                          | 5.821.598        | 0,93                         |
| 8.147  | Atrion Corp*                                   | 4.608.758        | 0,73                         |
| 68.146   | Bank of Hawaii Corp*                           | 2.809.660        | 0,45                         |
| 138.279  | Bio-Techne Corp*                               | 11.287.715       | 1,80                         |
| 33.082   | BOK Financial Corp*                            | 2.672.364        | 0,43                         |
| 38.052   | Bright Horizons Family Solutions Inc*          | 3.517.907        | 0,56                         |
| 6.499  | Cable One Inc*                                 | 4.270.363        | 0,68                         |
| 75.989   | Cactus Inc Class A*                            | 3.215.854        | 0,51                         |
| 43.286   | Chase Corp*                                    | 5.247.129        | 0,83                         |
| 21.054   | Chemed Corp*                                   | 11.404.320       | 1,81                         |
| 33.520   | Church & Dwight Co Inc*                        | 3.359.710        | 0,53                         |
| 98.391   | Community Bank System Inc*                     | 4.612.570        | 0,73                         |
| 55.117   | CommVault Systems Inc*                         | 4.002.597        | 0,64                         |
| 1.256  | CorVel Corp*                                   | 243.036          | 0,04                         |
| 24.388   | CRA International Inc*                         | 2.487.576        | 0,40                         |
| 50.020   | CSW Industrials Inc*                           | 8.312.824        | 1,32                         |
| 59.901   | Cullen/Frost Bankers Inc*                      | 6.441.155        | 1,02                         |
| 142.625  | CVB Financial Corp*                            | 1.894.060        | 0,30                         |
| 230.843  | Driven Brands Holdings Inc*                    | 6.246.612        | 0,99                         |
| 57.708   | Eagle Materials Inc*                           | 10.757.925       | 1,71                         |
| 199.445  | Element Solutions Inc*                         | 3.829.344        | 0,61                         |
| 74.243   | ESAB Corp*                                     | 4.940.129        | 0,79                         |
| 13.520   | ESCO Technologies Inc*                         | 1.401.078        | 0,22                         |
| 98.934   | Exponent Inc*                                  | 9.232.521        | 1,47                         |
| 16.810   | Fair Isaac Corp*                               | 13.602.820       | 2,16                         |
| 93.322   | First Financial Bankshares Inc*                | 2.658.744        | 0,42                         |
| 65.384   | FirstService Corp*                             | 10.075.021       | 1,60                         |
| 60.782   | Floor & Decor Holdings Inc Class A*            | 6.318.897        | 1,01                         |
| 61.567   | Forward Air Corp*                              | 6.532.874        | 1,04                         |
| 87.493   | Fox Factory Holding Corp*                      | 9.493.865        | 1,51                         |
| 49.720   | FTI Consulting Inc*                            | 9.456.744        | 1,50                         |

## US Small Cap - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile  | Wertpapierbezeichnung            | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|---|----------------------------------|---------------|----------------------|
| <b>Aktien 99,39% (31. Dezember 2022: 97,70 %) (Fortsetzung)</b> |                                  |               |                      |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>                                  |                                  |               |                      |
| 125.496   | Glacier Bancorp Inc*             | 3.911.710     | 0,62                 |
| 75.003  | Graco Inc*                       | 6.476.509     | 1,03                 |
| 87.388  | Grocery Outlet Holding Corp*     | 2.674.947     | 0,43                 |
| 122.458   | Haemonetics Corp*                | 10.426.074    | 1,66                 |
| 149.519   | Hagerty Inc Class A*             | 1.399.498     | 0,22                 |
| 28.111  | Hamilton Lane Inc Class A*       | 2.248.318     | 0,36                 |
| 312.985   | Hayward Holdings Inc*            | 4.021.857     | 0,64                 |
| 367.194   | Hillman Solutions Corp*          | 3.308.418     | 0,53                 |
| 41.159  | Houlihan Lokey Inc Class A*      | 4.046.341     | 0,64                 |
| 20.987  | ICON Plc*                        | 5.250.947     | 0,84                 |
| 25.308  | Jack Henry & Associates Inc*     | 4.234.788     | 0,67                 |
| 39.741  | Kadant Inc*                      | 8.826.476     | 1,40                 |
| 130.465   | Kirby Corp*                      | 10.039.282    | 1,60                 |
| 50.512  | Lakeland Financial Corp*         | 2.450.842     | 0,39                 |
| 185.759   | Lattice Semiconductor Corp*      | 17.845.867    | 2,84                 |
| 43.279  | LCI Industries*                  | 5.468.734     | 0,87                 |
| 31.915  | Lindsay Corp*                    | 3.808.736     | 0,61                 |
| 36.019  | Littelfuse Inc*                  | 10.492.695    | 1,67                 |
| 76.022  | Manhattan Associates Inc*        | 15.195.277    | 2,42                 |
| 11.178  | MarketAxess Holdings Inc*        | 2.922.153     | 0,46                 |
| 69.882  | Matador Resources Co*            | 3.656.226     | 0,58                 |
| 63.018  | MKS Instruments Inc*             | 6.812.246     | 1,08                 |
| 101.681   | Model N Inc*                     | 3.595.440     | 0,57                 |
| 209.529   | NetScout Systems Inc*            | 6.484.923     | 1,03                 |
| 60.542  | Nexstar Media Group Inc Class A* | 10.083.270    | 1,60                 |
| 25.325  | Nordson Corp*                    | 6.285.159     | 1,00                 |
| 37.246  | Novanta Inc*                     | 6.856.989     | 1,09                 |
| 200.717   | Oceaneering International Inc*   | 3.753.408     | 0,60                 |
| 23.930  | Omega Flex Inc*                  | 2.483.455     | 0,40                 |
| 35.208  | Pool Corp*                       | 13.190.325    | 2,10                 |
| 127.433   | Power Integrations Inc*          | 12.064.082    | 1,92                 |
| 73.020  | Prosperity Bancshares Inc*       | 4.124.170     | 0,66                 |
| 18.937  | Quaker Chemical Corp*            | 3.690.821     | 0,59                 |
| 76.224  | Qualys Inc*                      | 9.845.854     | 1,57                 |
| 36.716  | QuidelOrtho Corp*                | 3.042.288     | 0,48                 |
| 45.759  | RBC Bearings Inc*                | 9.951.210     | 1,58                 |
| 107.913   | Richelieu Hardware Ltd**         | 3.417.007     | 0,54                 |
| 45.373  | RLI Corp*                        | 6.192.053     | 0,98                 |
| 111.669   | Rollins Inc*                     | 4.782.783     | 0,76                 |
| 46.647  | Shift4 Payments Inc Class A*     | 3.167.798     | 0,50                 |

## US Small Cap - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile  | Wertpapierbezeichnung             | Zeitwert US\$      | % des Nettovermögens |
|---|-----------------------------------|--------------------|----------------------|
| <b>Aktien 99,39% (31. Dezember 2022: 97,70 %) (Fortsetzung)</b> |                                   |                    |                      |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>                                  |                                   |                    |                      |
| 79.316  | Simply Good Foods Co*             | 2.902.172          | 0,46                 |
| 62.770  | Simulations Plus Inc*             | 2.719.824          | 0,43                 |
| 24.804  | SiteOne Landscape Supply Inc*     | 4.151.197          | 0,66                 |
| 189.986   | Sitio Royalties Corp Class A*     | 4.990.932          | 0,79                 |
| 749.217   | Southwestern Energy Co*           | 4.502.794          | 0,72                 |
| 69.162  | SPS Commerce Inc*                 | 13.283.254         | 2,11                 |
| 61.619  | SPX Technologies Inc*             | 5.235.766          | 0,83                 |
| 21.677  | Standex International Corp*       | 3.066.645          | 0,49                 |
| 134.446   | Stevanato Group SpA*              | 4.353.361          | 0,69                 |
| 61.251  | Stock Yards Bancorp Inc*          | 2.778.958          | 0,44                 |
| 74.366  | TechTarget Inc*                   | 2.315.014          | 0,37                 |
| 54.028  | Tetra Tech Inc*                   | 8.846.545          | 1,41                 |
| 1.611   | Texas Pacific Land Corp*          | 2.120.882          | 0,34                 |
| 63.638  | Texas Roadhouse Inc Class A*      | 7.145.275          | 1,14                 |
| 117.993   | Tidewater Inc*                    | 6.541.532          | 1,04                 |
| 84.456  | Toro Co*                          | 8.584.952          | 1,37                 |
| 21.153  | Tractor Supply Co*                | 4.676.928          | 0,74                 |
| 43.692  | Transcat Inc*                     | 3.727.365          | 0,59                 |
| 14.880  | Tyler Technologies Inc*           | 6.197.074          | 0,99                 |
| 35.825  | UFP Technologies Inc*             | 6.944.676          | 1,10                 |
| 159.115   | United Community Banks Inc*       | 3.976.284          | 0,63                 |
| 168.204   | Utz Brands Inc*                   | 2.751.817          | 0,44                 |
| 36.174  | Valmont Industries Inc*           | 10.528.443         | 1,67                 |
| 157.965   | Vertex Inc Class A*               | 3.080.318          | 0,49                 |
| 18.216  | Watsco Inc*                       | 6.948.858          | 1,11                 |
| 27.253  | WD-40 Co*                         | 5.141.278          | 0,82                 |
| 26.383  | West Pharmaceutical Services Inc* | 10.090.706         | 1,60                 |
| 10.346  | Winmark Corp*                     | 3.439.735          | 0,55                 |
| 64.773  | XPEL Inc*                         | 5.455.182          | 0,87                 |
| 11.404  | Zebra Technologies Corp Class A*  | 3.373.645          | 0,54                 |
| <b>Aktien insgesamt</b>   |                                   | <b>624.961.391</b> | <b>99,39</b>         |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  |                                   | <b>624.961.391</b> | <b>99,39</b>         |

Devisenterminkontrakte 0,01 % (31. Dezember 2022: 0,16 %)

| Geforderter Betrag              | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 414.398 AUD                     | 274.421 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 6         | 1.550                          | 0,00                 |
| 64.417 AUD                      | 42.665 US\$         | 20.07.2023       | UBS AG                      | 1         | 234                            | 0,00                 |
| 113.582 AUD                     | 75.064 US\$         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 17        | 579                            | 0,00                 |

## US Small Cap - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 0,01 % (31. Dezember 2022: 0,16 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens        |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|-----------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen AUD (Fortsetzung)</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 325.457 US\$   | 483.279 AUD         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 9         | 3.613                          | 0,00                        |
| 164.834 US\$   | 244.365 AUD         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 21        | 2.095                          | 0,00                        |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 443.790 €  | 478.402 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 6         | 6.150                          | 0,01                        |
| 133.568 €  | 143.605 US\$        | 20.07.2023       | UBS AG                      | 2         | 2.231                          | 0,00                        |
| 752.114 €  | 818.223 US\$        | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 16        | 2.969                          | 0,00                        |
| 162.992 US\$   | 148.105 €           | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 3         | 1.284                          | 0,00                        |
| 429.503 US\$   | 389.059 €           | 20.07.2023       | UBS AG                      | 5         | 4.710                          | 0,00                        |
| 446.630 US\$   | 406.478 €           | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 4         | 2.818                          | 0,00                        |
| <i>Abgesicherte Klassen ZAR</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 161.989 US\$   | 2.989.688 ZAR       | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 8         | 3.980                          | 0,00                        |
| 20.150 US\$  | 374.382 ZAR         | 20.07.2023       | UBS AG                      | 2         | 363                            | 0,00                        |
| 65.821 US\$  | 1.220.552 ZAR       | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 21        | 1.311                          | 0,00                        |
| 2.714.670 ZAR  | 140.133 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 7         | 3.341                          | 0,00                        |
| 490.557 ZAR  | 25.032 US\$         | 20.07.2023       | UBS AG                      | 2         | 895                            | 0,00                        |
| 198.061 ZAR  | 10.209 US\$         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 25        | 257                            | 0,00                        |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>an</sup></b>                       |                     |                  |                             |           | <b>38.380</b>                  | <b>0,01</b>                 |
|  |                     |                  |                             |           | <b>Zeitwert US\$</b>           | <b>% des Nettovermögens</b> |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> |                     |                  |                             |           | <b>624.999.771</b>             | <b>99,40</b>                |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (0,03 %) (31. Dezember 2022: (0,04 %))

| Geforderter Betrag              | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 229.846 AUD                     | 155.362 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 5         | (2.294)                         | (0,00)               |
| 4.595.859 AUD                   | 3.095.609 US\$      | 20.07.2023       | UBS AG                      | 6         | (34.952)                        | (0,01)               |
| 380.968 AUD                     | 256.584 US\$        | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 36        | (2.875)                         | (0,00)               |
| 185.559 US\$                    | 281.206 AUD         | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 5         | (1.712)                         | (0,00)               |
| 48.920 US\$                     | 74.247 AUD          | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 6         | (526)                           | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 315.693 €                       | 346.374 US\$        | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 5         | (1.686)                         | (0,00)               |
| 295.437 €                       | 325.055 US\$        | 20.07.2023       | UBS AG                      | 3         | (2.483)                         | (0,00)               |
| 6.347.841 €                     | 6.971.643 US\$      | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 11        | (40.762)                        | (0,01)               |
| 298.079 US\$                    | 275.783 €           | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 5         | (3.035)                         | (0,00)               |
| 173.066 US\$                    | 159.250 €           | 20.07.2023       | UBS AG                      | 2         | (811)                           | (0,00)               |
| 291.852 US\$                    | 270.316 €           | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 12        | (3.294)                         | (0,00)               |

## US Small Cap - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Devisenterminkontrakte (0,03 %) (31. Dezember 2022: (0,04 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen ZAR</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 91.059 US\$  | 1.769.820 ZAR       | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 6         | (2.478)                         | (0,00)               |
| 24.605 US\$  | 488.783 ZAR         | 20.07.2023       | UBS AG                      | 2         | (1.228)                         | (0,00)               |
| 77.978 US\$  | 1.494.312 ZAR       | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 6         | (998)                           | (0,00)               |
| 31.430.445 ZAR   | 1.731.038 US\$      | 20.07.2023       | Goldman Sachs International | 10        | (69.900)                        | (0,01)               |
| 1.306.917 ZAR  | 70.454 US\$         | 20.07.2023       | UBS AG                      | 3         | (1.382)                         | (0,00)               |
| 1.431.490 ZAR  | 77.491 US\$         | 20.07.2023       | Westpac Banking Corp        | 33        | (1.834)                         | (0,00)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                             |           | <b>(172.250)</b>                | <b>(0,03)</b>        |

|   | Zeitwert US\$      | % des Nettovermögens |
|---|--------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(172.250)</b>   | <b>(0,03)</b>        |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>624.827.521</b> | <b>99,37</b>         |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>3.957.315</b>   | <b>0,63</b>          |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>628.784.836</b> | <b>100,00</b>        |

| Portfolioanalyse  | US\$               | % des Gesamtvermögens |
|---|--------------------|-----------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 621.544.384        | 98,37                 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden            | 3.417.007          | 0,54                  |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente   | (133.870)          | (0,02)                |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>624.827.521</b> | <b>98,89</b>          |

## US Small Cap Intrinsic Value - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der<br>Anteile                              | Wertpapierbezeichnung                        | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|------------------|------------------------------|
| <b>Aktien 90,50 % (31. Dezember 2022: 95,19 %)</b> |  |                  |                              |
| <b>US-Dollar</b>                                   |  |                  |                              |
| 77.154   | Acadia Healthcare Co Inc                     | 6.144.544        | 2,19                         |
| 347.679  | Accuray Inc                                  | 1.345.518        | 0,48                         |
| 227.122  | Adeia Inc                                    | 2.500.613        | 0,89                         |
| 78.691   | AerCap Holdings NV                           | 4.998.452        | 1,78                         |
| 232.709  | Amneal Pharmaceuticals Inc                   | 721.398          | 0,26                         |
| 32.031   | Arcosa Inc                                   | 2.426.989        | 0,87                         |
| 52.675   | AtriCure Inc                                 | 2.600.038        | 0,93                         |
| 55.330   | Avanos Medical Inc                           | 1.414.235        | 0,50                         |
| 33.564   | Avery Dennison Corp                          | 5.766.295        | 2,05                         |
| 450.141  | Babcock & Wilcox Enterprises Inc             | 2.655.832        | 0,95                         |
| 51.966   | Banc of California Inc                       | 601.766          | 0,21                         |
| 106.316  | BankUnited Inc                               | 2.291.110        | 0,82                         |
| 97.089   | Bloom Energy Corp Class A                    | 1.587.405        | 0,57                         |
| 65.481   | Box Inc Class A                              | 1.923.832        | 0,69                         |
| 28.624   | Bread Financial Holdings Inc                 | 898.507          | 0,32                         |
| 63.481   | Caleres Inc                                  | 1.519.100        | 0,54                         |
| 42.413   | Cannae Holdings Inc                          | 857.167          | 0,31                         |
| 50.196   | CEVA Inc                                     | 1.282.508        | 0,46                         |
| 13.320   | Charles River Laboratories International Inc | 2.800.530        | 1,00                         |
| 179.747  | Chico's FAS Inc                              | 961.646          | 0,34                         |
| 27.759   | Children's Place Inc                         | 644.286          | 0,23                         |
| 126.751  | Ciena Corp                                   | 5.385.650        | 1,92                         |
| 20.025   | Clean Harbors Inc                            | 3.292.711        | 1,17                         |
| 279.437  | Cleveland-Cliffs Inc                         | 4.683.364        | 1,67                         |
| 125.011  | CNX Resources Corp                           | 2.215.195        | 0,79                         |
| 369.607  | Cognyte Software Ltd                         | 2.250.907        | 0,80                         |
| 26.468   | Coherent Corp                                | 1.349.339        | 0,48                         |
| 53.008   | Comerica Inc                                 | 2.245.419        | 0,80                         |
| 877.304  | Conduent Inc                                 | 2.982.834        | 1,06                         |
| 251.462  | Criteo SA ADR                                | 8.484.328        | 3,02                         |
| 70.248   | Crown Holdings Inc                           | 6.102.444        | 2,18                         |
| 88.364   | CytoSorbents Corp                            | 317.227          | 0,11                         |
| 109.586  | Devon Energy Corp                            | 5.297.387        | 1,89                         |
| 52.824   | Dril-Quip Inc                                | 1.229.214        | 0,44                         |
| 141.188  | EMCORE Corp                                  | 106.258          | 0,04                         |
| 68.221   | Enerpac Tool Group Corp Class A              | 1.841.967        | 0,65                         |
| 6.241  | Entegris Inc                                 | 691.627          | 0,25                         |
| 206.383  | Enviri Corp                                  | 2.037.000        | 0,73                         |
| 38.026   | Haemonetics Corp                             | 3.237.534        | 1,16                         |
| 104.340  | Hain Celestial Group Inc                     | 1.305.293        | 0,46                         |

## US Small Cap Intrinsic Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile  | Wertpapierbezeichnung                   | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---|---------------|----------------------|
| <b>Aktien 90,50% (31. Dezember 2022: 95,19 %) (Fortsetzung)</b> |   |               |                      |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>                                  |   |               |                      |
| 282.330   | Huntington Bancshares Inc               | 3.043.518     | 1,08                 |
| 190.868   | Infinera Corp                           | 921.892       | 0,33                 |
| 198.105   | Innoviz Technologies Ltd                | 562.618       | 0,20                 |
| 16.785  | Integra LifeSciences Holdings Corp      | 690.367       | 0,25                 |
| 262.580   | International Game Technology Plc       | 8.373.676     | 2,99                 |
| 11.018  | ION Geophysical Corp                    | 0             | 0,00                 |
| 48.617  | Itron Inc                               | 3.505.285     | 1,25                 |
| 130.947   | KBR Inc                                 | 8.519.412     | 3,04                 |
| 348.207   | Kyndryl Holdings Inc                    | 4.624.189     | 1,65                 |
| 425.885   | Lions Gate Entertainment Corp Class B   | 3.556.140     | 1,27                 |
| 97.280  | MACOM Technology Solutions Holdings Inc | 6.374.758     | 2,27                 |
| 210.861   | Markforged Holding Corp                 | 255.142       | 0,09                 |
| 43.210  | Mercury Systems Inc                     | 1.494.634     | 0,53                 |
| 15.039  | Molina Healthcare Inc                   | 4.530.348     | 1,61                 |
| 53.120  | New Relic Inc                           | 3.476.173     | 1,24                 |
| 74.247  | nLight Inc                              | 1.144.889     | 0,41                 |
| 64.871  | ODP Corp                                | 3.037.260     | 1,08                 |
| 185.173   | Oil States International Inc            | 1.383.242     | 0,49                 |
| 108.989   | OneSpan Inc                             | 1.617.397     | 0,58                 |
| 219.579   | OPENLANE Inc                            | 3.341.992     | 1,19                 |
| 219.190   | OraSure Technologies Inc                | 1.098.142     | 0,39                 |
| 66.618  | Ormat Technologies Inc                  | 5.360.084     | 1,91                 |
| 21.558  | OSI Systems Inc                         | 2.540.179     | 0,90                 |
| 64.912  | Patterson Cos Inc                       | 2.158.973     | 0,77                 |
| 130.621   | Patterson-UTI Energy Inc                | 1.563.533     | 0,56                 |
| 700.683   | Quantum Corp                            | 756.738       | 0,27                 |
| 76.671  | Radware Ltd                             | 1.486.651     | 0,53                 |
| 139.935   | Rambus Inc                              | 8.979.629     | 3,20                 |
| 261.133   | Resideo Technologies Inc                | 4.611.609     | 1,64                 |
| 937.800   | Ribbon Communications Inc               | 2.616.462     | 0,93                 |
| 34.254  | SeaWorld Entertainment Inc              | 1.918.567     | 0,68                 |
| 296.000   | Standard BioTools Inc                   | 571.280       | 0,20                 |
| 68.972  | Stericycle Inc                          | 3.203.060     | 1,14                 |
| 263.606   | Stratasys Ltd                           | 4.681.643     | 1,67                 |
| 226.097   | TechnipFMC Plc                          | 3.757.732     | 1,34                 |
| 5.933   | Teledyne Technologies Inc               | 2.439.116     | 0,87                 |
| 63.080  | Tempur Sealy International Inc          | 2.527.616     | 0,90                 |
| 382.296   | TETRA Technologies Inc                  | 1.292.161     | 0,46                 |
| 61.315  | Texas Capital Bancshares Inc            | 3.157.722     | 1,13                 |
| 73.959  | TreeHouse Foods Inc                     | 3.726.054     | 1,33                 |

## US Small Cap Intrinsic Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile  | Wertpapierbezeichnung                             |        |                  | Zeitwert US\$      | % des Nettovermögens         |
|---|---|--------|------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Aktien 90,50% (31. Dezember 2022: 95,19 %) (Fortsetzung)</b>   |   |        |                  |                    |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>  |   |        |                  |                    |                              |
| 14.272  | Twin Discount Inc                                 |        |                  | 160.703            | 0,06                         |
| 129.020   | Under Armour Inc Class C                          |        |                  | 865.724            | 0,31                         |
| 358.248   | Unisys Corp                                       |        |                  | 1.425.827          | 0,51                         |
| 8.119   | Valmont Industries Inc                            |        |                  | 2.363.035          | 0,84                         |
| 66.498  | Varex Imaging Corp                                |        |                  | 1.567.358          | 0,56                         |
| 54.123  | Varonis Systems Inc Class B                       |        |                  | 1.442.378          | 0,51                         |
| 236.621   | Veeco Instruments Inc                             |        |                  | 6.076.427          | 2,17                         |
| 79.212  | Verint Systems Inc                                |        |                  | 2.777.173          | 0,99                         |
| 137.950   | Viasat Inc  |        |                  | 5.691.817          | 2,03                         |
| 173.790   | Viavi Solutions Inc                               |        |                  | 1.969.041          | 0,70                         |
| 160.788   | Vistra Corp                                       |        |                  | 4.220.685          | 1,50                         |
| 25.967  | Wix.com Ltd                                       |        |                  | 2.031.658          | 0,73                         |
| 181.695   | Xperi Inc   |        |                  | 2.389.289          | 0,85                         |
| 90.757  | Zimvie Inc  |        |                  | 1.019.201          | 0,36                         |
|   | <b>Aktien insgesamt *</b>                         |        |                  | <b>253.897.668</b> | <b>90,50</b>                 |
| <b>Immobilienaktiengesellschaften 0,55 % (31. Dezember 2022: 1,12 %)</b>                                |   |        |                  |                    |                              |
| <b>US-Dollar</b>  |   |        |                  |                    |                              |
| 77.337  | Chatham Lodging Trust                             |        |                  | 723.874            | 0,26                         |
| 78.246  | RLJ Lodging Trust                                 |        |                  | 803.587            | 0,29                         |
|   | <b>Immobilienaktiengesellschaften insgesamt *</b> |        |                  | <b>1.527.461</b>   | <b>0,55</b>                  |
| Kapitalbetrag   | Wertpapierbezeichnung                             | Kupon  | Fälligkeitsdatum | Zeitwert US\$      | % des Nettovermögens         |
| <b>Unternehmensanleihen 0,00 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)</b>  |   |        |                  |                    |                              |
| <b>US-Dollar</b>  |   |        |                  |                    |                              |
| 32.000  | ION Geophysical Escrow Corp                       | 8,00 % | 15.12.2025       | 0                  | 0,00                         |
|   | <b>Unternehmensanleihen insgesamt *</b>           |        |                  | <b>0</b>           | <b>0,00</b>                  |
|   | <b>Anlagen insgesamt</b>                          |        |                  | <b>255.425.129</b> | <b>91,05</b>                 |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>  |   |        |                  | <b>255.425.129</b> | <b>91,05</b>                 |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>            |   |        |                  | <b>255.425.129</b> | <b>91,05</b>                 |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  |   |        |                  | <b>25.121.671</b>  | <b>8,95</b>                  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                 |   |        |                  | <b>280.546.800</b> | <b>100,00</b>                |
| <b>Portfolioanalyse</b>   |   |        |                  | <b>US\$</b>        | <b>% des Gesamtvermögens</b> |
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind |   |        |                  | 255.425.129        | 90,90                        |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  |   |        |                  | <b>255.425.129</b> | <b>90,90</b>                 |



## Bilanzen

|   | 5G Connectivity      | Absolute Return<br>Multi Strategy | Asian Debt - Hard<br>Currency | China A-Share<br>Equity | China Bond         | China Equity       | CLO Income         | Commodities        |
|---|----------------------|-----------------------------------|-------------------------------|-------------------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|
|   | Zum                  | Zum                               | Zum                           | Zum                     | Zum                | Zum                | Zum                | Zum                |
| Anm.  | 30. Juni 2023        | 30. Juni 2023*                    | 30. Juni 2023                 | 30. Juni 2023           | 30. Juni 2023      | 30. Juni 2023      | 30. Juni 2023      | 30. Juni 2023      |
|   | US\$                 | US\$                              | US\$                          | CNY                     | CNY                | US\$               | US\$               | US\$               |
| <b>Umlaufvermögen</b>   |                      |                                   |                               |                         |                    |                    |                    |                    |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                      | 1.026.363.204        | 6.311                             | 56.362.229                    | 14.850.230              | 457.273.615        | 265.948.406        | 136.560.604        | 84.662.171         |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 2 31.391.766         | 93.875                            | 6.090.677                     | 1.052.762               | 12.170.410         | 8.516.169          | 7.894.827          | 27.897.105         |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen   | 2.654.347            | –                                 | –                             | –                       | –                  | 493.164            | –                  | –                  |
| Forderungen aus ausgegebenen Anteilen   | 859.198              | –                                 | –                             | –                       | 470                | –                  | –                  | 285.809            |
| Forderungen gegenüber Brokern   | –                    | –                                 | 157.288                       | –                       | 3.329.329          | –                  | –                  | 6.750.000          |
| Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen   | 424.961              | 3.193                             | 793.708                       | 65.943                  | 6.620.856          | 618.210            | 2.863.970          | 377.564            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>1.061.693.476</b> | <b>103.379</b>                    | <b>63.403.902</b>             | <b>15.968.935</b>       | <b>479.394.680</b> | <b>275.575.949</b> | <b>147.319.401</b> | <b>119.972.649</b> |
| <b>Kurzfristige Verbindlichkeiten</b>   |                      |                                   |                               |                         |                    |                    |                    |                    |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                   | 1.994.291            | –                                 | 58.718                        | –                       | 11.134.363         | 209.102            | 404.630            | 111.800            |
| Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen   | 3.085.256            | –                                 | 43.021                        | –                       | –                  | 45.857             | –                  | 30.974             |
| Antizipative Passiva  | 1.396.929            | 15.722                            | 4.667                         | 74.668                  | 155.362            | 305.973            | 78.951             | 58.688             |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen  | 3.978.180            | –                                 | 1.283.485                     | 240.678                 | –                  | –                  | 2.057.352          | 11.874.437         |
| Sonstige Verbindlichkeiten  | 9.719                | 87.657                            | 21.650                        | 54.831                  | 193.646            | 19.235             | 36.435             | 1.120              |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b> | <b>10.464.375</b>    | <b>103.379</b>                    | <b>1.411.541</b>              | <b>370.177</b>          | <b>11.483.371</b>  | <b>580.167</b>     | <b>2.577.368</b>   | <b>12.077.019</b>  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                             | <b>1.051.229.101</b> | <b>–</b>                          | <b>61.992.361</b>             | <b>15.598.758</b>       | <b>467.911.309</b> | <b>274.995.782</b> | <b>144.742.033</b> | <b>107.895.630</b> |

\* Der Absolute Return Multi Strategy wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Halbjahresabschlusses.

## Bilanzen (Fortsetzung)

|   | Corporate Hybrid Bond | Emerging Market Debt - Hard Currency | Emerging Market Debt - Local Currency | Emerging Market Debt Blend | Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend | Emerging Markets Equity | Emerging Markets Select Equity | Euro Bond Absolute Return |
|---|-----------------------|--------------------------------------|---------------------------------------|----------------------------|---|-------------------------|--------------------------------|---------------------------|
| Anm.  | Zum 30. Juni 2023     | Zum 30. Juni 2023                    | Zum 30. Juni 2023                     | Zum 30. Juni 2023          | Zum 30. Juni 2023                                       | Zum 30. Juni 2023       | Zum 30. Juni 2023              | Zum 30. Juni 2023         |
|   | EUR                   | US\$                                 | US\$                                  | US\$                       | US\$  | US\$                    | US\$                           | EUR                       |
| <b>Umlaufvermögen</b>   |                       |                                      |                                       |                            |   |                         |                                |                           |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                      | 1.602.043.058         | 2.403.247.465                        | 1.226.574.066                         | 468.515.359                | 58.440.926  | 114.387.855             | 93.150.712                     | 46.842.001                |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 2 113.490.095         | 45.125.088                           | 42.118.435                            | 20.813.774                 | 2.732.138   | 3.363.446               | 3.636.768                      | 967.934                   |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen   | 26                    | 746.407                              | 3.865.030                             | 13.384                     | 41.220  | 2.315.427               | 2.334.290                      | 586.474                   |
| Forderungen aus ausgegebenen Anteilen   | 1.836.590             | 16.885.423                           | 973.203                               | 714.703                    | –   | 1.408.141               | 1.454                          | –                         |
| Forderungen gegenüber Brokern   | –                     | 25.866.636                           | 17.440.312                            | 8.616.071                  | 1.231.765   | –                       | –                              | 1.737.155                 |
| Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen   | 24.973.501            | 54.886.612                           | 29.305.848                            | 10.883.699                 | 901.072   | 519.197                 | 260.986                        | 519.376                   |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>1.742.343.270</b>  | <b>2.546.757.631</b>                 | <b>1.320.276.894</b>                  | <b>509.556.990</b>         | <b>63.347.121</b>                                       | <b>121.994.066</b>      | <b>99.384.210</b>              | <b>50.652.940</b>         |
| <b>Kurzfristige Verbindlichkeiten</b>   |                       |                                      |                                       |                            |   |                         |                                |                           |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                   | 14.688.097            | 19.752.842                           | 28.231.342                            | 8.471.406                  | 730.092   | 291.952                 | –                              | 352.931                   |
| Kontenüberziehung   | 3 –                   | –                                    | 562                                   | 323                        | –   | –                       | –                              | 1.312                     |
| Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen   | 3.383.410             | 15.629.179                           | 885.078                               | 451.404                    | –   | 151.290                 | 9.603                          | –                         |
| Verbindlichkeiten gegenüber dem Makler  | –                     | –                                    | 8.020.000                             | 1.090.000                  | –   | –                       | –                              | –                         |
| Antizipative Passiva  | 1.024.513             | 1.745.690                            | 949.653                               | 381.433                    | 34.977  | 172.951                 | 94.213                         | 22.562                    |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen  | 2.838.082             | 17.567.181                           | 10.994.991                            | 5.237.538                  | 121.243   | 1.777.847               | 2.308.951                      | 2.041.028                 |
| Sonstige Verbindlichkeiten  | 19.430                | 60.519                               | 6.614.699                             | 1.813.884                  | 121.876   | 399.620                 | 203.025                        | 60.861                    |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b> | <b>21.953.532</b>     | <b>54.755.411</b>                    | <b>55.696.325</b>                     | <b>17.445.988</b>          | <b>1.008.188</b>  | <b>2.793.660</b>        | <b>2.615.792</b>               | <b>2.478.694</b>          |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                             | <b>1.720.389.738</b>  | <b>2.492.002.220</b>                 | <b>1.264.580.569</b>                  | <b>492.111.002</b>         | <b>62.338.933</b>                                       | <b>119.200.406</b>      | <b>96.768.418</b>              | <b>48.174.246</b>         |

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Halbjahresabschlusses.

## Bilanzen (Fortsetzung)

|   |      | Euro Opportunistic<br>Bond | European High<br>Yield Bond | European<br>Sustainable Equity | Event Driven         | Global Bond          | Global Diversified<br>Income FMP –<br>2024 | Global Equity<br>Megatrends | Global Flexible<br>Credit Income |
|---|------|----------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|----------------------|--|-----------------------------|----------------------------------|
|   | Anm. | Zum<br>30. Juni 2023       | Zum<br>30. Juni 2023        | Zum<br>30. Juni 2023           | Zum<br>30. Juni 2023 | Zum<br>30. Juni 2023 | Zum<br>30. Juni 2023                       | Zum<br>30. Juni 2023        | Zum<br>30. Juni 2023             |
|   |      | EUR                        | EUR                         | EUR                            | US\$                 | US\$                 | US\$                                       | US\$                        | US\$                             |
| <b>Umlaufvermögen</b>   |      |                            |                             |                                |                      |                      |  |                             |                                  |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                      |      | 9.112.292                  | 77.006.831                  | 169.803.221                    | 76.774.031           | 133.440.844          | 150.604.797                                | 99.819.818                  | 341.918.661                      |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 2    | 640.256                    | 2.996.592                   | 1.113.586                      | 9.565.910            | 7.875.870            | 8.951.889                                  | 2.359.193                   | 12.490.436                       |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen   |      | 202.474                    | 2.086                       | 357                            | –                    | 942.627              | –  | 3                           | 362.971                          |
| Forderungen aus ausgegebenen Anteilen   |      | –                          | 775                         | 736.466                        | 136.987              | 35.006               | –  | 700.416                     | 16.971                           |
| Forderungen gegenüber Brokern   |      | 222.532                    | –                           | –                              | –                    | 1.138.632            | –  | –                           | 3.825.961                        |
| Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen   |      | 118.305                    | 1.156.873                   | 116.088                        | 2.394                | 994.290              | 1.419.580                                  | 184.560                     | 5.462.767                        |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   |      | <b>10.295.859</b>          | <b>81.163.157</b>           | <b>171.769.718</b>             | <b>86.479.322</b>    | <b>144.427.269</b>   | <b>160.976.266</b>                         | <b>103.063.990</b>          | <b>364.077.767</b>               |
| <b>Kurzfristige Verbindlichkeiten</b>   |      |                            |                             |                                |                      |                      |  |                             |                                  |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                   |      | 61.163                     | 276.536                     | –                              | 61.574               | 3.308.113            | 108.675                                    | –                           | 3.851.868                        |
| Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen   |      | –                          | 312                         | –                              | 17.149               | 533                  | 322.863                                    | 121.372                     | 18.528                           |
| Antizipative Passiva  |      | 13.094                     | 14.849                      | 68.292                         | 45.902               | 29.093               | 120.910                                    | 170.404                     | 204.932                          |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen  |      | 598.324                    | 1.454.061                   | 760.762                        | 389                  | 4.791.583            | –  | –                           | 15.580.902                       |
| Sonstige Verbindlichkeiten  |      | 23.989                     | 12.027                      | 11.362                         | 221.324              | 81.307               | 11.333                                     | 7.166                       | 28.147                           |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b> |      | <b>696.570</b>             | <b>1.757.785</b>            | <b>840.416</b>                 | <b>346.338</b>       | <b>8.210.629</b>     | <b>563.781</b>                             | <b>298.942</b>              | <b>19.684.377</b>                |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                             |      | <b>9.599.289</b>           | <b>79.405.372</b>           | <b>170.929.302</b>             | <b>86.132.984</b>    | <b>136.216.640</b>   | <b>160.412.485</b>                         | <b>102.765.048</b>          | <b>344.393.390</b>               |

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Halbjahresabschlusses.

## Bilanzen (Fortsetzung)

| Anm.  | Global High Yield<br>SDG Engagement | Global High Yield<br>Sustainable Action | Global Investment<br>Grade Credit | Global<br>Opportunistic<br>Bond | Global Real Estate<br>Securities | Global Sustainable<br>Equity | High Yield Bond      | InnovAsia 5G         |         |
|---|-------------------------------------|---|-----------------------------------|---------------------------------|----------------------------------|------------------------------|----------------------|----------------------|---------|
|   | Zum<br>30. Juni 2023                | Zum<br>30. Juni 2023*                   | Zum<br>30. Juni 2023              | Zum<br>30. Juni 2023            | Zum<br>30. Juni 2023             | Zum<br>30. Juni 2023         | Zum<br>30. Juni 2023 | Zum<br>30. Juni 2023 |         |
|   | US\$                                | US\$                                    | US\$                              | US\$                            | US\$                             | US\$                         | US\$                 | US\$                 |         |
| <b>Umlaufvermögen</b>   |                                     |   |                                   |                                 |                                  |                              |                      |                      |         |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                      | 534.257.442                         | 43.352                                  | 77.993.985                        | 68.166.369                      | 32.552.210                       | 148.932.306                  | 2.122.569.399        | 20.360.194           |         |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 2                                   | 26.490.160                              | 4.440                             | 2.927.523                       | 2.155.826                        | 835.959                      | 1.239.689            | 90.767.761           | 827.112 |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen   | 1.713.453                           | 41.236                                  | 385.287                           | 139.614                         | 5.887                            | 47                           | 10.488.255           | 28                   |         |
| Forderungen aus ausgegebenen Anteilen   | 218.532                             | –                                       | –                                 | 7.050                           | 138.180                          | 97.459                       | 2.302.733            | –                    |         |
| Forderungen gegenüber Brokern   | –                                   | –                                       | –                                 | 1.289.448                       | –                                | –                            | –                    | –                    |         |
| Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen   | 8.609.478                           | 77.808                                  | 866.480                           | 703.168                         | 124.927                          | 87.515                       | 36.599.354           | 26.904               |         |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>571.289.065</b>                  | <b>166.836</b>                          | <b>82.173.275</b>                 | <b>72.461.475</b>               | <b>33.657.163</b>                | <b>150.357.016</b>           | <b>2.262.727.502</b> | <b>21.214.238</b>    |         |
| <b>Kurzfristige Verbindlichkeiten</b>   |                                     |   |                                   |                                 |                                  |                              |                      |                      |         |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                   | 1.546.329                           | 27.682                                  | 120.622                           | 2.407.819                       | 81.118                           | –                            | 13.405.321           | 71.701               |         |
| Kontenüberziehung   | 3                                   | –                                       | –                                 | –                               | –                                | –                            | 152                  | –                    |         |
| Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen   | 1.175.946                           | –                                       | –                                 | –                               | 68.660                           | 31.000                       | 4.757.338            | –                    |         |
| Antizipative Passiva  | 170.925                             | 64.241                                  | 60.301                            | 27.246                          | 27.026                           | 76.743                       | 2.035.137            | 86.773               |         |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen  | 7.683.830                           | 41.440                                  | 477.669                           | 2.219.660                       | 81.677                           | –                            | 22.221.481           | 32.300               |         |
| Sonstige Verbindlichkeiten  | 11.681                              | 33.473                                  | 4.222                             | 49.762                          | 15.190                           | 46                           | 77.665               | 16.709               |         |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b> | <b>10.588.711</b>                   | <b>166.836</b>                          | <b>662.814</b>                    | <b>4.704.487</b>                | <b>273.671</b>                   | <b>107.789</b>               | <b>42.497.094</b>    | <b>207.483</b>       |         |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                             | <b>560.700.354</b>                  | <b>–</b>                                | <b>81.510.461</b>                 | <b>67.756.988</b>               | <b>33.383.492</b>                | <b>150.249.227</b>           | <b>2.220.230.408</b> | <b>21.006.755</b>    |         |

\* Der Global High Yield Sustainable Action wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst.

## Bilanzen (Fortsetzung)

|   |      | Japan Equity<br>Engagement  | Macro<br>Opportunities FX   | Multi-Asset<br>Income        | Next Generation<br>Mobility  | Next Generation<br>Space Economy | Short Duration<br>Emerging Market<br>Debt | Short Duration<br>High Yield SDG<br>Engagement | Strategic Income             |
|---|------|-----------------------------|-----------------------------|------------------------------|------------------------------|----------------------------------|---|--|------------------------------|
|   | Anm. | Zum<br>30. Juni 2023<br>JPY | Zum<br>30. Juni 2023<br>EUR | Zum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | Zum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | Zum<br>30. Juni 2023<br>US\$     | Zum<br>30. Juni 2023<br>US\$              | Zum<br>30. Juni 2023<br>US\$                   | Zum<br>30. Juni 2023<br>US\$ |
| <b>Umlaufvermögen</b>   |      |                             |                             |                              |                              |                                  |   |  |                              |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                      |      | 23.402.815.103              | 34.111.776                  | 365.405                      | 159.397.583                  | 13.298.554                       | 4.721.979.849                             | 701.960.688                                    | 1.618.191.659                |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 2    | 765.160.735                 | 693.908                     | 9.467.247                    | 11.014.598                   | 401.894                          | 38.954.559                                | 14.489.730                                     | 99.718.970                   |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen   |      | –                           | 596.295                     | –                            | 680.322                      | 29.112                           | 2.978.868                                 | 19.543.152                                     | 34.372.205                   |
| Forderungen aus ausgegebenen Anteilen   |      | –                           | 162.430                     | –                            | 243.964                      | 113.156                          | 5.838.448                                 | 639.617  | 11.140.867                   |
| Forderungen gegenüber Brokern   |      | –                           | –                           | 40.176                       | –                            | –                                | –   | –  | 6.826.938                    |
| Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen   |      | 30.092.688                  | 88.208                      | 114.529                      | 171.827                      | 7.828                            | 55.137.422                                | 10.490.684                                     | 11.925.226                   |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   |      | <b>24.198.068.526</b>       | <b>35.652.617</b>           | <b>9.987.357</b>             | <b>171.508.294</b>           | <b>13.850.544</b>                | <b>4.824.889.146</b>                      | <b>747.123.871</b>                             | <b>1.782.175.865</b>         |
| <b>Kurzfristige Verbindlichkeiten</b>   |      |                             |                             |                              |                              |                                  |   |  |                              |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                   |      | 87.510.379                  | 4.247.855                   | 110.257                      | 4.261                        | –                                | 32.518.679                                | 16.944.350                                     | 31.971.503                   |
| Kontenüberziehung   | 3    | 168.811                     | –                           | 17.177                       | –                            | –                                | –   | –  | 2.716                        |
| Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen   |      | –                           | 1.456.171                   | 2.345.359                    | 341.141                      | –                                | 15.585.482                                | 214.190  | 3.259.749                    |
| Verbindlichkeiten gegenüber dem Makler  |      | –                           | –                           | –                            | –                            | –                                | –   | –  | 60.000                       |
| Antizipative Passiva  |      | 6.061.949                   | 26.465                      | 86.490                       | 252.655                      | 33.719                           | 2.492.120                                 | 368.833  | 1.081.858                    |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen  |      | 6.215.888                   | 1.106                       | 773                          | 186                          | 81.235                           | 7.724.276                                 | 11.385.747                                     | 269.536.379                  |
| Sonstige Verbindlichkeiten  |      | 385.415                     | 11.527                      | 44.717                       | 24.031                       | 12.520                           | 11.984                                    | 25.831   | 756.974                      |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b> |      | <b>100.342.442</b>          | <b>5.743.124</b>            | <b>2.604.773</b>             | <b>622.274</b>               | <b>127.474</b>                   | <b>58.332.541</b>                         | <b>28.938.951</b>                              | <b>306.669.179</b>           |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                             |      | <b>24.097.726.084</b>       | <b>29.909.493</b>           | <b>7.382.584</b>             | <b>170.886.020</b>           | <b>13.723.070</b>                | <b>4.766.556.605</b>                      | <b>718.184.920</b>                             | <b>1.475.506.686</b>         |

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Halbjahresabschlusses.

## Bilanzen (Fortsetzung)

|   | Sustainable Asia<br>High Yield | Sustainable<br>Emerging Market<br>Corporate Debt | Sustainable<br>Emerging Market<br>Debt - Hard<br>Currency | Systematic Global<br>Sustainable Value | Tactical Macro                | Ultra Short Term<br>Euro Bond | Uncorrelated<br>Strategies   | Uncorrelated<br>Trading        |
|---|--------------------------------|--|---|--|-------------------------------|-------------------------------|------------------------------|--------------------------------|
| Anm.  | Zum<br>30. Juni 2023<br>US\$   | Zum<br>30. Juni 2023<br>US\$                     | Zum<br>30. Juni 2023<br>US\$                              | Zum<br>30. Juni 2023<br>US\$           | Zum<br>30. Juni 2023*<br>US\$ | Zum<br>30. Juni 2023<br>EUR   | Zum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | Zum<br>30. Juni 2023**<br>US\$ |
| <b>Umlaufvermögen</b>   |                                |  |   |  |                               |                               |                              |                                |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                      | 26.301.961                     | 92.983.306                                       | 328.900.393   | 45.823.437                             | –                             | 864.284.603                   | 2.119.202.435                | –                              |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 2 1.771.725                    | 4.235.652  | 4.216.988   | 650.831                                | 10.501.333                    | 36.706.858                    | 264.128.069                  | 267.447                        |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen   | 95.545                         | 7.280  | 6.008.146   | 333.685                                | –                             | 972.488                       | 53.474.680                   | –                              |
| Forderungen aus ausgegebenen Anteilen   | –                              | 1.072  | 8.037   | 3.857                                  | 6.520.000                     | 3.217.380                     | 4.401.283                    | –                              |
| Forderungen gegenüber Brokern   | 48.070                         | 131.342  | 6.030.188   | –                                      | –                             | 8.771.717                     | 420.519.826                  | 40.000                         |
| Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen   | 630.562                        | 1.445.752  | 5.590.636   | 99.907                                 | –                             | 7.242.866                     | 134.980.051                  | 63.225                         |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>28.847.863</b>              | <b>98.804.404</b>                                | <b>350.754.388</b>  | <b>46.911.717</b>                      | <b>17.021.333</b>             | <b>921.195.912</b>            | <b>2.996.706.344</b>         | <b>370.672</b>                 |
| <b>Kurzfristige Verbindlichkeiten</b>   |                                |  |   |  |                               |                               |                              |                                |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                   | 14.136                         | 194.970  | 3.534.760   | 10.841                                 | –                             | 3.049.436                     | 558.160.115                  | –                              |
| Kontenüberziehung   | 3 –                            | –  | –   | –                                      | –                             | –                             | 2.638                        | 168                            |
| Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen   | –                              | 34.025   | 5.438.836   | 380.643                                | –                             | 1.196.918                     | 14.596.408                   | –                              |
| Verbindlichkeiten gegenüber dem Makler  | –                              | –  | –   | –                                      | –                             | –                             | 2.630.000                    | –                              |
| Antizipative Passiva  | 55.711                         | 112.143  | 152.501   | 27.144                                 | –                             | 196.201                       | 1.300.432                    | 138.882                        |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen  | 413.669                        | 1.710.901  | 1.308.195   | 335.157                                | –                             | 10.147.937                    | 26.801.245                   | –                              |
| Sonstige Verbindlichkeiten  | 3.601                          | 32.529   | 22.249  | 61.374                                 | –                             | 351.425                       | 111.497.607                  | 231.622                        |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b> | <b>487.117</b>                 | <b>2.084.568</b>                                 | <b>10.456.541</b>   | <b>815.159</b>                         | <b>–</b>                      | <b>14.941.917</b>             | <b>714.988.445</b>           | <b>370.672</b>                 |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                             | <b>28.360.746</b>              | <b>96.719.836</b>                                | <b>340.297.847</b>  | <b>46.096.558</b>                      | <b>17.021.333</b>             | <b>906.253.995</b>            | <b>2.281.717.899</b>         | <b>–</b>                       |

\* Der Tactical Macro wurde am 30. Juni 2023 aufgelegt.

\*\* Der Uncorrelated Trading wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Halbjahresabschlusses.

## Bilanzen (Fortsetzung)

| Anm.  | US Equity             | US Equity Index<br>PutWrite | US Large Cap<br>Value | US Long Short<br>Equity | US Multi Cap<br>Opportunities | US Real Estate<br>Securities | US Small Cap          | US Small Cap<br>Intrinsic Value |
|---|-----------------------|-----------------------------|-----------------------|-------------------------|-------------------------------|------------------------------|-----------------------|---------------------------------|
|   | Zum                   | Zum                         | Zum                   | Zum                     | Zum                           | Zum                          | Zum                   | Zum                             |
|   | 30. Juni 2023<br>US\$ | 30. Juni 2023<br>US\$       | 30. Juni 2023<br>US\$ | 30. Juni 2023<br>US\$   | 30. Juni 2023<br>US\$         | 30. Juni 2023<br>US\$        | 30. Juni 2023<br>US\$ | 30. Juni 2023<br>US\$           |
| <b>Umlaufvermögen</b>   |                       |                             |                       |                         |                               |                              |                       |                                 |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                      | 40.013.189            | 633.348.147                 | 1.776.727.431         | 190.324.226             | 415.032.041                   | 545.921.285                  | 624.999.771           | 255.425.129                     |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 2 953.326             | 46.245.854                  | 70.674.098            | 18.724.564              | 860.844                       | 17.306.089                   | 5.367.278             | 24.778.893                      |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen   | –                     | 985.460                     | 27.432.970            | 7.875.849               | 1.002.757                     | 302.465                      | 318.709               | –                               |
| Forderungen aus ausgegebenen Anteilen   | –                     | 3.351.081                   | 2.847.505             | 259.536                 | 646.359                       | 750.859                      | 935.451               | 693.332                         |
| Forderungen gegenüber Brokern   | –                     | –                           | –                     | 17.353.211              | –                             | –                            | –                     | –                               |
| Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen   | 8.361                 | 744.361                     | 1.777.067             | 1.126.595               | 215.211                       | 1.448.627                    | 225.845               | 100.120                         |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>40.974.876</b>     | <b>684.674.903</b>          | <b>1.879.459.071</b>  | <b>235.663.981</b>      | <b>417.757.212</b>            | <b>565.729.325</b>           | <b>631.847.054</b>    | <b>280.997.474</b>              |
| <b>Kurzfristige Verbindlichkeiten</b>   |                       |                             |                       |                         |                               |                              |                       |                                 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                   | 2.702.136             | 3.374.906                   | 203.695               | 8.390.982               | 1.390.983                     | 1.253.756                    | 172.250               | –                               |
| Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen   | –                     | 976.953                     | 3.508.716             | 1.999.700               | 2.303.164                     | 4.222.996                    | 1.699.351             | 192.500                         |
| Antizipative Passiva  | 29.494                | 285.115                     | 907.440               | 271.151                 | 504.028                       | 1.062.881                    | 572.072               | 197.512                         |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen  | –                     | 27.366                      | 8.399.265             | 1.934.474               | –                             | –                            | 589.306               | 59.574                          |
| Sonstige Verbindlichkeiten  | 7.938                 | 15.686                      | 1.042                 | 642.818                 | 28.468                        | 37.941                       | 29.239                | 1.088                           |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b> | <b>2.739.568</b>      | <b>4.680.026</b>            | <b>13.020.158</b>     | <b>13.239.125</b>       | <b>4.226.643</b>              | <b>6.577.574</b>             | <b>3.062.218</b>      | <b>450.674</b>                  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                             | <b>38.235.308</b>     | <b>679.994.877</b>          | <b>1.866.438.913</b>  | <b>222.424.856</b>      | <b>413.530.569</b>            | <b>559.151.751</b>           | <b>628.784.836</b>    | <b>280.546.800</b>              |

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Halbjahresabschlusses.

## Bilanzen (Fortsetzung)

|   | Fonds insgesamt* |                       |
|---|------------------|-----------------------|
|   | Zum              |                       |
| Anm.  | 30. Juni 2023    |                       |
|   | US\$             |                       |
| <b>Umlaufvermögen</b>   |                  |                       |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                      |                  | 27.147.539.813        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 2                | 1.189.839.113         |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen   |                  | 184.558.858           |
| Forderungen aus ausgegebenen Anteilen   |                  | 68.702.863            |
| Forderungen gegenüber Brokern   |                  | 529.472.156           |
| Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen   |                  | 421.759.618           |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   |                  | <b>29.541.872.421</b> |
| <b>Kurzfristige Verbindlichkeiten</b>   |                  |                       |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                   |                  | 773.077.380           |
| Kontenüberziehung   | 3                | 26.335                |
| Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen   |                  | 90.530.425            |
| Verbindlichkeiten gegenüber dem Makler  |                  | 11.800.000            |
| Antizipative Passiva  |                  | 19.855.549            |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen  |                  | 460.180.881           |
| Sonstige Verbindlichkeiten  |                  | 124.008.863           |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b> |                  | <b>1.479.479.433</b>  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                             |                  | <b>28.062.392.988</b> |

\* Der konsolidierte Abschluss wurde um im Namen des Fonds gehaltener Salden und um Überkreuzinvestitionen zwischen den Portfolios bereinigt. Details zu Überkreuzinvestitionen zwischen Teilfonds sind Anmerkung 8 der Anmerkungen zum ungeprüften verkürzten Halbjahresabschluss zu entnehmen.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Halbjahresabschlusses.



## Bilanzen (Fortsetzung)

|   | 5G Connectivity              | Absolute Return<br>Multi Strategy | Asian Debt - Hard<br>Currency | China A-Share<br>Equity     | China Bond                  | China Equity                 | CLO Income                   | Commodities                  |
|---|------------------------------|-----------------------------------|-------------------------------|-----------------------------|-----------------------------|------------------------------|------------------------------|------------------------------|
|   | Zum                          | Zum                               | Zum                           | Zum                         | Zum                         | Zum                          | Zum                          | Zum                          |
| Anm.  | 31. Dezember<br>2022<br>US\$ | 31. Dezember<br>2022*<br>US\$     | 31. Dezember<br>2022<br>US\$  | 31. Dezember<br>2022<br>CNY | 31. Dezember<br>2022<br>CNY | 31. Dezember<br>2022<br>US\$ | 31. Dezember<br>2022<br>US\$ | 31. Dezember<br>2022<br>US\$ |
| <b>Umlaufvermögen</b>   |                              |                                   |                               |                             |                             |                              |                              |                              |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                      | 965.036.484                  | 6.766                             | 20.262.516                    | 15.317.693                  | 429.085.411                 | 307.949.549                  | 116.138.374                  | 77.727.468                   |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 2 34.119.654                 | 93.179                            | 1.180.261                     | 952.930                     | 22.788.957                  | 8.545.056                    | 20.349.795                   | 8.094.998                    |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen   | 3.505.517                    | –                                 | –                             | –                           | 19.609.680                  | 2.164.762                    | 934                          | 5.565.123                    |
| Forderungen aus ausgegebenen Anteilen   | 1.012.596                    | –                                 | –                             | –                           | 194                         | –                            | –                            | 311.481                      |
| Forderungen gegenüber Brokern   | –                            | –                                 | 55.253                        | –                           | 839.388                     | –                            | 320.000                      | –                            |
| Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen   | 432.516                      | –                                 | 299.519                       | 256.475                     | 44.536.205                  | 227                          | 2.790.144                    | 202.284                      |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>1.004.106.767</b>         | <b>99.945</b>                     | <b>21.797.549</b>             | <b>16.527.098</b>           | <b>516.859.835</b>          | <b>318.659.594</b>           | <b>139.599.247</b>           | <b>91.901.354</b>            |
| <b>Kurzfristige Verbindlichkeiten</b>   |                              |                                   |                               |                             |                             |                              |                              |                              |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                   | 3.280.059                    | –                                 | 88.173                        | –                           | 2.739.680                   | 817.712                      | 1.324.169                    | 333.046                      |
| Kontenüberziehung   | 3 129                        | –                                 | –                             | –                           | –                           | –                            | –                            | –                            |
| Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen   | 1.380.674                    | –                                 | 18.123                        | –                           | 1.522.147                   | 1.759                        | –                            | 11.154                       |
| Verbindlichkeiten gegenüber dem Makler  | –                            | –                                 | –                             | –                           | –                           | –                            | –                            | 5.450.000                    |
| Antizipative Passiva  | 1.542.416                    | –                                 | 43.612                        | 207.005                     | 367.670                     | 405.069                      | 106.080                      | 85.152                       |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen  | 4.858.404                    | –                                 | –                             | –                           | 58.969.849                  | –                            | 85.088                       | –                            |
| Sonstige Verbindlichkeiten  | 34.892                       | 99.945                            | 21.432                        | 78.335                      | 216.910                     | 21.378                       | 46.446                       | 24.573                       |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b> | <b>11.096.574</b>            | <b>99.945</b>                     | <b>171.340</b>                | <b>285.340</b>              | <b>63.816.256</b>           | <b>1.245.918</b>             | <b>1.561.783</b>             | <b>5.903.925</b>             |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                             | <b>993.010.193</b>           | <b>–</b>                          | <b>21.626.209</b>             | <b>16.241.758</b>           | <b>453.043.579</b>          | <b>317.413.676</b>           | <b>138.037.464</b>           | <b>85.997.429</b>            |

\* Der Absolute Return Multi Strategy wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Halbjahresabschlusses.

## Bilanzen (Fortsetzung)

|   | Corporate Hybrid Bond | Emerging Market Debt - Hard Currency | Emerging Market Debt - Local Currency | Emerging Market Debt Blend | Emerging Market Investment Grade Blend | Emerging Markets Equity | Emerging Markets Select Equity | Euro Bond Absolute Return |
|---|-----------------------|--------------------------------------|---------------------------------------|----------------------------|--|-------------------------|--------------------------------|---------------------------|
|   | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2022                | Zum 31. Dezember 2022                 | Zum 31. Dezember 2022      | Zum 31. Dezember 2022                  | Zum 31. Dezember 2022   | Zum 31. Dezember 2022          | Zum 31. Dezember 2022     |
| Anm.  | EUR                   | US\$                                 | US\$                                  | US\$                       | US\$                                   | US\$                    | US\$                           | EUR                       |
| <b>Umlaufvermögen</b>   |                       |                                      |                                       |                            |  |                         |                                |                           |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                      | 1.684.830.088         | 2.346.546.593                        | 1.360.283.509                         | 463.102.332                | 50.898.306                             | 189.787.819             | 90.426.979                     | 47.520.374                |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 2 124.965.163         | 107.924.157                          | 12.401.585                            | 4.035.002                  | 3.413.071                              | 5.356.295               | 3.402.931                      | 1.710.742                 |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen   | –                     | –                                    | 3.199.020                             | 16.293.590                 | 7.893                                  | –                       | 34.597                         | 86.705                    |
| Forderungen aus ausgegebenen Anteilen   | 1.293.606             | 4.103.978                            | 883.605                               | 275.687                    | –                                      | 362.074                 | 16.812                         | 13.876.229                |
| Forderungen gegenüber Brokern   | –                     | 3.276.177                            | 54.984.796                            | 9.999.389                  | 424.677                                | –                       | –                              | 252.313                   |
| Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen   | 33.042.330            | 59.709.417                           | 30.010.757                            | 11.304.641                 | 746.361                                | 550.079                 | 193.164                        | 435.363                   |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>1.844.131.187</b>  | <b>2.521.560.322</b>                 | <b>1.461.763.272</b>                  | <b>505.010.641</b>         | <b>55.490.308</b>                      | <b>196.056.267</b>      | <b>94.074.483</b>              | <b>63.881.726</b>         |
| <b>Kurzfristige Verbindlichkeiten</b>   |                       |                                      |                                       |                            |  |                         |                                |                           |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                   | 57.668.909            | 11.868.883                           | 57.448.294                            | 13.780.086                 | 542.408                                | 666.859                 | –                              | 1.279.616                 |
| Kontenüberziehung   | 3 –                   | –                                    | –                                     | –                          | 12                                     | 345                     | –                              | 388                       |
| Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen   | 1.782.089             | 14.282.774                           | 1.482.933                             | 621.342                    | 1.033                                  | 2.563.061               | 577                            | 13.827.198                |
| Verbindlichkeiten gegenüber dem Makler  | –                     | –                                    | 3.980.000                             | 840.000                    | –                                      | –                       | –                              | –                         |
| Antizipative Passiva  | 1.193.107             | 2.024.113                            | 1.301.053                             | 469.534                    | 63.835                                 | 289.525                 | 124.746                        | 51.536                    |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen  | 1.276.923             | 1.572.454                            | 2.187.526                             | 1.940.067                  | 499.247                                | 38.266                  | 40.672                         | 46.881                    |
| Sonstige Verbindlichkeiten  | 55.351                | 107.170                              | 9.099.023                             | 17.178.132                 | 109.392                                | 690.456                 | 146.366                        | 148.231                   |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b> | <b>61.976.379</b>     | <b>29.855.394</b>                    | <b>75.498.829</b>                     | <b>34.829.161</b>          | <b>1.215.927</b>                       | <b>4.248.512</b>        | <b>312.361</b>                 | <b>15.353.850</b>         |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                             | <b>1.782.154.808</b>  | <b>2.491.704.928</b>                 | <b>1.386.264.443</b>                  | <b>470.181.480</b>         | <b>54.274.381</b>                      | <b>191.807.755</b>      | <b>93.762.122</b>              | <b>48.527.876</b>         |

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Halbjahresabschlusses.

## Bilanzen (Fortsetzung)

|   | Euro Opportunistic<br>Bond  | European High<br>Yield Bond | European<br>Sustainable Equity | Event Driven                | Global Bond                 | Global Diversified<br>Income FMP –<br>2024 | Global Equity<br>Megatrends | Global Flexible<br>Credit Income |
|---|-----------------------------|-----------------------------|--------------------------------|-----------------------------|-----------------------------|--|-----------------------------|----------------------------------|
|   | Zum<br>31. Dezember<br>2022 | Zum<br>31. Dezember<br>2022 | Zum<br>31. Dezember<br>2022    | Zum<br>31. Dezember<br>2022 | Zum<br>31. Dezember<br>2022 | Zum<br>31. Dezember<br>2022                | Zum<br>31. Dezember<br>2022 | Zum<br>31. Dezember<br>2022      |
| Anm.  | EUR                         | EUR                         | EUR                            | US\$                        | US\$                        | US\$                                       | US\$                        | US\$                             |
| <b>Umlaufvermögen</b>   |                             |                             |                                |                             |                             |  |                             |                                  |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                      | 8.590.398                   | 33.741.184                  | 174.388.827                    | 34.759.787                  | 133.785.619                 | 154.791.860                                | 79.465.335                  | 385.148.567                      |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 2 473.148                   | 1.372.196                   | 1.487.612                      | 6.873.963                   | 4.700.090                   | 50.248.991                                 | 77.732                      | 10.118.861                       |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen   | 121.972                     | 2                           | –                              | –                           | 834.394                     | –  | –                           | 154.968                          |
| Forderungen aus ausgegebenen Anteilen   | –                           | 13.705.182                  | 5.007.586                      | –                           | –                           | –  | 40.452                      | 9.991                            |
| Forderungen gegenüber Brokern   | 258.450                     | –                           | –                              | –                           | 376.572                     | –  | –                           | 5.284.784                        |
| Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen   | 102.378                     | 544.743                     | 172.097                        | 8.601                       | 867.942                     | 1.581.894                                  | 115.036                     | 6.555.070                        |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>9.546.346</b>            | <b>49.363.307</b>           | <b>181.056.122</b>             | <b>41.642.351</b>           | <b>140.564.617</b>          | <b>206.622.745</b>                         | <b>79.698.555</b>           | <b>407.272.241</b>               |
| <b>Kurzfristige Verbindlichkeiten</b>   |                             |                             |                                |                             |                             |  |                             |                                  |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                   | 112.447                     | 3.113.019                   | –                              | 18.616                      | 2.112.792                   | 417  | –                           | 12.005.976                       |
| Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen   | –                           | 13.707.154                  | 3.727.664                      | –                           | –                           | 46.050.000                                 | 134.741                     | 28.122                           |
| Antizipative Passiva  | 34.664                      | 50.457                      | 134.129                        | 76.524                      | 65.484                      | 167.100                                    | 188.716                     | 280.150                          |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen  | 17.717                      | 20.048                      | 1.319.645                      | –                           | 3.505.750                   | –  | 37                          | 352.483                          |
| Sonstige Verbindlichkeiten  | 86.776                      | 18.101                      | 20.454                         | 100.539                     | 69.295                      | 9.142                                      | 30.696                      | 79.181                           |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b> | <b>251.604</b>              | <b>16.908.779</b>           | <b>5.201.892</b>               | <b>195.679</b>              | <b>5.753.321</b>            | <b>46.226.659</b>                          | <b>354.190</b>              | <b>12.745.912</b>                |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                             | <b>9.294.742</b>            | <b>32.454.528</b>           | <b>175.854.230</b>             | <b>41.446.672</b>           | <b>134.811.296</b>          | <b>160.396.086</b>                         | <b>79.344.365</b>           | <b>394.526.329</b>               |

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Halbjahresabschlusses.

## Bilanzen (Fortsetzung)

|   | Global High Yield<br>SDG Engagement | Global High Yield<br>Sustainable Action | Global Investment<br>Grade Credit | Global<br>Opportunistic<br>Bond | Global Real Estate<br>Securities | Global Sustainable<br>Equity | High Yield Bond      | InnovAsia 5G         |
|---|-------------------------------------|---|-----------------------------------|---------------------------------|----------------------------------|------------------------------|----------------------|----------------------|
|   | Zum                                 | Zum                                     | Zum                               | Zum                             | Zum                              | Zum                          | Zum                  | Zum                  |
| Anm.  | 31. Dezember<br>2022                | 31. Dezember<br>2022                    | 31. Dezember<br>2022              | 31. Dezember<br>2022            | 31. Dezember<br>2022             | 31. Dezember<br>2022         | 31. Dezember<br>2022 | 31. Dezember<br>2022 |
|   | US\$                                | US\$                                    | US\$                              | US\$                            | US\$                             | US\$                         | US\$                 | US\$                 |
| <b>Umlaufvermögen</b>   |                                     |   |                                   |                                 |                                  |                              |                      |                      |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                      | 286.905.751                         | 14.547.172                              | 83.541.497                        | 80.110.952                      | 38.072.868                       | 130.524.482                  | 2.170.021.483        | 14.325.847           |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 2 5.259.514                         | 1.033.221                               | 3.565.231                         | 5.863.263                       | 1.125.241                        | 1.070.714                    | 134.476.435          | 596.336              |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen   | 71.005                              | 253                                     | –                                 | 406.959                         | 13                               | –                            | 4.627.097            | 41.445               |
| Forderungen aus ausgegebenen Anteilen   | 123.184.909                         | –                                       | –                                 | 14                              | –                                | 4.411.790                    | 3.517.926            | –                    |
| Forderungen gegenüber Brokern   | –                                   | –                                       | –                                 | 1.228.672                       | –                                | –                            | 300.000              | –                    |
| Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen   | 5.725.188                           | 279.956                                 | 882.351                           | 908.005                         | 119.762                          | 91.089                       | 38.784.027           | 69.903               |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>421.146.367</b>                  | <b>15.860.602</b>                       | <b>87.989.079</b>                 | <b>88.517.865</b>               | <b>39.317.884</b>                | <b>136.098.075</b>           | <b>2.351.726.968</b> | <b>15.033.531</b>    |
| <b>Kurzfristige Verbindlichkeiten</b>   |                                     |   |                                   |                                 |                                  |                              |                      |                      |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                   | 9.426.254                           | 358.029                                 | 1.642.819                         | 5.529.567                       | 147.763                          | –                            | 25.597.669           | 78.732               |
| Kontenüberziehung   | 3 15                                | –                                       | –                                 | –                               | 86                               | –                            | 149                  | –                    |
| Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen   | 144.749                             | –                                       | –                                 | 30                              | 69.724                           | 4.397.123                    | 5.887.375            | 32.016               |
| Antizipative Passiva  | 120.597                             | 40.994                                  | 90.568                            | 75.034                          | 58.301                           | 116.088                      | 2.442.382            | 103.033              |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen  | 74.390.132                          | 406.264                                 | –                                 | 6.676.859                       | –                                | 7                            | 18.780.475           | 48.481               |
| Sonstige Verbindlichkeiten  | 111.242                             | 8.247                                   | 347.050                           | 130.932                         | 19.590                           | 6.658                        | 267.206              | 22.276               |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b> | <b>84.192.989</b>                   | <b>813.534</b>                          | <b>2.080.437</b>                  | <b>12.412.422</b>               | <b>295.464</b>                   | <b>4.519.876</b>             | <b>52.975.256</b>    | <b>284.538</b>       |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                             | <b>336.953.378</b>                  | <b>15.047.068</b>                       | <b>85.908.642</b>                 | <b>76.105.443</b>               | <b>39.022.420</b>                | <b>131.578.199</b>           | <b>2.298.751.712</b> | <b>14.748.993</b>    |

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Halbjahresabschlusses.

## Bilanzen (Fortsetzung)

|   | Japan Equity<br>Engagement  | Macro<br>Opportunities FX   | Multi-Asset<br>Income       | Next Generation<br>Mobility | Next Generation<br>Space Economy | Short Duration<br>Emerging Market<br>Debt | Short Duration<br>High Yield SDG<br>Engagement | Strategic Income            |
|---|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|----------------------------------|---|--|-----------------------------|
|   | Zum<br>31. Dezember<br>2022 | Zum<br>31. Dezember<br>2022 | Zum<br>31. Dezember<br>2022 | Zum<br>31. Dezember<br>2022 | Zum<br>31. Dezember<br>2022      | Zum<br>31. Dezember<br>2022               | Zum<br>31. Dezember<br>2022                    | Zum<br>31. Dezember<br>2022 |
| Anm.  | JPY                         | EUR                         | US\$                        | US\$                        | US\$                             | US\$                                      | US\$   | US\$                        |
| <b>Umlaufvermögen</b>   |                             |                             |                             |                             |                                  |   |  |                             |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                      | 20.251.986.644              | 35.753.350                  | 9.231.268                   | 138.694.644                 | 7.981.674                        | 4.901.636.040                             | 536.260.884                                    | 1.454.526.951               |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 2 421.921.338               | 131.107                     | 1.795.321                   | 9.717.383                   | 555.274                          | 196.555.616                               | 27.853.758                                     | 104.978.500                 |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen   | –                           | 67                          | 284.261                     | 72.621                      | –                                | 11.003                                    | 56.462   | 34.551.202                  |
| Forderungen aus ausgegebenen Anteilen   | –                           | 66.778                      | 67.840                      | 279.664                     | 19.545                           | 9.283.967                                 | 2.421.432                                      | 5.263.162                   |
| Forderungen gegenüber Brokern   | –                           | –                           | 628.167                     | –                           | –                                | –   | –  | 3.722.665                   |
| Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen   | 28.870.308                  | 107.020                     | 189.122                     | 53.143                      | 13.778                           | 77.069.801                                | 7.908.182                                      | 13.288.492                  |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>20.702.778.290</b>       | <b>36.058.322</b>           | <b>12.195.979</b>           | <b>148.817.455</b>          | <b>8.570.271</b>                 | <b>5.184.556.427</b>                      | <b>574.500.718</b>                             | <b>1.616.330.972</b>        |
| <b>Kurzfristige Verbindlichkeiten</b>   |                             |                             |                             |                             |                                  |   |  |                             |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                   | 141.215.249                 | 4.428.576                   | 647.046                     | 213.661                     | –                                | 25.830.013                                | 5.286.451                                      | 13.465.056                  |
| Kontenüberziehung   | 3 98.494                    | –                           | 3.963                       | –                           | –                                | –   | –  | 155                         |
| Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen   | –                           | 51.700                      | –                           | 79.879                      | –                                | 7.657.731                                 | 3.628.199                                      | 3.707.806                   |
| Verbindlichkeiten gegenüber dem Makler  | –                           | –                           | –                           | –                           | –                                | –   | –  | 250.000                     |
| Antizipative Passiva  | 12.310.780                  | 48.457                      | 74.442                      | 279.259                     | 42.290                           | 3.062.519                                 | 411.720  | 1.089.994                   |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen  | 5.076.179                   | –                           | 67.370                      | 216.677                     | 23.001                           | 23.342.727                                | 8.756.374                                      | 274.300.844                 |
| Sonstige Verbindlichkeiten  | 1.410.003                   | 19.433                      | 37.043                      | 23.302                      | 14.118                           | 1.687                                     | 44.295   | 711.262                     |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b> | <b>160.110.705</b>          | <b>4.548.166</b>            | <b>829.864</b>              | <b>812.778</b>              | <b>79.409</b>                    | <b>59.894.677</b>                         | <b>18.127.039</b>                              | <b>293.525.117</b>          |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                             | <b>20.542.667.585</b>       | <b>31.510.156</b>           | <b>11.366.115</b>           | <b>148.004.677</b>          | <b>8.490.862</b>                 | <b>5.124.661.750</b>                      | <b>556.373.679</b>                             | <b>1.322.805.855</b>        |

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Halbjahresabschlusses.

## Bilanzen (Fortsetzung)

|   | Sustainable Asia<br>High Yield | Sustainable<br>Emerging Market<br>Corporate Debt | Sustainable<br>Emerging Market<br>Debt - Hard<br>Currency | Systematic Global<br>Sustainable Value | Ultra Short Term<br>Euro Bond | Uncorrelated<br>Strategies  | Uncorrelated<br>Trading     | US Equity                   |
|---|--------------------------------|--|---|--|-------------------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
|   | Zum<br>31. Dezember<br>2022    | Zum<br>31. Dezember<br>2022                      | Zum<br>31. Dezember<br>2022                               | Zum<br>31. Dezember<br>2022            | Zum<br>31. Dezember<br>2022   | Zum<br>31. Dezember<br>2022 | Zum<br>31. Dezember<br>2022 | Zum<br>31. Dezember<br>2022 |
| <i>Anm.</i>   | US\$                           | US\$   | US\$  | US\$                                   | EUR                           | US\$                        | US\$                        | US\$                        |
| <b>Umlaufvermögen</b>   |                                |  |   |  |                               |                             |                             |                             |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                      | 28.628.399                     | 92.287.239                                       | 147.618.248   | 47.841.138                             | 808.942.173                   | 2.555.941.719               | 598.691.431                 | 29.642.109                  |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 2 2.770.190                    | 6.953.109  | 8.625.196   | 727.506                                | 10.039.473                    | 301.147.318                 | 66.208.500                  | 2.395.266                   |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen   | –                              | –  | 6.851   | 270.540                                | 7.615                         | 84.079.197                  | 25.143.028                  | –                           |
| Forderungen aus ausgegebenen Anteilen   | –                              | 198.096  | 2.755.712   | 3.427                                  | 606.680                       | 10.881.609                  | 303.985                     | 7.971                       |
| Forderungen gegenüber Brokern   | 58.035                         | 166.695  | 199.602   | –                                      | 6.612.268                     | 737.006.142                 | 89.712.105                  | –                           |
| Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen   | 679.979                        | 1.542.219  | 3.029.425   | 113.386                                | 7.293.900                     | 228.604.888                 | 19.269.949                  | 25.906                      |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>32.136.603</b>              | <b>101.147.358</b>                               | <b>162.235.034</b>  | <b>48.955.997</b>                      | <b>833.502.109</b>            | <b>3.917.660.873</b>        | <b>799.328.998</b>          | <b>32.071.252</b>           |
| <b>Kurzfristige Verbindlichkeiten</b>   |                                |  |   |  |                               |                             |                             |                             |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                   | 29.229                         | 141.962  | 908.488   | 90.456                                 | 10.569.827                    | 489.983.868                 | 59.324.225                  | 546.931                     |
| Kontenüberziehung   | 3 –                            | 1.508.656  | –   | –                                      | –                             | 22.735                      | 27.694                      | –                           |
| Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen   | –                              | 177.478  | 2.726.126   | 727.660                                | 322.425                       | 2.890.689                   | 223.254                     | –                           |
| Verbindlichkeiten gegenüber dem Makler  | –                              | –  | –   | –                                      | –                             | 5.000                       | 63.659                      | –                           |
| Antizipative Passiva  | 70.771                         | 149.274  | 117.559   | 55.463                                 | 257.172                       | 2.108.050                   | 1.477.266                   | 47.361                      |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen  | 85.047                         | 809.961  | –   | 152                                    | 608.123                       | 126.044.433                 | 14.876.428                  | –                           |
| Sonstige Verbindlichkeiten  | 29.285                         | 115.719  | 62.267  | 57.825                                 | 354.495                       | 166.119.116                 | 11.393.762                  | 12.131                      |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b> | <b>214.332</b>                 | <b>2.903.050</b>                                 | <b>3.814.440</b>  | <b>931.556</b>                         | <b>12.112.042</b>             | <b>787.173.891</b>          | <b>87.386.288</b>           | <b>606.423</b>              |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                             | <b>31.922.271</b>              | <b>98.244.308</b>                                | <b>158.420.594</b>  | <b>48.024.441</b>                      | <b>821.390.067</b>            | <b>3.130.486.982</b>        | <b>711.942.710</b>          | <b>31.464.829</b>           |

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Halbjahresabschlusses.

## Bilanzen (Fortsetzung)

|   |      | US Equity Index<br>PutWrite | US Large Cap<br>Value | US Long Short<br>Equity | US Multi Cap<br>Opportunities | US Real Estate<br>Securities | US Small Cap         | US Small Cap<br>Intrinsic Value | Fonds insgesamt*      |
|---|------|-----------------------------|-----------------------|-------------------------|-------------------------------|------------------------------|----------------------|---------------------------------|-----------------------|
|   |      | Zum                         | Zum                   | Zum                     | Zum                           | Zum                          | Zum                  | Zum                             | Zum                   |
|   | Anm. | 31. Dezember<br>2022        | 31. Dezember<br>2022  | 31. Dezember<br>2022    | 31. Dezember<br>2022          | 31. Dezember<br>2022         | 31. Dezember<br>2022 | 31. Dezember<br>2022            | 31. Dezember<br>2022  |
|   |      | US\$                        | US\$                  | US\$                    | US\$                          | US\$                         | US\$                 | US\$                            | US\$                  |
| <b>Umlaufvermögen</b>   |      |                             |                       |                         |                               |                              |                      |                                 |                       |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                      |      | 648.856.403                 | 1.689.599.584         | 179.143.690             | 441.762.007                   | 628.621.129                  | 579.729.131          | 186.889.372                     | 27.511.074.629        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 2    | 44.491.927                  | 75.198.123            | 34.444.171              | 1.259.174                     | 21.884.190                   | 10.674.691           | 8.840.096                       | 1.518.644.441         |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen   |      | 3.987.199                   | 17.011.441            | 8.813.281               | 2.155.112                     | 96                           | 109.183              | 1.398.733                       | 217.909.539           |
| Forderungen aus ausgegebenen Anteilen   |      | 567.528                     | 5.505.395             | 289.671                 | 823.707                       | 3.580.698                    | 1.178.559            | 491.844                         | 217.511.029           |
| Forderungen gegenüber Brokern   |      | –                           | –                     | 11.644.215              | –                             | –                            | –                    | –                               | 927.110.748           |
| Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen   |      | 379.288                     | 1.854.555             | 891.436                 | 219.477                       | 1.956.405                    | 2.524.308            | 66.145                          | 573.072.046           |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   |      | <b>698.282.345</b>          | <b>1.789.169.098</b>  | <b>235.226.464</b>      | <b>446.219.477</b>            | <b>656.042.518</b>           | <b>594.215.872</b>   | <b>197.686.190</b>              | <b>30.965.322.432</b> |
| <b>Kurzfristige Verbindlichkeiten</b>   |      |                             |                       |                         |                               |                              |                      |                                 |                       |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                   |      | 14.283.196                  | 102.612               | 2.889.863               | 587.402                       | 1.230.032                    | 236.699              | –                               | 846.692.109           |
| Kontenüberziehung   | 3    | –                           | –                     | –                       | –                             | –                            | –                    | –                               | 1.565.099             |
| Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen   |      | 543.568                     | 494.764               | 1.227.732               | 1.019.084                     | 3.412.368                    | 780.783              | 287.203                         | 142.576.198           |
| Verbindlichkeiten gegenüber dem Makler  |      | –                           | –                     | –                       | –                             | –                            | –                    | –                               | 10.588.659            |
| Antizipative Passiva  |      | 366.712                     | 1.065.730             | 329.297                 | 631.626                       | 1.318.524                    | 654.722              | 196.002                         | 25.893.180            |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen  |      | 2.608.050                   | 19.542.707            | 91.888                  | 2.618.414                     | 1.982.404                    | 129.484              | 2.170.492                       | 605.080.476           |
| Sonstige Verbindlichkeiten  |      | 24.081                      | 8.926                 | 9.157.783               | 47.001                        | 73.395                       | 35.517               | 991.453                         | 218.544.490           |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b> |      | <b>17.825.607</b>           | <b>21.214.739</b>     | <b>13.696.563</b>       | <b>4.903.527</b>              | <b>8.016.723</b>             | <b>1.837.205</b>     | <b>3.645.150</b>                | <b>1.850.940.211</b>  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                             |      | <b>680.456.738</b>          | <b>1.767.954.359</b>  | <b>221.529.901</b>      | <b>441.315.950</b>            | <b>648.025.795</b>           | <b>592.378.667</b>   | <b>194.041.040</b>              | <b>29.114.382.221</b> |

\* Der konsolidierte Abschluss wurde um im Namen des Fonds gehaltener Salden und um Überkreuzinvestitionen zwischen den Portfolios bereinigt. Details zu Überkreuzinvestitionen zwischen Teilfonds sind Anmerkung 8 der Anmerkungen zum ungeprüften verkürzten Halbjahresabschluss zu entnehmen.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Halbjahresabschlusses.

## Gewinn- und Verlustrechnungen

| Anm.   | 5G Connectivity<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | Absolute Return<br>Multi Strategy<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023*<br>US\$ | Asian Debt - Hard<br>Currency<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | China A-Share<br>Equity<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>CNY | China Bond<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>CNY | China Equity<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | CLO Income<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | Commodities<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ |             |
|--|--|---|--|---|--|---|---|--|-------------|
| <b>Erträge</b>   |  |   |  |   |  |   |   |  |             |
| Zinserträge  | 708.077  | 2.250   | 926.410  | 49  | 7.232.460  | 50.537  | 7.589.008   | 1.225.148  |             |
| Dividenderträge  | 2.394.114  | 13.148  | –  | 214.795   | –  | 4.181.209   | 217.245   | –  |             |
| Sonstige Erträge   | –  | 1.832   | 1.046  | –   | –  | –   | –   | –  |             |
| Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten | 209.834.008  | (17.230)  | 148.134  | (711.393)   | 31.770.361   | (31.713.085)  | 5.010.161   | (6.897.537)  |             |
|  | 212.936.199  | –   | 1.075.590  | (496.549)   | 39.002.821   | (27.481.339)  | 12.816.414  | (5.672.389)  |             |
| <b>Aufwendungen</b>  |  |   |  |   |  |   |   |  |             |
| Managementgebühr   | 5  | 7.049.822   | –  | 14.782  | 72.941   | 155.200   | 1.835.198   | 379.682  | 165.439     |
| Vertriebsgebühren  | 5  | 310.464   | –  | 2.132   | –  | –   | 99  | –  | 1.232       |
| Verwaltungsgebühren  | 5  | 271.063   | –  | 32.249  | 80.572   | 239.700   | 87.421  | 43.932   | 31.756      |
| Bereitstellungsprovision   | 16   | 95.433  | –  | 2.154   | 1.044  | 17.387  | 19.662  | 8.985  | 6.895       |
| Depotgebühren  | 5  | 63.226  | –  | 5.973   | 38.110   | 130.146   | 37.867  | 5.689  | 5.580       |
| Gebühren der Verwahrstelle   | 5  | 25.215  | –  | 1.038   | 405  | 11.480  | 7.687   | 3.347  | 2.311       |
| Honorare   | 7  | 91.925  | –  | 22.773  | 143.791  | 204.648   | 52.360  | 25.345   | 17.720      |
| Honorare der Direktoren  | 6  | 2.400   | –  | 2.208   | 15.245   | 14.814  | 2.447   | 2.258  | 2.328       |
| Transaktionskosten   | 7  | 1.254.317   | –  | 5.416   | 62.617   | 131.408   | 243.310   | 26.170   | 13.032      |
| Prüfungshonorare   | 7  | 4.858   | –  | 4.856   | 31.888   | 26.760  | 4.564   | 4.676  | 5.227       |
| Umsatzsteuerentlastung   |  | (2.234)   | –  | (211)   | (40)   | (2.085)   | (742)   | (404)  | (302)       |
| Sonstige Aufwendungen  | 7  | 22.147  | –  | 2.719   | 16.205   | 112.507   | 10.582  | 1.005  | 1.535       |
| Kostenverzicht   | 5  | –   | –  | (44.375)  | (352.629)  | (289.561)   | –   | –  | –           |
| <b>Aufwendungen insgesamt</b>  |  | 9.188.636   | –  | 51.714  | 110.149  | 752.404   | 2.300.455   | 500.685  | 252.753     |
| <b>Finanzierungskosten</b>   |  |   |  |   |  |   |   |  |             |
| Zinsaufwendungen   |  | 641   | –  | 49  | –  | 8.303   | –   | –  | –           |
| Gezahlte Ausschüttungen  | 1  | –   | –  | 375.286   | 15.082   | 137.148   | 3.216   | 5.413.500  | –           |
|  |  | 641   | –  | 375.335   | 15.082   | 145.451   | 3.216   | 5.413.500  | –           |
| Quellensteuern   |  | 527.142   | –  | 24  | 21.220   | 5.743   | 279.784   | –  | –           |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit</b>              |  | 203.219.780   | –  | 648.517   | (643.000)  | 38.099.223  | (30.064.794)  | 6.902.229  | (5.925.142) |

\* Der Absolute Return Multi Strategy wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Halbjahresabschlusses.



## Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

|  | Anm. | Corporate Hybrid Bond<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>EUR | Emerging Market Debt - Hard Currency<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | Emerging Market Debt - Local Currency<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | Emerging Market Debt Blend<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | Emerging Markets Equity<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | Emerging Markets Select Equity<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | Euro Bond Absolute Return<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>EUR |
|--|------|---|---|--|---|--|--|---|---|
| <b>Erträge</b>   |      |   |   |  |   |  |  |   |   |
| Zinserträge  |      | 36.107.542  | 72.179.288  | 37.580.057   | 13.321.574  | 1.304.157  | 118.430  | 56.878  | 668.520   |
| Dividenderträge  |      | –   | –   | 113.951  | 75.335  | –  | 1.786.378  | 1.046.958   | –   |
| Sonstige Erträge   |      | –   | –   | 832.193  | 185.553   | 3.693  | 131  | 4.061   | 2.891   |
| Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten |      | 4.697.512   | 61.016.046  | 73.227.074   | 18.916.573  | (607.068)  | 8.032.589  | 2.337.756   | (113.093)   |
|  |      | 40.805.054  | 133.195.334   | 111.753.275  | 32.499.035  | 700.782  | 9.937.528  | 3.445.653   | 558.318   |
| <b>Aufwendungen</b>  |      |   |   |  |   |  |  |   |   |
| Managementgebühr   | 5    | 5.689.682   | 9.383.425   | 4.423.000  | 1.606.572   | 145.046  | 779.682  | 406.099   | 25.668  |
| Vertriebsgebühren  | 5    | 100.046   | 128.406   | 116.918  | 13.881  | –  | 23.323   | –   | –   |
| Verwaltungsgebühren  | 5    | 384.653   | 636.474   | 400.452  | 204.271   | 47.499   | 111.957  | 31.626  | 33.684  |
| Bereitstellungsprovision   | 16   | 123.931   | 173.309   | 90.481   | 33.745  | 3.868  | 12.855   | 6.234   | 3.174   |
| Depotgebühren  | 5    | 62.530  | 88.161  | 434.480  | 83.125  | 6.088  | 62.548   | 26.629  | 5.524   |
| Gebühren der Verwahrstelle   | 5    | 43.848  | 62.342  | 31.594   | 11.760  | 1.460  | 3.933  | 2.390   | 1.190   |
| Honorare   | 7    | 83.514  | 131.406   | 117.539  | 62.035  | 18.551   | 67.467   | 31.002  | 16.862  |
| Honorare der Direktoren  | 6    | 2.050   | 2.432   | 2.384  | 2.334   | 2.424  | 2.421  | 2.427   | 2.253   |
| Transaktionskosten   | 7    | 43.832  | 167.037   | 314.790  | 157.104   | 34.816   | 538.001  | 162.200   | 17.553  |
| Prüfungshonorare   | 7    | 4.819   | 4.488   | 4.740  | 5.243   | 5.085  | 4.256  | 4.774   | 3.960   |
| Umsatzsteuerentlastung   |      | (8.051)   | (11.092)  | (5.982)  | (2.112)   | (217)  | (695)  | (419)   | (216)   |
| Sonstige Aufwendungen  | 7    | 4.597   | 5.039   | 16.189   | 15.483  | 2.821  | 2.822  | 2.758   | 2.841   |
| Kostenverzicht   | 5    | –   | –   | (52.448)   | (4.691)   | (57.102)   | (123.252)  | –   | (32.670)  |
| <b>Aufwendungen insgesamt</b>  |      | 6.535.451   | 10.771.427  | 5.894.137  | 2.188.750   | 210.339  | 1.485.318  | 675.720   | 79.823  |
| <b>Finanzierungskosten</b>   |      |   |   |  |   |  |  |   |   |
| Zinsaufwendungen   |      | 136.188   | 767   | 35.706   | 8.636   | 78   | 539  | –   | 1.176   |
| Gezahlte Ausschüttungen  | 1    | 8.023.661   | 17.257.280  | 10.217.619   | 2.192.115   | –  | 211.792  | –   | 76  |
|  |      | 8.159.849   | 17.258.047  | 10.253.325   | 2.200.751   | 78   | 212.331  | –   | 1.252   |
| Quellensteuern   |      | –   | –   | 356.428  | 12.508  | 11.976   | 195.699  | 132.528   | –   |
| Kapitalertragsteuer  |      | –   | –   | 673.345  | 96.371  | 13.795   | 180.671  | 87.263  | –   |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit</b>              |      | 26.109.754  | 105.165.860   | 94.576.040   | 28.000.655  | 464.594  | 7.863.509  | 2.550.142   | 477.243   |

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Halbjahresabschlusses.

## Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

|  | Anm. | Euro Opportunistic<br>Bond<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>EUR | European High Yield<br>Bond<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>EUR | European<br>Sustainable Equity<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>EUR | Event Driven<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | Global Bond<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | Global Diversified<br>Income FMP – 2024<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | Global Equity<br>Megatrends<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | Global Flexible<br>Credit Income<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ |
|--|------|--|---|--|---|--|--|--|---|
| <b>Erträge</b>   |      |  |   |  |   |  |  |  |   |
| Zinserträge  |      | 143.081  | 1.351.236   | 29.487   | 213.608   | 2.511.947  | 3.484.238  | 23.886   | 10.847.451  |
| Dividendenerträge  |      | –  | –   | 2.089.868  | –   | –  | –  | 573.655  | 12.914  |
| Sonstige Erträge   |      | 1.183  | –   | –  | –   | 4.311  | –  | 6.970  | 97  |
| Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten |      | 185.227  | 397.944   | 21.509.454   | 3.595.406   | (45.955)   | 1.094.703  | 12.702.921   | 16.539.736  |
|  |      | 329.491  | 1.749.180   | 23.628.809   | 3.809.014   | 2.470.303  | 4.578.941  | 13.307.432   | 27.400.198  |
| <b>Aufwendungen</b>  |      |  |   |  |   |  |  |  |   |
| Managementgebühr   | 5    | 16.560   | 32.889  | 277.005  | 147.300   | 3.716  | 451.201  | 613.815  | 776.349   |
| Vertriebsgebühren  | 5    | –  | 1.935   | 147  | –   | 2.665  | –  | 122.385  | 24.275  |
| Verwaltungsgebühren  | 5    | 21.425   | 45.120  | 47.016   | 22.237  | 74.733   | 48.916   | 57.629   | 99.038  |
| Bereitstellungsprovision   | 16   | 639  | 3.140   | 11.163   | 1.749   | 9.703  | 11.044   | 6.033  | 24.861  |
| Depotgebühren  | 5    | 5.580  | 5.331   | 9.287  | 4.542   | 5.477  | 5.951  | 5.703  | 7.922   |
| Gebühren der Verwahrstelle   | 5    | 237  | 1.333   | 4.402  | 706   | 3.495  | 3.981  | 2.267  | 8.681   |
| Honorare   | 7    | 14.656   | 27.529  | 23.829   | 27.304  | 29.865   | 30.609   | 18.538   | 36.591  |
| Honorare der Direktoren  | 6    | 2.252  | 2.035   | 2.112  | 1.923   | 2.429  | 2.246  | 2.439  | 2.317   |
| Erfolgsabhängige Gebühr  | 5    | –  | –   | –  | 211.938   | –  | –  | –  | –   |
| Transaktionskosten   | 7    | 8.431  | 9.902   | 49.203   | 4.831   | 32.322   | 3.038  | 20.639   | 37.159  |
| Prüfungshonorare   | 7    | 3.925  | 4.318   | 4.036  | 5.098   | 4.415  | 4.713  | 4.529  | 4.958   |
| Umsatzsteuerentlastung   |      | (43)   | (212)   | (547)  | (211)   | (614)  | (382)  | (230)  | (849)   |
| Sonstige Aufwendungen  | 7    | 2.825  | 2.642   | 2.474  | 2.672   | 2.385  | 2.894  | 13.107   | 3.365   |
| Kostenverzicht   | 5    | (48.444)   | (44.351)  | –  | (22.212)  | (9.385)  | –  | –  | –   |
| Verzicht auf Gebühren  | 5    | –  | –   | –  | –   | –  | –  | –  | (701)   |
| <b>Aufwendungen insgesamt</b>  |      | 28.043   | 91.611  | 430.127  | 407.877   | 161.206  | 564.211  | 866.854  | 1.023.966   |
| <b>Finanzierungskosten</b>   |      |  |   |  |   |  |  |  |   |
| Zinsaufwendungen   |      | 8  | 2   | –  | 127   | 20   | –  | 26   | –   |
| Gezahlte Ausschüttungen  | 1    | 96.302   | 11.380  | 1.048.292  | –   | 1.109  | 1.932.504  | –  | 9.063   |
|  |      | 96.310   | 11.382  | 1.048.292  | 127   | 1.129  | 1.932.504  | 26   | 9.063   |
| Quellensteuern   |      | –  | 1.915   | 369.229  | 4.281   | 19.816   | 1.695  | 87.327   | 26.804  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit</b>              |      | 205.138  | 1.644.272   | 21.781.161   | 3.396.729   | 2.288.152  | 2.080.531  | 12.353.225   | 26.340.365  |

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Halbjahresabschlusses.

## Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

|  | Anm. | Global High Yield<br>SDG Engagement<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | Global High Yield<br>Sustainable Action<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023*<br>US\$ | Global Investment<br>Grade Credit<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | Global<br>Opportunistic Bond<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | Global Real Estate<br>Securities<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | Global Sustainable<br>Equity<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | High Yield Bond<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | InnovAsia 5G<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ |
|--|------|--|---|--|---|---|---|--|---|
| <b>Erträge</b>   |      |  |   |  |   |   |   |  |   |
| Zinserträge  |      | 13.724.612   | 380.455   | 1.693.072  | 1.452.317   | 27.424  | 30.199  | 75.652.442   | 14.435  |
| Dividenderträge  |      | –  | –   | –  | 4.090   | 723.396   | 833.357   | 697.828  | 79.819  |
| Sonstige Erträge   |      | 3.578  | 47  | –  | 29.537  | –   | –   | 323.809  | –   |
| Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten |      | 2.309.957  | 302.666   | 1.077.872  | 495.428   | (47.627)  | 19.966.585  | 20.518.228   | 3.399.353   |
|  |      | 16.038.147   | 683.168   | 2.770.944  | 1.981.372   | 703.193   | 20.830.141  | 97.192.307   | 3.493.607   |
| <b>Aufwendungen</b>  |      |  |   |  |   |   |   |  |   |
| Managementgebühr   | 5    | 835.729  | 36.223  | 23.614   | 55.110  | 124.243   | 188.507   | 9.987.791  | 84.920  |
| Vertriebsgebühren  | 5    | 3.629  | –   | –  | –   | 9.543   | 1.764   | 908.028  | 165   |
| Verwaltungsgebühren  | 5    | 138.787  | 70.047  | 39.390   | 69.879  | 33.056  | 48.564  | 772.201  | 26.255  |
| Bereitstellungsprovision   | 16   | 28.103   | 1.194   | 7.105  | 4.742   | 2.338   | 8.550   | 155.346  | 1.013   |
| Depotgebühren  | 5    | 6.087  | 6.000   | 5.942  | 5.697   | 5.951   | 5.951   | 15.995   | 5.808   |
| Gebühren der Verwahrstelle   | 5    | 11.806   | 462   | 2.154  | 1.669   | 906   | 3.548   | 56.815   | 218   |
| Honorare   | 7    | 37.498   | 38.938  | 16.547   | 23.495  | 28.288  | 28.885  | 181.785  | 40.955  |
| Honorare der Direktoren  | 6    | 2.252  | 2.387   | 2.102  | 2.253   | 2.236   | 2.238   | 2.338  | 2.007   |
| Transaktionskosten   | 7    | 65.522   | 2.818   | 2.063  | 32.610  | 49.744  | 18.200  | 136.448  | 73.810  |
| Prüfungshonorare   | 7    | 4.576  | 10.617  | 5.716  | 4.904   | 4.726   | 4.710   | 6.465  | 5.734   |
| Umsatzsteuerentlastung   |      | (1.577)  | (44)  | (249)  | (338)   | (170)   | (338)   | (6.839)  | (42)  |
| Sonstige Aufwendungen  | 7    | 3.593  | 5.121   | 1.030  | 3.600   | 2.971   | 1.158   | 5.803  | 2.220   |
| Kostenverzicht   | 5    | (32.415)   | (122.957)   | (20.390)   | (65.637)  | (44.740)  | –   | –  | (101.872)   |
| Verzicht auf Gebühren  | 5    | –  | –   | –  | (222)   | –   | –   | (37.869)   | –   |
| <b>Aufwendungen insgesamt</b>  |      | 1.103.590  | 50.806  | 85.024   | 137.762   | 219.092   | 311.737   | 12.184.307   | 141.191   |
| <b>Finanzierungskosten</b>   |      |  |   |  |   |   |   |  |   |
| Zinsaufwendungen   |      | 6  | 25  | 101  | 68  | –   | 649   | –  | –   |
| Gezahlte Ausschüttungen  | 1    | 148.757  | 289.047   | –  | 143.211   | 140.153   | –   | 43.826.657   | –   |
|  |      | 148.763  | 289.072   | 101  | 143.279   | 140.153   | 649   | 43.826.657   | –   |
| Quellensteuern   |      | –  | –   | –  | 1.939   | 137.925   | 227.315   | 254.577  | 9.673   |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit</b>              |      | 14.785.794   | 343.290   | 2.685.819  | 1.698.392   | 206.023   | 20.290.440  | 40.926.766   | 3.342.743   |

\* Der Global High Yield Sustainable Action wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Halbjahresabschlusses.

## Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

| Anm.   | Japan Equity<br>Engagement<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>JPY | Macro<br>Opportunities FX<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>EUR | Multi-Asset Income<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | Next Generation<br>Mobility<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | Next Generation<br>Space Economy<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | Short Duration<br>Emerging Market<br>Debt<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | Short Duration<br>Yield High<br>SDG<br>Engagement<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | Strategic Income<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ |
|--|--|---|---|--|---|--|--|---|
| <b>Erträge</b>   |  |   |   |  |   |  |  |   |
| Zinserträge  | –  | 100.878   | 143.181   | 238.086  | 9.480   | 103.141.171  | 19.740.389   | 31.064.030  |
| Dividenerträge   | 225.363.637  | –   | 76.971  | 878.990  | 67.976  | –  | 46.575   | 28.176  |
| Sonstige Erträge   | –  | –   | 185   | –  | –   | –  | 47.823   | 119.770   |
| Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten | 4.242.762.887  | (1.146.642)   | 122.546   | 33.472.595   | 1.727.044   | 14.940.138   | (7.515.909)  | (4.695.469)   |
|  | 4.468.126.524  | (1.045.764)   | 342.883   | 34.589.671   | 1.804.500   | 118.081.309  | 12.318.878   | 26.516.507  |
| <b>Aufwendungen</b>  |  |   |   |  |   |  |  |   |
| Managementgebühr   | 5  | 35.481.710  | 75.149  | 65.813   | 1.107.812   | 45.208   | 13.525.302   | 4.750.284   |
| Vertriebsgebühren  | 5  | –   | –   | 15.904   | 182.960   | 6.835  | 362.688  | 487.344   |
| Verwaltungsgebühren  | 5  | 5.850.914   | 30.852  | 85.816   | 68.262  | 12.251   | 1.016.745  | 462.404   |
| Bereitstellungsprovision   | 16   | 1.465.972   | 2.167   | 746  | 10.909  | 693  | 342.360  | 95.410  |
| Depotgebühren  | 5  | 1.231.491   | 5.744   | 6.569  | 5.304   | 5.730  | 187.271  | 18.410  |
| Gebühren der Verwahrstelle   | 5  | 537.464   | 792   | 368  | 4.029   | 134  | 124.180  | 35.510  |
| Honorare   | 7  | 2.805.402   | 20.107  | 55.886   | 32.611  | 24.602   | 214.731  | 82.872  |
| Honorare der Direktoren  | 6  | 310.557   | 2.080   | 2.450  | 2.433   | 2.341  | 2.405  | 2.385   |
| Transaktionskosten   | 7  | 14.704.177  | 22.954  | 48.717   | 27.620  | 11.703   | 76.146   | 155.360   |
| Prüfungshonorare   | 7  | 549.772   | 4.353   | 11.145   | 5.071   | 6.812  | 5.402  | 10.373  |
| Umsatzsteuerentlastung   |  | (67.540)  | (90)  | (47)   | (655)   | (32)   | (22.608)   | (6.275)   |
| Sonstige Aufwendungen  | 7  | 383.450   | 3.135   | 9.532  | 5.399   | 740  | 7.959  | 4.601   |
| Kostenverzicht   | 5  | –   | (58.267)  | (206.453)  | –   | (52.532)   | –  | –   |
| Verzicht auf Gebühren  | 5  | –   | –   | –  | –   | –  | (2.527)  | (1.529)   |
| <b>Aufwendungen insgesamt</b>  |  | 63.253.369  | 108.976   | 96.446   | 1.451.755   | 64.485   | 15.842.581   | 6.097.149   |
| <b>Finanzierungskosten</b>   |  |   |   |  |   |  |  |   |
| Zinsaufwendungen   |  | –   | 195   | 1.058  | –   | –  | 22.571   | 2.516   |
| Gezahlte Ausschüttungen  | 1  | 111.381.658   | 5   | 4.025  | –   | –  | 27.272.467   | 8.040.452   |
|  |  | 111.381.658   | 200   | 5.083  | –   | –  | 27.295.038   | 8.042.968   |
| Quellensteuern   |  | 33.921.407  | –   | 7.319  | 154.852   | 7.945  | –  | 236.777   |
| Kapitalertragsteuer  |  | –   | –   | 709  | –   | –  | –  | 9.919   |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit</b>              |  | 4.259.570.090   | (1.154.940)   | 233.326  | 32.983.064  | 1.732.070  | 74.943.690   | 12.129.694  |

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Halbjahresabschlusses.

## Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

|  | Anm. | Sustainable Asia<br>High Yield<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | Sustainable<br>Emerging Market<br>Corporate Debt<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | Sustainable<br>Emerging Market<br>Debt - Hard<br>Currency<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | Systematic Global<br>Sustainable Value<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | Tactical Macro<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023*<br>US\$ | Ultra Short Term<br>Euro Bond<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>EUR | Uncorrelated<br>Strategies<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | Uncorrelated<br>Trading<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023**<br>US\$ |
|--|------|---|---|--|---|--|---|---|--|
| <b>Erträge</b>   |      |   |   |  |   |  |   |   |  |
| Zinserträge  |      | 917.330   | 2.537.550   | 5.877.340  | 7.013   | 1.333  | 9.761.262   | 20.162.574  | 3.568.239  |
| Dividenerträge   |      | –   | –   | –  | 857.017   | –  | –   | –   | –  |
| Sonstige Erträge   |      | –   | –   | –  | 3.964   | –  | 43.432  | –   | 8.248  |
| Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten |      | (433.446)   | 1.262.661   | 5.520.039  | 3.309.467   | –  | 5.647.618   | (103.720.069)   | (12.686.374)   |
|  |      | 483.884   | 3.800.211   | 11.397.379   | 4.177.461   | 1.333  | 15.452.312  | (83.557.495)  | (9.109.887)  |
| <b>Aufwendungen</b>  |      |   |   |  |   |  |   |   |  |
| Managementgebühr   | 5    | 4.463   | 346.500   | 448.124  | 58.102  | –  | 628.851   | 19.704.011  | 2.845.723  |
| Vertriebsgebühren  | 5    | –   | 14.761  | –  | 2.067   | –  | 936   | 84.068  | –  |
| Verwaltungsgebühren  | 5    | 26.622  | 65.509  | 59.198   | 29.364  | –  | 202.483   | 1.428.365   | 347.786  |
| Bereitstellungsprovision   | 16   | 2.399   | 6.181   | 16.222   | 2.714   | –  | 52.962  | 201.105   | 54.101   |
| Depotgebühren  | 5    | 5.716   | 5.933   | 5.692  | 5.785   | –  | 33.409  | 160.166   | 62.274   |
| Gebühren der Verwahrstelle   | 5    | 756   | 2.393   | 5.754  | 1.204   | –  | 20.854  | 139.287   | 45.183   |
| Honorare   | 7    | 40.403  | 50.173  | 21.729   | 31.643  | –  | 41.597  | 313.720   | 68.646   |
| Honorare der Direktoren  | 6    | 2.403   | 2.421   | 2.318  | 2.298   | –  | 2.078   | 2.318   | 2.397  |
| Transaktionskosten   | 7    | 8.302   | 21.211  | 24.446   | 73.660  | –  | 44.854  | 9.693.000   | 1.040.743  |
| Prüfungshonorare   | 7    | 4.288   | 4.974   | 5.141  | 4.522   | –  | 4.414   | 4.530   | 9.096  |
| Umsatzsteuerentlastung   |      | (83)  | (440)   | (1.050)  | (219)   | –  | (3.714)   | (8.044)   | (1.707)  |
| Sonstige Aufwendungen  | 7    | 2.311   | 2.427   | 1.762  | 2.722   | –  | 3.386   | 2.638.950   | 287.209  |
| Kostenverzicht   | 5    | (69.080)  | (76.526)  | (6.420)  | (45.185)  | –  | –   | –   | (155.312)  |
| Verzicht auf Gebühren  | 5    | –   | –   | –  | –   | –  | –   | –   | –  |
| <b>Aufwendungen insgesamt</b>  |      | 28.500  | 445.517   | 582.916  | 168.677   | –  | 1.032.110   | 34.361.476  | 4.606.139  |
| <b>Finanzierungskosten</b>   |      |   |   |  |   |  |   |   |  |
| Zinsaufwendungen   |      | –   | 1.353   | 92   | 211   | –  | –   | 77.487  | 83.462   |
| Gezahlte Ausschüttungen  | 1    | 187.353   | 98.923  | –  | –   | –  | 14.618  | –   | –  |
|  |      | 187.353   | 100.276   | 92   | 211   | –  | 14.618  | 77.487  | 83.462   |
| Quellensteuern   |      | 1.827   | 196   | 121.222  | 172.475   | –  | –   | 5.314.284   | 366.026  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit</b>              |      | 266.204   | 3.254.222   | 10.693.149   | 3.836.098   | 1.333  | 14.405.584  | (123.310.742)   | (14.165.514)   |

\* Der Tactical Macro wurde am 30. Juni 2023 aufgelegt.

\*\* Der Uncorrelated Trading wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Halbjahresabschlusses.

## Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

|  | Anm. | US Equity<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | US Equity Index<br>PutWrite<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | US Large Cap Value<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | US Long Short<br>Equity<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | US Multi Cap<br>Opportunities<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | US Real Estate<br>Securities<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | US Small Cap<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | US Small Cap<br>Intrinsic Value<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ |
|--|------|--|--|---|--|--|---|---|--|
| <b>Erträge</b>   |      |  |  |   |  |  |   |   |  |
| Zinserträge  |      | 40.612   | 2.436.978  | 1.636.743   | 1.109.734  | 35.692   | 489.958   | 231.380   | 476.416  |
| Dividenderträge  |      | 157.055  | –  | 23.918.038  | 1.084.012  | 2.480.438  | 11.307.531  | 2.871.389   | 795.985  |
| Sonstige Erträge   |      | –  | –  | –   | –  | –  | –   | 61  | –  |
| Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten |      | 4.777.206  | 79.192.712   | (46.458.604)  | 15.671.790   | 48.684.450   | 7.974.525   | 69.246.916  | 18.972.106   |
|  |      | 4.974.873  | 81.629.690   | (20.903.823)  | 17.865.536   | 51.200.580   | 19.772.014  | 72.349.746  | 20.244.507   |
| <b>Aufwendungen</b>  |      |  |  |   |  |  |   |   |  |
| Managementgebühr   | 5    | 119.556  | 1.382.114  | 5.145.192   | 1.463.065  | 2.593.881  | 4.088.051   | 3.014.213   | 1.002.700  |
| Vertriebsgebühren  | 5    | 3.470  | 5.969  | 173.028   | 17.201   | 219.236  | 649.075   | 90.952  | 2.589  |
| Verwaltungsgebühren  | 5    | 21.642   | 168.013  | 375.561   | 87.727   | 179.950  | 414.454   | 197.305   | 71.148   |
| Bereitstellungsprovision   | 16   | 2.120  | 41.531   | 134.969   | 18.558   | 28.976   | 41.751  | 43.798  | 15.076   |
| Depotgebühren  | 5    | 5.999  | 5.678  | 9.917   | 5.951  | 5.758  | 5.608   | 6.068   | 6.002  |
| Gebühren der Verwahrstelle   | 5    | 863  | 15.880   | 45.424  | 5.554  | 10.638   | 15.180  | 15.617  | 6.012  |
| Honorare   | 7    | 17.155   | 55.189   | 48.720  | 39.759   | 68.640   | 85.356  | 75.800  | 27.131   |
| Honorare der Direktoren  | 6    | 2.298  | 2.102  | 2.414   | 2.310  | 2.384  | 2.355   | 2.421   | 2.406  |
| Transaktionskosten   | 7    | 8.884  | 56.553   | 529.375   | 59.729   | 117.636  | 230.287   | 144.064   | 50.248   |
| Prüfungshonorare   | 7    | 3.984  | 4.726  | 4.572   | 4.910  | 4.911  | 4.934   | 4.571   | 4.720  |
| Umsatzsteuerentlastung   |      | (153)  | (3.054)  | (6.768)   | (984)  | (1.900)  | (2.751)   | (2.656)   | (964)  |
| Sonstige Aufwendungen  | 7    | 2.807  | 3.246  | 5.442   | 5.186  | 3.120  | 3.811   | 3.878   | 12.724   |
| Kostenverzicht   | 5    | (24.406)   | –  | –   | –  | –  | –   | –   | –  |
| <b>Aufwendungen insgesamt</b>  |      | 164.219  | 1.737.947  | 6.467.846   | 1.708.966  | 3.233.230  | 5.538.111   | 3.596.031   | 1.199.792  |
| <b>Finanzierungskosten</b>   |      |  |  |   |  |  |   |   |  |
| Zinsaufwendungen   |      | 60   | –  | –   | 20   | 754  | –   | –   | –  |
| Gezahlte Ausschüttungen  | 1    | –  | 572.069  | 10.005.740  | 52.784   | 12.800   | 2.527.684   | –   | –  |
|  |      | 60   | 572.069  | 10.005.740  | 52.804   | 13.554   | 2.527.684   | –   | –  |
| Quellensteuern   |      | 45.361   | –  | 6.326.595   | 303.537  | 709.742  | 2.844.622   | 806.856   | 208.701  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit</b>              |      | 4.765.233  | 79.319.674   | (43.704.004)  | 15.800.229   | 47.244.054   | 8.861.597   | 67.946.859  | 18.836.014   |

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Halbjahresabschlusses.

## Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

|  | Anm. | Fonds insgesamt*<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ |
|--|------|---|
| <b>Erträge</b>   |      |   |
| Zinserträge  |      | 492.034.830   |
| Dividenderträge  |      | 61.268.982  |
| Sonstige Erträge   |      | 1.628.215   |
| Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten |      | 613.804.874   |
|  |      | 1.168.736.901   |
| <b>Aufwendungen</b>  |      |   |
| Managementgebühr   | 5    | 110.862.235   |
| Vertriebsgebühren  | 5    | 4.155.184   |
| Verwaltungsgebühren  | 5    | 9.623.762   |
| Bereitstellungsprovision   | 16   | 2.043.091   |
| Depotgebühren  | 5    | 1.603.114   |
| Gebühren der Verwahrstelle   | 5    | 823.786   |
| Honorare   | 7    | 2.922.417   |
| Honorare der Direktoren  | 6    | 125.151   |
| Erfolgsabhängige Gebühr  | 5    | 211.938   |
| Transaktionskosten   | 7    | 16.158.911  |
| Prüfungshonorare   | 7    | 282.577   |
| Umsatzsteuerentlastung   |      | (114.120)   |
| Sonstige Aufwendungen  | 7    | 3.185.550   |
| Kostenverzicht   | 5    | (1.627.902)   |
| Verzicht auf Gebühren  | 5    | (42.848)  |
| <b>Aufwendungen insgesamt</b>  |      | 150.212.846   |
| <b>Finanzierungskosten</b>   |      |   |
| Zinsaufwendungen   |      | 386.788   |
| Gezahlte Ausschüttungen  | 1    | 144.436.302   |
| <b>Finanzkosten insgesamt</b>  |      | 144.823.090   |
| Quellensteuern   |      | 20.575.993  |
| Kapitalertragsteuer  |      | 1.062.073   |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit</b>              |      | 852.062.899   |

Alle Erträge und Aufwendungen ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit – mit Ausnahme des Absolute Return Multi Strategy, des Global High Yield Sustainable Action und des Uncorrelated Trading, die am 20. Dezember 2021, 16. Juni 2023 bzw. 24. Mai 2023 aufgelöst wurden. Außer den in der konsolidierten Gewinn- und Verlustrechnung ausgewiesenen gab es keine Gewinne und Verluste im Berichtszeitraum.

\* Der konsolidierte Halbjahresabschluss wurde um Überkreuzinvestitionen zwischen den Portfolios bereinigt. Details zu Überkreuzinvestitionen zwischen Teilfonds sind Anmerkung 8 der Anmerkungen zum ungeprüften verkürzten Halbjahresabschluss zu entnehmen.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Halbjahresabschlusses.

## Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

|  | Anm. | 5G Connectivity<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>US\$ | Asian Debt - Hard<br>Currency<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>US\$ | China A-Share<br>Equity<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>CNY | China Bond<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>CNY | China Equity<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>US\$ | CLO Income<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>US\$ | Commodities<br>Berichtszeitraum<br>zum<br>30. Juni 2022*<br>US\$ | Corporate Hybrid<br>Bond<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>EUR |
|--|------|--|--|---|--|---|---|--|--|
| <b>Erträge</b>   |      |  |  |   |  |   |   |  |  |
| Zinserträge  |      | 48.417   | 259.439  | –   | 9.837.560  | 1.816   | 4.806.105   | 161.467  | 41.277.489   |
| Dividendenerträge  |      | 4.263.289  | –  | 158.266   | –  | 7.123.335   | –   | –  | –  |
| Erträge aus der Wertpapierleihe  | 15   | –  | –  | –   | –  | –   | –   | –  | 55.092   |
| Sonstige Erträge   |      | –  | –  | –   | –  | –   | –   | –  | –  |
| Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum<br>beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen<br>Vermögenswerten und Verbindlichkeiten |      | (872.780.041)  | (2.040.467)  | (2.680.928)   | (14.291.854)   | (71.104.310)  | (22.883.848)  | (2.252.919)  | (356.995.881)  |
|  |      | (868.468.335)  | (1.781.028)  | (2.522.662)   | (4.454.294)  | (63.979.159)  | (18.077.743)  | (2.091.452)  | (315.663.300)  |
| <b>Aufwendungen</b>  |      |  |  |   |  |   |   |  |  |
| Managementgebühr   | 5    | 11.368.672   | 45.421   | 94.463  | 674.018  | 2.843.807   | 402.329   | 73.760   | 7.095.469  |
| Vertriebsgebühren  | 5    | 397.368  | 2.902  | –   | –  | 191.311   | –   | 455  | 123.513  |
| Verwaltungsgebühren  | 5    | 478.405  | 30.612   | 97.824  | 289.485  | 117.752   | 45.740  | 16.597   | 485.431  |
| Bereitstellungsprovision   | 16   | 40.745   | 837  | 1.447   | 68.244   | 31.311  | 8.476   | –  | 141.868  |
| Depotgebühren  | 5    | 185.642  | 5.944  | 30.822  | 191.096  | 66.198  | 5.944   | 2.476  | 83.980   |
| Gebühren der Verwahrstelle   | 5    | 41.182   | 310  | 525   | 14.587   | 11.318  | 3.584   | 492  | 54.712   |
| Honorare   | 7    | 123.633  | 31.085   | 134.148   | 263.333  | 64.862  | 31.297  | 27.580   | 119.952  |
| Honorare der Direktoren  | 6    | 2.647  | 2.681  | 17.427  | 15.200   | 2.741   | 2.661   | 1.972  | 2.352  |
| Transaktionskosten   | 7    | 2.795.782  | 5.614  | 45.280  | 191.883  | 312.854   | 4.462   | 3.094  | 44.911   |
| Gründungsaufwendungen  | 7    | –  | –  | –   | –  | –   | –   | 33.630   | –  |
| Prüfungshonorare   | 7    | 8.539  | 6.125  | 41.341  | 101.453  | 8.422   | 7.600   | 5.962  | 8.584  |
| Umsatzsteuerentlastung   |      | (6.640)  | (50)   | (83)  | (2.382)  | (1.723)   | (583)   | (192)  | (8.996)  |
| Sonstige Aufwendungen  | 7    | 15.300   | 2.683  | 18.919  | 12.659   | 19.030  | 1.501   | 2.009  | 3.001  |
| Kostenverzicht   | 5    | –  | (72.837)   | (369.825)   | (467.503)  | –   | –   | (27.176)   | –  |
| Verzicht auf Gebühren  | 5    | –  | –  | –   | –  | –   | –   | –  | –  |
| <b>Aufwendungen insgesamt</b>  |      | 15.451.275   | 61.327   | 112.288   | 1.352.073  | 3.667.883   | 513.011   | 140.659  | 8.154.777  |
| <b>Finanzierungskosten</b>   |      |  |  |   |  |   |   |  |  |
| Zinsaufwendungen   |      | 6.727  | 179  | –   | –  | –   | 77  | 10   | 69   |
| Gezahlte Ausschüttungen  | 1    | –  | 341.669  | –   | 1.201.981  | 3.567   | 2.923.610   | –  | 7.603.870  |
| <b>Finanzkosten insgesamt</b>  |      | 6.727  | 341.848  | –   | 1.201.981  | 3.567   | 2.923.687   | 10   | 7.603.939  |
| Quellensteuern   |      | 788.301  | –  | 15.466  | –  | 434.467   | –   | –  | –  |
| Kapitalertragsteuer  |      | –  | –  | –   | –  | –   | –   | –  | –  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter<br/>Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der<br/>Geschäftstätigkeit</b>            |      | (884.714.638)  | (2.184.203)  | (2.650.416)   | (7.008.348)  | (68.085.076)  | (21.514.441)  | (2.232.121)  | (331.422.016)  |

\* Der Commodities wurde am 9. Februar 2022 aufgelegt.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Halbjahresabschlusses.



## Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

|  |      | Emerging Market<br>Debt - Hard<br>Currency<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum | Emerging Market<br>Debt - Local<br>Currency<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum | Emerging Market<br>Debt Blend<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum | Emerging Market<br>Debt Sustainable<br>Investment Grade<br>Blend<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum | Emerging Markets<br>Equity<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum | Emerging Markets<br>Select Equity<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum | Euro Bond Absolute<br>Return<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum | Euro Opportunistic<br>Bond<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum |
|--|------|--|---|---|--|--|---|--|--|
|  | Anm. | 30. Juni 2022<br>US\$  | 30. Juni 2022<br>US\$   | 30. Juni 2022<br>US\$   | 30. Juni 2022<br>US\$  | 30. Juni 2022<br>US\$  | 30. Juni 2022<br>US\$   | 30. Juni 2022<br>EUR   | 30. Juni 2022<br>EUR   |
| <b>Erträge</b>   |      |  |   |   |  |  |   |  |  |
| Zinserträge  |      | 84.862.585   | 53.036.464  | 23.107.753  | 825.061  | 12.276   | 8.374   | 723.853  | 144.158  |
| Dividenerträge   |      | –  | –   | –   | –  | 3.312.112  | 847.915   | –  | –  |
| Erträge aus der Wertpapierleihe  | 15   | 4.832  | –   | 225   | –  | 3.219  | 6.427   | 1.599  | –  |
| Sonstige Erträge   |      | –  | 409.973   | 83.506  | 1.422  | –  | –   | 416  | –  |
| Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten |      | (942.571.249)  | (370.463.756)   | (188.793.324)   | (10.011.681)   | (86.963.119)   | (28.410.425)  | (2.893.998)  | (1.557.993)  |
|  |      | (857.703.832)  | (317.017.319)   | (165.601.840)   | (9.185.198)  | (83.635.512)   | (27.547.709)  | (2.168.130)  | (1.413.835)  |
| <b>Aufwendungen</b>  |      |  |   |   |  |  |   |  |  |
| Managementgebühr   | 5    | 11.182.641   | 6.440.335   | 2.717.770   | 108.675  | 2.052.051  | 455.418   | 68.631   | 18.325   |
| Vertriebsgebühren  | 5    | 157.290  | 327.223   | 15.850  | –  | 407.802  | –   | –  | –  |
| Verwaltungsgebühren  | 5    | 749.632  | 625.520   | 283.100   | 49.791   | 156.480  | 36.210  | 33.929   | 20.375   |
| Bereitstellungsprovision   | 16   | 219.977  | 122.551   | 49.892  | 2.727  | 20.574   | 7.248   | 3.212  | 623  |
| Depotgebühren  | 5    | 137.235  | 733.080   | 180.454   | 5.949  | 84.396   | 32.060  | 5.252  | 5.251  |
| Gebühren der Verwahrstelle   | 5    | 72.895   | 45.370  | 19.868  | 1.098  | 8.460  | 2.681   | 1.410  | 262  |
| Honorare   | 7    | 185.696  | 157.986   | 101.784   | 30.575   | 85.915   | 30.796  | 27.506   | 23.540   |
| Honorare der Direktoren  | 6    | 2.646  | 2.637   | 2.637   | 2.646  | 2.741  | 2.646   | 2.358  | 2.358  |
| Transaktionskosten   | 7    | 140.782  | 685.898   | 200.863   | 39.329   | 440.823  | 127.295   | 13.004   | 5.359  |
| Prüfungshonorare   | 7    | 10.766   | 14.570  | 8.533   | 4.862  | 9.116  | 6.151   | 5.870  | 5.642  |
| Umsatzsteuerentlastung   |      | (11.601)   | (7.092)   | (2.961)   | (175)  | (1.328)  | (420)   | (229)  | (42)   |
| Sonstige Aufwendungen  | 7    | 3.700  | 3.430   | 4.128   | 6.124  | 9.716  | 3.541   | 2.750  | 3.287  |
| Kostenverzicht   | 5    | –  | (67.657)  | –   | (93.825)   | –  | –   | (30.729)   | (55.300)   |
| Verzicht auf Gebühren  | 5    | –  | –   | –   | –  | –  | –   | –  | –  |
| <b>Aufwendungen insgesamt</b>  |      | 12.851.659   | 9.083.851   | 3.581.918   | 157.776  | 3.276.746  | 703.626   | 132.964  | 29.680   |
| <b>Finanzierungskosten</b>   |      |  |   |   |  |  |   |  |  |
| Zinsaufwendungen   |      | 5.178  | 10.632  | 9.387   | 100  | 525  | 203   | 108  | 67   |
| Gezahlte Ausschüttungen  | 1    | 22.305.880   | 16.486.957  | 3.378.077   | –  | 2.683  | 391   | 81.583   | 81.631   |
| <b>Finanzkosten insgesamt</b>  |      | 22.311.058   | 16.497.589  | 3.387.464   | 100  | 3.208  | 594   | 81.691   | 81.698   |
| Quellensteuern   |      | –  | 1.892.396   | 371.014   | 17.392   | 333.398  | 103.832   | 242  | 11   |
| Kapitalertragsteuer  |      | –  | (1.801.721)   | (251.299)   | (3.408)  | (600.487)  | (60.194)  | –  | –  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit</b>              |      | (892.866.549)  | (342.689.434)   | (172.690.937)   | (9.357.058)  | (86.648.377)   | (28.295.567)  | (2.383.027)  | (1.525.224)  |

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Halbjahresabschlusses.

## Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

|  | European High Yield Bond<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>EUR | European Sustainable Equity<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>EUR | Global Bond<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>US\$ | Global Diversified<br>Income FMP – 2024<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>US\$ | Global Equity<br>Megatrends<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>US\$ | Global Flexible Credit<br>Income<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>US\$ | Global High Yield<br>SDG Engagement<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>US\$ | Global High Yield<br>Sustainable Action<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>US\$ |
|--|--|---|--|--|--|---|--|--|
| Anm.   |  |   |  |  |  |   |  |  |
| <b>Erträge</b>   |  |   |  |  |  |   |  |  |
| Zinserträge  | 780.984  | –   | 1.699.196  | 4.798.996  | 601  | 16.085.629  | 2.202.671  | 392.934  |
| Dividenderträge  | –  | 1.679.391   | –  | –  | 436.818  | 13.928  | –  | –  |
| Erträge aus der Wertpapierleihe  | 15 977   | –   | 1  | –  | –  | –   | 64   | –  |
| Sonstige Erträge   | –  | –   | 39   | –  | 36.925   | –   | 8  | –  |
| Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum<br>beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen<br>Vermögenswerten und Verbindlichkeiten | (3.469.815)  | (39.205.777)  | (24.977.113)   | (18.097.561)   | (12.740.782)   | (159.885.935)   | (27.911.175)   | (2.918.368)  |
|  | (2.687.854)  | (37.526.386)  | (23.277.877)   | (13.298.565)   | (12.266.438)   | (143.786.378)   | (25.708.432)   | (2.525.434)  |
| <b>Aufwendungen</b>  |  |   |  |  |  |   |  |  |
| Managementgebühr   | 5 63.096   | 328.229   | 7.641  | 577.418  | 590.464  | 1.176.480   | 116.864  | 42.259   |
| Vertriebsgebühren  | 5 1.320  | 128   | 4.166  | –  | 118.015  | 28.052  | 5.725  | –  |
| Verwaltungsgebühren  | 5 45.995   | 37.849  | 79.550   | 60.427   | 50.437   | 137.917   | 54.756   | 27.325   |
| Bereitstellungsprovision   | 16 2.192   | 5.718   | 9.526  | 13.171   | 4.774  | 40.390  | 1.907  | 1.001  |
| Depotgebühren  | 5 5.244  | 6.048   | 5.975  | 5.947  | 5.944  | 10.701  | 5.944  | 5.952  |
| Gebühren der Verwahrstelle   | 5 899  | 3.363   | 3.946  | 5.401  | 1.971  | 15.332  | 2.095  | 403  |
| Honorare   | 7 35.131   | 21.861  | 44.888   | 43.910   | 34.252   | 55.805  | 34.858   | 25.858   |
| Honorare der Direktoren  | 6 2.359  | 2.445   | 2.644  | 2.646  | 2.695  | 2.640   | 2.657  | 2.627  |
| Transaktionskosten   | 7 9.758  | 167.336   | 30.459   | 2.299  | 31.432   | 27.770  | 12.367   | 2.735  |
| Prüfungshonorare   | 7 7.437  | 7.722   | 6.403  | 8.307  | 7.118  | 7.363   | 6.835  | 6.664  |
| Umsatzsteuerentlastung   | (148)  | (540)   | (639)  | (864)  | (312)  | (2.551)   | (144)  | (65)   |
| Sonstige Aufwendungen  | 7 2.180  | 1.678   | 2.973  | 3.526  | 9.233  | 2.453   | 3.206  | 3.928  |
| Kostenverzicht   | 5 (72.897)   | –   | (13.762)   | –  | –  | –   | (70.797)   | (59.343)   |
| Verzicht auf Gebühren  | 5 –  | –   | –  | –  | –  | (1.773)   | –  | –  |
| <b>Aufwendungen insgesamt</b>  | 102.566  | 581.837   | 183.770  | 722.188  | 856.023  | 1.500.579   | 176.273  | 59.344   |
| <b>Finanzierungskosten</b>   |  |   |  |  |  |   |  |  |
| Zinsaufwendungen   | –  | 6.000   | 586  | –  | 129  | 9.000   | 5  | –  |
| Gezahlte Ausschüttungen  | 1 28.890   | 102.238   | 1.523  | 3.080.650  | –  | 9.089   | 58.815   | 278.541  |
| <b>Finanzkosten insgesamt</b>  | 28.890   | 108.238   | 2.109  | 3.080.650  | 129  | 18.089  | 58.820   | 278.541  |
| Quellensteuern   | –  | 227.211   | 4.376  | –  | 63.534   | 229.366   | –  | –  |
| Kapitalertragsteuer  | –  | –   | –  | –  | –  | –   | –  | –  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter<br/>Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der<br/>Geschäftstätigkeit</b>            | (2.819.310)  | (38.443.672)  | (23.468.132)   | (17.101.403)   | (13.186.124)   | (145.534.412)   | (25.943.525)   | (2.863.319)  |

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Halbjahresabschlusses.

## Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

|  |      | Global Investment<br>Grade Credit<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum | Global<br>Opportunistic Bond<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum | Global Real Estate<br>Securities<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum | Global Sustainable<br>Equity<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum | High Yield Bond<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum | InnovAsia 5G<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum | Japan Equity<br>Engagement<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum | Macro<br>Opportunities FX<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum |
|--|------|---|--|--|--|---|--|--|---|
|  | Anm. | 30. Juni 2022<br>US\$   | 30. Juni 2022<br>US\$  | 30. Juni 2022<br>US\$  | 30. Juni 2022<br>US\$  | 30. Juni 2022<br>US\$                                 | 30. Juni 2022<br>US\$                              | 30. Juni 2022<br>JPY   | 30. Juni 2022<br>EUR  |
| <b>Erträge</b>   |      |   |  |  |  |   |  |  |   |
| Zinserträge  |      | 1.326.691   | 1.423.551  | 359  | 1.793  | 76.098.580  | 810  | –  | 187.647   |
| Dividenderträge  |      | –   | 120.436  | 862.222  | 956.682  | 893.172   | 119.306  | 186.906.630  | –   |
| Erträge aus der Wertpapierleihe  | 15   | –   | 142  | –  | –  | 369.752   | –  | –  | –   |
| Sonstige Erträge   |      | –   | 3  | –  | –  | 159.756   | –  | –  | –   |
| Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten |      | (14.651.019)  | (13.541.230)   | (12.595.912)   | (68.559.110)   | (521.125.930)   | (11.594.956)                                       | (1.297.268.822)  | (904.861)   |
|  |      | (13.324.328)  | (11.997.098)   | (11.733.331)   | (67.600.635)   | (443.604.670)   | (11.474.840)                                       | (1.110.362.192)  | (717.214)   |
| <b>Aufwendungen</b>  |      |   |  |  |  |   |  |  |   |
| Managementgebühr   | 5    | 22.658  | 105.478  | 175.710  | 471.885  | 12.370.492  | 106.289  | 46.516.217   | 83.761  |
| Vertriebsgebühren  | 5    | –   | 2.042  | 14.244   | 55.928   | 1.359.997   | 137  | –  | 79  |
| Verwaltungsgebühren  | 5    | 26.012  | 69.225   | 39.133   | 53.708   | 1.011.514   | 18.592   | 4.464.922  | 31.640  |
| Bereitstellungsprovision   | 16   | –   | 5.639  | 2.949  | 11.206   | 196.813   | 1.534  | –  | 2.734   |
| Depotgebühren  | 5    | 5.024   | 5.944  | 5.952  | 5.787  | 22.331  | 5.107  | 766.189  | 5.253   |
| Gebühren der Verwahrstelle   | 5    | 1.132   | 2.187  | 1.251  | 5.223  | 66.976  | 284  | 408.691  | 883   |
| Honorare   | 7    | 25.931  | 38.817   | 33.656   | 23.736   | 232.136   | 27.961   | 4.088.953  | 27.446  |
| Honorare der Direktoren  | 6    | 2.350   | 2.657  | 2.641  | 2.712  | 2.642   | 2.950  | 320.371  | 2.359   |
| Transaktionskosten   | 7    | –   | 32.080   | 71.423   | 90.143   | 145.363   | 115.321  | 14.483.013   | 20.521  |
| Prüfungshonorare   | 7    | 7.152   | 6.623  | 7.049  | 6.963  | 20.551  | 12.541   | 683.854  | 6.143   |
| Umsatzsteuerentlastung   |      | (362)   | (360)  | (207)  | (840)  | (10.937)  | (91)   | (70.758)   | (144)   |
| Sonstige Aufwendungen  | 7    | 1.788   | 6.443  | 3.485  | 2.224  | 5.181   | 3.703  | 73.257   | 2.380   |
| Kostenverzicht   | 5    | (10.572)  | (65.384)   | (46.871)   | –  | –   | (87.353)   | –  | (61.154)  |
| Verzicht auf Gebühren  | 5    | –   | (562)  | –  | –  | (113.712)   | –  | –  | –)  |
| <b>Aufwendungen insgesamt</b>  |      | 81.113  | 210.829  | 310.415  | 728.675  | 15.309.347  | 206.975  | 71.734.709   | 121.901   |
| <b>Finanzierungskosten</b>   |      |   |  |  |  |   |  |  |   |
| Zinsaufwendungen   |      | –   | 1.878  | 216  | 67   | 13.602  | 47   | 975.795  | 41  |
| Gezahlte Ausschüttungen  | 1    | –   | 104.562  | 107.067  | –  | 47.503.827  | –  | –  | 1.645   |
| <b>Finanzkosten insgesamt</b>  |      | –   | 106.440  | 107.283  | 67   | 47.517.429  | 47   | 975.795  | 1.686   |
| Quellensteuern   |      | 986   | 5.268  | 171.982  | 247.116  | 44.124  | 15.636   | 28.035.995   | –   |
| Kapitalertragsteuer  |      | –   | –  | –  | –  | –   | 4.531  | –  | –   |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit</b>              |      | (13.406.427)  | (12.319.635)   | (12.323.011)   | (68.576.493)   | (506.475.570)   | (11.702.029)                                       | (1.211.108.691)  | (840.801)   |

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Halbjahresabschlusses.

## Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

|  | Multi-Asset Income<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>Anm. 30. Juni 2022<br>US\$ | Next Generation<br>Mobility<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>US\$ | Next Generation<br>Space Economy<br>Berichtszeitraum<br>zum<br>30. Juni 2022*<br>US\$ | Short Duration<br>Emerging Market<br>Debt<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>US\$ | Short Duration<br>Yield High<br>SDG<br>Engagement<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>US\$ | Strategic Income<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>US\$ | Sustainable Asia<br>High Yield<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>US\$ | Sustainable Emerging<br>Market Corporate<br>Debt<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>US\$ |              |
|--|--|--|---|--|--|---|---|---|--------------|
| <b>Erträge</b>   |  |  |   |  |  |   |   |   |              |
| Zinserträge  | 197.462  | 9.197  | 427   | 132.919.815  | 16.612.650   | 23.129.810  | 1.622.926   | 3.324.058   |              |
| Dividenerträge   | 186.838  | 1.056.875  | 10.358  | –  | 67.139   | 30.397  | –   | –   |              |
| Erträge aus der Wertpapierleihe  | 15   | –  | –   | 11.742   | 19.067   | 21.952  | –   | 151   |              |
| Sonstige Erträge   | –  | –  | –   | –  | 39.569   | –   | –   | –   |              |
| Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum<br>beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen<br>Vermögenswerten und Verbindlichkeiten | (3.082.899)  | (63.246.879)   | (82.483)  | (1.117.875.413)  | (98.077.032)   | (241.538.222)   | (19.477.427)  | (29.513.798)  |              |
|  | (2.698.599)  | (62.180.807)   | (71.698)  | (984.943.856)  | (81.338.607)   | (218.356.063)   | (17.854.501)  | (26.189.589)  |              |
| <b>Aufwendungen</b>  |  |  |   |  |  |   |   |   |              |
| Managementgebühr   | 5  | 104.784  | 1.271.294   | 6.889  | 17.299.065   | 1.886.054   | 4.599.764   | 139.725   | 489.519      |
| Vertriebsgebühren  | 5  | 24.120   | 198.801   | 1.137  | 450.391  | 39.386  | 556.980   | –   | 15.134       |
| Verwaltungsgebühren  | 5  | 65.365   | 81.780  | 2.286  | 1.321.510  | 180.350   | 464.870   | 35.005  | 84.203       |
| Bereitstellungsprovision   | 16   | 1.312  | 12.597  | –  | 409.028  | 38.569  | 84.562  | –   | 8.321        |
| Depotgebühren  | 5  | 5.945  | 5.952   | 840  | 250.797  | 5.950   | 21.506  | 4.041   | 5.956        |
| Gebühren der Verwahrstelle   | 5  | 521  | 4.661   | 18   | 155.221  | 14.416  | 34.785  | 807   | 3.279        |
| Honorare   | 7  | 32.688   | 47.811  | 8.367  | 227.685  | 73.533  | 115.734   | 33.167  | 67.219       |
| Honorare der Direktoren  | 6  | 2.637  | 2.692   | 690  | 2.637  | 2.627   | 2.644   | 2.580   | 2.637        |
| Transaktionskosten   | 7  | 33.512   | 37.143  | 5.701  | 69.893   | 33.084  | 129.897   | 6.277   | 19.803       |
| Gründungsaufwendungen  | 7  | –  | –   | 33.380   | –  | –   | –   | –   | –            |
| Prüfungshonorare   | 7  | 6.666  | 8.024   | 3.057  | 11.493   | 13.652  | 25.381  | 8.112   | 8.081        |
| Umsatzsteuerentlastung   |  | (84)   | (741)   | –  | (24.704)   | (2.286)   | (5.555)   | (236)   | (518)        |
| Sonstige Aufwendungen  | 7  | 3.133  | 10.283  | 563  | 4.495  | 3.794   | 30.214  | 4.173   | 2.468        |
| Kostenverzicht   | 5  | (123.839)  | –   | (17.496)   | –  | –   | –   | (45.756)  | (80.567)     |
| Verzicht auf Gebühren  | 5  | –  | –   | –  | –  | (8.548)   | (3.869)   | –   | –            |
| <b>Aufwendungen insgesamt</b>  |  | 156.760  | 1.680.297   | 45.432   | 20.177.511   | 2.280.581   | 6.056.913   | 187.895   | 625.535      |
| <b>Finanzierungskosten</b>   |  |  |   |  |  |   |   |   |              |
| Zinsaufwendungen   | 2  | –  | –   | –  | 97.981   | –   | 76  | –   | 6.659        |
| Gezahlte Ausschüttungen  | 1  | 8.306  | –   | –  | 33.769.222   | 1.687.770   | 4.061.207   | 74.547  | 180.316      |
| <b>Finanzkosten insgesamt</b>  |  | 8.308  | –   | –  | 33.867.203   | 1.687.770   | 4.061.283   | 74.547  | 186.975      |
| Quellensteuern   |  | 25.173   | 187.209   | 2.179  | –  | –   | 273.663   | 13.789  | –            |
| Kapitalertragsteuer  |  | (491)  | –   | –  | –  | –   | (65.574)  | –   | –            |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter<br/>Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der<br/>Geschäftstätigkeit</b>            |  | (2.888.349)  | (64.048.313)  | (119.309)  | (1.038.988.570)  | (85.306.958)  | (228.682.348)   | (18.130.732)  | (27.002.099) |

\* Der Next Generation Space Economy wurde am 10. Mai 2022 aufgelegt.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Halbjahresabschlusses.

## Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

|  |    | Sustainable Emerging<br>Market Debt - Hard<br>Currency<br>Berichtszeitraum<br>zum<br>Anm. 30. Juni 2022*<br>US\$ | Systematic Global<br>Sustainable Value<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>US\$ | Ultra Short Term<br>Euro Bond<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>EUR | Uncorrelated<br>Strategies<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>US\$ | Uncorrelated<br>Trading<br>Berichtszeitraum<br>zum<br>30. Juni 2022**<br>US\$ | US Equity<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>US\$ | US Equity Index<br>PutWrite<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>US\$ | US Large Cap Value<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>US\$ |
|--|----|--|---|---|---|---|--|--|---|
| <b>Erträge</b>   |    |  |   |   |   |   |  |  |   |
| Zinserträge  |    | 2.237.202  | 233   | 10.214.589  | 8.550.716   | 60.232  | 764  | 2.003.803  | 44.018  |
| Dividendenerträge  |    | –  | 698.806   | –   | –   | 16.753  | 85.576   | –  | 5.090.521   |
| Erträge aus der Wertpapierleihe  | 15 | –  | 235   | 36.550  | –   | –   | 2.477  | –  | –   |
| Sonstige Erträge   |    | –  | 396   | –   | 875.273   | –   | 756  | –  | –   |
| Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum<br>beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen<br>Vermögenswerten und Verbindlichkeiten |    | (27.900.852)   | (7.724.773)   | (74.540.842)  | 59.244.419  | (5.962.486)   | (4.819.928)  | (94.673.365)   | (118.626.733)   |
|  |    | (25.663.650)   | (7.025.103)   | (64.289.703)  | 68.670.408  | (5.885.501)   | (4.730.355)  | (92.669.562)   | (113.492.194)   |
| <b>Aufwendungen</b>  |    |  |   |   |   |   |  |  |   |
| Managementgebühr   | 5  | 154.774  | 47.787  | 840.533   | 8.684.669   | 151.642   | 56.579   | 1.203.860  | 1.049.819   |
| Vertriebsgebühren  | 5  | –  | 2.563   | 73  | 84.161  | –   | 28   | 7.093  | 14.687  |
| Verwaltungsgebühren  | 5  | 29.856   | 26.301  | 240.090   | 1.315.706   | 19.287  | 17.143   | 163.261  | 75.592  |
| Bereitstellungsprovision   | 16 | –  | 1.187   | 63.739  | 146.357   | –   | 546  | 26.583   | –   |
| Depotgebühren  | 5  | 2.749  | 5.944   | 39.810  | 136.874   | 1.303   | 5.944  | 5.938  | 4.031   |
| Gebühren der Verwahrstelle   | 5  | 1.105  | 957   | 28.789  | 129.250   | 931   | 365  | 14.092   | 5.734   |
| Honorare   | 7  | 35.172   | 41.916  | 63.656  | 218.684   | 6.185   | 23.651   | 61.646   | 35.402  |
| Honorare der Direktoren  | 6  | 2.325  | 2.648   | 2.548   | 2.646   | 205   | 2.649  | 2.648  | 2.569   |
| Erfolgsabhängige Gebühr  | 5  | –  | –   | –   | 56.462.840  | 21  | –  | –  | –   |
| Transaktionskosten   | 7  | 12.999   | 86.268  | 78.024  | 12.462.842  | 252.615   | 6.287  | 51.623   | 290.905   |
| Gründungs aufwendungen   | 7  | 34.116   | –   | –   | –   | 105.495   | –  | –  | –   |
| Prüfungshonorare   | 7  | 6.890  | 6.092   | 6.004   | 7.097   | 783   | 7.020  | 8.953  | 7.093   |
| Umsatzsteuerentlastung   |    | (399)  | (166)   | (4.577)   | (10.503)  | –   | (52)   | (2.230)  | (2.496)   |
| Sonstige Aufwendungen  | 7  | 1.679  | 2.613   | 4.221   | 2.755.005   | 4.939   | 2.695  | 2.765  | 4.807   |
| Kostenverzicht   | 5  | (34.763)   | (46.343)  | –   | –   | –   | (48.318)   | –  | –   |
| Verzicht auf Gebühren  | 5  | –  | –   | –   | –   | –   | –  | –  | –   |
| <b>Aufwendungen insgesamt</b>  |    | 246.503  | 177.767   | 1.362.910   | 82.395.628  | 543.406   | 74.537   | 1.546.232  | 1.488.143   |
| <b>Finanzierungskosten</b>   |    |  |   |   |   |   |  |  |   |
| Zinsaufwendungen   |    | 1.319  | 155   | –   | 38.565  | 2.498   | 1.008  | –  | 63  |
| Gezahlte Ausschüttungen  | 1  | –  | –   | 6.135   | –   | –   | –  | 2.620.757  | –   |
| <b>Finanzkosten insgesamt</b>  |    | 1.319  | 155   | 6.135   | 38.565  | 2.498   | 1.008  | 2.620.757  | 63  |
| Quellensteuern   |    | 65.285   | 125.247   | 10.633  | 2.393.842   | 8   | 23.062   | –  | 1.443.845   |
| Kapitalertragsteuer  |    | –  | –   | –   | –   | –   | –  | –  | –   |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile<br/>entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit</b>                |    | (25.976.757)   | (7.328.272)   | (65.669.381)  | (16.157.627)  | (6.431.413)   | (4.828.962)  | (96.836.551)   | (116.424.245)   |

\* Der Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency wurde am 19. Januar 2022 aufgelegt.

\*\* Der Uncorrelated Tradin Fund wurde am 14. Juni 2022 aufgelegt.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Halbjahresabschlusses.

## Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

|  |      | US Long Short Equity<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>US\$ | US Multi Cap<br>Opportunities<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>US\$ | US Real Estate<br>Securities<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>US\$ | US Small Cap<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>US\$ | US Small Cap Intrinsic<br>Value<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>US\$ | Fonds insgesamt*<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>US\$ |
|--|------|---|--|---|---|--|---|
|  | Anm. |   |  |   |   |  |   |
| <b>Erträge</b>   |      |   |  |   |   |  |   |
| Zinserträge  |      | 241.338   | 4.193  | 9.862   | 8.175   | 14.634   | 521.959.506   |
| Dividenerträge   |      | 1.549.775   | 4.411.471  | 13.677.180  | 2.511.898   | 543.092  | 52.269.181  |
| Erträge aus der Wertpapierleihe  | 15   | 67.231  | –  | –   | –   | –  | 610.498   |
| Sonstige Erträge   |      | 99.401  | –  | –   | –   | –  | 1.707.482   |
| Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden<br>Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und<br>Verbindlichkeiten |      | (36.165.895)  | (187.617.902)  | (225.757.163)   | (170.206.814)   | (47.411.456)   | (6.448.449.732)   |
|  |      | (34.208.150)  | (183.202.238)  | (212.070.121)   | (167.686.741)   | (46.853.730)   | (5.871.903.065)   |
| <b>Aufwendungen</b>  |      |   |  |   |   |  |   |
| Managementgebühr   | 5    | 1.741.187   | 4.206.423  | 6.212.100   | 3.717.452   | 722.837  | 116.986.803   |
| Vertriebsgebühren  | 5    | 22.313  | 515.614  | 1.140.760   | 477.697   | 2.738  | 6.778.859   |
| Verwaltungsgebühren  | 5    | 104.466   | 291.965  | 683.639   | 253.287   | 53.536   | 10.562.574  |
| Bereitstellungsprovision   | 16   | 23.565  | 45.429   | 56.380  | 43.559  | 8.645  | 1.951.197   |
| Depotgebühren  | 5    | 5.952   | 5.986  | 6.833   | 6.122   | 5.944  | 2.229.948   |
| Gebühren der Verwahrstelle   | 5    | 6.776   | 18.290   | 22.658  | 15.980  | 4.168  | 851.853   |
| Honorare   | 7    | 42.337  | 95.307   | 113.452   | 84.812  | 29.936   | 3.331.153   |
| Honorare der Direktoren  | 6    | 2.637   | 2.661  | 2.646   | 2.627   | 2.641  | 134.547   |
| Erfolgsabhängige Gebühr  | 5    | –   | –  | –   | –   | –  | 56.462.861  |
| Transaktionskosten   | 7    | 118.886   | 151.122  | 245.986   | 147.818   | 55.874   | 20.061.789  |
| Gründungsaufwendungen  | 7    | –   | –  | –   | –   | –  | 206.621   |
| Prüfungshonorare   | 7    | 8.576   | 10.222   | 11.801  | 9.736   | 6.452  | 448.814   |
| Umsatzsteuerentlastung   |      | (1.195)   | (2.919)  | (3.812)   | (2.487)   | (684)  | (128.203)   |
| Sonstige Aufwendungen  | 7    | 75.295  | 3.080  | 3.879   | 4.128   | 8.749  | 3.074.842   |
| Kostenverzicht   | 5    | –   | –  | –   | –   | –  | (1.382.422)   |
| Verzicht auf Gebühren  | 5    | –   | –  | –   | –   | –  | (128.464)   |
| <b>Aufwendungen insgesamt</b>  |      | 2.150.795   | 5.343.180  | 8.496.322   | 4.760.731   | 900.836  | 221.442.772   |
| <b>Finanzierungskosten</b>   |      |   |  |   |   |  |   |
| Zinsaufwendungen   |      | –   | 1.775  | 335   | 75  | –  | 223.881   |
| Gezahlte Ausschüttungen  | 1    | –   | 13.581   | 4.143.391   | –   | –  | 151.972.746   |
| <b>Finanzkosten insgesamt</b>  |      | –   | 15.356   | 4.143.726   | 75  | –  | 152.196.627   |
| Quellensteuern   |      | 392.455   | 1.265.500  | 3.405.340   | 723.182   | 136.180  | 15.690.268  |
| Kapitalertragsteuer  |      | –   | –  | –   | –   | –  | (2.778.643)   |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile<br/>entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit</b>                |      | (36.751.400)  | (189.826.274)  | (228.115.509)   | (173.170.729)   | (47.890.746)   | (6.258.454.089)   |

Alle Erträge und Aufwendungen ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit. Außer den in der konsolidierten Gewinn- und Verlustrechnung ausgewiesenen gab es keine Gewinne und Verluste im Berichtszeitraum.

\* Der konsolidierte Halbjahresabschluss wurde um Überkreuzinvestitionen zwischen den Portfolios bereinigt. Details zu Überkreuzinvestitionen zwischen Teilfonds sind Anmerkung 8 der Anmerkungen zum ungeprüften verkürzten Halbjahresabschluss zu entnehmen.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Halbjahresabschlusses.

## Aufstellungen über die Entwicklung des auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens

|   | 5G Connectivity<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | Absolute Return<br>Multi Strategy<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023*<br>US\$ | Asian Debt - Hard<br>Currency<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | China A-Share<br>Equity<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>CNY | China Bond<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>CNY | China Equity<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | CLO Income<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | Commodities<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ |
|---|--|---|--|---|--|---|---|--|
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter<br/>Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des<br/>Berichtszeitraums</b> | 993.010.193  | –   | 21.626.209   | 16.241.758  | 453.043.579  | 317.413.676   | 138.037.464   | 85.997.429   |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile<br>entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit               | 203.219.780  | –   | 648.517  | (643.000)   | 38.099.223   | (30.064.794)  | 6.902.229   | (5.925.142)  |
| Zeichnungen   | 51.386.945   | –   | 50.123.098   | –   | 598.358  | 26.675  | 15.732.390  | 33.061.808   |
| Rücknahmen  | (196.387.817)  | –   | (10.405.463)   | –   | (23.829.851)   | (12.379.775)  | (15.930.050)  | (5.238.465)  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter<br/>Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des<br/>Berichtszeitraums</b>   | 1.051.229.101  | –   | 61.992.361   | 15.598.758  | 467.911.309  | 274.995.782   | 144.742.033   | 107.895.630  |

  

|   | Corporate Hybrid<br>Bond<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>EUR | Emerging Market<br>Debt - Hard<br>Currency<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | Emerging Market<br>Debt - Local<br>Currency<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | Emerging Market<br>Debt Blend<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | Emerging Market<br>Debt Sustainable<br>Investment Grade<br>Blend<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | Emerging Markets<br>Equity<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | Emerging Markets<br>Select Equity<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | Euro Bond<br>Absolute Return<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>EUR |
|---|--|---|--|--|---|---|--|--|
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter<br/>Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des<br/>Berichtszeitraums</b> | 1.782.154.808  | 2.491.704.928   | 1.386.264.443  | 470.181.480  | 54.274.381  | 191.807.755   | 93.762.122   | 48.527.876   |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile<br>entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit               | 26.109.754   | 105.165.860   | 94.576.040   | 28.000.655   | 464.594   | 7.863.509   | 2.550.142  | 477.243  |
| Zeichnungen   | 256.495.170  | 454.361.872   | 108.440.639  | 48.821.292   | 8.312.942   | 63.717.088  | 859.976  | 691.146  |
| Rücknahmen  | (344.369.994)  | (559.230.440)   | (324.700.553)  | (54.892.425)   | (712.984)   | (144.187.946)   | (403.822)  | (1.522.019)  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter<br/>Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des<br/>Berichtszeitraums</b>   | 1.720.389.738  | 2.492.002.220   | 1.264.580.569  | 492.111.002  | 62.338.933  | 119.200.406   | 96.768.418   | 48.174.246   |

\* Der Absolute Return Multi Strategy wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

## Aufstellungen über die Entwicklung des auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens (Fortsetzung)

|   | Euro Opportunistic Bond<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>EUR | European High Yield Bond<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>EUR | European Sustainable Equity<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>EUR | Event Driven<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | Global Bond<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | Global Diversified Income FMP – 2024<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | Global Equity Megatrends<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | Global Flexible Credit Income<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ |
|---|---|--|---|---|--|---|---|--|
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums</b> | 9.294.742   | 32.454.528   | 175.854.230   | 41.446.672  | 134.811.296  | 160.396.086   | 79.344.365  | 394.526.329  |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit          | 205.138   | 1.644.272  | 21.781.161  | 3.396.729   | 2.288.152  | 2.080.531   | 12.353.225  | 26.340.365   |
| Zeichnungen   | 99.409  | 48.375.701   | 17.658.480  | 53.340.583  | 7.790.898  | 18.845  | 24.472.539  | 16.246.439   |
| Rücknahmen  | –   | (3.069.129)  | (44.364.569)  | (12.051.000)  | (8.673.706)  | (2.082.977)   | (13.405.081)  | (92.719.743)   |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>   | 9.599.289   | 79.405.372   | 170.929.302   | 86.132.984  | 136.216.640  | 160.412.485   | 102.765.048   | 344.393.390  |

  

|   | Global High Yield<br>SDG Engagement<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | Global High Yield Sustainable Action<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023*<br>US\$ | Global Investment Grade Credit<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | Global Opportunistic Bond<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | Global Real Estate Securities<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | Global Sustainable Equity<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | High Yield Bond<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | InnovAsia 5G<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ |
|---|--|--|---|--|--|--|--|---|
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums</b> | 336.953.378  | 15.047.068   | 85.908.642  | 76.105.443   | 39.022.420   | 131.578.199  | 2.298.751.712  | 14.748.993  |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit          | 14.785.794   | 343.290  | 2.685.819   | 1.698.392  | 206.023  | 20.290.440   | 40.926.766   | 3.342.743   |
| Zeichnungen   | 236.711.240  | –  | 450.000   | 4.021.220  | 1.224.931  | 12.589.751   | 318.060.660  | 3.877.592   |
| Rücknahmen  | (27.750.058)   | (15.390.358)   | (7.534.000)   | (14.068.067)   | (7.069.882)  | (14.209.163)   | (437.508.730)  | (962.573)   |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>   | 560.700.354  | –  | 81.510.461  | 67.756.988   | 33.383.492   | 150.249.227  | 2.220.230.408  | 21.006.755  |

\* Der Global High Yield Sustainable Action wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst.



## Aufstellungen über die Entwicklung des auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens (Fortsetzung)

|   | Japan Equity<br>Engagement<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>JPY      | Macro<br>Opportunities FX<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>EUR                         | Multi-Asset Income<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$  | Next Generation<br>Mobility<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$            | Next Generation<br>Space Economy<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | Short Duration<br>Emerging Market<br>Debt<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | Short Duration<br>High Yield SDG<br>Engagement<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | Strategic Income<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$          |
|---|---|---|--|---|---|--|---|--|
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter<br/>Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des<br/>Berichtszeitraums</b> | 20.542.667.585  | 31.510.156  | 11.366.115   | 148.004.677   | 8.490.862   | 5.124.661.750  | 556.373.679   | 1.322.805.855  |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile<br>entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit               | 4.259.570.090   | (1.154.940)   | 233.326  | 32.983.064  | 1.732.070   | 74.943.690   | 7.099.027   | 12.129.694   |
| Zeichnungen   | 805.743.700   | 6.050.887   | 24.302   | 11.355.250  | 3.616.134   | 518.710.028  | 354.687.947   | 455.304.514  |
| Rücknahmen  | (1.510.255.291)   | (6.496.610)   | (4.241.159)  | (21.456.971)  | (115.996)   | (951.758.863)  | (199.975.733)   | (314.733.377)  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter<br/>Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des<br/>Berichtszeitraums</b>   | 24.097.726.084  | 29.909.493  | 7.382.584  | 170.886.020   | 13.723.070  | 4.766.556.605  | 718.184.920   | 1.475.506.686  |
|   | Sustainable Asia<br>High Yield<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | Sustainable<br>Emerging Market<br>Corporate Debt<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | Sustainable<br>Emerging Market<br>Debt - Hard<br>Currency<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | Systematic Global<br>Sustainable Value<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | Tactical Macro<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023*<br>US\$                  | Ultra Short Term<br>Euro Bond<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>EUR              | Uncorrelated<br>Strategies<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$                     | Uncorrelated<br>Trading<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023**<br>US\$ |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter<br/>Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des<br/>Berichtszeitraums</b> | 31.922.271  | 98.244.308  | 158.420.594  | 48.024.441  | -   | 821.390.067  | 3.130.486.982   | 711.942.710  |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile<br>entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit               | 266.204   | 3.254.222   | 10.693.149   | 3.836.098   | 1.333   | 14.405.584   | (123.310.742)   | (14.165.514)   |
| Zeichnungen   | 5.943   | 2.682.037   | 209.126.718  | 3.480.645   | 17.020.000  | 244.744.474  | 617.909.134   | 11.358.695   |
| Rücknahmen  | (3.833.672)   | (7.460.731)   | (37.942.614)   | (9.244.626)   | -   | (174.286.130)  | (1.343.367.475)   | (709.135.891)  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter<br/>Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des<br/>Berichtszeitraums</b>   | 28.360.746  | 96.719.836  | 340.297.847  | 46.096.558  | 17.021.333  | 906.253.995  | 2.281.717.899   | -  |

\* Der Tactical Macro wurde am 30. Juni 2023 aufgelegt.

\*\* Der Uncorrelated Trading wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Halbjahresabschlusses.

## Aufstellungen über die Entwicklung des auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens (Fortsetzung)

|   | US Equity<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | US Equity Index<br>PutWrite<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | US Large Cap Value<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | US Long Short<br>Equity<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | US Multi Cap<br>Opportunities<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | US Real Estate<br>Securities<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | US Small Cap<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ | US Small Cap<br>Intrinsic Value<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2023<br>US\$ |
|---|--|--|---|--|--|---|---|--|
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter<br/>Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des<br/>Berichtszeitraums</b> | 31.464.829   | 680.456.738  | 1.767.954.359   | 221.529.901  | 441.315.950  | 648.025.795   | 592.378.667   | 194.041.040  |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile<br>entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit               | 4.765.233  | 79.319.674   | (43.704.004)  | 15.800.229   | 47.244.054   | 8.861.597   | 67.946.859  | 18.836.014   |
| Zeichnungen   | 2.596.705  | 112.089.031  | 518.940.915   | 34.107.630   | 49.576.232   | 46.464.562  | 75.425.983  | 82.913.505   |
| Rücknahmen  | (591.459)  | (191.870.566)  | (376.752.357)   | (49.012.904)   | (124.605.667)  | (144.200.203)   | (106.966.673)   | (15.243.759)   |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter<br/>Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des<br/>Berichtszeitraums</b>   | 38.235.308   | 679.994.877  | 1.866.438.913   | 222.424.856  | 413.530.569  | 559.151.751   | 628.784.836   | 280.546.800  |
|   | <b>Fonds insgesamt*</b>  |  |   |  |  |   |   |  |
|   | <b>Sechsmonatiger</b>  |  |   |  |  |   |   |  |
|   | <b>Berichtszeitraum</b>  |  |   |  |  |   |   |  |
|   | <b>Anm. 30. Juni 2023</b>  |  |   |  |  |   |   |  |
|   | <b>US\$</b>  |  |   |  |  |   |   |  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter<br/>Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des<br/>Berichtszeitraums</b> | 29.114.382.221   |  |   |  |  |   |   |  |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile<br>entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit               | 852.062.899  |  |   |  |  |   |   |  |
| Wechselkursbewegungen   | 12   | 51.504.327   |   |  |  |   |   |  |
| Zeichnungen   |  | 5.267.098.167  |   |  |  |   |   |  |
| Rücknahmen  |  | (7.222.654.626)  |   |  |  |   |   |  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter<br/>Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des<br/>Berichtszeitraums</b>   | 28.062.392.988   |  |   |  |  |   |   |  |

\* Der konsolidierte Halbjahresabschluss wurde um Überkreuzinvestitionen zwischen den Portfolios bereinigt. Details zu Überkreuzinvestitionen zwischen Teilfonds sind Anmerkung 8 der Anmerkungen zum ungeprüften verkürzten Halbjahresabschluss zu entnehmen.

## Aufstellungen über die Entwicklung des auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens (Fortsetzung)

|   | 5G Connectivity                 | Asian Debt - Hard Currency      | China A-Share Equity            | China Bond                      | China Equity                    | CLO Income                      | Commodities Berichtszeitraum zum | Corporate Hybrid Bond           |
|---|---------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|----------------------------------|---------------------------------|
|   | Sechsmonatiger Berichtszeitraum | Sechsmonatiger Berichtszeitraum | Sechsmonatiger Berichtszeitraum | Sechsmonatiger Berichtszeitraum | Sechsmonatiger Berichtszeitraum | Sechsmonatiger Berichtszeitraum | zum                              | Sechsmonatiger Berichtszeitraum |
|   | 30. Juni 2022                   | 30. Juni 2022                   | 30. Juni 2022                   | 30. Juni 2022                   | 30. Juni 2022                   | 30. Juni 2022                   | 30. Juni 2022*                   | 30. Juni 2022                   |
|   | US\$                            | US\$                            | CNY                             | CNY                             | US\$                            | US\$                            | US\$                             | EUR                             |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums</b> | 2.395.521.641                   | 14.429.520                      | 24.427.958                      | 580.753.658                     | 529.341.191                     | 149.839.432                     | –                                | 2.458.411.975                   |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit          | (884.714.638)                   | (2.184.203)                     | (2.650.416)                     | (7.008.348)                     | (68.085.076)                    | (21.514.441)                    | (2.232.121)                      | (331.422.016)                   |
| Zeichnungen   | 147.176.248                     | 850                             | 133.524                         | 45.709.066                      | 198.138                         | 7.494.889                       | 79.044.044                       | 573.630.794                     |
| Rücknahmen  | (458.519.212)                   | (1.032.932)                     | –                               | (31.012.658)                    | (26.174.955)                    | (4.765.175)                     | (7.944.681)                      | (882.823.567)                   |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>   | 1.199.464.039                   | 11.213.235                      | 21.911.066                      | 588.441.718                     | 435.279.298                     | 131.054.705                     | 68.867.242                       | 1.817.797.186                   |

|   | Emerging Market Debt - Hard Currency | Emerging Market Debt - Local Currency | Emerging Market Debt Blend      | Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend | Emerging Markets Equity         | Emerging Markets Select Equity  | Euro Bond Absolute Return       | Euro Opportunistic Bond         |
|---|--------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------|---|---------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|
|   | Sechsmonatiger Berichtszeitraum      | Sechsmonatiger Berichtszeitraum       | Sechsmonatiger Berichtszeitraum | Sechsmonatiger Berichtszeitraum                         | Sechsmonatiger Berichtszeitraum | Sechsmonatiger Berichtszeitraum | Sechsmonatiger Berichtszeitraum | Sechsmonatiger Berichtszeitraum |
|   | 30. Juni 2022                        | 30. Juni 2022                         | 30. Juni 2022                   | 30. Juni 2022   | 30. Juni 2022                   | 30. Juni 2022                   | 30. Juni 2022                   | 30. Juni 2022                   |
|   | US\$                                 | US\$                                  | US\$                            | US\$  | US\$                            | US\$                            | EUR                             | EUR                             |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums</b> | 3.612.575.490                        | 2.102.682.652                         | 947.581.444                     | 47.386.279  | 388.690.425                     | 125.356.269                     | 54.164.845                      | 11.211.336                      |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit          | (892.866.549)                        | (342.689.434)                         | (172.690.937)                   | (9.357.058)   | (86.648.377)                    | (28.295.567)                    | (2.383.027)                     | (1.525.224)                     |
| Zeichnungen   | 740.527.045                          | 150.406.997                           | 74.377.278                      | 7.465.499   | 41.537.075                      | 2.428.701                       | 6.302.708                       | –                               |
| Rücknahmen  | (1.036.647.020)                      | (355.181.519)                         | (243.593.166)                   | (5.644.895)   | (39.363.743)                    | (3.245.904)                     | (5.392.248)                     | –                               |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>   | 2.423.588.966                        | 1.555.218.696                         | 605.674.619                     | 39.849.825  | 304.215.380                     | 96.243.499                      | 52.692.278                      | 9.686.112                       |

\* Der Commodities wurde am 9. Februar 2022 aufgelegt.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Halbjahresabschlusses.

## Aufstellungen über die Entwicklung des auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens (Fortsetzung)

|   | European High Yield Bond<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>EUR | European Sustainable Equity<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>EUR | Global Bond<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>US\$ | Global Diversified<br>Income FMP – 2024<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>US\$ | Global Equity<br>Megatrends<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>US\$ | Global Flexible<br>Credit Income<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>US\$ | Global High Yield<br>SDG Engagement<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>US\$ | Global High Yield<br>Sustainable Action<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>US\$ |
|---|--|---|--|--|--|---|--|--|
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter<br/>Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des<br/>Berichtszeitraums</b> | 38.865.311   | 113.886.075   | 180.397.378  | 233.747.409  | 83.153.849   | 705.212.784   | 39.627.349   | 17.600.553   |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile<br>entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit               | (2.819.310)  | (38.443.672)  | (23.468.132)   | (17.101.403)   | (13.186.124)   | (145.534.412)   | (25.943.525)   | (2.863.319)  |
| Zeichnungen   | 294.057  | 66.284.346  | 11.182.181   | –  | 23.102.189   | 92.946.039  | 270.090.220  | –  |
| Rücknahmen  | (2.806.683)  | (5.692.819)   | (23.857.346)   | (8.523.955)  | (17.689.197)   | (118.000.203)   | (7.170.849)  | –  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter<br/>Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des<br/>Berichtszeitraums</b>   | 33.533.375   | 136.033.930   | 144.254.081  | 208.122.051  | 75.380.717   | 534.624.208   | 276.603.195  | 14.737.234   |

  

|   | Global Investment<br>Grade Credit<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>US\$ | Global<br>Opportunistic Bond<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>US\$ | Global Real Estate<br>Securities<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>US\$ | Global Sustainable<br>Equity<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>US\$ | High Yield Bond<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>US\$ | InnovAsia 5G<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>US\$ | Japan Equity<br>Engagement<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>JPY | Macro<br>Opportunities FX<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>EUR |
|---|--|---|---|---|--|---|--|---|
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter<br/>Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des<br/>Berichtszeitraums</b> | 98.810.202   | 94.244.831  | 50.887.571  | 203.986.580   | 3.203.355.473  | 26.794.987  | 12.105.937.644   | 44.609.891  |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile<br>entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit               | (13.406.427)   | (12.319.635)  | (12.323.011)  | (68.576.493)  | (506.475.570)  | (11.702.029)  | (1.211.108.691)  | (840.801)   |
| Zeichnungen   | 12.467   | 19.474.727  | 19.444.793  | 80.567.135  | 222.534.043  | 6.138.962   | 8.909.419.112  | 7.871.163   |
| Rücknahmen  | –  | (20.755.442)  | (6.554.649)   | (19.444.459)  | (758.393.890)  | (2.008.112)   | (1.271.346.753)  | (16.299.186)  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter<br/>Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des<br/>Berichtszeitraums</b>   | 85.416.242   | 80.644.481  | 51.454.704  | 196.532.763   | 2.161.020.056  | 19.223.808  | 18.532.901.312   | 35.341.067  |

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Halbjahresabschlusses.

## Aufstellungen über die Entwicklung des auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens (Fortsetzung)

|   | Multi-Asset Income<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>US\$ | Next Generation<br>Mobility<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>US\$ | Next Generation<br>Space Economy<br>Berichtszeitraum<br>zum<br>30. Juni 2022*<br>US\$ | Short Duration<br>Emerging Market<br>Debt<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>US\$ | Short Duration<br>High Yield SDG<br>Engagement<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>US\$ | Strategic Income<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>US\$ | Sustainable Asia<br>High Yield<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>US\$ | Sustainable Emerging<br>Market Corporate<br>Debt<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>US\$ |
|---|---|--|---|--|---|---|---|---|
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter<br/>Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des<br/>Berichtszeitraums</b> | 22.705.351  | 220.483.316  | –   | 6.934.454.095  | 644.439.910   | 1.444.921.523   | 24.721.277  | 145.057.425   |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile<br>entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit               | (2.888.349)   | (64.048.313)   | (119.309)   | (1.038.988.570)  | (85.306.958)  | (228.682.348)   | (18.130.732)  | (27.002.099)  |
| Zeichnungen   | 1.155.986   | 26.324.449   | 5.001.644   | 881.072.543  | 34.603.251  | 336.823.460   | 72.400.542  | 13.875.652  |
| Rücknahmen  | (2.822.703)   | (29.178.885)   | –   | (1.283.189.043)  | (93.051.613)  | (278.125.619)   | (46.266.927)  | (18.731.668)  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter<br/>Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des<br/>Berichtszeitraums</b>   | 18.150.285  | 153.580.567  | 4.882.335   | 5.493.349.025  | 500.684.590   | 1.274.937.016   | 32.724.160  | 113.199.310   |

  

|   | Sustainable<br>Emerging Market<br>Debt - Hard<br>Currency<br>Berichtszeitraum<br>zum<br>30. Juni 2022**<br>US\$ | Systematic Global<br>Sustainable Value<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>US\$ | Ultra Short Term<br>Euro Bond<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>EUR | Uncorrelated<br>Strategies<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>US\$ | Uncorrelated<br>Trading<br>Berichtszeitraum<br>zum<br>30. Juni 2022***<br>US\$ | US Equity<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>US\$ | US Equity Index<br>PutWrite<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>US\$ | US Large Cap Value<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum<br>30. Juni 2022<br>US\$ |
|---|---|---|---|---|--|--|--|---|
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter<br/>Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des<br/>Berichtszeitraums</b> | –   | 20.888.250  | 1.160.670.538   | 2.578.359.212   | –  | 8.931.605  | 475.077.135  | 2.045.700   |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile<br>entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit               | (25.976.757)  | (7.328.272)   | (65.669.381)  | (16.157.627)  | (6.431.413)  | (4.828.962)  | (96.836.551)   | (116.424.245)   |
| Zeichnungen   | 148.631.018   | 58.913.869  | 575.467.220   | 616.874.442   | 721.009.465  | 19.501.255   | 277.533.905  | 1.107.747.383   |
| Rücknahmen  | –   | (13.804.661)  | (611.804.789)   | (566.433.509)   | (1.630.567)  | (849.076)  | (72.395.374)   | (30.712.381)  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter<br/>Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des<br/>Berichtszeitraums</b>   | 122.654.261   | 58.669.186  | 1.058.663.588   | 2.612.642.518   | 712.947.485  | 22.754.822   | 583.379.115  | 962.656.457   |

\* Der Next Generation Space Economy wurde am 10. Mai 2022 aufgelegt.

\*\* Der Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency wurde am 19. Januar 2022 aufgelegt.

\*\* Der Uncorrelated Trading Fund wurde am 14. Juni 2022 aufgelegt.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Halbjahresabschlusses.

## Aufstellungen über die Entwicklung des auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens (Fortsetzung)

|   | US Long Short<br>Equity<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum | US Multi Cap<br>Opportunities<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum | US Real Estate<br>Securities<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum | US Small Cap<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum | US Small Cap<br>Intrinsic Value<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum | Fonds insgesamt*<br>Sechsmonatiger<br>Berichtszeitraum |
|---|---|---|--|--|---|--|
| Anm.  | 30. Juni 2022   | 30. Juni 2022   | 30. Juni 2022  | 30. Juni 2022                                      | 30. Juni 2022   | 30. Juni 2022  |
|   | US\$  | US\$  | US\$   | US\$   | US\$  | US\$   |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums</b> | 474.020.776   | 781.225.671   | 1.022.296.968  | 822.142.195  | 153.622.426   | 35.433.928.751   |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit          | (36.751.400)  | (189.826.274)   | (228.115.509)  | (173.170.729)                                      | (47.890.746)  | (6.258.454.089)  |
| Wechselkursbewegungen   | <sup>12</sup> -   | -   | -  | -  | -   | (346.864.658)  |
| Zeichnungen   | 48.823.421  | 157.630.186   | 333.298.685  | 147.151.861  | 85.936.295  | 8.514.171.390  |
| Rücknahmen  | (256.118.682)   | (176.774.945)   | (326.175.542)  | (263.584.513)                                      | (10.088.114)  | (8.311.367.151)  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>   | 229.974.115   | 572.254.638   | 801.304.602  | 532.538.814  | 181.579.861   | 29.031.414.243   |

\* Der konsolidierte Halbjahresabschluss wurde um Überkreuzinvestitionen zwischen den Portfolios bereinigt. Details zu Überkreuzinvestitionen zwischen Teilfonds sind Anmerkung 8 der Anmerkungen zum ungeprüften verkürzten Halbjahresabschluss zu entnehmen.

## Aufstellungen der wesentlichen Käufe und Verkäufe (ungeprüft)

In Einklang mit den EG-Richtlinien über Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren („European Communities (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations, 2011“) (in ihrer geltenden Fassung) wird eine Aufstellung über die Entwicklung der Zusammensetzung des Wertpapierbestands im Berichtszeitraum vorgelegt, um sicherzustellen, dass die Anteilhaber Veränderungen in den vom Portfolio gehaltenen Anlagen identifizieren können. Die folgenden Aufstellungen geben die gesamten Käufe und Verkäufe von Wertpapieren, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe und Verkäufe im Berichtszeitraum übersteigen, wieder. Es werden mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe aufgeführt, falls zutreffend.

### 5G Connectivity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung                      | Kosten US\$ |
|-----------|--|-------------|
| 252.400   | Lasertec Corp                              | 41.039.953  |
| 1.776.000 | Maxscend Microelectronics Co Ltd Class A   | 36.203.846  |
| 695.046   | STMicroelectronics NV                      | 32.825.887  |
| 114.599   | NVIDIA Corp                                | 32.669.777  |
| 204.200   | Palo Alto Networks Inc                     | 31.637.442  |
| 151.655   | Analog Devices Inc                         | 27.607.231  |
| 37.855    | Broadcom Inc                               | 26.032.267  |
| 152.917   | Workday Inc Class A                        | 25.865.377  |
| 38.977    | ASML Holding NV                            | 25.213.655  |
| 124.866   | Salesforce Inc                             | 24.237.515  |
| 175.000   | Disco Corp                                 | 23.516.991  |
| 97.892    | Meta Platforms Inc Class A                 | 23.245.365  |
| 571.906   | Infineon Technologies AG                   | 22.385.807  |
| 319.757   | Shopify Inc Class A                        | 20.620.800  |
| 7.796     | Booking Holdings Inc                       | 20.564.460  |
| 6.178.500 | Foxconn Industrial Internet Co Ltd Class A | 20.532.875  |
| 8.492.000 | Wistron Corp                               | 19.294.932  |
| 65.699    | Microsoft Corp                             | 19.207.496  |
| 794.644   | Deutsche Telekom AG                        | 18.681.178  |
| 235.723   | ON Semiconductor Corp                      | 18.677.491  |
| 33.165    | Lam Research Corp                          | 18.561.695  |
| 754.057   | Kanzhun Ltd ADR                            | 18.289.235  |
| 3.947.000 | Quanta Computer Inc                        | 17.506.033  |
| 31.700    | Keyence Corp                               | 15.918.752  |
| 3.426.000 | Unimicron Technology Corp                  | 15.763.476  |
| 146.639   | Qorvo Inc                                  | 15.313.693  |
| 106.198   | T-Mobile US Inc                            | 15.144.838  |
| 60.947    | Enphase Energy Inc                         | 14.556.763  |
| 106.832   | Arista Networks Inc                        | 13.284.420  |
| 108.963   | Dexcom Inc                                 | 12.205.948  |
| 213.974   | Calix Inc                                  | 11.720.465  |
| 109.349   | Oracle Corp                                | 11.330.787  |
| 58.795    | Naver Corp                                 | 10.646.507  |

## 5G Connectivity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen: (Fortsetzung)

| <b>Anteile</b> | <b>Wertpapierbezeichnung</b>   | <b>Kosten US\$</b> |
|----------------|--------------------------------|--------------------|
| 101.129        | BE Semiconductor Industries NV | 10.405.401         |
| 79.195         | QUALCOMM Inc                   | 10.376.061         |
| 56.556         | Apple Inc                      | 10.278.954         |
| 87.145         | Amazon.com Inc                 | 10.206.190         |
| 266.800        | TDK Corp                       | 10.021.595         |
| 7.484          | MercadoLibre Inc               | 9.675.143          |
| 102.700        | Advantest Corp                 | 9.193.609          |
| 147.312        | Micron Technology Inc          | 9.009.755          |



## 5G Connectivity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung                    | Erlöse US\$ |
|-----------|--|-------------|
| 282.300   | Lasertec Corp                            | 47.153.026  |
| 981.361   | Marvell Technology Inc                   | 39.876.155  |
| 224.965   | Keysight Technologies Inc                | 34.917.599  |
| 7.568.359 | Nokia OYJ ADR                            | 34.469.816  |
| 82.791    | ASM International NV                     | 30.967.457  |
| 67.558    | Monolithic Power Systems Inc             | 30.472.798  |
| 853.000   | StarPower Semiconductor Ltd Class A      | 30.379.701  |
| 5.987.000 | Unimicron Technology Corp                | 29.914.900  |
| 324.600   | Advantest Corp                           | 28.792.996  |
| 1.078.500 | SG Micro Corp Class A                    | 28.005.693  |
| 733.231   | Cellnex Telecom SA                       | 26.979.786  |
| 838.109   | Taiyo Yuden Co Ltd                       | 26.570.433  |
| 66.476    | HubSpot Inc                              | 26.279.507  |
| 242.435   | Advanced Micro Devices Inc               | 25.736.434  |
| 1.776.000 | Maxscend Microelectronics Co Ltd Class A | 25.092.526  |
| 131.736   | Analog Devices Inc                       | 23.425.172  |
| 217.676   | Crowdstrike Holdings Inc Class A         | 22.484.351  |
| 147.391   | Snowflake Inc Class A                    | 21.831.064  |
| 100.914   | Enphase Energy Inc                       | 20.093.647  |
| 131.008   | Arista Networks Inc                      | 19.751.366  |
| 102.540   | Cadence Design Systems Inc               | 19.382.006  |
| 411.301   | Wolfspeed Inc                            | 18.954.735  |
| 103.526   | Workday Inc Class A                      | 18.910.987  |
| 429.393   | Ciena Corp                               | 18.898.357  |
| 194.808   | Alphabet Inc Class C                     | 18.297.700  |
| 265.940   | Datadog Inc Class A                      | 18.217.697  |
| 376.934   | STMicroelectronics                       | 18.209.874  |
| 246.575   | Micron Technology Inc                    | 15.861.037  |
| 3.942.500 | East Buy Holding Ltd                     | 13.909.771  |
| 146.639   | Qorvo Inc                                | 13.446.650  |
| 121.073   | QUALCOMM Inc                             | 13.046.698  |
| 126.719   | Amazon.com Inc                           | 12.689.424  |
| 155.400   | BILL Holdings Inc                        | 12.073.439  |
| 57.756    | Palo Alto Networks Inc                   | 11.771.187  |
| 389.640   | Uber Technologies Inc                    | 11.574.884  |
| 303.206   | ROBLOX Corp Class A                      | 11.437.764  |
| 754.057   | Kanzhun Ltd ADR                          | 11.434.864  |
| 328.900   | Recruit Holdings Co Ltd                  | 10.635.817  |
| 102.400   | Hoya Corp                                | 10.623.296  |
| 22.809    | ServiceNow Inc                           | 10.391.827  |

## Asian Debt - Hard Currency – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung  | Kosten US\$ |
|-----------|--|-------------|
| 750.000   | Indonesia Government International Bond, 8.50%, 12/10/2035                   | 980.550     |
| 1.000.000 | Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara, 6.15%, 21/05/2048 | 975.000     |
| 1.000.000 | Mongolia Government International Bond, 5.13%, 07/04/2026                    | 897.500     |
| 800.000   | Pertamina Persero PT, 6.50%, 27/05/2041                                      | 837.200     |
| 784.000   | Standard Chartered Plc, 6.30%, 06/07/2034                                    | 784.000     |
| 780.000   | State Bank of India, 4.88%, 05/05/2028                                       | 777.644     |
| 900.000   | Indonesia Government International Bond, 1.10%, 12/03/2033                   | 730.909     |
| 600.000   | Export-Import Bank of Korea, 5.00%, 11/01/2028                               | 620.406     |
| 600.000   | Standard Chartered Plc, 09/01/2029   | 619.840     |
| 600.000   | AIA Group Ltd, 4.95%, 04/04/2033   | 602.066     |
| 600.000   | Industrial & Commercial Bank of China Ltd, 4.88%, 21/09/2025                 | 597.598     |
| 500.000   | Philippine Government International Bond, 6.38%, 23/10/2034                  | 566.875     |
| 525.000   | Shinhan Bank Co Ltd, 4.50%, 12/04/2028                                       | 522.748     |
| 700.000   | Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd, 3.10%, 08/01/2051               | 518.943     |
| 500.000   | Airport Authority, 4.88%, 12/01/2033   | 506.520     |
| 500.000   | Indonesia Government International Bond, 5.25%, 17/01/2042                   | 502.250     |
| 444.000   | Philippine Government International Bond, 5.50%, 17/01/2048                  | 444.000     |
| 500.000   | TSMC Global Ltd, 2.25%, 23/04/2031   | 422.098     |
| 400.000   | Kasikornbank PCL/Hong Kong, 5.46%, 07/03/2028                                | 406.600     |
| 400.000   | Hyundai Capital America, 5.60%, 30/03/2028                                   | 399.744     |

## Asian Debt - Hard Currency – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung   | Erlöse US\$ |
|---------|---|-------------|
| 444.000 | Philippine Government International Bond, 5.50%, 17/01/2048                                     | 447.645     |
| 400.000 | ABJA Investment Co Pte Ltd, 5.45%, 24/01/2028   | 400.480     |
| 380.000 | State Bank of India, 4.88%, 05/05/2028  | 377.940     |
| 300.000 | Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara, 6.15%, 21/05/2048                    | 294.600     |
| 222.000 | Philippine Government International Bond, 5.00%, 17/07/2033                                     | 222.555     |
| 200.000 | Export-Import Bank of Korea, 5.13%, 11/01/2033  | 207.106     |
| 200.000 | Airport Authority, 4.88%, 12/01/2030  | 202.350     |
| 200.000 | China Resources Land Ltd, 6.00%, 27/02/2024   | 201.680     |
| 200.000 | Airport Authority, 4.88%, 12/01/2033  | 201.510     |
| 200.000 | POSCO, 5.75%, 17/01/2028  | 200.896     |
| 200.000 | AIA Group Ltd, 4.95%, 04/04/2033  | 200.654     |
| 200.000 | Airport Authority, 4.75%, 12/01/2028  | 200.076     |
| 200.000 | Indonesia Government International Bond, 5.65%, 11/01/2053                                      | 199.800     |
| 200.000 | SK Telecom Co Ltd, 3.75%, 16/04/2023  | 199.348     |
| 200.000 | China Construction Bank Corp, 4.25%, 27/02/2029   | 198.700     |
| 200.000 | TNB Global Ventures Capital Bhd, 4.85%, 01/11/2028  | 198.340     |
| 200.000 | Adani Green Energy UP Ltd/Prayatna Developers Pvt Ltd/Parampujya Solar Energ, 6.25%, 10/12/2024 | 197.100     |
| 200.000 | Cathay Pacific MTN Financing HK Ltd, 4.88%, 17/08/2026  | 195.260     |
| 200.000 | Indonesia Government International Bond, 5.25%, 17/01/2042                                      | 194.362     |
| 200.000 | Vedanta Resources Finance II Plc, 13.88%, 21/01/2024  | 192.000     |
| 200.000 | ICBCIL Finance Co Ltd, 2.70%, 27/01/2027  | 182.900     |
| 200.000 | ICBCIL Finance Co Ltd, 2.25%, 02/11/2026  | 179.120     |
| 200.000 | Kasikornbank PCL, 3.34%, 02/10/2031   | 177.654     |
| 200.000 | Krung Thai Bank PCL, 4.40%, 29/12/2049  | 176.750     |
| 200.000 | Hanwha Life Insurance Co Ltd, 3.38%, 04/02/2032   | 176.678     |
| 200.000 | CAS Capital No 1 Ltd, 4.00%, 29/12/2049   | 164.600     |
| 200.000 | GENM Capital Labuan Ltd, 3.88%, 19/04/2031  | 162.000     |
| 200.000 | Meituan, 3.05%, 28/10/2030  | 160.446     |
| 200.000 | Country Garden Holdings Co Ltd, 3.13%, 22/10/2025   | 92.620      |
| 200.000 | Sino-Ocean Land Treasure IV Ltd, 2.70%, 13/01/2025  | 68.000      |

## China A-Share Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung                                  | Kosten CNY |
|---------|--|------------|
| 2.700   | Wanhua Chemical Group Co Ltd Class A                   | 260.656    |
| 40.500  | China Construction Bank Corp Class A                   | 256.860    |
| 11.400  | CITIC Securities Co Ltd Class A                        | 243.154    |
| 1.307   | Advanced Micro-Fabrication Equipment Inc China Class A | 230.429    |
| 2.100   | Sungrow Power Supply Co Ltd Class A                    | 214.870    |
| 3.400   | Jiangsu Yoke Technology Co Ltd Class A                 | 207.539    |
| 5.600   | JCET Group Co Ltd Class A                              | 179.103    |
| 1.000   | Wuliangye Yibin Co Ltd Class A                         | 177.353    |
| 20.700  | China Railway Group Ltd Class A                        | 173.988    |
| 3.600   | LONGi Green Energy Technology Co Ltd Class A           | 155.060    |
| 450     | Suzhou Maxwell Technologies Co Ltd Class A             | 150.272    |
| 1.300   | Milkyway Chemical Supply Chain Service Co Ltd Class A  | 146.785    |
| 3.100   | Shenzhen Sunnypol Optometrics Co Ltd Class A           | 141.369    |
| 6.300   | TongFu Microelectronics Co Ltd Class A                 | 136.097    |
| 1.700   | Shenzhen Inovance Technology Co Ltd Class A            | 112.669    |
| 1.341   | Amlogic Shanghai Co Ltd Class A                        | 111.792    |
| 7.400   | China Jushi Co Ltd Class A                             | 108.995    |
| 3.100   | Tongwei Co Ltd Class A                                 | 100.072    |
| 900     | Tsingtao Brewery Co Ltd Class A                        | 95.448     |
| 3.200   | Inner Mongolia Yili Industrial Group Co Ltd Class A    | 93.414     |
| 300     | Tencent Holdings Ltd                                   | 93.344     |
| 1.900   | Ping An Insurance Group Co of China Ltd Class A        | 92.277     |
| 20.200  | TCL Technology Group Corp Class A                      | 86.256     |
| 1.000   | Alibaba Group Holding Ltd                              | 79.528     |
| 2.500   | Chaozhou Three-Circle Group Co Ltd Class A             | 76.327     |
| 800     | WuXi AppTec Co Ltd Class A                             | 66.163     |
| 1.000   | Wingtech Technology Co Ltd Class A                     | 59.991     |
| 500     | Will Semiconductor Co Ltd Shanghai Class A             | 48.002     |
| 1.600   | NARI Technology Co Ltd Class A                         | 41.552     |

## China A-Share Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung                                      | Erlöse CNY |
|---------|--|------------|
| 3.768   | Montage Technology Co Ltd Class A                          | 248.639    |
| 13.600  | Ming Yang Smart Energy Group Ltd Class A                   | 247.300    |
| 8.600   | Bank of Ningbo Co Ltd Class A                              | 239.602    |
| 3.300   | Bethel Automotive Safety Systems Co Ltd Class A            | 233.404    |
| 2.200   | Guangzhou Kingmed Diagnostics Group Co Ltd Class A         | 182.124    |
| 3.000   | Wingtech Technology Co Ltd Class A                         | 171.678    |
| 800     | Contemporary Amperex Technology Co Ltd Class A             | 169.785    |
| 3.700   | TCL Zhonghuan Renewable Energy Technology Co Ltd Class A   | 168.501    |
| 4.400   | Beijing Oriental Yuhong Waterproof Technology Co Ltd Class | 164.019    |
| 6.300   | TongFu Microelectronics Co Ltd Class A                     | 155.604    |
| 1.300   | Meituan Class B  | 152.920    |
| 7.700   | WUS Printed Circuit Kunshan Co Ltd Class A                 | 142.187    |
| 1.500   | Will Semiconductor Co Ltd Shanghai Class A                 | 139.122    |
| 2.400   | Yifeng Pharmacy Chain Co Ltd Class A                       | 137.698    |
| 1.920   | Hangzhou First Applied Material Co Ltd Class A             | 133.999    |
| 3.100   | Shenzhen Sunnypol Optometrics Co Ltd Class A               | 133.822    |
| 1.600   | WuXi AppTec Co Ltd Class A                                 | 129.440    |
| 1.000   | Yunnan Energy New Material Co Ltd Class A                  | 126.358    |
| 3.200   | Zhejiang Jiemei Electronic & Technology Co Ltd Class A     | 98.890     |
| 4.100   | Sinoma Science & Technology Co Ltd Class A                 | 91.715     |
| 700     | Chongqing Brewery Co Ltd Class A                           | 88.879     |
| 1.500   | Guangdong Haid Group Co Ltd Class A                        | 83.003     |
| 1.000   | Luoyang Xinqianglian Slewing Bearing Co Ltd Class A        | 62.539     |
| 4.200   | Poly Developments & Holdings Group Co Ltd Class A          | 61.572     |
| 2.400   | Zhejiang Weixing New Building Materials Co Ltd Class A     | 59.593     |
| 14.000  | TCL Technology Group Corp Class A                          | 52.680     |
| 1.500   | China Merchants Bank Co Ltd Class A                        | 50.279     |
| 445     | Amlogic Shanghai Co Ltd Class A                            | 39.019     |

## China Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile    | Wertpapierbezeichnung  | Kosten CNY |
|------------|--|------------|
| 20.000.000 | Bank of China Ltd, 4.01%, 22/11/2029                             | 20.334.720 |
| 20.000.000 | China Southern Power Grid Co Ltd, 2.84%, 24/11/2025              | 19.919.840 |
| 20.000.000 | Industrial & Commercial Bank of China Ltd, 2.60%, 06/11/2023     | 19.619.800 |
| 20.000.000 | China Everbright Bank Co Ltd 28/02/2023                          | 19.556.420 |
| 20.000.000 | China Citic Bank Corp, 2.49%, 22/05/2024                         | 19.535.620 |
| 20.000.000 | Agricultural Bank of China Ltd, 2.63%, 23/04/2024                | 19.496.260 |
| 10.000.000 | Industrial & Commercial Bank of China Ltd, 4.15%, 21/01/2031     | 10.233.870 |
| 10.000.000 | Guotai Junan Securities Co Ltd, 2.44%, 11/11/2025                | 10.083.300 |
| 10.000.000 | Tianfeng Securities Co Ltd, 3.70%, 24/10/2023                    | 10.018.630 |
| 10.000.000 | Central Huijin Investment Ltd., 2.44%, 11/11/2025                | 9.863.350  |
| 1.500.000  | ENN Clean Energy International Investment Ltd, 3.38%, 12/05/2026 | 9.369.430  |
| 1.000.000  | TFI Overseas Investment Ltd, 6.50%, 05/06/2024                   | 6.980.133  |
| 1.000.000  | China Mengniu Dairy Co Ltd, 4.25%, 07/08/2023                    | 6.867.066  |
| 1.000.000  | China Hongqiao Group Ltd, 6.25%, 08/06/2024                      | 6.790.530  |
| 1.000.000  | Huarong Finance II Co Ltd, 5.50%, 16/01/2025                     | 6.701.400  |
| 1.000.000  | Blossom Joy Ltd, 3.10%, 29/12/2049                               | 6.586.031  |
| 1.000.000  | Studio City Finance Ltd, 6.00%, 15/07/2025                       | 6.462.997  |
| 1.000.000  | Tencent Holdings Ltd, 3.98%, 11/04/2029                          | 6.340.104  |
| 1.000.000  | Wynn Macau Ltd, 5.13%, 15/12/2029                                | 5.588.909  |
| 6.000.000  | Country Garden Holdings Co Ltd, 0.00%, 12/03/2026                | 4.800.000  |
| 583.000    | Shui On Development Holding Ltd, 5.75%, 12/11/2023               | 3.876.677  |
| 2.895.000  | China Southern Airlines Co Ltd, 0.60%, 15/10/2026                | 3.796.939  |
| 3.150.000  | LONGi Green Energy Technology Co Ltd, 0.40%, 05/01/2028          | 3.533.509  |
| 500.000    | Huarong Finance 2019 Co Ltd, 3.75%, 29/05/2024                   | 3.204.225  |

## China Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Verkäufe insgesamt:

| Anteile    | Wertpapierbezeichnung   | Erlöse CNY |
|------------|---|------------|
| 30.000.000 | Bank of China Ltd, 4.84%, 11/10/2028                          | 30.394.110 |
| 30.000.000 | Shanghai Pudong Development Bank Co Ltd, 2.44%, 14/02/2023    | 29.285.430 |
| 20.000.000 | GD Power Development Co Ltd, 3.33%, 06/07/2024                | 20.123.800 |
| 20.000.000 | China Citic Bank Corp, 0.00%, 22/09/2023                      | 19.660.988 |
| 20.000.000 | China Everbright Bank Co Ltd, 2.55%, 28/02/2023               | 19.504.660 |
| 2.000.000  | China Mengniu Dairy Co Ltd, 4.25%, 07/08/2023                 | 13.734.202 |
| 10.000.000 | China Government Bond, 2.47%, 02/09/2024                      | 10.050.170 |
| 10.000.000 | Tianfeng Securities Co Ltd, 3.70%, 24/10/2023                 | 10.044.860 |
| 1.000.000  | SF Holding Investment Ltd, 4.13%, 26/07/2023                  | 6.878.225  |
| 1.000.000  | China Construction Bank Corp, 1.00%, 04/08/2023               | 6.768.982  |
| 1.000.000  | Kunlun Energy Co Ltd, 3.75%, 13/05/2025                       | 6.734.093  |
| 1.000.000  | Wynn Macau Ltd, 5.13%, 15/12/2029                             | 5.744.886  |
| 2.000.000  | Unigroup International Holdings Ltd, 6.00%, 10/12/2020        | 5.700.394  |
| 6.000.000  | Country Garden Holdings Co Ltd, 0.00%, 12/03/2026             | 5.105.926  |
| 435.000    | Haitong International Securities Group Ltd, 3.38%, 19/07/2024 | 2.997.549  |
| 1.000.000  | Hangscha Group Co Ltd, 0.40%, 25/03/2027                      | 1.326.831  |
| 400.000    | Country Garden Holdings Co Ltd, 5.13%, 14/01/2027             | 1.256.138  |
| 500.000    | CIFI Holdings Group Co Ltd, 6.55%, 28/03/2024                 | 886.342    |

## China Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung                                       | Kosten US\$ |
|-----------|---|-------------|
| 1.766.919 | TCL Zhonghuan Renewable Energy Technology Co Ltd Class A    | 11.880.799  |
| 144.483   | H World Group Ltd ADR                                       | 7.267.873   |
| 665.000   | Zhejiang Jingsheng Mechanical & Electrical Co Ltd Class A   | 6.637.212   |
| 660.000   | Eve Energy Co Ltd Class A                                   | 6.211.463   |
| 219.921   | Shenzhen Dynanonic Co Ltd Class A                           | 6.156.976   |
| 303.000   | Meituan Class B   | 5.585.938   |
| 400.000   | Jiangsu Hengli Hydraulic Co Ltd Class A                     | 3.925.868   |
| 205.090   | Yunnan Energy New Material Co Ltd Class A                   | 3.522.870   |
| 1.385.879 | Satellite Chemical Co Ltd Class A                           | 3.351.595   |
| 495.922   | Ninestar Corp Class A                                       | 3.102.146   |
| 129.167   | Suzhou Maxwell Technologies Co Ltd Class A                  | 2.628.509   |
| 335.500   | Li Ning Co Ltd  | 1.916.674   |
| 399.947   | Luxshare Precision Industry Co Ltd Class A                  | 1.784.296   |
| 38.750    | Trip.com Group Ltd  | 1.418.869   |
| 446.000   | China Pacific Insurance Group Co Ltd - H Shares             | 1.260.178   |
| 125.000   | Shenzhen Inovance Technology Co Ltd Class A                 | 1.248.070   |
| 340.000   | Zhongsheng Group Holdings Ltd                               | 1.236.469   |
| 1.000.000 | Zoomlion Heavy Industry Science & Technology Co Ltd Class A | 947.725     |
| 25.429    | ZTO Express Cayman Inc ADR                                  | 716.103     |
| 112.000   | China Resources Land Ltd                                    | 513.373     |



## China Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung                               | Erlöse US\$ |
|-----------|---|-------------|
| 175.000   | Tencent Holdings Ltd                                | 8.305.784   |
| 1.766.000 | Inner Mongolia Yili Industrial Group Co Ltd Class A | 7.492.940   |
| 3.533.007 | Jiangsu Eastern Shenghong Co Ltd Class A            | 6.809.545   |
| 1.546.054 | JL Mag Rare-Earth Co Ltd Class A                    | 6.475.125   |
| 500.000   | Alibaba Group Holding Ltd                           | 6.417.445   |
| 350.000   | JD.com Inc Class A                                  | 6.244.163   |
| 7.278.000 | China Yongda Automobiles Services Holdings Ltd      | 5.279.154   |
| 316.000   | Wanhua Chemical Group Co Ltd Class A                | 4.525.865   |
| 157.000   | ZTO Express Cayman Inc ADR                          | 4.411.170   |
| 5.299.600 | Man Wah Holdings Ltd                                | 4.215.779   |
| 170.000   | Meituan Class B                                     | 3.310.444   |
| 66.000    | Beijing Kingsoft Office Software Inc Class A        | 2.795.482   |
| 3.898.000 | China National Building Material Co Ltd - H Shares  | 2.589.968   |
| 54.501    | H World Group Ltd ADR                               | 2.399.696   |
| 495.922   | Ninestar Corp Class A                               | 2.316.383   |
| 425.000   | Shandong Hualu Hengsheng Chemical Co Ltd Class A    | 1.891.885   |
| 38.750    | Trip.com Group Ltd ADR                              | 1.368.115   |
| 96.000    | Shenzhen Dynanonic Co Ltd Class A                   | 1.342.117   |
| 45.900    | SG Micro Corp Class A                               | 1.175.590   |
| 150.000   | China Resources Beer Holdings Co Ltd                | 1.137.259   |

## CLO Income – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Käufe insgesamt:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung   | Kosten US\$ |
|-----------|---|-------------|
| 2.043.974 | iShares USD Treasury Bond 0-1yr UCITS ETF                                     | 10.329.645  |
| 103.575   | iShares USD High Yield Corp Bond UCITS ETF                                    | 9.526.829   |
| 5.500.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 11/07/2023                                | 5.491.615   |
| 3.000.000 | Euro-Galaxy VII CLO DAC Series 2019-7X Class ER, 9.46%, 25/07/2035            | 2.818.694   |
| 2.000.000 | AGL CLO 22 Ltd Series 2022-22X Class E, 13.68%, 20/10/2035                    | 1.999.400   |
| 1.650.000 | Vesey Park CLO DAC Series 1X Class E, 13.23%, 16/11/2032                      | 1.481.563   |
| 1.500.000 | OCP CLO 2023-26 Ltd 17/04/2036  | 1.477.500   |
| 1.485.000 | Otranto Park CLO DAC Series 1X Class E, 10.37%, 15/05/2035                    | 1.477.169   |
| 1.500.000 | Goldentree Loan Management EUR CLO 3 DAC Series 3X Class E, 9.11%, 20/01/2032 | 1.411.205   |
| 1.400.000 | CVC Cordatus Loan Fund XXVII DAC Series 27X Class F, 15/04/2035               | 1.407.867   |
| 1.400.000 | Aqueduct European CLO 7-22 DAC Series 2022-7X, 15/03/2036                     | 1.394.840   |
| 1.500.000 | Goldentree Loan Management EUR CLO 5 DAC Series 5X Class E, 8.45%, 20/04/2034 | 1.367.169   |
| 1.251.000 | OCP Euro CLO 2029-3 Ltd Series 2019-3X Class ER, 9.22%, 20/04/2033            | 1.237.535   |
| 1.050.000 | Cifc European Funding CLO III DAC Series 3X Class E, 8.79%, 15/01/2034        | 1.034.360   |
| 1.000.000 | Margay CLO I DAC Series 1X, 15/07/2036  | 1.022.537   |
| 1.000.000 | BlackRock European CLO XIV DAC Series 14X Class F, 15/07/2036                 | 1.004.640   |
| 1.000.000 | Invesco US CLO 2023-1 Ltd Series 2023-1X Class E, 13.23%, 22/04/2035          | 980.000     |
| 1.000.000 | AGL CLO 25 Ltd Series 2023-25X Class E, 13.91%, 21/07/2036                    | 980.000     |
| 1.000.000 | Bain Capital Credit CLO 2023-2 Ltd Series 2023-2X Class E, 13.71%, 18/07/2036 | 970.000     |
| 1.000.000 | Arbour CLO VI DAC Series 6X Class E, 9.10%, 15/11/2031                        | 948.791     |
| 689.000   | Providus CLO IV DAC Series 4X Class ER, 9.19%, 20/04/2034                     | 681.486     |
| 700.000   | CVC Cordatus Loan Fund XXIII DAC Series 23X Class E, 10.52%, 25/04/2036       | 658.171     |

## CLO Income – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Verkäufe insgesamt:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung  | Erlöse US\$ |
|-----------|--|-------------|
| 6.385.000 | Octagon Investment Partners XV Ltd Series 2013-1X Class ER, 11.80%, 19/07/2030 | 5.298.273   |
| 988.533   | iShares USD Treasury Bond 0-1yr UCITS ETF                                      | 5.001.483   |
| 4.000.000 | Oha Loan Funding 2013-1 Ltd Series 2013-1X Class ER2, 9.82%, 23/07/2031        | 3.621.600   |
| 33.486    | iShares USD High Yield Corp Bond UCITS ETF                                     | 3.008.382   |
| 3.000.000 | Dryden 49 Senior Loan Fund Series 2017-49X Class E, 11.09%, 18/07/2030         | 2.476.800   |
| 2.500.000 | Voya CLO 2015-1 Ltd Series 2015-1X Class DR, 10.44%, 18/01/2029                | 1.896.375   |
| 2.000.000 | Trinitas CLO XII Ltd Series 2020-12X Class E, 11.76%, 25/04/2033               | 1.821.660   |
| 2.000.000 | Madison Park Funding XXX Ltd Series 2018-30X Class E, 10.52%, 15/04/2029       | 1.813.200   |
| 2.000.000 | Ares XXXVII CLO Ltd Series 2015-4X Class DR, 11.72%, 15/10/2030                | 1.715.400   |
| 2.000.000 | Chenango Park CLO Ltd Series 2018-1X Class D, 10.59%, 15/04/2030               | 1.593.100   |
| 1.000.000 | Avoca CLO XXVI Designated Activity Co Series 26X Class F, 12.30%, 15/04/2035   | 908.471     |
| 1.000.000 | Long Point Park CLO Ltd Series 2017-1X Class D2, 10.39%, 17/01/2030            | 800.200     |
| 500.000   | Octagon Loan Funding Ltd Series 2014-1X Class ERR, 10.67%, 18/11/2031          | 365.300     |

## Commodities – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile    | Wertpapierbezeichnung                                | Kosten US\$ |
|------------|--|-------------|
| 13.550.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 28/09/2023       | 13.374.511  |
| 10.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 20/07/2023       | 9.880.170   |
| 10.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 13/06/2023       | 9.844.391   |
| 4.355.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 31/08/2023       | 4.296.899   |
| 2.240.000  | Enterprise Products Operating LLC, 3.90%, 15/02/2024 | 2.212.940   |
| 2.000.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 29/06/2023       | 1.976.583   |
| 2.000.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 11/07/2023       | 1.973.452   |
| 1.915.000  | Citigroup Inc, 6.62%, 17/03/2026                     | 1.935.538   |
| 1.540.000  | PepsiCo Inc, 5.49%, 13/02/2026                       | 1.540.000   |
| 1.545.000  | AbbVie Inc, 3.85%, 15/06/2024                        | 1.520.172   |
| 1.490.000  | Shell International Finance BV, 5.72%, 13/11/2023    | 1.492.811   |
| 1.425.000  | Simon Property Group LP, 3.75%, 01/02/2024           | 1.407.891   |
| 1.395.000  | Bank of America Corp, 6.15%, 25/04/2025              | 1.395.109   |
| 1.365.000  | Royal Bank of Canada, 5.49%, 21/01/2025              | 1.362.262   |
| 1.285.000  | Federal Home Loan Banks, 5.55%, 05/04/2024           | 1.284.036   |
| 1.299.000  | Amgen Inc, 3.63%, 22/05/2024                         | 1.275.319   |
| 1.265.000  | Capital One Financial Corp, 5.78%, 06/12/2024        | 1.255.620   |
| 1.211.000  | Pioneer Natural Resources Co, 0.55%, 15/05/2023      | 1.204.594   |
| 1.175.000  | John Deere Capital Corp, 0.00%, 11/10/2024           | 1.172.957   |
| 1.155.000  | Enbridge Inc, 4.00%, 01/10/2023                      | 1.146.683   |
| 1.175.000  | Amazon.com Inc, 0.45%, 12/05/2024                    | 1.122.971   |
| 1.060.000  | Goldman Sachs Group Inc, 7.06%, 29/11/2023           | 1.066.661   |
| 1.000.000  | Citigroup Inc, 0.00%, 17/05/2024                     | 1.000.010   |
| 1.000.000  | JPMorgan Chase & Co, 5.67%, 23/06/2025               | 996.211     |
| 1.011.000  | AT&T Inc, 0.90%, 25/03/2024                          | 976.424     |
| 765.000    | Morgan Stanley, 5.69%, 24/01/2025                    | 763.214     |

Verkäufe insgesamt:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung                          | Erlöse US\$ |
|-----------|--|-------------|
| 9.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 01/06/2023 | 8.977.917   |
| 1.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 11/07/2023 | 993.839     |
| 675.000   | Starbucks Corp, 5.51%, 14/02/2024              | 675.018     |
| 250.000   | United States Treasury Bill, 0.00%, 18/05/2023 | 249.517     |

## Corporate Hybrid Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile    | Wertpapierbezeichnung                                    | Kosten EUR |
|------------|--|------------|
| 51.300.000 | Vattenfall AB, 0.00%, 17/08/2083                         | 59.073.078 |
| 44.100.000 | Elia Group SA/NV, 5.85%, 15/06/2172                      | 44.106.361 |
| 36.600.000 | British Telecommunications Plc, 8.38%, 20/12/2083        | 42.514.875 |
| 48.750.000 | British Telecommunications Plc, 4.25%, 23/11/2081        | 40.950.318 |
| 38.000.000 | Vodafone Group Plc, 0.00%, 30/08/2084                    | 37.777.700 |
| 34.400.000 | Vodafone Group Plc, 6.25%, 03/10/2078                    | 31.317.685 |
| 35.000.000 | EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG, 1.38%, 31/08/2081    | 27.675.625 |
| 36.371.000 | Heimstaden Bostad AB, 2.63%, 01/05/2172                  | 21.759.898 |
| 20.600.000 | Vattenfall AB, 0.00%, 29/06/2083                         | 19.520.814 |
| 17.275.000 | Stedin Holding NV, 1.50%, 31/03/2172                     | 14.784.250 |
| 16.860.000 | Heimstaden Bostad AB, 3.25%, 29/12/2049                  | 13.217.950 |
| 12.700.000 | Enel SpA, 6.38%, 16/07/2171                              | 12.832.000 |
| 16.200.000 | EDP - Energias de Portugal SA, 1.88%, 14/03/2082         | 12.250.500 |
| 10.600.000 | Orange SA, 0.00%, 18/04/2172                             | 10.524.740 |
| 9.800.000  | Infineon Technologies AG, 3.63%, 29/12/2049              | 8.893.500  |
| 8.400.000  | BP Capital Markets Plc, 4.25%, 29/12/2049                | 8.566.299  |
| 9.300.000  | AusNet Services Holdings Pty Ltd, 1.63%, 11/03/2081      | 7.819.875  |
| 7.900.000  | ELM BV for Firmenich International SA, 3.75%, 29/12/2049 | 7.663.000  |
| 7.400.000  | Redeia Corp. SA, 4.63%, 07/08/2171                       | 7.375.580  |
| 5.600.000  | Enel SpA, 6.63%, 16/07/2171                              | 5.600.000  |
| 7.000.000  | Paramount Global, 6.38%, 30/03/2062                      | 5.081.352  |

## Corporate Hybrid Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile    | Wertpapierbezeichnung                                  | Erlöse EUR |
|------------|--|------------|
| 50.100.000 | Solvay SA, 2.50%, 29/12/2049                           | 44.731.900 |
| 34.310.000 | TenneT Holding BV, 2.37%, 29/12/2049                   | 32.139.550 |
| 39.100.000 | EDP - Energias de Portugal SA, 1.88%, 14/03/2082       | 29.744.250 |
| 29.100.000 | Veolia Environnement SA, 2.50%, 29/12/2049             | 23.846.296 |
| 28.100.000 | Terna - Rete Elettrica Nazionale, 2.38%, 29/12/2049    | 23.498.625 |
| 18.800.000 | Vattenfall AB, 0.00%, 17/08/2083                       | 21.741.831 |
| 18.000.000 | British Telecommunications Plc, 8.38%, 20/12/2083      | 20.974.829 |
| 17.700.000 | Orsted A/S, 5.25%, 08/12/3022                          | 18.031.875 |
| 20.200.000 | Veolia Environnement SA, 2.25%, 29/12/2049             | 17.937.900 |
| 19.000.000 | Bayer AG, 2.38%, 12/11/2079                            | 17.385.000 |
| 16.800.000 | Elia Group SA, 2.75%, 29/12/2049                       | 16.472.400 |
| 15.800.000 | Electricite de France SA, 7.50%, 29/12/2049            | 16.225.750 |
| 17.100.000 | Volkswagen International Finance NV, 3.50%, 29/12/2049 | 15.997.050 |
| 18.500.000 | BP Capital Markets Plc, 3.63%, 29/12/2049              | 15.933.125 |
| 14.100.000 | Electricite de France SA, 6.00%, 29/12/2049            | 15.217.192 |
| 14.600.000 | Elia Group SA/NV, 5.85%, 15/06/2172                    | 14.527.000 |
| 13.705.000 | TotalEnergies SE, 1.75%, 29/12/2049                    | 13.081.423 |
| 15.000.000 | Volkswagen International Finance NV, 4.38%, 29/12/2049 | 12.412.500 |
| 13.100.000 | Engie SA, 1.63%, 29/12/2049                            | 12.035.625 |
| 12.900.000 | Bertelsmann SE & Co KGaA, 3.50%, 23/04/2075            | 11.722.875 |
| 13.000.000 | Volkswagen International Finance NV, 3.88%, 29/12/2049 | 11.631.250 |
| 12.000.000 | Electricite de France SA, 5.88%, 29/12/2049            | 11.484.880 |
| 10.600.000 | Orange SA, 0.00%, 18/04/2172                           | 10.541.700 |
| 12.018.000 | CMS Energy Corp, 3.75%, 01/12/2050                     | 8.969.714  |
| 7.300.000  | Redeia Corp. SA, 4.63%, 07/08/2171                     | 7.200.032  |
| 6.100.000  | Enel SpA, 6.38%, 16/07/2171                            | 6.118.910  |
| 7.100.000  | NGG Finance Plc, 2.13%, 05/09/2082                     | 6.059.350  |
| 7.362.000  | Southern Co, 1.88%, 15/09/2081                         | 5.897.388  |
| 5.600.000  | Enel SpA, 6.63%, 16/07/2171                            | 5.647.335  |
| 5.000.000  | NGG Finance Plc, 5.63%, 18/06/2073                     | 5.463.922  |
| 5.695.000  | SSE Plc, 3.13%, 29/12/2049                             | 5.139.738  |
| 4.887.000  | SSE Plc, 3.74%, 29/12/2049                             | 5.115.200  |

## Emerging Market Debt - Hard Currency – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile    | Wertpapierbezeichnung   | Kosten US\$ |
|------------|---|-------------|
| 20.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 28/03/2023  | 19.927.677  |
| 60.900.000 | Argentine Republic Government International Bond, 1.50%, 09/07/2035                             | 18.867.994  |
| 18.449.000 | Colombia Government International Bond, 7.50%, 02/02/2034                                       | 18.091.563  |
| 17.898.000 | Guatemala Government Bond, 6.60%, 13/06/2036  | 18.019.387  |
| 16.838.000 | Brazilian Government International Bond, 6.00%, 20/10/2033                                      | 16.642.661  |
| 14.987.000 | Turkey Government International Bond, 9.13%, 13/07/2030   | 14.854.665  |
| 50.350.000 | Argentine Republic Government International Bond, 0.50%, 09/07/2030                             | 13.820.007  |
| 10.028.000 | Bank Gospodarstwa Krajowego, 5.13%, 22/02/2033  | 10.689.513  |
| 10.489.000 | Petrobras Global Finance BV, 6.50%, 03/07/2033  | 10.394.179  |
| 9.596.000  | Turkey Government International Bond, 9.38%, 14/03/2029   | 9.542.070   |
| 11.310.000 | Nigeria Government International Bond, 8.75%, 21/01/2031  | 9.302.475   |
| 9.059.000  | Republic of Poland Government International Bond, 5.50%, 04/04/2053                             | 8.947.574   |
| 8.930.000  | Romanian Government International Bond, 7.13%, 17/01/2033                                       | 8.870.348   |
| 8.742.000  | Panama Government International Bond, 6.85%, 28/03/2054   | 8.825.300   |
| 7.500.000  | Indonesia Government International Bond, 4.85%, 11/01/2033                                      | 7.417.300   |
| 7.033.000  | Dominican Republic International Bond, 7.05%, 03/02/2031  | 7.033.000   |
| 6.639.000  | Panama Government International Bond, 6.40%, 14/02/2035   | 6.842.927   |
| 6.750.000  | Cemex SAB de CV, 9.13%, 29/12/2049  | 6.750.000   |
| 7.290.000  | Dominican Republic International Bond, 6.00%, 22/02/2033  | 6.738.030   |
| 9.342.000  | Nigeria Government International Bond, 8.25%, 28/09/2051  | 6.539.400   |
| 6.284.000  | Morocco Government International Bond, 6.50%, 08/09/2033  | 6.220.195   |
| 12.575.000 | El Salvador Government International Bond, 7.65%, 15/06/2035                                    | 6.207.488   |
| 6.077.000  | Costa Rica Government International Bond, 6.55%, 03/04/2034                                     | 6.077.000   |
| 7.900.000  | Angolan Government International Bond, 9.13%, 26/11/2049  | 5.934.875   |
| 5.772.000  | Chile Government International Bond, 4.95%, 05/01/2036  | 5.746.488   |
| 5.879.000  | Petroleos Mexicanos, 10.00%, 07/02/2033   | 5.743.783   |
| 7.120.000  | Republic of Armenia International Bond, 3.60%, 02/02/2031                                       | 5.627.390   |
| 5.990.000  | Adani Green Energy UP Ltd/Prayatna Developers Pvt Ltd/Parampujya Solar Energ, 6.25%, 10/12/2024 | 5.480.850   |
| 4.923.000  | Mexico Government International Bond, 6.35%, 09/02/2035   | 4.977.567   |
| 4.928.000  | Bank Gospodarstwa Krajowego, 5.38%, 22/05/2033  | 4.916.321   |
| 4.867.000  | Serbia International Bond, 6.50%, 26/09/2033  | 4.755.205   |
| 4.430.000  | Republic of Poland Government International Bond, 4.25%, 14/02/2043                             | 4.722.946   |
| 4.715.000  | Turkiye Ihracat Kredi Bankasi AS, 9.38%, 31/01/2026   | 4.687.889   |
| 6.552.000  | Serbia International Bond, 1.65%, 03/03/2033  | 4.636.141   |
| 4.395.000  | Ecopetrol SA, 8.88%, 13/01/2033   | 4.359.269   |
| 4.310.000  | Braskem Netherlands Finance BV, 7.25%, 13/02/2033   | 4.310.000   |

## Emerging Market Debt - Hard Currency – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile    | Wertpapierbezeichnung   | Erlöse US\$ |
|------------|---|-------------|
| 97.187.890 | Argentine Republic Government International Bond, 0.50%, 09/07/2030 | 32.466.229  |
| 20.950.000 | Petroleos Mexicanos, 7.69%, 23/01/2050                              | 14.544.558  |
| 60.490.000 | Argentine Republic Government International Bond, 1.50%, 09/07/2035 | 14.506.981  |
| 12.500.000 | Indonesia Government International Bond, 5.25%, 17/01/2042          | 12.272.260  |
| 15.750.000 | Egypt Government International Bond, 8.70%, 01/03/2049              | 11.305.665  |
| 11.940.000 | Republic of Kenya Government International Bond, 8.00%, 22/05/2032  | 10.306.926  |
| 9.320.000  | Minmetals Bounteous Finance BVI Ltd, 3.38%, 29/12/2049              | 9.049.860   |
| 8.973.750  | Iraq International Bond, 5.80%, 15/01/2028                          | 8.408.668   |
| 9.432.000  | Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd, 2.30%, 08/01/2031      | 8.209.336   |
| 23.087.184 | Argentine Republic Government International Bond, 1.00%, 09/07/2029 | 7.648.067   |
| 7.701.000  | Mexico Government International Bond, 2.38%, 11/02/2030             | 7.494.469   |
| 7.010.000  | Oman Government International Bond, 6.75%, 17/01/2048               | 6.769.228   |
| 6.500.000  | Southern Gas Corridor CJSC, 6.88%, 24/03/2026                       | 6.633.140   |
| 7.170.000  | Saudi Arabian Oil Co, 4.25%, 16/04/2039                             | 6.449.087   |
| 9.010.000  | Colombia Government International Bond, 5.20%, 15/05/2049           | 6.343.040   |
| 5.888.000  | Paraguay Government International Bond, 4.95%, 28/04/2031           | 5.701.540   |
| 5.300.000  | Romanian Government International Bond, 7.13%, 17/01/2033           | 5.674.416   |
| 5.469.000  | TSMC Arizona Corp, 4.25%, 22/04/2032                                | 5.296.727   |
| 6.329.000  | Peruvian Government International Bond, 3.00%, 15/01/2034           | 5.199.939   |
| 7.400.000  | Egypt Government International Bond, 8.15%, 20/11/2059              | 5.124.500   |
| 7.370.000  | Colombia Government International Bond, 5.00%, 15/06/2045           | 5.071.850   |
| 4.867.000  | Serbia International Bond, 6.50%, 26/09/2033                        | 4.856.846   |
| 4.330.000  | Costa Rica Government International Bond, 7.16%, 12/03/2045         | 4.308.350   |
| 4.650.000  | Angolan Government International Bond, 9.38%, 08/05/2048            | 4.301.250   |
| 9.188.000  | Ecuador Government International Bond, 2.50%, 31/07/2035            | 4.141.072   |
| 4.000.000  | Indonesia Government International Bond, 4.85%, 11/01/2033          | 4.066.471   |
| 3.700.000  | Mexico Government International Bond, 6.35%, 09/02/2035             | 3.914.914   |
| 6.809.538  | Ecuador Government International Bond, 5.50%, 31/07/2030            | 3.894.769   |
| 3.618.000  | Panama Government International Bond, 6.70%, 26/01/2036             | 3.835.924   |
| 3.800.000  | Republic of Uzbekistan International Bond, 4.75%, 20/02/2024        | 3.758.590   |
| 4.770.000  | Brazilian Government International Bond, 5.00%, 27/01/2045          | 3.689.696   |



## Emerging Market Debt - Local Currency – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile         | Wertpapierbezeichnung   | Kosten US\$ |
|-----------------|---|-------------|
| 627.331.000.000 | Indonesia Treasury Bond, 7.00%, 15/02/2033                        | 42.274.312  |
| 39.853.600      | United States Treasury Bill, 0.00%, 18/05/2023                    | 39.407.275  |
| 40.000.000      | United States Treasury Bill, 0.00%, 10/08/2023                    | 39.099.606  |
| 544.902.933     | Republic of South Africa Government Bond, 8.88%, 28/02/2035       | 25.620.776  |
| 26.024.800      | United States Treasury Bill, 0.00%, 17/08/2023                    | 25.434.587  |
| 4.206.696.000   | Mexico Cetes, 0.00%, 06/02/2025                                   | 18.976.927  |
| 355.500.000     | Mexican Bonos, 7.50%, 26/05/2033                                  | 18.890.445  |
| 72.020.900.000  | Colombian TES, 13.25%, 09/02/2033                                 | 18.714.068  |
| 318.866.689     | Republic of South Africa Government Bond, 10.50%, 21/12/2026      | 16.766.627  |
| 63.974.000      | Republic of Poland Government Bond, 7.50%, 25/07/2028             | 15.947.016  |
| 325.647.695     | Republic of South Africa Government Bond, 8.75%, 31/01/2044       | 15.182.699  |
| 285.718.987     | Republic of South Africa Government Bond, 7.00%, 28/02/2031       | 13.875.145  |
| 55.140.000      | Romania Government Bond, 4.40%, 25/09/2023                        | 12.194.570  |
| 80.000.000      | China Development Bank, 3.30%, 03/03/2026                         | 11.758.537  |
| 193.134.396     | Turkey Government Bond, 1.50%, 18/06/2025                         | 11.284.356  |
| 272.154.491     | Republic of South Africa Government Bond, 8.50%, 31/01/2037       | 11.163.600  |
| 42.875.000      | Malaysia Government Bond, 4.89%, 08/06/2038                       | 10.563.406  |
| 399.834.000     | Uruguay Government International Bond, 8.50%, 15/03/2028          | 9.495.438   |
| 160.148.700     | Mexican Bonos, 8.50%, 31/05/2029                                  | 8.513.539   |
| 3.926.450.000   | Hungary Government Bond, 3.00%, 27/10/2027                        | 8.197.567   |
| 6.172.847.140   | Bonos de la Tesoreria de la Republica, 1.90%, 01/09/2030          | 7.737.426   |
| 259.670.000     | Bank of Thailand Bill, 0.00%, 09/05/2024                          | 7.498.901   |
| 31.188.000      | Malaysia Government Bond, 4.70%, 15/10/2042                       | 7.365.724   |
| 29.868.000      | Republic of Poland Government Bond, 6.00%, 25/10/2033             | 7.089.549   |
| 50.000.000      | Central Huijin Investment Ltd, 2.74%, 24/05/2026                  | 7.017.640   |
| 212.000.000     | Egypt Treasury Bill, 0.00%, 18/04/2023                            | 6.834.292   |
| 23.856.000      | Peru Government Bond, 7.30%, 12/08/2033                           | 6.536.651   |
| 3.109.260.000   | Hungary Government Bond, 3.25%, 22/10/2031                        | 6.439.749   |
| 4.885.000.000   | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos, 6.00%, 01/04/2033 | 6.361.821   |
| 2.611.170.000   | Hungary Government Bond, 5.50%, 24/06/2025                        | 6.353.018   |
| 209.900.000     | Bank of Thailand Bill, 1.76%, 17/08/2023                          | 6.154.169   |
| 40.000.000      | China Development Bank, 4.04%, 06/07/2028                         | 6.114.447   |
| 40.000.000      | China Development Bank, 3.34%, 14/07/2025                         | 5.858.245   |
| 36.484.000      | Republic of Poland Government Bond, 1.75%, 25/04/2032             | 5.760.287   |

## Emerging Market Debt - Local Currency – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile         | Wertpapierbezeichnung   | Erlöse US\$ |
|-----------------|---|-------------|
| 923.130.000     | Mexican Bonos, 7.75%, 29/05/2031                                  | 46.154.140  |
| 39.853.600      | United States Treasury Bill, 0.00%, 18/05/2023                    | 39.762.757  |
| 40.000.000      | United States Treasury Bill, 0.00%, 10/08/2023                    | 39.616.669  |
| 175.207.000     | Republic of Poland Government Bond, 2.50%, 25/07/2026             | 35.678.875  |
| 748.754.834     | Republic of South Africa Government Bond, 8.50%, 31/01/2037       | 33.720.276  |
| 26.024.800      | United States Treasury Bill, 0.00%, 17/08/2023                    | 25.595.391  |
| 362.544.305     | Republic of South Africa Government Bond, 10.50%, 21/12/2026      | 23.025.292  |
| 4.206.696.000   | Mexico Cetes, 0.00%, 06/02/2025                                   | 20.754.908  |
| 279.400.000.000 | Indonesia Treasury Bond, 7.00%, 15/02/2033                        | 18.572.742  |
| 373.574.994     | Republic of South Africa Government Bond, 8.88%, 28/02/2035       | 17.962.806  |
| 587.994.000     | Thailand Government Bond, 1.45%, 17/12/2024                       | 17.861.687  |
| 353.806.647     | Republic of South Africa Government Bond, 7.00%, 28/02/2031       | 16.634.667  |
| 218.141.436     | Turkey Government Bond, 1.50%, 18/06/2025                         | 15.664.739  |
| 509.670.000     | Thailand Government Bond, 2.40%, 17/12/2023                       | 15.307.096  |
| 344.310.000     | Czech Republic Government Bond, 2.40%, 17/09/2025                 | 14.492.410  |
| 67.215.000      | Republic of Poland Government Bond, 0.25%, 25/10/2026             | 12.327.025  |
| 289.994.714     | Republic of South Africa Government Bond, 8.75%, 31/01/2044       | 12.241.347  |
| 60.855.000      | Republic of Poland Government Bond, 2.75%, 25/10/2029             | 11.662.353  |
| 167.800.000.000 | Indonesia Treasury Bond, 8.13%, 15/05/2024                        | 11.480.525  |
| 56.930.000      | Republic of Poland Government Bond, 2.75%, 25/04/2028             | 10.754.816  |
| 60.060.000      | Romania Government Bond, 2.50%, 25/10/2027                        | 10.644.104  |
| 40.210.000      | Malaysia Government Bond, 4.06%, 30/09/2024                       | 9.516.038   |
| 65.000.000      | China Government Bond, 2.69%, 12/08/2026                          | 9.443.869   |
| 140.100.000.000 | Indonesia Treasury Bond, 6.38%, 15/08/2028                        | 9.119.305   |
| 129.017.000.000 | Indonesia Treasury Bond, 8.38%, 15/03/2024                        | 8.818.087   |
| 60.000.000      | China Government Bond, 3.02%, 22/10/2025                          | 8.781.860   |
| 36.640.000      | Malaysia Government Bond, 3.80%, 17/08/2023                       | 8.504.308   |
| 7.150.000.000   | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos, 4.70%, 01/09/2030 | 8.433.895   |

## Emerging Market Debt Blend – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile         | Wertpapierbezeichnung  | Kosten US\$ |
|-----------------|--|-------------|
| 114.018.000.000 | Indonesia Treasury Bond, 7.00%, 15/02/2033                   | 7.730.218   |
| 122.707.805     | Republic of South Africa Government Bond, 8.88%, 28/02/2035  | 5.765.897   |
| 5.000.000       | United States Treasury Bill, 0.00%, 10/08/2023               | 4.887.451   |
| 17.690.100.000  | Colombian TES, 13.25%, 09/02/2033                            | 4.634.320   |
| 4.459.200       | United States Treasury Bill, 0.00%, 17/08/2023               | 4.358.070   |
| 76.539.832      | Republic of South Africa Government Bond, 10.50%, 21/12/2026 | 4.078.738   |
| 69.240.000      | Mexican Bonos, 7.50%, 26/05/2033                             | 3.676.416   |
| 63.463.200      | Mexican Bonos, 8.50%, 31/05/2029                             | 3.373.124   |
| 707.876.000     | Mexico Cetes, 0.00%, 06/02/2025                              | 3.193.316   |
| 12.516.000      | Republic of Poland Government Bond, 7.50%, 25/07/2028        | 3.119.906   |
| 61.692.900      | Republic of South Africa Government Bond, 7.00%, 28/02/2031  | 2.948.893   |
| 39.132.092      | Turkey Government Bond, 1.50%, 18/06/2025                    | 2.328.845   |
| 8.600.000       | Malaysia Government Bond, 4.89%, 08/06/2038                  | 2.114.965   |
| 954.550.000     | Hungary Government Bond, 3.25%, 22/10/2031                   | 1.975.615   |
| 26.900.000.000  | Indonesia Treasury Bond, 7.13%, 15/06/2038                   | 1.870.769   |
| 42.497.304      | Republic of South Africa Government Bond, 8.50%, 31/01/2037  | 1.735.375   |
| 72.068.000      | Uruguay Government International Bond, 8.50%, 15/03/2028     | 1.712.408   |
| 34.830.369      | Republic of South Africa Government Bond, 8.75%, 31/01/2044  | 1.616.048   |
| 9.761.000       | Republic of Poland Government Bond, 1.75%, 25/04/2032        | 1.601.257   |
| 41.160.000      | Czech Republic Government Bond, 1.20%, 13/03/2031            | 1.467.479   |
| 6.066.000       | Malaysia Government Bond, 4.70%, 15/10/2042                  | 1.425.309   |
| 21.482.000.000  | Indonesia Treasury Bond, 6.38%, 15/08/2028                   | 1.403.121   |

## Emerging Market Debt Blend – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile        | Wertpapierbezeichnung  | Erlöse US\$ |
|----------------|--|-------------|
| 33.900.000     | Republic of Poland Government Bond, 2.50%, 25/07/2026        | 6.941.069   |
| 108.480.000    | Mexican Bonos, 7.75%, 29/05/2031                             | 5.454.281   |
| 5.000.000      | United States Treasury Bill, 0.00%, 10/08/2023               | 4.936.875   |
| 101.615.217    | Republic of South Africa Government Bond, 8.50%, 31/01/2037  | 4.695.006   |
| 4.459.200      | United States Treasury Bill, 0.00%, 17/08/2023               | 4.385.623   |
| 82.707.676     | Republic of South Africa Government Bond, 8.88%, 28/02/2035  | 3.933.873   |
| 21.221.000     | Republic of Poland Government Bond, 2.75%, 25/10/2029        | 3.921.665   |
| 71.997.400     | Mexican Bonos, 7.50%, 03/06/2027                             | 3.819.636   |
| 54.376.000.000 | Indonesia Treasury Bond, 8.13%, 15/05/2024                   | 3.720.292   |
| 707.876.000    | Mexico Cetes, 0.00%, 06/02/2025                              | 3.492.504   |
| 41.287.158     | Turkey Government Bond, 1.50%, 18/06/2025                    | 2.942.464   |
| 11.200.000     | Malaysia Government Bond, 3.80%, 17/08/2023                  | 2.596.808   |
| 35.000.000.000 | Indonesia Treasury Bond, 7.00%, 15/02/2033                   | 2.319.058   |
| 11.362.000     | Republic of Poland Government Bond, 0.25%, 25/10/2026        | 2.107.615   |
| 1.948.000      | Qatar Government International Bond, 4.82%, 14/03/2049       | 1.957.935   |
| 64.618.000     | Thailand Government Bond,, 2.40%, 17/12/2023                 | 1.938.985   |
| 31.906.900     | Mexican Bonos, 8.50%, 31/05/2029                             | 1.792.655   |
| 26.500.000.000 | Indonesia Treasury Bond, 6.38%, 15/08/2028                   | 1.749.746   |
| 26.427.855     | Republic of South Africa Government Bond, 10.50%, 21/12/2026 | 1.678.441   |
| 10.790.000     | China Government Bond, 2.68%, 21/05/2030                     | 1.573.057   |
| 8.715.000      | Romania Government Bond, 2.50%, 25/10/2027                   | 1.552.088   |

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile        | Wertpapierbezeichnung   | Kosten US\$ |
|----------------|---|-------------|
| 13.032.000.000 | Indonesia Treasury Bond, 7.00%, 15/02/2033                          | 889.492     |
| 600.000        | Panama Government International Bond, 6.70%, 26/01/2036             | 647.820     |
| 460.000        | Philippine Government International Bond, 9.50%, 02/02/2030         | 589.950     |
| 586.800        | United States Treasury Bill 18/05/2023                              | 580.228     |
| 410.000        | Bank Gospodarstwa Krajowego, 5.13%, 22/02/2033                      | 444.913     |
| 588.000        | Panama Government International Bond, 4.50%, 19/01/2063             | 423.003     |
| 1.248.100.000  | Colombian TES, 13.25%, 09/02/2033                                   | 324.478     |
| 350.000        | Latvia Government International Bond, 0.25%, 23/01/2030             | 302.811     |
| 276.000        | Republic of Poland Government International Bond, 4.25%, 14/02/2043 | 293.815     |
| 4.412.000.000  | Indonesia Treasury Bond, 6.38%, 15/08/2028                          | 292.693     |
| 5.500.000      | Mexican Bonos, 7.50%, 26/05/2033                                    | 292.262     |
| 220.000        | Indonesia Government International Bond, 8.50%, 12/10/2035          | 291.389     |
| 290.000        | Romanian Government International Bond, 7.13%, 17/01/2033           | 288.063     |
| 284.000        | Republic of Poland Government International Bond, 5.50%, 04/04/2053 | 280.507     |
| 270.000        | Indonesia Government International Bond, 1.40%, 30/10/2031          | 237.095     |
| 250.000        | Lithuania Government International Bond, 2.13%, 01/06/2032          | 237.015     |
| 4.550.000      | Mexican Bonos, 7.50%, 03/06/2027                                    | 233.387     |
| 250.000        | Romanian Government International Bond, 3.75%, 07/02/2034           | 222.679     |
| 871.000        | Republic of Poland Government Bond, 7.50%, 25/07/2028               | 217.117     |
| 200.000        | SK Hynix Inc, 6.50%, 17/01/2033                                     | 210.328     |
| 200.000        | Israel Government International Bond, 4.50%, 17/01/2033             | 203.520     |
| 200.000        | DIB Sukuk Ltd, 4.80%, 16/08/2028                                    | 200.000     |
| 200.000        | Braskem Netherlands Finance BV, 7.25%, 13/02/2033                   | 200.000     |
| 200.000        | Bank Gospodarstwa Krajowego, 5.38%, 22/05/2033                      | 199.526     |
| 200.000        | Mexico Government International Bond, 6.35%, 09/02/2035             | 199.264     |
| 200.000        | Airport Authority, 4.88%, 12/01/2030                                | 198.760     |
| 200.000        | Indonesia Government International Bond, 4.85%, 11/01/2033          | 198.750     |
| 200.000        | Chile Government International Bond, 1.88%, 27/05/2030              | 193.247     |
| 200.000        | Abu Dhabi Commercial Bank PJSC, 3.50%, 31/03/2027                   | 191.750     |
| 180.000        | Bulgaria Government International Bond, 4.50%, 27/01/2033           | 190.437     |
| 757.000        | Malaysia Government Bond, 4.89%, 08/06/2038                         | 185.628     |
| 1.200.000      | China Government Bond, 2.79%, 15/12/2029                            | 176.609     |
| 200.000        | Chile Government International Bond, 2.55%, 27/01/2032              | 172.586     |
| 200.000        | LG Chem Ltd, 2.38%, 07/07/2031                                      | 168.560     |
| 700.000        | Malaysia Government Bond, 4.50%, 30/04/2029                         | 168.342     |
| 3.482.100      | Mexican Bonos, 7.75%, 13/11/2042                                    | 167.489     |
| 700.000        | Malaysia Government Bond, 4.70%, 15/10/2042                         | 166.796     |
| 36.314.000     | Mexico Cetes, 0.00%, 06/02/2025                                     | 163.817     |

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile       | Wertpapierbezeichnung   | Erlöse US\$ |
|---------------|---|-------------|
| 842.000       | Panama Government International Bond, 6.70%, 26/01/2036             | 894.849     |
| 1.000.000     | Chile Government International Bond, 0.83%, 02/07/2031              | 856.551     |
| 2.293.000     | Republic of Poland Government Bond, 2.50%, 25/07/2026               | 470.916     |
| 6.439.400     | Mexican Bonos, 8.50%, 31/05/2029                                    | 351.703     |
| 284.000       | Republic of Poland Government International Bond, 5.50%, 04/04/2053 | 285.789     |
| 5.300.000     | Mexican Bonos, 7.75%, 29/05/2031                                    | 266.111     |
| 245.000       | Republic of Poland Government International Bond, 5.75%, 16/11/2032 | 259.700     |
| 4.469.800     | Mexican Bonos, 5.00%, 06/03/2025                                    | 221.590     |
| 250.000       | Mexico Government International Bond, 5.75%, 12/10/2110             | 220.597     |
| 200.000       | Airport Authority, 4.88%, 12/01/2030                                | 205.288     |
| 200.000       | Export Import Bank of Thailand, 5.58%, 20/11/2023                   | 200.108     |
| 200.000       | Indonesia Government International Bond, 5.25%, 17/01/2042          | 196.000     |
| 200.000       | Israel Government International Bond, 4.50%, 17/01/2033             | 194.100     |
| 200.000       | TSMC Arizona Corp, 4.25%, 22/04/2032                                | 193.700     |
| 2.800.000.000 | Indonesia Treasury Bond, 7.00%, 15/02/2033                          | 185.519     |
| 200.000       | Airport Authority, 2.10%, 29/12/2049                                | 182.776     |
| 200.000       | Corp Nacional del Cobre de Chile, 3.15%, 14/01/2030                 | 180.036     |
| 36.314.000    | Mexico Cetes, 0.00%, 06/02/2025                                     | 179.165     |
| 915.000       | Republic of Poland Government Bond, 2.75%, 25/10/2029               | 174.765     |
| 150.000       | Indonesia Government International Bond, 6.63%, 17/02/2037          | 172.503     |
| 200.000       | Chile Government International Bond, 2.55%, 27/01/2032              | 169.620     |
| 2.200.000.000 | Indonesia Treasury Bond,, 8.38%, 15/03/2024                         | 150.366     |
| 115.000.000   | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos, 4.70%, 01/09/2030   | 135.695     |
| 664.000       | Republic of Poland Government Bond, 2.75%, 25/04/2028               | 125.907     |
| 100.000       | Peruvian Government International Bond, 8.75%, 21/11/2033           | 124.769     |
| 1.700.000.000 | Indonesia Treasury Bond, 7.50%, 15/06/2035                          | 123.100     |
| 800.000       | China Government Bond, 3.27%, 19/11/2030                            | 122.409     |
| 800.000       | China Government Bond, 2.88%, 05/11/2023                            | 119.064     |
| 150.000       | Indonesia Government International Bond, 1.10%, 12/03/2033          | 118.585     |
| 500.000       | Malaysia Government Bond, 3.48%, 15/03/2023                         | 116.021     |
| 1.600.000.000 | Indonesia Treasury Bond, 6.38%, 15/08/2028                          | 104.095     |
| 132.000       | Hungary Government International Bond, 1.75%, 05/06/2035            | 102.534     |
| 100.000       | Uruguay Government International Bond, 4.38%, 23/01/2031            | 100.450     |
| 521.000       | Republic of Poland Government Bond, 0.25%, 25/10/2026               | 96.699      |

## Emerging Markets Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung                              | Kosten US\$ |
|-----------|--|-------------|
| 65.641    | Samsung Electronics Co Ltd                         | 3.161.258   |
| 31.670    | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR      | 2.874.837   |
| 46.100    | Tencent Holdings Ltd                               | 2.168.006   |
| 180.800   | Alibaba Group Holding Ltd                          | 2.075.519   |
| 435.500   | Bangkok Bank PCL                                   | 2.045.309   |
| 22.908    | Pinduoduo Inc ADR                                  | 2.029.483   |
| 28.544    | Rio Tinto Plc                                      | 1.943.696   |
| 512.520   | NARI Technology Co Ltd Class A                     | 1.940.365   |
| 603.200   | CITIC Securities Co Ltd Class A                    | 1.873.029   |
| 95.541    | Grupo Aeroportuario del Pacifico SAB de CV Class B | 1.747.396   |
| 172.500   | Shenzhen Inovance Technology Co Ltd Class A        | 1.694.804   |
| 224.000   | Li Ning Co Ltd                                     | 1.680.598   |
| 408.900   | Bank of Ningbo Co Ltd Class A                      | 1.659.719   |
| 91.760    | SM Investments Corp                                | 1.547.089   |
| 335.000   | Hua Hong Semiconductor Ltd                         | 1.474.610   |
| 623.810   | BDO Unibank Inc                                    | 1.415.467   |
| 165.568   | Hypera SA  | 1.393.645   |
| 979.000   | China Longyuan Power Group Corp Ltd - H Shares     | 1.376.487   |
| 1.796.437 | Adnoc Gas Plc                                      | 1.346.131   |
| 145.000   | Midea Group Co Ltd Class A                         | 1.180.257   |
| 37.500    | BYD Co Ltd - H Shares                              | 1.158.529   |
| 5.965     | Globant SA   | 952.483     |
| 109.825   | Grupo Financiero Banorte SAB de CV Class O         | 915.121     |
| 675.449   | Bharat Electronics Ltd                             | 903.361     |
| 55.400    | Sungrow Power Supply Co Ltd Class A                | 887.965     |
| 84.966    | ICICI Bank Ltd                                     | 880.578     |
| 36.231    | Samsung Engineering Co Ltd                         | 823.400     |
| 331.000   | Foxconn Industrial Internet Co Ltd Class A         | 753.681     |
| 1.395     | LG Chem Ltd  | 742.668     |
| 10.581    | SK Hynix Inc                                       | 728.432     |

## Emerging Markets Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung                                 | Erlöse US\$ |
|-----------|---|-------------|
| 105.767   | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR         | 9.350.889   |
| 178.500   | Tencent Holdings Ltd                                  | 8.246.823   |
| 100.565   | Samsung Electronics Co Ltd                            | 4.952.215   |
| 369.100   | Alibaba Group Holding Ltd                             | 4.553.941   |
| 192.945   | JD.com Inc Class A                                    | 4.378.749   |
| 322.836   | ICICI Bank Ltd  | 3.478.837   |
| 778.743   | Wal-Mart de Mexico SAB de CV                          | 3.047.784   |
| 374.000   | Ping An Insurance Group Co of China Ltd - H Shares    | 2.548.023   |
| 145.540   | Meituan Class B                                       | 2.527.255   |
| 616.364   | Sichuan Kelun Pharmaceutical Co Ltd Class A           | 2.509.472   |
| 346.858   | State Bank of India                                   | 2.431.645   |
| 80.549    | Reliance Industries Ltd                               | 2.343.597   |
| 4.250     | LG Chem Ltd   | 2.328.697   |
| 979.000   | Uni-President Enterprises Corp                        | 2.291.061   |
| 60.971    | Trip.com Group Ltd ADR                                | 2.164.218   |
| 242.408   | Saudi Arabian Oil Co                                  | 2.119.676   |
| 22.626    | Dino Polska SA  | 2.115.003   |
| 308.022   | Tong Hsing Electronic Industries Ltd                  | 2.042.445   |
| 1.853.990 | Jiangsu Changshu Rural Commercial Bank Co Ltd Class A | 1.958.604   |
| 53.818    | Anglo American Plc                                    | 1.882.399   |
| 7.100     | Kweichow Moutai Co Ltd Class A                        | 1.852.324   |
| 26.803    | SK Hynix Inc  | 1.826.947   |
| 83.027    | Bid Corp Ltd  | 1.804.405   |
| 89.521    | HDFC Bank Ltd   | 1.798.137   |
| 231.591   | Wingtech Technology Co Ltd Class A                    | 1.773.004   |
| 1.383.000 | Geely Automobile Holdings Ltd                         | 1.771.762   |
| 382.206   | Qatar National Bank QPSC                              | 1.759.092   |
| 425.845   | Xianhe Co Ltd Class A                                 | 1.743.476   |
| 433.000   | Chunghwa Telecom Co Ltd                               | 1.718.640   |
| 106.400   | GigaDevice Semiconductor Inc Class A                  | 1.662.083   |
| 89.451    | Parex Resources Inc                                   | 1.633.554   |
| 138.700   | Wuxi NCE Power Co Ltd Class A                         | 1.618.602   |
| 402.200   | Bank of Ningbo Co Ltd Class A                         | 1.590.742   |
| 685.711   | B3 SA - Brasil Bolsa Balcao                           | 1.557.990   |
| 440.625   | Klabin SA   | 1.554.332   |



## Emerging Markets Select Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung                                  | Kosten US\$ |
|---------|--|-------------|
| 127.161 | Axis Bank Ltd  | 1.424.997   |
| 179.000 | Li Ning Co Ltd   | 1.306.274   |
| 130.900 | Shenzhen Inovance Technology Co Ltd Class              | 1.281.518   |
| 148.200 | Midea Group Co Ltd Class                               | 1.206.609   |
| 16.366  | Rio Tinto Plc  | 1.111.893   |
| 12.430  | PDD Holdings Inc ADR                                   | 1.103.707   |
| 290.600 | NARI Technology Co Ltd Class A                         | 1.098.266   |
| 335.100 | CITIC Securities Co Ltd Class A                        | 1.043.862   |
| 207.900 | Bangkok Bank PCL                                       | 998.485     |
| 94.169  | Grupo Aeroportuario del Centro Norte SAB de CV Class B | 991.369     |
| 119.610 | Grupo Financiero Banorte SAB de CV Class O             | 988.708     |
| 143.000 | Galaxy Entertainment Group Ltd                         | 988.029     |
| 60.400  | Sungrow Power Supply Co Ltd Class A                    | 968.123     |
| 157.000 | Chroma ATE Inc   | 965.286     |
| 6.258   | Baidu Inc ADR  | 945.061     |
| 30.500  | BYD Co Ltd H Class H                                   | 942.558     |
| 36.575  | Samsung Engineering Co Ltd                             | 823.650     |
| 359.500 | Foxconn Industrial Internet Co Ltd Class A             | 818.575     |
| 17.913  | Dixon Technologies India Ltd                           | 768.675     |
| 89.103  | Hypera SA  | 754.176     |
| 4.100   | Naspers Ltd Class N                                    | 724.509     |
| 42.630  | SM Investments Corp                                    | 719.913     |
| 304.220 | BDO Unibank Inc  | 690.278     |
| 174.700 | Bank of Ningbo Co Ltd Class A                          | 667.661     |
| 4.082   | Globant SA   | 652.237     |
| 909.246 | Borouge Plc  | 641.328     |
| 19.646  | Larsen & Toubro Ltd                                    | 587.555     |
| 51.283  | Saudi National Bank                                    | 582.956     |
| 10.319  | Samsung Electronics Co Ltd                             | 530.889     |
| 11.410  | H World Group Ltd ADR                                  | 490.100     |
| 41.800  | Alibaba Group Holding Ltd                              | 471.543     |
| 34.000  | Accton Technology Corp                                 | 345.373     |
| 17.876  | GMM Pfaudler Ltd                                       | 338.970     |
| 108.312 | Aptus Value Housing Finance India Ltd                  | 325.529     |
| 312.474 | Americana Restaurants International Plc                | 323.860     |
| 99.589  | B3 SA - Brasil Bolsa Balcao                            | 307.564     |

## Emerging Markets Select Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung                                 | Erlöse US\$ |
|---------|---|-------------|
| 105.350 | JD.com Inc  | 2.379.404   |
| 340.033 | Wal-Mart de Mexico SAB de CV                          | 1.327.614   |
| 26.600  | Tencent Holdings Ltd                                  | 1.125.040   |
| 67.960  | Meituan Class B                                       | 1.111.126   |
| 15.093  | State Bank of India Class S                           | 1.035.014   |
| 182.864 | Yifeng Pharmacy Chain Co Ltd Class A                  | 986.190     |
| 208.616 | Qatar National Bank QPSC                              | 927.923     |
| 212.273 | Xianhe Co Ltd Class A                                 | 849.174     |
| 131.596 | Tong Hsing Electronic Industries Ltd                  | 845.329     |
| 7.525   | Fabrinet  | 842.711     |
| 828.337 | Jiangsu Changshu Rural Commercial Bank Co Ltd Class A | 838.782     |
| 181.000 | LONGi Green Energy Technology Co Ltd Class A          | 780.443     |
| 887.876 | Ngern Tid Lor PCL                                     | 764.793     |
| 620.000 | Geely Automobile Holdings Ltd                         | 764.711     |
| 108.100 | Wingtech Technology Co Ltd Class A                    | 762.478     |
| 119.500 | Ping An Insurance Group Co of China Ltd Class H       | 757.184     |
| 49.000  | Eclat Textile Co Ltd                                  | 746.765     |
| 653.000 | China Longyuan Power Group Corp Ltd Class H           | 722.129     |
| 200.827 | Klabin SA   | 693.706     |
| 59.300  | Wuxi NCE Power Co Ltd Class A                         | 684.887     |
| 3.936   | Naspers Ltd Class N                                   | 649.987     |
| 6.233   | Dino Polska SA  | 639.952     |
| 27.439  | ICICI Bank Ltd ADR                                    | 629.846     |
| 85.115  | Zhejiang HangKe Technology Inc Co Class A             | 596.022     |
| 387.176 | Dubai Islamic Bank PJSC                               | 557.640     |
| 16.134  | Anglo American Plc                                    | 537.134     |
| 91.369  | DLF Ltd   | 525.642     |
| 716.764 | Borouge Plc   | 501.732     |
| 28.182  | United Breweries Ltd                                  | 493.422     |
| 15.188  | Trip.com Group Ltd ADR                                | 481.568     |
| 2.809   | Soulbrain Co Ltd                                      | 469.906     |
| 67.006  | State Bank of India                                   | 467.355     |
| 115.300 | Bank of Ningbo Co Ltd Class A                         | 398.626     |
| 26.088  | Infosys Ltd ADR                                       | 395.830     |
| 174.008 | B3 SA - Brasil Bolsa Balcao                           | 390.740     |
| 1.500   | Kweichow Moutai Co Ltd Class A                        | 377.751     |
| 36.000  | Tsingtao Brewery Co Ltd - H Shares                    | 370.215     |
| 9.137   | SK Telecom Co Ltd                                     | 341.190     |
| 10.969  | Reliance Industries Ltd                               | 327.526     |

## Euro Bond Absolute Return – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung                                  | Kosten EUR |
|-----------|--|------------|
| 1.600.000 | Thames Water Utilities Finance Plc, 4.38%, 18/01/2031  | 1.588.106  |
| 1.500.000 | Bundesobligation, 2.20%, 13/04/2028                    | 1.494.810  |
| 1.035.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.40%, 01/05/2033   | 1.057.642  |
| 1.000.000 | Morgan Stanley, 4.66%, 02/03/2029                      | 1.000.000  |
| 1.000.000 | Toyota Motor Credit Corp, 4.05%, 13/09/2029            | 998.180    |
| 1.000.000 | VF Corp, 4.25%, 07/03/2029                             | 995.700    |
| 1.001.000 | Spain Government Bond, 3.15%, 30/04/2033               | 995.528    |
| 1.000.000 | Intesa Sanpaolo SpA, 5.63%, 08/03/2033                 | 992.540    |
| 1.000.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.40%, 28/03/2025   | 991.560    |
| 7.000.000 | Nykredit Realkredit AS, 5.00%, 01/10/2053              | 930.745    |
| 7.000.000 | Nykredit Realkredit AS, 4.00%, 01/10/2053              | 915.877    |
| 905.093   | French Republic Government Bond OAT, 0.10%, 25/07/2031 | 891.591    |
| 860.000   | Spain Government Bond, 3.55%, 31/10/2033               | 862.112    |
| 800.000   | NatWest Group Plc, 28/02/2034                          | 800.000    |
| 800.000   | Société Générale, 5.63%, 02/06/2033                    | 793.772    |
| 700.000   | AstraZeneca Plc, 3.75%, 03/03/2032                     | 699.944    |
| 700.000   | National Gas Transmission Plc, 4.25%, 05/04/2030       | 699.748    |
| 700.000   | HSBC Holdings Plc, 4.79%, 10/03/2032                   | 697.950    |
| 700.000   | Linde Plc, 3.63%, 12/06/2034                           | 697.935    |
| 700.000   | BPCE SA, 4.75%, 14/06/2034                             | 697.053    |

## Euro Bond Absolute Return – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung                                  | Erlöse EUR |
|-----------|--|------------|
| 1.217.000 | Slovakia Government Bond, 4.00%, 19/10/2032            | 1.278.758  |
| 1.200.000 | Thames Water Utilities Finance Plc, 4.38%, 18/01/2031  | 1.196.838  |
| 1.035.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.40%, 01/05/2033   | 1.056.701  |
| 1.000.000 | Morgan Stanley, 4.66%, 02/03/2029                      | 1.005.551  |
| 1.000.000 | Toyota Motor Credit Corp, 4.05%, 13/09/2029            | 1.003.180  |
| 1.000.000 | VF Corp, 4.25%, 07/03/2029                             | 999.225    |
| 1.000.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 28/02/2023          | 997.780    |
| 1.000.000 | Intesa Sanpaolo SpA, 5.63%, 08/03/2033                 | 988.250    |
| 937.836   | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.40%, 26/05/2025   | 924.256    |
| 905.691   | French Republic Government Bond OAT, 0.10%, 25/07/2031 | 887.965    |
| 902.850   | French Republic Government Bond OAT, 2.00%, 25/11/2032 | 845.770    |
| 800.000   | NatWest Group Plc, 28/02/2034                          | 802.048    |
| 800.000   | Société Générale, 5.63%, 02/06/2033                    | 796.080    |
| 827.111   | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.60%, 22/11/2028   | 795.350    |
| 795.000   | Spain Government Bond, 3.15%, 30/04/2033               | 777.856    |
| 700.000   | HSBC Holdings Plc, 4.79%, 10/03/2032                   | 707.732    |
| 700.000   | BPCE SA, 4.75%, 14/06/2034                             | 703.995    |
| 700.000   | National Gas Transmission Plc, 4.25%, 05/04/2030       | 703.220    |
| 700.000   | Orsted A/S, 4.13%, 01/03/2035                          | 700.441    |
| 700.000   | WPP Finance SA, 4.13%, 30/05/2028                      | 700.189    |

## Euro Opportunistic Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung   | Kosten EUR |
|---------|---|------------|
| 400.000 | Thames Water Utilities Finance Plc, 4.38%, 18/01/2031             | 396.817    |
| 200.000 | BNP Paribas SA, 7.38%, 28/02/2034                                 | 200.000    |
| 200.000 | Intesa Sanpaolo SpA, 0.00%, 20/02/2034                            | 200.000    |
| 200.000 | NatWest Group Plc, 0.00%, 02/03/2029                              | 200.000    |
| 200.000 | Morgan Stanley, 7.38%, 11/06/2172                                 | 200.000    |
| 200.000 | National Gas Transmission Plc, 4.25%, 05/04/2030                  | 199.928    |
| 200.000 | Banco BPM SpA, 6.00%, 14/06/2028                                  | 199.910    |
| 200.000 | Toyota Motor Credit Corp, 4.05%, 13/09/2029                       | 199.636    |
| 200.000 | HSBC Holdings Plc, 4.79%, 10/03/2032                              | 199.590    |
| 215.000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1.70%, 15/08/2032       | 199.500    |
| 200.000 | Linde Plc, 3.63%, 12/06/2034                                      | 199.410    |
| 200.000 | Caixa Central de Credito Agricola Mutuo CRL, 8.38%, 04/07/2027    | 199.362    |
| 200.000 | Athora Holding Ltd, 6.63%, 16/06/2028                             | 199.322    |
| 200.000 | BPCE SA, 4.75%, 14/06/2034  | 199.158    |
| 200.000 | VF Corp, 4.25%, 07/03/2029  | 199.140    |
| 200.000 | BPCE SA, 5.13%, 25/01/2035  | 199.070    |
| 200.000 | Banque Federative du Credit Mutuel SA, 4.38%, 02/05/2030          | 198.902    |
| 200.000 | Continental AG, 4.00%, 01/06/2028                                 | 198.890    |
| 200.000 | Intesa Sanpaolo SpA, 5.63%, 08/03/2033                            | 198.508    |
| 200.000 | Société Générale, 5.63%, 02/06/2033                               | 198.443    |
| 200.000 | HeidelbergCement AG, 3.75%, 31/05/2032                            | 197.488    |
| 200.000 | Engie SA, 4.25%, 11/01/2043                                       | 197.104    |
| 200.000 | Shamrock Residential DAC Series 2023-1 Class C, 6.19%, 24/06/2071 | 192.200    |

## Euro Opportunistic Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung   | Erlöse EUR |
|---------|---|------------|
| 300.000 | Thames Water Utilities Finance Plc, 4.38%, 18/01/2031             | 299.947    |
| 200.000 | HSBC Holdings Plc, 4.79%, 10/03/2032                              | 201.591    |
| 200.000 | Morgan Stanley, 4.66%, 02/03/2029                                 | 201.110    |
| 200.000 | BPCE SA, 4.75%, 14/06/2034  | 200.967    |
| 200.000 | National Gas Transmission Plc, 4.25%, 05/04/2030                  | 200.920    |
| 200.000 | Banco BPM SpA, 6.00%, 14/06/2028                                  | 200.684    |
| 200.000 | Toyota Motor Credit Corp, 4.05%, 13/09/2029                       | 200.636    |
| 200.000 | NatWest Group Plc, 0.00%, 28/02/2034                              | 200.512    |
| 200.000 | BNP Paribas SA, 7.38%, 11/06/2172                                 | 200.160    |
| 200.000 | Linde Plc, 3.63%, 12/06/2034                                      | 200.004    |
| 200.000 | VF Corp, 4.25%, 07/03/2029  | 199.845    |
| 200.000 | Banque Federative du Credit Mutuel SA, 4.38%, 02/05/2030          | 199.447    |
| 200.000 | Athora Holding Ltd, 6.63%, 16/06/2028                             | 199.313    |
| 200.000 | Engie SA, 4.25%, 11/01/2043                                       | 199.300    |
| 200.000 | Continental AG, 4.00%, 01/06/2028                                 | 199.269    |
| 200.000 | Société Générale, 5.63%, 02/06/2033                               | 199.020    |
| 200.000 | Intesa Sanpaolo SpA, 0.00%, 20/02/2034                            | 198.068    |
| 200.000 | Intesa Sanpaolo SpA, 5.63%, 08/03/2033                            | 197.650    |
| 200.000 | BPCE SA, 5.13%, 25/01/2035  | 197.165    |
| 200.000 | HeidelbergCement AG, 3.75%, 31/05/2032                            | 196.730    |
| 200.000 | Shamrock Residential DAC Series 2023-1 Class C, 6.19%, 24/06/2071 | 192.000    |
| 189.965 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1.70%, 15/08/2032       | 180.750    |

## European High Yield Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung                                     | Kosten EUR |
|-----------|---|------------|
| 1.100.000 | EDP - Energias de Portugal SA, 5.94%, 23/04/2083          | 1.099.877  |
| 1.030.000 | Ford Motor Credit Co LLC, 3.02%, 06/03/2024               | 1.015.122  |
| 950.000   | Telecom Italia SpA, 4.00%, 11/04/2024                     | 939.135    |
| 900.000   | Valeo, 5.38%, 28/05/2027                                  | 911.980    |
| 1.000.000 | Abertis Infraestructuras Finance BV, 3.25%, 29/12/2049    | 903.992    |
| 900.000   | Lorca Telecom Bondco SA, 4.00%, 18/09/2027                | 826.425    |
| 809.000   | Benteler International AG, 9.38%, 15/05/2028              | 818.080    |
| 870.000   | Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH, 2.00%, 15/07/2025 | 814.536    |
| 770.000   | Banijay Entertainment SASU, 3.50%, 01/03/2025             | 750.456    |
| 800.000   | Verisure Holding AB, 3.88%, 15/07/2026                    | 748.097    |
| 726.000   | Emerald Debt Merger Sub, 6.38%, 15/12/2030                | 726.000    |
| 650.000   | NGG Finance Plc, 5.63%, 18/06/2073                        | 722.270    |
| 710.000   | Ford Motor Credit Co LLC, 4.87%, 03/08/2027               | 693.505    |
| 900.000   | CECONOMY AG, 1.75%, 24/06/2026                            | 684.970    |
| 665.000   | Dana Financing Luxembourg Sarl, 8.50%, 15/07/2031         | 666.000    |
| 650.000   | Motion Finco Sarl, 7.00%, 15/05/2025                      | 663.139    |
| 800.000   | Cellnex Telecom SA, 1.75%, 23/10/2030                     | 654.291    |
| 700.000   | Deutsche Lufthansa AG, 3.75%, 11/02/2028                  | 650.475    |
| 629.000   | IHO Verwaltungs GmbH, 8.75%, 15/05/2028                   | 636.183    |
| 700.000   | Douglas GmbH, 6.00%, 08/04/2026                           | 634.819    |

## European High Yield Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung  | Erlöse EUR |
|---------|--|------------|
| 750.000 | thyssenkrupp AG, 2.88%, 22/02/2024   | 741.750    |
| 750.000 | Altice France Holding SA, 8.00%, 15/05/2027                                      | 563.517    |
| 482.000 | Emerald Debt Merger Sub, 6.38%, 15/12/2030                                       | 481.111    |
| 440.000 | Ford Motor Credit Co LLC, 3.02%, 06/03/2024                                      | 434.062    |
| 400.000 | Cheplapharm Arzneimittel GmbH, 7.50%, 15/05/2030                                 | 402.455    |
| 400.000 | SGL Carbon SE, 4.63%, 30/09/2024   | 399.161    |
| 400.000 | TDC NET A/S, 5.62%, 06/02/2030   | 391.775    |
| 426.000 | Repsol International Finance BV, 4.25%, 29/12/2049                               | 389.668    |
| 350.000 | Cirsa Finance International Sarl, 10.38%, 30/11/2027                             | 372.750    |
| 380.000 | Energia Group NI FinanceCo Plc/Energia Group ROI Holdings DAC, 4.00%, 15/09/2025 | 365.750    |
| 330.000 | Stonegate Pub Company Financing 2019 Plc, 8.25%, 31/07/2025                      | 350.488    |
| 354.000 | Playtech Plc, 4.25%, 07/03/2026  | 342.510    |
| 350.000 | Avis Budget Finance Plc, 4.75%, 30/01/2026                                       | 341.425    |
| 400.000 | Ahlstrom-Munksjo Holding 3, 3.63%, 04/02/2028                                    | 338.675    |
| 362.000 | 888 Acquisitions Ltd, 7.56%, 15/07/2027  | 318.651    |
| 356.000 | Sappi Papier Holding GmbH, 3.63%, 15/03/2028                                     | 314.348    |
| 300.000 | Dana Financing Luxembourg Sarl, 8.50%, 15/07/2031                                | 309.586    |
| 300.000 | Motion Finco Sarl, 7.00%, 15/05/2025   | 305.190    |
| 298.000 | Enel SpA, 6.38%, 16/07/2171  | 300.983    |
| 300.000 | Air France-KLM, 8.13%, 31/05/2028  | 298.416    |
| 300.000 | Huhtamaki OYJ, 4.25%, 09/06/2027   | 297.093    |
| 300.000 | Celanese US Holdings LLC, 4.78%, 19/07/2026                                      | 293.925    |
| 300.000 | Adevinta ASA, 3.00%, 15/11/2027  | 271.875    |
| 250.000 | Centrica Plc, 5.25%, 10/04/2075  | 269.918    |
| 267.000 | Telecom Italia SpA/Milano, 6.88%, 15/02/2028                                     | 268.967    |
| 300.000 | eG Global Finance Plc, 6.25%, 30/10/2025   | 266.400    |
| 300.000 | Altice France SA, 2.13%, 15/02/2025  | 263.250    |
| 300.000 | International Consolidated Airlines Group SA, 3.75%, 25/03/2029                  | 251.320    |
| 300.000 | Petroleos Mexicanos, 4.75%, 26/02/2029   | 250.098    |
| 250.000 | Italmatch Chemicals SpA, 10.00%, 06/02/2028                                      | 249.203    |
| 250.000 | Pinnacle Bidco Plc, 5.50%, 15/02/2025  | 239.491    |
| 250.000 | Iliad Holding SASU, 5.63%, 15/10/2028  | 234.223    |
| 250.000 | Virgin Media Secured Finance Plc, 4.25%, 15/01/2030                              | 233.980    |
| 300.000 | United Group BV, 5.25%, 01/02/2030   | 230.460    |
| 250.000 | INEOS Finance Plc, 2.88%, 01/05/2026   | 226.625    |



## European Sustainable Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Käufe insgesamt:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung           | Kosten EUR |
|---------|---------------------------------|------------|
| 12.370  | Ferrari NV                      | 3.424.611  |
| 71.962  | Netcompany Group A/S            | 2.723.595  |
| 24.464  | Reply SpA                       | 2.548.958  |
| 5.918   | L'Oreal SA                      | 2.260.589  |
| 25.958  | Alfen NV                        | 1.724.388  |
| 44.988  | Cellnex Telecom SA              | 1.699.696  |
| 16.881  | London Stock Exchange Group Plc | 1.442.895  |
| 655     | Adyen NV                        | 1.030.996  |
| 13.319  | Euronext NV                     | 845.870    |
| 4.644   | Nestle SA                       | 533.365    |
| 17.296  | Zalando SE                      | 425.904    |
| 22.939  | HelloFresh SE                   | 425.658    |
| 750     | Tecan Group AG                  | 254.926    |

## European Sustainable Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen

| Anteile | Wertpapierbezeichnung           | Erlöse EUR |
|---------|---------------------------------|------------|
| 329.947 | 3i Group Plc                    | 6.805.923  |
| 77.311  | Amundi SA                       | 4.239.249  |
| 37.730  | London Stock Exchange Group Plc | 3.639.818  |
| 5.695   | Kering SA                       | 3.161.329  |
| 53.703  | Zalando SE                      | 2.191.372  |
| 13.567  | Novo Nordisk A/S Class B        | 1.844.219  |
| 4.596   | Tecan Group AG                  | 1.824.556  |
| 4.614   | VAT Group AG                    | 1.589.010  |
| 106.975 | TeamViewer SE                   | 1.517.469  |
| 2.478   | ASML Holding NV                 | 1.484.560  |
| 118.270 | Atlas Copco AB Class A          | 1.399.513  |
| 11.789  | Nestle SA                       | 1.286.379  |
| 20.979  | Bakkafrost P/F                  | 1.257.181  |
| 59.148  | HelloFresh SE                   | 1.231.768  |
| 7.801   | Schneider Electric SE           | 1.163.749  |
| 9.021   | Straumann Holding AG            | 1.143.160  |
| 42.899  | Assa Abloy AB Class B           | 965.224    |
| 2.419   | L'Oreal SA                      | 956.404    |
| 12.937  | Euronext NV                     | 893.213    |
| 1.055   | Partners Group Holding AG       | 874.096    |
| 15.926  | Scout24 SE                      | 855.463    |
| 528     | Adyen NV                        | 751.247    |
| 2.471   | Sartorius Stedim Biotech        | 743.604    |
| 19.266  | Cellnex Telecom SA              | 665.320    |
| 19.819  | Dechra Pharmaceuticals Plc      | 634.608    |
| 8.338   | Alfen NV                        | 624.442    |
| 24.463  | CVS Group Plc                   | 524.439    |
| 4.282   | Beiersdorf AG                   | 497.606    |

## Event Driven – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung                          | Kosten US\$ |
|-----------|--|-------------|
| 8.650.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 31/08/2023 | 8.531.968   |
| 6.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 17/10/2023 | 5.898.845   |
| 4.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 01/08/2023 | 3.942.926   |
| 4.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 19/09/2023 | 3.941.188   |
| 4.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 24/08/2023 | 3.941.140   |
| 4.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 07/09/2023 | 3.940.881   |
| 4.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 10/08/2023 | 3.938.119   |
| 4.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 17/08/2023 | 3.937.768   |
| 4.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 14/09/2023 | 3.936.444   |
| 4.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 26/09/2023 | 3.935.935   |
| 4.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 24/10/2023 | 3.931.796   |
| 4.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 02/11/2023 | 3.927.229   |
| 3.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 30/03/2023 | 2.969.995   |
| 3.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 27/06/2023 | 2.953.508   |
| 3.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 05/07/2023 | 2.951.640   |
| 3.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 20/07/2023 | 2.951.072   |
| 3.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 22/06/2023 | 2.950.704   |
| 3.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 06/07/2023 | 2.949.845   |
| 3.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 10/10/2023 | 2.949.550   |
| 3.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 03/10/2023 | 2.948.704   |
| 3.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 29/06/2023 | 2.948.008   |
| 3.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 13/07/2023 | 2.946.934   |
| 3.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 09/11/2023 | 2.942.751   |
| 2.800.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 06/04/2023 | 2.770.306   |
| 2.800.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 16/05/2023 | 2.758.322   |
| 2.800.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 23/05/2023 | 2.757.640   |
| 2.800.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 06/06/2023 | 2.757.591   |
| 2.800.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 13/06/2023 | 2.756.429   |
| 2.800.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 20/06/2023 | 2.755.893   |

Verkäufe insgesamt:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse US\$ |
|---------|-----------------------|-------------|
| 19.059  | Kenvue Inc            | 486.576     |
| 4.736   | CAVA Group Inc        | 198.912     |
| 6.315   | Nextracker Inc        | 191.408     |
| 1.136   | ACELYRIN Inc          | 26.128      |

## Global Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

| Anteile        | Wertpapierbezeichnung  | Kosten US\$ |
|----------------|--|-------------|
| 4.746.920      | United States Treasury Inflation Indexed Note, 1.63%, 15/10/2027 | 4.834.558   |
| 2.595.000      | United States Treasury Note/Bond, 4.13%, 15/11/2032              | 2.727.196   |
| 2.500.000      | State of Hesse, 2.88%, 04/07/2033                                | 2.725.318   |
| 3.580.000      | Canadian Government Bond, 3.00%, 01/11/2024                      | 2.589.112   |
| 2.503.000      | United States Treasury Note/Bond, 3.50%, 31/01/2028              | 2.484.675   |
| 2.330.000      | United States Treasury Note/Bond, 3.50%, 15/02/2033              | 2.308.672   |
| 2.090.000      | United States Treasury Note/Bond, 3.38%, 15/05/2033              | 2.028.549   |
| 28.806.000.000 | Indonesia Treasury Bond, 6.63%, 15/05/2033                       | 1.940.961   |
| 1.500.000      | Gemeinsame Bundeslaender, 3.00%, 26/04/2030                      | 1.631.447   |
| 1.505.000      | Fannie Mae Pool, 6.00%, 01/03/2054                               | 1.524.545   |
| 1.440.000      | United States Treasury Bond, 3.63%, 15/02/2053                   | 1.423.219   |
| 10.100.000     | Nykredit Realkredit AS, 4.00%, 01/10/2053                        | 1.402.975   |
| 1.240.732      | United Kingdom Gilt, 3.75%, 22/10/2053                           | 1.362.512   |
| 1.892.000      | Queensland Treasury Corp, 4.50%, 09/03/2033                      | 1.276.502   |
| 1.200.000      | Croatia Government International Bond, 6.00%, 26/01/2024         | 1.206.840   |
| 1.145.000      | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/02/2041                               | 1.161.087   |
| 1.145.000      | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/03/2054                               | 1.154.650   |
| 1.134.204      | Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/01/2053                               | 1.122.650   |
| 1.125.000      | United States Treasury Note, 3.50%, 30/04/2030                   | 1.106.064   |
| 980.000        | Schleswig-Holstein, Land, 3.00%, 05/06/2030                      | 1.044.864   |

## Global Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

| Anteile    | Wertpapierbezeichnung  | Erlöse US\$ |
|------------|--|-------------|
| 4.208.375  | United States Treasury Inflation Indexed Note, 1.63%, 15/10/2027 | 4.231.210   |
| 5.730.000  | Canadian Government Bond, 3.00%, 01/11/2024                      | 4.225.104   |
| 3.415.000  | United States Treasury Note/Bond, 4.13%, 15/11/2032              | 3.548.502   |
| 4.202.104  | Canadian Government Real Return Bond, 4.25%, 01/12/2026          | 3.423.689   |
| 60.445.000 | Mexican Bonos, 7.75%, 29/05/2031                                 | 3.130.791   |
| 3.161.300  | United States Treasury Note/Bond, 0.88%, 31/01/2024              | 3.040.981   |
| 2.330.000  | United States Treasury Note/Bond, 3.50%, 15/02/2033              | 2.322.107   |
| 2.054.000  | United States Treasury Note/Bond, 0.50%, 31/03/2025              | 1.903.713   |
| 1.505.000  | Fannie Mae Pool, 6.00%, 01/03/2054                               | 1.520.318   |
| 1.395.573  | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.25%, 15/02/2027      | 1.402.112   |
| 1.230.000  | United States Treasury Note/Bond, 3.38%, 15/05/2033              | 1.197.541   |
| 1.145.000  | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/01/2053                               | 1.161.758   |
| 1.145.000  | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/02/2041                               | 1.155.545   |
| 1.145.000  | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/03/2054                               | 1.140.104   |
| 1.149.000  | United States Treasury Note/Bond, 2.88%, 15/05/2032              | 1.053.386   |
| 930.000    | Texas Water Development Board, 5.00%, 15/10/2047                 | 1.031.723   |
| 1.050.000  | United States Treasury Bond, 3.63%, 15/02/2053                   | 1.008.218   |
| 886.460    | Netherlands Government Bond, 2.50%, 15/01/2033                   | 963.345     |
| 945.000    | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/06/2053                               | 943.080     |
| 1.075.000  | United States Treasury Note/Bond, 3.00%, 15/08/2052              | 928.115     |

## Global Diversified Income FMP - 2024 – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Käufe insgesamt:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung  | Kosten US\$ |
|-----------|--|-------------|
| 4.040.000 | Ball Corp, 4.00%, 15/11/2023   | 3.989.500   |
| 3.000.000 | HSBC Holdings Plc, 4.25%, 14/03/2024   | 2.954.520   |
| 3.000.000 | Nationwide Building Society, 0.55%, 22/01/2024                                     | 2.898.840   |
| 3.000.000 | Air Lease Corp, 0.70%, 15/02/2024  | 2.891.640   |
| 2.345.000 | Sprint LLC, 7.13%, 15/06/2024  | 2.400.694   |
| 2.200.000 | Energy Transfer LP, 3.90%, 15/05/2024  | 2.170.718   |
| 815.000   | NOVA Chemicals Corp, 4.88%, 01/06/2024   | 802.775     |
| 790.000   | Taylor Morrison Communities Inc/Taylor Morrison Holdings II Inc, 5.63%, 01/03/2024 | 787.038     |
| 490.000   | Ford Motor Credit Co LLC, 5.58%, 18/03/2024  | 486.938     |
| 480.000   | FMG Resources August 2006 Pty Ltd, 5.13%, 15/05/2024                               | 477.792     |
| 480.000   | EQM Midstream Partners LP, 4.75%, 15/07/2023                                       | 477.600     |
| 470.000   | Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc, 5.25%, 15/04/2024          | 467.063     |
| 400.000   | TRI Pointe Group Inc/TRI Pointe Homes Inc, 5.88%, 15/06/2024                       | 399.500     |
| 400.000   | Starwood Property Trust Inc, 5.50%, 01/11/2023                                     | 399.000     |
| 400.000   | Hanesbrands Inc, 4.63%, 15/05/2024   | 394.900     |
| 390.000   | OneMain Finance Corp, 6.13%, 15/03/2024  | 387.563     |
| 400.000   | Huarong Finance 2019 Co Ltd, 3.75%, 29/05/2024                                     | 383.000     |

Verkäufe insgesamt:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung                                  | Erlöse US\$ |
|---------|--|-------------|
| 989.000 | Egypt Government International Bond, 6.20%, 01/03/2024 | 908.958     |
| 800.000 | REC Ltd, 3.50%, 12/12/2024                             | 777.384     |
| 400.000 | Egypt Government International Bond, 4.55%, 20/11/2023 | 388.000     |

## Global Equity Megatrends – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Käufe insgesamt:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung             | Kosten US\$ |
|---------|-----------------------------------|-------------|
| 108.548 | Uber Technologies Inc             | 3.562.645   |
| 150.563 | Element Solutions Inc             | 2.747.575   |
| 40.391  | ModivCare Inc                     | 2.351.035   |
| 94.424  | Gen Digital Inc                   | 1.921.769   |
| 23.307  | Stericycle Inc                    | 1.079.319   |
| 45.049  | Vistra Corp                       | 977.716     |
| 9.895   | Alphabet Inc Class A              | 920.549     |
| 155.592 | Despegar.com Corp                 | 896.153     |
| 5.787   | Expedia Group Inc                 | 602.289     |
| 14.893  | Perrigo Co Plc                    | 492.068     |
| 5.182   | Amdocs Ltd                        | 470.056     |
| 4.212   | Alibaba Group Holding Ltd ADR     | 364.518     |
| 10.824  | Scholastic Corp                   | 339.632     |
| 7.087   | Corning Inc                       | 242.354     |
| 25.578  | Zeta Global Holdings Corp Class A | 226.987     |
| 1.708   | TE Connectivity Ltd               | 209.577     |
| 4.076   | Delta Air Lines Inc               | 135.514     |

## Global Equity Megatrends – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung             | Erlöse US\$ |
|---------|-----------------------------------|-------------|
| 204.763 | Paya Holdings Inc                 | 1.976.649   |
| 5.613   | Quanta Services Inc               | 947.996     |
| 5.607   | Alibaba Group Holding Ltd ADR     | 586.315     |
| 27.295  | Element Fleet Management Corp     | 389.804     |
| 996     | Aon Plc Class A                   | 308.356     |
| 7.598   | ATI Inc                           | 277.378     |
| 6.313   | Scholastic Corp                   | 269.116     |
| 43.067  | Pets at Home Group Plc            | 191.972     |
| 5.640   | Criteo SA ADR                     | 171.520     |
| 3.948   | Perrigo Co Plc                    | 140.805     |
| 1.467   | Amdocs Ltd                        | 140.433     |
| 5.836   | Vistra Corp                       | 138.287     |
| 3.915   | Corning Inc                       | 135.746     |
| 1.266   | Alphabet Inc Class A              | 130.739     |
| 643     | TE Connectivity Ltd               | 83.887      |
| 5.275   | Zeta Global Holdings Corp Class A | 56.627      |
| 321     | Tetra Tech Inc                    | 46.612      |
| 681     | Delta Air Lines Inc               | 23.361      |
| 457     | Stericycle Inc                    | 23.226      |
| 226     | ModivCare Inc                     | 20.944      |



## Global Flexible Credit Income – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung  | Kosten US\$ |
|-----------|--|-------------|
| 8.410.000 | United States Treasury Note/Bond, 3.38%, 15/05/2033                                | 8.168.903   |
| 5.080.000 | United States Treasury Note/Bond, 3.88%, 15/05/2043                                | 4.996.677   |
| 3.490.000 | TransDigm Inc, 6.75%, 15/08/2028   | 3.542.350   |
| 3.471.000 | Comstock Resources Inc, 6.75%, 01/03/2029  | 3.132.243   |
| 2.470.000 | Bath & Body Works Inc, 6.63%, 01/10/2030   | 2.381.750   |
| 1.905.000 | Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC, 6.50%, 15/02/2028 | 1.910.081   |
| 1.795.000 | Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 1B1, 7.94%, 25/07/2030              | 1.873.531   |
| 1.810.000 | Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer, 6.75%, 15/04/2028    | 1.811.025   |
| 1.930.000 | Iron Mountain Inc, 5.63%, 15/07/2032   | 1.770.775   |
| 1.935.000 | Macy's Retail Holdings LLC, 5.88%, 15/03/2030                                      | 1.720.325   |
| 1.890.000 | Energizer Holdings Inc, 4.75%, 15/06/2028  | 1.675.490   |
| 1.590.000 | Mauser Packaging Solutions Holding Co, 7.88%, 15/08/2026                           | 1.590.000   |
| 1.585.000 | Ford Motor Credit Co LLC, 6.95%, 06/03/2026  | 1.586.325   |
| 1.530.000 | PetSmart Inc/PetSmart Finance Corp., 7.75%, 15/02/2029                             | 1.494.150   |
| 1.510.000 | United Rentals North America Inc, 5.25%, 15/01/2030                                | 1.475.572   |
| 1.695.000 | Midwest Gaming Borrower LLC/Midwest Gaming Finance Corp, 4.88%, 01/05/2029         | 1.475.100   |
| 1.450.000 | Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp, 8.25%, 31/12/2028            | 1.442.750   |
| 1.302.000 | IHO Verwaltungs GmbH, 8.75%, 15/05/2028  | 1.418.437   |
| 1.360.000 | Uniti Group LP/Uniti Group Finance Inc/CSL Capital LLC, 10.50%, 15/02/2028         | 1.354.900   |
| 1.161.000 | Emerald Debt Merger Sub, 6.38%, 15/12/2030   | 1.277.158   |

## Global Flexible Credit Income – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung   | Erlöse US\$ |
|-----------|---|-------------|
| 3.000.000 | Trinitas CLO XII Ltd Series 2020-12X Class D, 8.36%, 25/04/2033       | 2.817.300   |
| 2.265.000 | American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd, 5.50%, 20/04/2026   | 2.216.869   |
| 2.530.000 | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp, 4.25%, 01/02/2031         | 2.106.225   |
| 1.795.000 | Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 1B1, 7.94%, 25/07/2030 | 1.913.919   |
| 2.000.000 | Dryden 93 CLO Ltd Series 2021-93X Class D, 8.21%, 15/01/2034          | 1.846.000   |
| 1.715.000 | Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp, 8.00%, 15/01/2027      | 1.690.873   |
| 1.665.000 | Harvest Midstream I LP, 7.50%, 01/09/2028                             | 1.646.800   |
| 1.700.000 | Sappi Papier Holding GmbH, 3.63%, 15/03/2028                          | 1.635.390   |
| 2.105.000 | Cablevision Lightpath LLC, 5.63%, 15/09/2028                          | 1.573.488   |
| 1.500.000 | AA Bond Co Ltd, 6.50%, 31/01/2026                                     | 1.571.299   |
| 1.965.000 | Sirius XM Radio Inc, 3.88%, 01/09/2031                                | 1.544.981   |
| 1.680.000 | Dealer Tire LLC/DT Issuer LLC, 8.00%, 01/02/2028                      | 1.538.639   |
| 1.785.000 | WR Grace Holdings LLC, 5.63%, 15/08/2029                              | 1.502.156   |
| 1.579.000 | Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4.60%, 15/04/2048                 | 1.455.992   |
| 1.745.000 | DaVita Inc, 4.63%, 01/06/2030   | 1.443.988   |
| 1.619.740 | Global Aircraft Leasing Co Ltd, 6.50%, 15/09/2024                     | 1.430.028   |
| 1.485.000 | TransDigm Inc, 5.50%, 15/11/2027                                      | 1.410.750   |
| 1.500.000 | Annisa CLO Ltd Series 2016-2X Class DR, 7.81%, 20/07/2031             | 1.406.700   |
| 1.750.000 | MPH Acquisition Holdings LLC, 5.50%, 01/09/2028                       | 1.395.535   |
| 1.425.000 | Periama Holdings LLC, 5.95%, 19/04/2026                               | 1.387.801   |

## Global High Yield SDG Engagement – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung   | Kosten US\$ |
|-----------|---|-------------|
| 4.020.000 | American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd, 5.75%, 20/04/2029 | 3.829.239   |
| 3.970.000 | CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC, 5.50%, 15/06/2031           | 3.636.931   |
| 3.960.000 | 1011778 BC ULC/New Red Finance Inc, 4.00%, 15/10/2030               | 3.425.400   |
| 3.000.000 | Energizer Holdings Inc, 6.50%, 31/12/2027                           | 2.932.054   |
| 2.820.000 | Lorca Telecom Bondco SA, 4.00%, 18/09/2027                          | 2.793.384   |
| 3.155.000 | Yum! Brands Inc, 3.63%, 15/03/2031                                  | 2.774.364   |
| 2.680.000 | Aramark Services Inc, 5.00%, 01/02/2028                             | 2.539.300   |
| 2.700.000 | Molina Healthcare Inc, 4.38%, 15/06/2028                            | 2.525.713   |
| 2.370.000 | First Quantum Minerals Ltd, 8.63%, 01/06/2031                       | 2.368.300   |
| 2.295.000 | ZF North America Capital Inc, 7.13%, 14/04/2030                     | 2.347.436   |
| 2.135.000 | HUB International Ltd, 7.25%, 15/06/2030                            | 2.135.000   |
| 2.485.000 | WMG Acquisition Corp, 3.75%, 01/12/2029                             | 2.134.000   |
| 2.050.000 | Verisure Holding AB, 3.88%, 15/07/2026                              | 2.047.847   |
| 2.225.000 | Novelis Corp, 4.75%, 30/01/2030                                     | 2.024.750   |
| 2.055.000 | IQVIA Inc, 5.00%, 15/10/2026  | 2.016.960   |
| 1.965.000 | TransDigm Inc, 6.75%, 15/08/2028                                    | 1.986.375   |
| 1.700.000 | Telefonica Europe BV, 7.13%, 29/12/2049                             | 1.875.886   |
| 1.820.000 | XPO Inc, 6.25%, 01/06/2028  | 1.808.077   |
| 1.769.000 | Asea SAB de CV, 7.75%, 14/12/2026                                   | 1.765.727   |
| 1.790.000 | Ally Financial Inc, 6.70%, 14/02/2033                               | 1.750.942   |

## Global High Yield SDG Engagement – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung   | Erlöse US\$ |
|-----------|---|-------------|
| 2.771.000 | LeasePlan Corp NV, 7.38%, 29/12/2049                                  | 2.830.236   |
| 2.200.000 | EQM Midstream Partners LP, 6.50%, 01/07/2027                          | 2.139.700   |
| 2.280.000 | CAB SELAS, 3.38%, 01/02/2028  | 2.030.284   |
| 1.975.000 | Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp, 8.00%, 15/01/2027      | 1.934.344   |
| 1.780.000 | Adevinta ASA, 2.63%, 15/11/2025                                       | 1.828.373   |
| 1.725.000 | Ford Motor Credit, 3.37%, 17/11/2023                                  | 1.706.025   |
| 1.676.000 | Belden Inc, 3.38%, 15/07/2027   | 1.667.729   |
| 1.800.000 | MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp, 5.25%, 01/08/2026      | 1.588.676   |
| 1.790.000 | Ally Financial Inc, 6.70%, 14/02/2033                                 | 1.579.945   |
| 1.475.000 | Century Aluminum Co, 7.50%, 01/04/2028                                | 1.401.250   |
| 1.625.000 | Hertz Corp, 5.00%, 01/12/2029   | 1.322.907   |
| 1.200.000 | Adient Global Holdings Ltd, 3.50%, 15/08/2024                         | 1.270.895   |
| 1.343.000 | Akbank TAS, 6.80%, 06/02/2026   | 1.242.283   |
| 1.432.000 | Cia de Minas Buenaventura SAA, 5.50%, 23/07/2026                      | 1.230.881   |
| 1.335.000 | Sirius XM Radio Inc, 5.00%, 01/08/2027                                | 1.229.569   |
| 1.275.000 | NOVA Chemicals Corp, 5.00%, 01/05/2025                                | 1.226.588   |
| 1.170.000 | Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance Inc, 5.75%, 15/07/2027 | 1.105.683   |
| 1.390.000 | Legacy LifePoint Health LLC, 4.38%, 15/02/2027                        | 1.056.400   |
| 980.000   | Avis Budget Finance Plc, 4.75%, 30/01/2026                            | 1.053.869   |
| 1.260.000 | Medline Borrower LP, 5.25%, 01/10/2029                                | 1.052.283   |

## Global High Yield Sustainable Action – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung  | Kosten US\$ |
|---------|--|-------------|
| 190.000 | IQVIA Inc, 5.00%, 15/10/2026   | 184.465     |
| 135.000 | Avient Corp, 7.13%, 01/08/2030   | 136.349     |
| 140.000 | Energizer Holdings Inc, 6.50%, 31/12/2027  | 135.288     |
| 100.000 | Belden Inc, 3.38%, 15/07/2027  | 98.331      |
| 100.000 | eG Global Finance Plc, 4.38%, 07/02/2025   | 94.857      |
| 100.000 | Heimstaden Bostad AB, 3.25%, 29/12/2049  | 82.561      |
| 75.000  | Sprint Capital Corp, 6.88%, 15/11/2028   | 78.180      |
| 80.000  | Clean Harbors Inc, 4.88%, 15/07/2027   | 76.600      |
| 80.000  | Hologic Inc, 4.63%, 01/02/2028   | 76.401      |
| 75.000  | Berry Global Inc, 5.63%, 15/07/2027  | 72.938      |
| 70.000  | Mauser Packaging Solutions Holding Co, 7.88%, 15/08/2026                           | 70.150      |
| 60.000  | TerraForm Power Operating LLC, 5.00%, 31/01/2028                                   | 56.586      |
| 55.000  | NortonLifeLock Inc, 12/09/2029   | 54.931      |
| 50.000  | Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer, 6.75%, 15/04/2028    | 50.000      |
| 45.000  | Ford Motor Credit Co LLC, 6.95%, 06/03/2026  | 45.043      |
| 45.000  | Tenet Healthcare Corp, 6.75%, 15/05/2031   | 45.000      |
| 40.000  | United Rentals North America Inc, 6.00%, 15/12/2029                                | 40.200      |
| 40.000  | Iron Mountain Inc, 5.25%, 15/03/2028   | 37.500      |
| 30.000  | Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC, 6.50%, 15/02/2028 | 30.000      |
| 30.000  | United Rentals North America Inc, 5.50%, 15/05/2027                                | 29.475      |
| 30.000  | Clean Harbors Inc, 5.13%, 15/07/2029   | 28.950      |
| 30.000  | CommScope Inc, 6.00%, 01/03/2026   | 28.875      |
| 30.000  | EnerSys, 4.38%, 15/12/2027   | 28.125      |
| 30.000  | CommScope Inc, 8.25%, 01/03/2027   | 26.475      |
| 25.000  | Centene Corp, 4.25%, 15/12/2027  | 23.890      |
| 25.000  | United Rentals North America Inc, 4.00%, 15/07/2030                                | 22.202      |
| 25.000  | API Group DE Inc, 4.13%, 15/07/2029  | 21.656      |
| 20.000  | Ford Motor Credit Co LLC, 8.04%, 06/03/2026  | 20.075      |
| 20.000  | American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 7.25%, 15/02/2028                 | 20.000      |
| 25.000  | Dana Inc, 4.50%, 15/02/2032  | 19.774      |
| 20.000  | Zf North America Inc, 4.75%, 29/04/2025  | 19.550      |
| 20.000  | Tenet Healthcare Corp, 4.88%, 01/01/2026   | 19.542      |

## Global High Yield Sustainable Action – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung  | Erlöse US\$ |
|---------|--|-------------|
| 330.000 | Iron Mountain Inc, 5.25%, 15/03/2028   | 309.375     |
| 265.000 | IQVIA Inc, 5.00%, 15/10/2026   | 257.050     |
| 255.000 | TerraForm Power Operating LLC, 5.00%, 31/01/2028                                   | 241.375     |
| 255.000 | Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc, 6.25%, 15/01/2028          | 239.063     |
| 260.000 | Frontier Communications Holdings LLC, 5.88%, 15/10/2027                            | 237.019     |
| 240.000 | Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC, 5.88%, 15/02/2028 | 234.022     |
| 270.000 | OneMain Finance Corp, 3.50%, 15/01/2027  | 231.849     |
| 250.000 | AssuredPartners Inc,, 5.63%, 15/01/2029  | 216.130     |
| 220.000 | Valvoline Inc, 4.25%, 15/02/2030   | 215.875     |
| 200.000 | Belden Inc, 3.38%, 15/07/2027  | 203.178     |
| 205.000 | Tenet Healthcare Corp, 4.88%, 01/01/2026   | 200.718     |
| 175.000 | SGL Carbon SE, 4.63%, 30/09/2024   | 187.588     |
| 185.000 | HCA Inc, 5.38%, 01/02/2025   | 184.375     |
| 220.000 | Vmed Q2 UK Financing I Plc, 4.75%, 15/07/2031                                      | 184.108     |
| 210.000 | GYP Holdings III Corp, 4.63%, 01/05/2029   | 183.803     |
| 200.000 | ZF Finance GmbH, 2.25%, 03/05/2028   | 183.295     |
| 200.000 | Organon & Co/Organon Foreign Debt Co-Issuer BV, 5.13%, 30/04/2031                  | 171.250     |
| 170.000 | APX Group Inc, 6.75%, 15/02/2027   | 167.300     |
| 175.000 | NextEra Energy Operating Partners LP, 4.50%, 15/09/2027                            | 164.339     |
| 200.000 | VZ Secured Financing BV, 5.00%, 15/01/2032   | 163.262     |

## Global Investment Grade Credit – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung  | Kosten US\$ |
|-----------|--|-------------|
| 1.090.000 | WEC Energy Group Inc, 4.75%, 09/01/2026  | 1.088.736   |
| 1.000.000 | Daimler Truck Holding AG, 5.13%, 19/01/2028  | 999.350     |
| 875.000   | United States Treasury Note/Bond, 3.75%, 15/04/2026  | 871.858     |
| 723.000   | UBS Group AG, 3.25%, 02/04/2026  | 766.012     |
| 745.000   | Morgan Stanley, 5.12%, 01/02/2029  | 744.985     |
| 655.000   | Kenvue Inc, 5.00%, 22/03/2030  | 653.356     |
| 615.000   | Amgen Inc, 5.15%, 02/03/2028   | 613.930     |
| 610.000   | Intel Corp, 4.88%, 10/02/2028  | 609.494     |
| 520.000   | Thames Water Utilities Finance Plc, 4.38%, 18/01/2031  | 555.684     |
| 540.000   | Cox Communications Inc, 5.70%, 15/06/2033  | 540.232     |
| 600.000   | Aroundtown SA, 1.63%, 31/01/2028   | 480.362     |
| 400.000   | Lloyds Banking Group Plc, 6.63%, 02/06/2033  | 479.806     |
| 480.000   | Penske Truck Leasing, 6.20%, 15/06/2030  | 478.699     |
| 450.000   | Morgan Stanley, 0.00%, 02/03/2029  | 478.638     |
| 480.000   | Comcast Corp, 4.80%, 15/05/2033  | 478.522     |
| 440.000   | Realty Income Corp, 5.13%, 06/07/2034  | 477.253     |
| 480.000   | Interpublic Group of Cos Inc, 5.38%, 15/06/2033  | 474.000     |
| 495.000   | Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital, 4.20%, 15/03/2028 | 466.260     |
| 450.000   | MPLX LP, 5.00%, 01/03/2033   | 446.265     |
| 445.000   | CVS Health Corp, 5.13%, 21/02/2030   | 442.032     |
| 400.000   | AT&T Inc, 4.30%, 18/11/2034  | 436.388     |
| 400.000   | Cargill Inc, 3.88%, 24/04/2030   | 434.959     |
| 410.000   | HSBC Holdings Plc, 4.79%, 10/03/2032   | 434.010     |
| 400.000   | Continental AG, 4.00%, 01/06/2028  | 428.111     |
| 389.000   | Anglo American Capital Plc, 5.00%, 15/03/2031  | 409.436     |

## Global Investment Grade Credit – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung  | Erlöse US\$ |
|-----------|--|-------------|
| 2.865.000 | United States Treasury Note/Bond, 2.63%, 15/04/2025                        | 2.778.854   |
| 1.000.000 | Daimler Truck Holding AG, 5.13%, 19/01/2028                                | 1.001.590   |
| 1.000.000 | AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust, 4.50%, 15/09/2023 | 995.150     |
| 1.000.000 | Vontier Corp, 1.80%, 01/04/2026  | 894.620     |
| 900.000   | Anglo American Capital Plc, 3.63%, 11/09/2024                              | 876.609     |
| 875.000   | United States Treasury Note/Bond, 3.75%, 15/04/2026                        | 862.727     |
| 800.000   | UBS Group AG, 1.01%, 30/07/2024  | 782.984     |
| 904.000   | UBS Group AG, 0.65%, 14/01/2028  | 763.813     |
| 700.000   | Volkswagen International Finance NV, 3.88%, 29/12/2049                     | 679.484     |
| 570.000   | ArcelorMittal SA, 6.55%, 29/11/2027  | 588.907     |
| 700.000   | Comcast Corp, 3.45%, 01/02/2050  | 524.969     |
| 500.000   | Bank of America Corp, 1.95%, 27/10/2026                                    | 509.522     |
| 470.000   | Liberty Mutual Group Inc, 4.63%, 02/12/2030                                | 499.995     |
| 539.000   | New York Life Global Funding, 0.25%, 04/10/2028                            | 489.825     |
| 450.000   | Morgan Stanley, 0.00%, 02/03/2029  | 486.056     |
| 480.000   | Penske Truck Leasing, 6.20%, 15/06/2030                                    | 481.243     |
| 472.000   | Verizon Communications Inc, 1.38%, 27/10/2026                              | 474.949     |
| 500.000   | Westpac Banking Corp, 2.89%, 04/02/2030                                    | 467.220     |
| 455.000   | EQT Corp, 5.70%, 01/04/2028  | 455.405     |
| 400.000   | Cargill Inc, 3.88%, 24/04/2030   | 439.254     |



## Global Opportunistic Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung                                 | Kosten US\$ |
|-----------|---|-------------|
| 2.363.000 | United States Treasury Note/Bond, 3.00%, 31/07/2024   | 2.314.363   |
| 1.883.000 | United States Treasury Note/Bond, 3.88%, 31/03/2025   | 1.878.446   |
| 1.776.000 | United States Treasury Note/Bond, 4.13%, 31/01/2025   | 1.773.370   |
| 1.190.000 | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/02/2041                    | 1.207.071   |
| 1.220.000 | Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/02/2043                    | 1.193.998   |
| 1.110.000 | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/06/2053                    | 1.114.734   |
| 911.000   | United Kingdom Gilt, 3.25%, 31/01/2033                | 1.106.990   |
| 7.100.000 | China Government Bond, 2.88%, 25/02/2033              | 1.033.856   |
| 995.000   | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/03/2054                    | 1.002.996   |
| 1.050.000 | Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/02/2043                    | 992.127     |
| 860.000   | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/05/2053                    | 871.740     |
| 870.000   | Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/02/2043                    | 870.102     |
| 795.000   | Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/03/2043                    | 791.913     |
| 795.000   | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/04/2054                    | 790.770     |
| 798.000   | United States Treasury Note/Bond, 3.00%, 30/06/2024   | 781.575     |
| 760.000   | Fannie Mae Pool, 6.00%, 01/02/2053                    | 777.634     |
| 760.000   | Fannie Mae Pool, 6.00%, 01/03/2054                    | 773.953     |
| 690.000   | Fannie Mae Pool, 6.00%, 01/05/2053                    | 706.044     |
| 695.000   | Ginnie Mae, 5.50%, 01/03/2053                         | 701.417     |
| 685.000   | Ginnie Mae, 5.00%, 01/03/2054                         | 685.412     |
| 2.758.000 | Republic of Poland Government Bond, 6.00%, 25/10/2033 | 646.764     |
| 630.000   | Fannie Mae Pool, 6.00%, 01/04/2054                    | 635.242     |
| 896.000   | Queensland Treasury Corp, 4.50%, 09/03/2033           | 604.517     |
| 610.000   | Fannie Mae Pool, 4.50%, 25/03/2044                    | 602.732     |
| 570.000   | Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/05/2053                    | 571.488     |
| 570.000   | Fannie Mae Pool, 5.00%, 25/06/2045                    | 569.697     |
| 570.000   | Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/07/2052                    | 560.020     |
| 555.000   | Fannie Mae Pool, 5.50%, 25/08/2038                    | 554.003     |
| 535.000   | Ginnie Mae, 5.50%, 01/05/2053                         | 541.723     |
| 535.000   | Ginnie Mae, 5.50%, 01/06/2053                         | 538.828     |
| 535.000   | Ginnie Mae, 5.50%, 01/04/2054                         | 534.667     |
| 535.000   | Ginnie Mae, 5.50%, 01/07/2038                         | 534.118     |

## Global Opportunistic Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile    | Wertpapierbezeichnung  | Erlöse US\$ |
|------------|--|-------------|
| 3.433.000  | United States Treasury Note/Bond, 3.00%, 31/07/2024                              | 3.356.504   |
| 200.000    | Neuberger Berman Global Investment Grade Credit Fund                             | 1.724.000   |
| 1.590.000  | United States Treasury Note, 3.88%, 31/03/2025                                   | 1.575.773   |
| 10.180.000 | China Government Bond, 2.56%, 21/10/2023   | 1.512.738   |
| 1.190.000  | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/01/2053   | 1.207.768   |
| 1.220.000  | Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/02/2043   | 1.204.947   |
| 1.190.000  | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/02/2041   | 1.203.596   |
| 1.110.000  | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/06/2053   | 1.114.734   |
| 1.050.000  | Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/02/2043   | 1.020.540   |
| 995.000    | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/03/2054   | 990.425     |
| 870.000    | Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/01/2053   | 870.374     |
| 860.000    | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/05/2053   | 868.539     |
| 870.000    | Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/02/2043   | 867.446     |
| 5.490.000  | China Government Bond, 2.26%, 24/02/2025   | 810.053     |
| 795.000    | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/04/2054   | 806.424     |
| 782.398    | Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes Class M2, 7.45%, 25/09/2030 | 790.222     |
| 795.000    | Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/03/2043   | 779.253     |
| 760.000    | Fannie Mae Pool, 6.00%, 01/01/2053   | 778.288     |
| 798.000    | United States Treasury Note/Bond, 3.00%, 30/06/2024                              | 778.174     |
| 760.000    | Fannie Mae Pool, 6.00%, 01/02/2053   | 775.794     |
| 760.000    | Fannie Mae Pool, 6.00%, 01/03/2054   | 767.114     |
| 1.228.000  | New Zealand Government Bond, 4.25%, 15/05/2034                                   | 754.557     |
| 690.000    | Fannie Mae Pool, 6.00%, 01/05/2053   | 703.153     |
| 695.000    | Ginnie Mae, 5.50%, 01/03/2053  | 696.013     |
| 685.000    | Ginnie Mae, 5.00%, 01/03/2054  | 674.546     |
| 4.570.000  | China Government Bond, 2.37%, 20/01/2027   | 669.289     |
| 630.000    | Fannie Mae Pool, 6.00%, 01/04/2054   | 645.159     |
| 1.028.000  | New Zealand Government Bond, 3.50%, 14/04/2033                                   | 623.016     |
| 610.000    | Fannie Mae Pool, 4.50%, 25/03/2044   | 585.173     |

## Global Real Estate Securities – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung               | Kosten US\$ |
|---------|-------------------------------------|-------------|
| 762     | GLP J-REIT                          | 867.146     |
| 373     | Nippon Prologis REIT Inc            | 862.363     |
| 33.500  | Nomura Real Estate Holdings Inc     | 732.943     |
| 37.000  | Sun Hung Kai Properties Ltd         | 516.053     |
| 15.912  | VICI Properties Inc Class A         | 510.583     |
| 296.815 | Region RE Ltd                       | 504.910     |
| 159.685 | Grainger Plc                        | 490.364     |
| 634     | Equinix Inc                         | 459.024     |
| 127.612 | GPT Group                           | 374.836     |
| 5.725   | Realty Income Corp                  | 372.235     |
| 2.156   | EastGroup Properties Inc            | 348.991     |
| 1.060   | Public Storage                      | 316.739     |
| 9.056   | Weyerhaeuser Co                     | 262.092     |
| 7.042   | Canadian Apartment Properties REIT  | 259.188     |
| 1.885   | Crown Castle Inc                    | 258.401     |
| 12.044  | Kimco Realty Corp                   | 235.636     |
| 13.872  | RioCan Real Estate Investment Trust | 231.304     |
| 4.056   | Boston Properties Inc               | 219.241     |
| 3.150   | Equity LifeStyle Properties Inc     | 205.537     |
| 13.511  | Urban Edge Properties               | 202.199     |
| 6.391   | Omega Healthcare Investors Inc      | 200.338     |
| 23.120  | Tricon Residential Inc              | 198.270     |
| 30.200  | Link REIT                           | 192.884     |
| 3.270   | Iron Mountain Inc                   | 163.566     |
| 3.667   | Invitation Homes Inc                | 121.948     |
| 3.446   | Apartment Income REIT Corp          | 118.583     |

## Global Real Estate Securities – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung               | Erlöse US\$ |
|---------|-------------------------------------|-------------|
| 246     | Mitsui Fudosan Logistics Park Inc   | 915.095     |
| 50.173  | Summit Industrial Income REIT       | 868.371     |
| 762     | GLP J-REIT                          | 867.092     |
| 65.900  | Mitsubishi Estate Co Ltd            | 790.819     |
| 7.790   | Digital Realty Trust Inc            | 740.763     |
| 5.955   | Prologis Inc                        | 719.396     |
| 144.000 | China Resources Land Ltd            | 694.462     |
| 6.460   | Welltower Inc                       | 484.235     |
| 79.000  | Wharf Real Estate Investment Co Ltd | 462.690     |
| 10.872  | Spirit Realty Capital Inc           | 427.847     |
| 583     | Equinix Inc                         | 423.774     |
| 55.841  | Land Securities Group Plc           | 418.797     |
| 17.800  | Nomura Real Estate Holdings Inc     | 403.368     |
| 32.978  | Medical Properties Trust Inc        | 327.947     |
| 122.000 | New World Development Co Ltd        | 322.583     |
| 1.093   | Public Storage                      | 318.455     |
| 44.391  | Great Portland Estates Plc          | 271.898     |
| 1.284   | American Tower Corp                 | 264.983     |
| 4.480   | Boston Properties Inc               | 254.167     |
| 10.614  | Kimco Realty Corp                   | 223.766     |
| 1.634   | Sun Communities Inc                 | 223.013     |
| 9.552   | Vonovia SE                          | 204.986     |
| 3.151   | Equity Residential                  | 192.494     |
| 1.418   | Crown Castle Inc                    | 184.701     |
| 1.815   | Life Storage Inc                    | 177.404     |
| 5.134   | Invitation Homes Inc                | 171.699     |
| 8.300   | Mitsui Fudosan Co Ltd               | 157.571     |
| 30.700  | UOL Group Ltd                       | 156.313     |
| 2.433   | Rexford Industrial Realty Inc       | 152.044     |
| 4.415   | American Homes 4 Rent Class A       | 151.208     |
| 2.374   | Realty Income Corp                  | 149.831     |
| 2.788   | Iron Mountain Inc                   | 149.527     |

## Global Sustainable Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung        | Kosten US\$ |
|---------|------------------------------|-------------|
| 10.237  | Synopsis Inc                 | 3.925.844   |
| 5.674   | L'Oreal SA                   | 2.362.545   |
| 7.810   | Microsoft Corp               | 2.176.607   |
| 9.076   | Estee Lauder Cos Inc Class A | 1.797.446   |
| 21.675  | Alfen NV                     | 1.627.765   |
| 3.574   | VAT Group AG                 | 1.149.278   |
| 1.538   | UnitedHealth Group Inc       | 757.864     |
| 358     | Adyen NV                     | 554.138     |
| 4.764   | NIKE Inc Class B             | 533.984     |
| 6.759   | Bakkafrost P/F               | 454.589     |
| 3.997   | Alphabet Inc Class A         | 453.829     |
| 4.219   | Abbott Laboratories          | 444.995     |
| 1.173   | Adobe Inc                    | 440.592     |
| 896     | Elevance Health Inc          | 432.111     |
| 1.324   | SolarEdge Technologies Inc   | 390.035     |
| 3.275   | Amazon.com Inc               | 374.570     |
| 15.923  | Assa Abloy AB Class B        | 369.854     |
| 834     | S&P Global Inc               | 301.271     |
| 540     | Thermo Fisher Scientific Inc | 298.600     |
| 9.700   | Recruit Holdings Co Ltd      | 283.866     |
| 218     | Partners Group Holding AG    | 225.117     |

## Global Sustainable Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung        | Erlöse US\$ |
|---------|------------------------------|-------------|
| 6.121   | S&P Global Inc               | 2.061.537   |
| 12.719  | Marsh & McLennan Cos Inc     | 1.995.110   |
| 91.127  | 3i Group Plc                 | 1.925.006   |
| 13.940  | Applied Materials Inc        | 1.657.419   |
| 3.594   | Microsoft Corp               | 1.120.004   |
| 9.518   | Alphabet Inc Class A         | 1.108.024   |
| 3.199   | Moody's Corp                 | 953.126     |
| 16.791  | Brown & Brown Inc            | 949.203     |
| 8.100   | Amazon.com Inc               | 910.503     |
| 2.429   | Netflix Inc                  | 856.170     |
| 15.775  | Nasdaq Inc                   | 852.060     |
| 956     | UnitedHealth Group Inc       | 469.901     |
| 676     | ASML Holding NV              | 453.473     |
| 1.145   | Synopsys Inc                 | 449.789     |
| 1.949   | Visa Inc Class A             | 446.994     |
| 5.833   | Bakkafrost P/F               | 412.480     |
| 760     | Thermo Fisher Scientific Inc | 406.720     |
| 2.953   | NIKE Inc Class B             | 361.653     |
| 199     | Adyen NV                     | 313.389     |
| 3.776   | Alfen NV                     | 301.720     |
| 1.374   | Estee Lauder Cos Inc Class A | 294.468     |
| 677     | Intuit Inc                   | 293.336     |
| 834     | Adobe Inc                    | 291.935     |
| 703     | VAT Group AG                 | 282.304     |
| 534     | Ulta Beauty Inc              | 281.359     |
| 599     | Elevance Health Inc          | 276.346     |
| 654     | Mastercard Inc Class A       | 249.347     |
| 1.003   | Danaher Corp                 | 231.352     |
| 8.769   | HelloFresh SE                | 229.309     |

## High Yield Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

| Anteile    | Wertpapierbezeichnung  | Kosten US\$ |
|------------|--|-------------|
| 16.610.000 | TransDigm Inc, 6.75%, 15/08/2028   | 16.741.731  |
| 15.070.000 | First Quantum Minerals Ltd, 8.63%, 01/06/2031                              | 15.059.275  |
| 14.335.000 | Mauser Packaging Solutions Holding Co, 7.88%, 15/08/2026                   | 14.350.825  |
| 14.275.000 | Uniti Group LP/Uniti Group Finance Inc/CSL Capital LLC, 10.50%, 15/02/2028 | 14.283.163  |
| 13.525.000 | HUB International Ltd, 7.25%, 15/06/2030                                   | 13.525.000  |
| 10.765.000 | Regal Rexnord Corp, 6.40%, 15/04/2033                                      | 10.699.628  |
| 10.220.000 | Pilgrim's Pride Corp, 6.25%, 01/07/2033                                    | 10.040.402  |
| 9.840.000  | Tenet Healthcare Corp, 6.75%, 15/05/2031                                   | 9.840.000   |
| 11.150.000 | Caesars Entertainment Inc, 4.63%, 15/10/2029                               | 9.753.413   |
| 9.710.000  | Ford Motor Credit Co LLC, 6.95%, 06/03/2026                                | 9.718.100   |
| 9.655.000  | Churchill Downs Inc, 6.75%, 01/05/2031                                     | 9.655.000   |
| 10.790.000 | CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC, 5.50%, 15/06/2031                  | 9.515.184   |
| 8.720.000  | NRG Energy Inc, 10.25%, 29/12/2049   | 8.780.471   |
| 8.765.000  | Petco Animal Supplies Inc, 0.00%, 03/03/2028                               | 8.740.386   |
| 8.225.000  | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 7.88%, 15/09/2029          | 8.469.350   |
| 8.360.000  | Energizer Holdings Inc, 6.50%, 31/12/2027                                  | 8.179.888   |
| 8.500.000  | Mauser Packaging Solutions Holding Co, 9.25%, 15/04/2027                   | 8.078.019   |
| 7.785.000  | TransDigm Inc, 0.00%, 10/08/2028   | 7.785.000   |
| 7.505.000  | Noble Finance II LLC, 8.00%, 15/04/2030                                    | 7.544.794   |
| 7.405.000  | Regal Rexnord Corp, 6.05%, 15/04/2028                                      | 7.400.261   |

## High Yield Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

| Anteile    | Wertpapierbezeichnung  | Erlöse US\$ |
|------------|--|-------------|
| 18.520.000 | Global Aircraft Leasing Co Ltd, 6.50%, 15/09/2024                          | 16.395.433  |
| 20.140.000 | Level 3 Financing Inc, 4.63%, 15/09/2027                                   | 12.321.488  |
| 14.250.000 | OneMain Finance Corp, 3.50%, 15/01/2027                                    | 12.068.863  |
| 11.745.000 | Occidental Petroleum Corp, 6.13%, 01/01/2031                               | 11.913.050  |
| 16.390.000 | MPH Acquisition Holdings LLC, 5.75%, 01/11/2028                            | 11.448.480  |
| 12.010.000 | Sirius XM Radio Inc, 5.00%, 01/08/2027                                     | 11.052.794  |
| 13.165.000 | Medline Borrower LP, 5.25%, 01/10/2029                                     | 11.029.123  |
| 11.050.000 | Harvest Midstream I LP, 7.50%, 01/09/2028                                  | 10.808.275  |
| 18.625.000 | CSC Holdings LLC, 5.75%, 15/01/2030  | 9.565.738   |
| 11.560.000 | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp, 4.50%, 15/08/2030              | 9.494.913   |
| 10.115.000 | Sirius XM Radio Inc, 5.50%, 01/07/2029                                     | 9.386.675   |
| 9.497.021  | Great Outdoors Group LLC, 0.08%, 06/03/2028                                | 9.307.562   |
| 14.640.000 | Uniti Group LP/Uniti Fiber Holdings Inc/CSL Capital LLC, 6.50%, 15/02/2029 | 8.712.463   |
| 8.565.000  | Mauser Packaging Solutions Holding Co, 7.88%, 15/08/2026                   | 8.617.056   |
| 11.665.000 | Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp, 5.75%, 15/01/2029                | 8.445.012   |
| 8.545.000  | APX Group Inc, 6.75%, 15/02/2027   | 8.317.875   |
| 7.535.000  | Occidental Petroleum Corp, 7.50%, 01/05/2031                               | 8.294.125   |
| 8.818.000  | Centene Corp, 4.63%, 15/12/2029  | 8.279.298   |
| 8.805.000  | MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp, 5.25%, 01/08/2026           | 7.728.147   |
| 7.925.000  | American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd, 5.50%, 20/04/2026        | 7.701.713   |



## InnovAsia 5G – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung                                     | Kosten US\$ |
|---------|---|-------------|
| 29.400  | Mercari Inc   | 622.045     |
| 7.000   | Rohm Co Ltd   | 561.410     |
| 167.000 | Gold Circuit Electronics Ltd                              | 553.086     |
| 26.350  | Baidu Inc Class A   | 493.864     |
| 63.630  | Shenzhen Sinexcel Electric Co Ltd Class A                 | 479.560     |
| 3.400   | Shibaura Mechatronics Corp                                | 476.074     |
| 142.000 | Lite-On Technology Corp                                   | 449.329     |
| 116.000 | Longshine Technology Group Co Ltd Class A                 | 413.097     |
| 135.000 | Vanguard International Semiconductor Corp                 | 411.633     |
| 259.600 | KCE Electronics PCL                                       | 408.238     |
| 269.000 | Inventec Corp   | 395.592     |
| 4.704   | SK Hynix Inc  | 350.116     |
| 54.000  | Win Semiconductors Corp                                   | 327.942     |
| 75.000  | Tripod Technology Corp                                    | 309.319     |
| 26.100  | Sansan Inc  | 308.199     |
| 9.300   | Harmonic Drive Systems Inc                                | 303.527     |
| 10.000  | Parade Technologies Ltd                                   | 300.425     |
| 446.140 | Zomato Ltd  | 298.273     |
| 36.342  | One 97 Communications Ltd                                 | 298.028     |
| 13.521  | Kanzhun Ltd ADR   | 296.521     |
| 47.000  | E Ink Holdings Inc  | 292.640     |
| 500     | SMC Corp  | 275.133     |
| 20.000  | Novatek Microelectronics Corp                             | 269.145     |
| 12.700  | Meituan Class B   | 268.277     |
| 11.302  | Hanmi Semiconductor Co Ltd                                | 261.690     |
| 15.000  | Jentech Precision Industrial Co Ltd                       | 230.479     |
| 22.200  | Zhejiang Jingsheng Mechanical & Electrical Co Ltd Class A | 223.685     |
| 1.927   | Fabrinet  | 216.912     |
| 13.000  | Silergy Corp  | 206.371     |
| 4.100   | Square Enix Holdings Co Ltd                               | 198.502     |
| 9.981   | HPSP Co Ltd   | 196.530     |
| 109.300 | Hana Microelectronics PCL                                 | 195.647     |
| 39.000  | Unimicron Technology Corp                                 | 176.965     |
| 669     | LG Innotek Co Ltd   | 156.011     |
| 4.100   | JMDC Inc  | 147.774     |
| 3.532   | New Oriental Education & Technology Group Inc ADR         | 144.307     |
| 52.100  | AEM Holdings Ltd  | 130.237     |

## InnovAsia 5G – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung                                     | Erlöse US\$ |
|---------|---|-------------|
| 6.400   | Socionext Inc   | 907.235     |
| 102.000 | Unimicron Technology Corp                                 | 553.965     |
| 9.849   | Beijing Kingsoft Office Software Inc Class A              | 491.007     |
| 103.000 | Hongfa Technology Co Ltd Class A                          | 467.804     |
| 34.300  | Sansan Inc  | 447.887     |
| 25.000  | Yageo Corp  | 432.734     |
| 104.700 | Zhejiang Jiemei Electronic & Technology Co Ltd Class A    | 422.650     |
| 48.800  | CyberAgent Inc  | 419.078     |
| 7.186   | Rambus Inc  | 419.025     |
| 31.000  | Silergy Corp  | 403.084     |
| 6.000   | eMemory Technology Inc                                    | 368.078     |
| 55.000  | Elite Material Co Ltd                                     | 342.317     |
| 54.000  | Win Semiconductors Corp                                   | 303.454     |
| 10.000  | Parade Technologies Ltd                                   | 296.429     |
| 46.000  | Chroma ATE Inc  | 289.971     |
| 13.200  | Dexerials Corp  | 267.552     |
| 23.000  | Accton Technology Corp                                    | 266.106     |
| 79.000  | Vanguard International Semiconductor Corp                 | 237.566     |
| 9.500   | Meituan Class B   | 190.297     |
| 4.000   | Square Enix Holdings Co Ltd                               | 187.567     |
| 2.400   | Rohm Co Ltd   | 175.573     |
| 12.000  | Novatek Microelectronics Corp                             | 166.480     |
| 28.000  | E Ink Holdings Inc  | 160.990     |
| 3.404   | Beijing Huafeng Test & Control Technology Co Ltd Class A  | 151.406     |
| 7.400   | Baidu Inc Class A   | 130.411     |
| 3.004   | New Oriental Education & Technology Group Inc ADR         | 125.941     |
| 400     | Disco Corp  | 119.512     |
| 3.100   | JMDC Inc  | 114.703     |
| 11.650  | Zhejiang Jingsheng Mechanical & Electrical Co Ltd Class A | 113.362     |
| 3.200   | Harmonic Drive Systems Inc                                | 111.508     |
| 7.000   | Jentech Precision Industrial Co Ltd                       | 111.457     |

## Japan Equity Engagement – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung               | Kosten JPY  |
|---------|-------------------------------------|-------------|
| 73.900  | FP Partner Inc                      | 461.780.120 |
| 158.000 | Kosaido Holdings Co Ltd             | 394.128.494 |
| 66.000  | Zenkoku Hoshō Co Ltd                | 344.790.254 |
| 77.000  | JSB Co Ltd                          | 334.934.282 |
| 91.000  | Asics Corp                          | 307.404.233 |
| 284.700 | Ricoh Co Ltd                        | 300.742.885 |
| 30.000  | ABC-Mart Inc                        | 238.776.363 |
| 40.000  | Keisei Electric Railway Co Ltd      | 229.249.314 |
| 95.000  | TBS Holdings Inc                    | 221.542.657 |
| 34.000  | Tokyo Seimitsu Co Ltd               | 219.522.101 |
| 44.000  | San-A Co Ltd                        | 206.669.961 |
| 90.000  | Daiei Kankyo Co Ltd                 | 178.477.138 |
| 119.000 | Skymark Airlines Inc                | 168.786.020 |
| 18.700  | M&A Research Institute Holdings Inc | 168.178.242 |
| 85.600  | Kansai Paint Co Ltd                 | 163.997.732 |
| 200.000 | Cover Corp                          | 150.000.000 |
| 86.000  | Transaction Co Ltd                  | 128.031.034 |
| 32.000  | Tokyotokeiba Co Ltd                 | 127.541.672 |
| 16.000  | Visional Inc                        | 123.440.315 |
| 167.500 | Monstarlab Holdings Inc             | 120.600.000 |
| 31.400  | St Cousair Co Ltd                   | 118.916.918 |
| 36.000  | TKP Corp                            | 104.554.989 |
| 20.000  | eWeLL Co Ltd                        | 91.891.709  |
| 9.100   | Fujimi Inc                          | 85.191.767  |
| 30.000  | MEC Co Ltd                          | 83.861.448  |
| 14.000  | Justsystems Corp                    | 64.168.863  |
| 46.000  | Yamanashi Chuo Bank Ltd             | 54.167.484  |

## Japan Equity Engagement – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung            | Erlöse JPY  |
|---------|----------------------------------|-------------|
| 749.700 | Ricoh Co Ltd                     | 804.439.450 |
| 173.800 | Musashi Seimitsu Industry Co Ltd | 307.468.681 |
| 72.000  | Daiseki Co Ltd                   | 286.370.456 |
| 49.000  | Zenkoku Hosho Co Ltd             | 245.801.600 |
| 500.000 | Concordia Financial Group Ltd    | 240.381.175 |
| 118.000 | Cover Corp                       | 235.816.763 |
| 46.000  | Pilot Corp                       | 205.941.767 |
| 41.000  | Yamaha Corp                      | 204.930.337 |
| 56.000  | Heiwa Real Estate Co Ltd         | 202.849.975 |
| 144.500 | Direct Marketing MiX Inc         | 194.318.790 |
| 30.000  | Kohoku Kogyo Co Ltd              | 172.194.627 |
| 260.000 | Tokyu Fudosan Holdings Corp      | 171.155.716 |
| 167.500 | Monstarlab Holdings Inc          | 165.494.195 |
| 123.000 | Amada Co Ltd                     | 159.531.852 |
| 91.000  | PR Times Inc                     | 158.773.860 |
| 60.000  | Nakanishi Inc                    | 151.644.348 |
| 27.000  | SHO-BOND Holdings Co Ltd         | 142.205.668 |
| 54.000  | Shoei Co Ltd                     | 140.945.136 |
| 48.000  | Niterra Co Ltd                   | 127.050.340 |
| 38.000  | JSR Corp                         | 126.613.643 |
| 64.000  | Appier Group Inc                 | 122.135.424 |
| 36.600  | BML Inc                          | 114.684.929 |
| 53.000  | Resorttrust Inc                  | 112.156.649 |
| 23.500  | Hokkoku Financial Holdings Inc   | 110.445.966 |
| 36.000  | TKP Corp                         | 106.176.150 |
| 40.000  | Menicon Co Ltd                   | 102.584.381 |
| 45.000  | Yokogawa Electric Corp           | 101.662.093 |
| 34.000  | Okinawa Cellular Telephone Co    | 99.808.100  |
| 50.000  | Open Up Group Inc                | 95.087.798  |
| 50.600  | Kansai Paint Co Ltd              | 87.151.163  |
| 14.000  | BayCurrent Consulting Inc        | 77.561.967  |
| 53.000  | Daiwa Industries Ltd             | 75.144.781  |
| 36.000  | Snow Peak Inc                    | 67.651.056  |
| 31.000  | Comture Corp                     | 65.703.018  |

## Macro Opportunities FX – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung  | Kosten EUR |
|-----------|--|------------|
| 3.300.000 | Finland T-Bill, 0.00%, 13/02/2024                                    | 3.223.736  |
| 1.500.000 | Royal Bank of Canada, 0.25%, 29/01/2024                              | 1.458.395  |
| 1.500.000 | Santander UK Plc, 0.10%, 12/05/2024                                  | 1.451.985  |
| 1.400.000 | BPCE SFH SA, 0.38%, 21/02/2024                                       | 1.358.560  |
| 1.350.000 | ESM T-Bill, 0.00%, 20/07/2023  | 1.332.511  |
| 1.350.000 | Toronto-Dominion Bank, 0.50%, 03/04/2024                             | 1.315.020  |
| 1.300.000 | European Stability Mechanism Treasury Bill, 0.00%, 23/11/2023        | 1.280.206  |
| 1.000.000 | La Banque Postale Home Loan SFH SA, 2.38%, 15/01/2024                | 991.330    |
| 1.000.000 | Bank of Montreal, 0.25%, 10/01/2024                                  | 980.880    |
| 1.000.000 | DNB Boligkreditt AS, 0.38%, 14/11/2023                               | 980.250    |
| 1.000.000 | Finland T-Bill, 0.00%, 13/11/2023                                    | 977.405    |
| 1.000.000 | Westpac Securities NZ Ltd, 0.50%, 17/01/2024                         | 974.850    |
| 1.000.000 | Dexia Credit Local SA, 0.63%, 03/02/2024                             | 974.170    |
| 1.000.000 | Credit Mutuel Home Loan SFH SA, 0.25%, 30/04/2024                    | 970.740    |
| 850.000   | Finland T-Bill, 0.00%, 12/04/2023                                    | 845.714    |
| 800.000   | European Union Bill, 0.00%, 10/11/2023                               | 788.112    |
| 600.000   | Societe Generale SFH SA, 2.00%, 29/04/2024                           | 591.834    |
| 500.000   | Caisse de Refinancement de l'Habitat SA, 3.60%, 08/03/2024           | 499.430    |
| 500.000   | Caisse Centrale du Credit Immobilier de France SA, 0.00%, 17/01/2024 | 484.915    |
| 300.000   | Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale, 0.38%, 08/02/2024          | 291.621    |
| 300.000   | Federation des Caisses Desjardins du Quebec, 0.35%, 30/01/2024       | 291.564    |
| 250.000   | Toronto-Dominion Bank, 0.25%, 26/03/2024                             | 242.773    |

## Macro Opportunities FX – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Verkäufe insgesamt:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung   | Erlöse EUR |
|-----------|---|------------|
| 3.250.000 | Finland T-Bill, 0.00%, 14/08/2023   | 3.231.699  |
| 1.500.000 | Santander UK Plc, 0.38%, 20/09/2023   | 1.486.890  |
| 1.350.000 | ESM T-Bill, 20/07/2023  | 1.344.886  |
| 1.200.000 | ESM T-Bill, 0.00%, 20/04/2023   | 1.193.464  |
| 1.000.000 | UNEDIC ASSEO, 2.25%, 05/04/2023   | 999.800    |
| 1.000.000 | Arkea Home Loans SFH SA, 2.38%, 11/07/2023  | 999.210    |
| 1.000.000 | AXA Bank Europe SCF, 0.38%, 23/03/2023  | 998.480    |
| 1.000.000 | BNG Bank NV, 0.05%, 11/07/2023  | 998.372    |
| 1.000.000 | Jyske Realkredit A/S, 0.25%, 01/07/2023   | 998.210    |
| 1.000.000 | DNB Boligkreditt AS, 0.25%, 18/04/2023  | 996.690    |
| 1.000.000 | OP Mortgage Bank, 0.25%, 11/05/2023   | 995.384    |
| 1.000.000 | Dexia Credit Local SA, 0.25%, 01/06/2023  | 993.920    |
| 1.000.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0.13%, 07/06/2023                                    | 992.540    |
| 1.000.000 | BPCE SFH SA, 2.38%, 29/11/2023  | 992.240    |
| 850.000   | Finland T-Bill, 0.00%, 12/04/2023   | 847.976    |
| 800.000   | Nederlandse Financierings-Maatschappij voor Ontwikkelingslanden NV, 0.13%, 01/06/2023 | 794.664    |
| 500.000   | ING Bank NV, 1.88%, 22/05/2023  | 499.165    |
| 400.000   | DNB Boligkreditt AS, 0.38%, 14/11/2023  | 395.396    |
| 300.000   | Federation des Caisses Desjardins du Quebec, 0.38%, 30/05/2023                        | 298.182    |

## Multi-Asset Income – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung  | Kosten US\$ |
|---------|--|-------------|
| 2.745   | iShares J.P. Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF Class D | 237.756     |
| 100.000 | Benteler International Aktiengesellschaft, 9.38%, 15/05/2028   | 109.387     |
| 100.000 | Ford Motor Credit Co LLC, 4.87%, 03/08/2027                    | 106.318     |
| 100.000 | Abertis Infraestructuras Finance BV, 3.25%, 29/12/2049         | 98.567      |
| 100.000 | eG Global Finance Plc., 4.38%, 07/02/2025                      | 94.857      |
| 80.000  | United States Treasury Note/Bond, 4.00%, 15/11/2052            | 84.149      |
| 80.000  | United States Treasury Note/Bond, 3.00%, 15/11/2044            | 70.118      |
| 65.000  | United States Treasury Note/Bond, 3.13%, 15/05/2048            | 58.028      |
| 65.000  | United States Treasury Note/Bond, 2.38%, 15/05/2051            | 49.686      |
| 65.000  | United States Treasury Note/Bond, 2.00%, 15/11/2041            | 49.249      |
| 62.000  | Capital One Financial Corp, 3.95%, 29/12/2049                  | 47.591      |
| 35.000  | Citigroup Inc, 7.38%, 29/12/2049                               | 35.000      |
| 35.000  | Truist Financial Corp, 5.10%, 29/12/2049                       | 31.161      |
| 30.000  | United States Treasury Note/Bond, 3.50%, 15/02/2033            | 30.245      |
| 30.000  | United States Treasury Note/Bond, 3.88%, 15/02/2043            | 29.594      |
| 35.000  | United States Treasury Note/Bond, 2.50%, 15/02/2045            | 28.341      |
| 900     | New Fortress Energy Inc Class A                                | 27.223      |
| 3.599   | iShares MSCI India UCITS ETF                                   | 25.879      |
| 246     | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR                  | 21.747      |
| 30.000  | United States Treasury Note/Bond, 2.00%, 15/08/2051            | 21.340      |

## Multi-Asset Income – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung  | Erlöse US\$ |
|---------|--|-------------|
| 40.890  | Neuberger Berman China Bond Fund                             | 407.674     |
| 2.745   | iShares J.P. Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF       | 231.944     |
| 16.300  | Neuberger Berman Commodities Fund                            | 177.881     |
| 210.000 | NatWest Group Plc, 4.60%, 29/12/2049                         | 150.413     |
| 200.000 | ING Groep NV, 3.88%, 29/12/2049                              | 142.078     |
| 100.000 | NGG Finance Plc, 5.63%, 18/06/2073                           | 120.453     |
| 100.000 | Benteler International Aktiengesellschaft, 9.38%, 15/05/2028 | 111.905     |
| 120.000 | Petroleos Mexicanos, 4.75%, 26/02/2029                       | 109.963     |
| 100.000 | Assemblin Financing, 8.53%, 15/05/2025                       | 108.861     |
| 100.000 | Ford Motor Credit Co LLC, 4.87%, 03/08/2027                  | 107.962     |
| 1.500   | Targa Resources Corp   | 105.591     |
| 100.000 | Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH, 2.00%, 15/07/2025    | 104.146     |
| 100.000 | Electricite de France SA, 5.88%, 29/12/2049                  | 103.884     |
| 100.000 | Electricite de France SA, 5.00%, 29/12/2049                  | 103.689     |
| 100.000 | eG Global Finance Plc, 3.63%, 07/02/2024                     | 102.784     |
| 100.000 | eG Global Finance Plc, 4.38%, 07/02/2025                     | 102.704     |
| 100.000 | INEOS Finance Plc, 2.88%, 01/05/2026                         | 102.396     |
| 100.000 | Gruenthal GmbH, 4.13%, 15/05/2028                            | 102.115     |
| 100.000 | Bayer AG, 5.38%, 25/03/2082                                  | 101.745     |
| 100.000 | Telefonica Europe BV, 3.88%, 29/12/2049                      | 101.243     |



## Next Generation Mobility – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung        | Kosten US\$ |
|---------|------------------------------|-------------|
| 4.498   | Autodesk Inc                 | 880.196     |
| 4.712   | Verisk Analytics Inc Class A | 852.868     |
| 26.000  | BYD Co Ltd Class H           | 811.262     |
| 2.068   | LG Energy Solution Ltd       | 796.514     |
| 4.135   | Albemarle Corp               | 783.349     |
| 3.189   | Caterpillar Inc              | 727.813     |
| 26.955  | MP Materials Corp            | 638.831     |
| 4.502   | T-Mobile US Inc              | 615.818     |
| 8.839   | Micron Technology Inc        | 533.272     |
| 6.509   | Ambarella Inc                | 468.631     |
| 3.823   | Amazon.com Inc               | 411.451     |
| 1.132   | Deere & Co                   | 401.820     |
| 969     | Monolithic Power Systems Inc | 387.314     |
| 4.205   | Amphenol Corp Class A        | 327.371     |
| 2.042   | Keysight Technologies Inc    | 326.073     |
| 1.835   | Schneider Electric SE        | 315.306     |
| 2.307   | Tesla Inc                    | 313.984     |
| 525     | Linde Plc                    | 171.074     |
| 967     | Texas Instruments Inc        | 170.709     |
| 1.456   | Applied Materials Inc        | 167.242     |
| 13.999  | ChargePoint Holdings Inc     | 167.134     |
| 3.498   | Trimble Inc                  | 166.992     |
| 267     | ASML Holding NV              | 164.680     |
| 13.662  | NIO Inc ADR                  | 161.724     |
| 452     | Linde Plc                    | 160.601     |
| 976     | Analog Devices Inc           | 158.637     |
| 3.490   | Rambus Inc                   | 158.457     |
| 565     | NVIDIA Corp                  | 157.713     |
| 579     | Air Products & Chemicals Inc | 156.706     |
| 2.253   | ON Semiconductor Corp        | 155.416     |
| 1.957   | Lattice Semiconductor Corp   | 154.686     |
| 4.520   | Mobileye Global Inc Class A  | 154.488     |

## Next Generation Mobility – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung          | Erlöse US\$ |
|---------|--------------------------------|-------------|
| 46.448  | Rambus Inc                     | 2.446.100   |
| 10.572  | Analog Devices Inc             | 1.914.668   |
| 5.603   | ANSYS Inc                      | 1.705.191   |
| 9.385   | Keysight Technologies Inc      | 1.469.400   |
| 15.648  | Lattice Semiconductor Corp     | 1.359.801   |
| 6.397   | Autodesk Inc                   | 1.279.265   |
| 4.371   | Caterpillar Inc                | 1.024.826   |
| 18.242  | Magna International Inc        | 1.006.410   |
| 34.213  | MP Materials Corp              | 968.077     |
| 6.824   | Applied Materials Inc          | 919.489     |
| 9.581   | Alphabet Inc Class A           | 880.131     |
| 3.187   | NVIDIA Corp                    | 856.744     |
| 2.056   | Deere & Co                     | 821.515     |
| 2.257   | Air Products & Chemicals Inc   | 656.079     |
| 3.154   | Cadence Design Systems Inc     | 648.941     |
| 976     | Monolithic Power Systems Inc   | 501.193     |
| 3.019   | Schneider Electric SE          | 500.074     |
| 7.187   | Altair Engineering Inc Class A | 490.761     |
| 13.781  | Uber Technologies Inc          | 484.126     |
| 1.303   | Linde Plc                      | 477.672     |
| 17.227  | Gentex Corp                    | 475.103     |
| 41.013  | NIO Inc ADR                    | 338.921     |
| 3.940   | BE Semiconductor Industries NV | 320.639     |
| 3.992   | Amphenol Corp Class A          | 314.118     |
| 4.419   | ON Semiconductor Corp          | 313.866     |
| 2.899   | Amazon.com Inc                 | 310.993     |
| 879     | S&P Global Inc                 | 309.819     |
| 10.314  | Coherent Corp                  | 282.349     |

## Next Generation Space Economy – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung                            | Kosten US\$ |
|---------|--|-------------|
| 1.796   | Boeing Co  | 365.250     |
| 143.035 | Spirent Communications Plc                       | 345.356     |
| 6.800   | Mitsubishi Heavy Industries Ltd                  | 277.301     |
| 2.727   | NV5 Global Inc                                   | 274.778     |
| 49.882  | Virgin Galactic Holdings Inc                     | 248.818     |
| 8.257   | AXA SA   | 246.135     |
| 2.072   | QUALCOMM Inc                                     | 244.181     |
| 493     | Lockheed Martin Corp                             | 236.012     |
| 3.350   | Okta Inc Class A                                 | 231.164     |
| 52.659  | Planet Labs PBC                                  | 199.775     |
| 4.032   | Trimble Inc                                      | 195.809     |
| 4.600   | NEC Corp   | 187.717     |
| 675     | ANSYS Inc  | 182.632     |
| 3.014   | Iridium Communications Inc                       | 182.083     |
| 1.323   | Airbus SE  | 181.535     |
| 15.950  | Kratos Defense & Security Solutions Inc          | 170.723     |
| 2.600   | MACOM Technology Solutions Holdings Inc Class H  | 164.594     |
| 1.793   | Advanced Micro Devices Inc                       | 162.372     |
| 42.300  | SKY Perfect JSAT Holdings Inc                    | 159.110     |
| 1.032   | Safran SA  | 141.662     |
| 347     | Teledyne Technologies Inc                        | 140.266     |
| 818     | Keysight Technologies Inc                        | 130.111     |
| 2.097   | Intellian Technologies Inc                       | 119.821     |
| 42.500  | Singapore Technologies Engineering Ltd           | 112.341     |
| 267     | Deere & Co                                       | 104.019     |
| 22.086  | Rocket Lab USA Inc                               | 100.278     |
| 1.063   | Hanwha Aerospace Co Ltd                          | 93.861      |
| 17.400  | Shanghai Huace Navigation Technology Ltd Class A | 77.159      |
| 816     | Leidos Holdings Inc                              | 77.024      |
| 641     | Jacobs Solutions Inc                             | 74.631      |
| 634     | Amazon.com Inc                                   | 66.273      |
| 306     | Palo Alto Networks Inc                           | 65.554      |
| 211     | CACI International Inc Class A                   | 63.856      |

## Next Generation Space Economy – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung                   | Erlöse US\$ |
|---------|---|-------------|
| 2.563   | Moog Inc Class A                        | 263.641     |
| 30.747  | Universal Microwave Technology Inc      | 166.582     |
| 7.662   | Smiths Group Plc                        | 161.528     |
| 1.528   | Advanced Micro Devices Inc              | 157.649     |
| 10.032  | Kratos Defense & Security Solutions Inc | 142.820     |
| 931     | Safran SA                               | 139.046     |
| 951     | Snowflake Inc Class A                   | 131.087     |
| 977     | Arista Networks Inc                     | 111.517     |
| 1.095   | Crowdstrike Holdings Inc Class A        | 106.002     |
| 821     | Airbus SE                               | 101.569     |
| 299     | NVIDIA Corp                             | 99.162      |
| 842     | Zscaler Inc                             | 92.109      |
| 353     | Motorola Solutions Inc                  | 91.835      |
| 16.694  | Rocket Lab USA Inc                      | 88.371      |
| 797     | Raytheon Technologies Corp              | 80.286      |
| 995     | Leidos Holdings Inc                     | 76.942      |
| 500     | Palo Alto Networks Inc                  | 67.931      |
| 8.695   | Virgin Galactic Holdings Inc            | 49.894      |
| 99      | Lockheed Martin Corp                    | 48.330      |
| 654     | Ball Corp                               | 38.987      |
| 41      | TransDigm Group Inc                     | 30.383      |
| 86      | CACI International Inc Class A          | 29.112      |
| 213     | Jacobs Solutions Inc                    | 27.323      |
| 208     | Thales SA                               | 25.447      |

## Short Duration Emerging Market Debt – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile    | Wertpapierbezeichnung   | Kosten US\$ |
|------------|---|-------------|
| 51.306.000 | Serbia International Bond, 3.13%, 15/05/2027  | 50.130.469  |
| 50.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 24/11/2023  | 48.800.083  |
| 37.754.000 | Korea Mine Rehabilitation & Mineral Resources Corp, 5.38%, 11/05/2028                           | 37.463.294  |
| 37.000.000 | Serbia International Bond, 1.00%, 23/09/2028  | 31.461.097  |
| 26.610.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 27/07/2023  | 25.988.349  |
| 25.371.000 | Korea Housing Finance Corp, 4.63%, 24/02/2028   | 25.232.474  |
| 25.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 04/04/2023  | 24.931.594  |
| 25.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 02/05/2023  | 24.916.469  |
| 25.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 11/07/2023  | 24.597.631  |
| 25.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 05/09/2023  | 24.586.806  |
| 25.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 26/09/2023  | 24.565.733  |
| 24.831.000 | Hungarian Development Bank, 6.50%, 29/06/2028   | 24.556.866  |
| 17.799.000 | Serbia International Bond, 6.25%, 26/05/2028  | 17.732.610  |
| 19.305.000 | Ivory Coast Government International Bond, 5.25%, 22/03/2030                                    | 17.390.642  |
| 16.930.000 | Romanian Government International Bond, 2.88%, 26/05/2028                                       | 16.492.300  |
| 16.000.000 | First Abu Dhabi Bank PJSC, 4.38%, 24/04/2028  | 15.894.240  |
| 16.157.000 | Adani Green Energy UP Ltd/Prayatna Developers Pvt Ltd/Parampujya Solar Energ, 6.25%, 10/12/2024 | 15.591.373  |
| 14.467.000 | Commercial Bank of Dubai PSC, 5.32%, 14/06/2028   | 14.467.000  |
| 13.634.000 | Romanian Government International Bond, 6.63%, 17/02/2028                                       | 13.580.418  |
| 13.464.000 | Hong Kong Government International Bond, 4.50%, 11/01/2028                                      | 13.413.375  |
| 15.000.000 | Colombia Government International Bond, 4.50%, 15/03/2029                                       | 13.335.000  |
| 12.746.000 | Oman Government International Bond, 5.63%, 17/01/2028   | 12.592.839  |
| 12.489.000 | DIB Sukuk Ltd, 4.80%, 16/08/2028  | 12.489.000  |
| 12.623.000 | Kingdom of Morocco, 5.95%, 08/03/2028   | 12.478.142  |
| 12.476.000 | Central American Bank for Economic Integration, 5.00%, 09/02/2026                               | 12.473.505  |
| 12.488.000 | Mexico Government International Bond, 5.40%, 09/02/2028   | 12.463.399  |
| 12.099.000 | The Egyptian Financial Company for Sovereign Taskeek, 10.88%, 28/02/2026                        | 12.061.251  |
| 13.330.000 | Comision Federal de Electricidad, 4.69%, 15/05/2029   | 12.016.995  |
| 11.805.000 | Hyundai Capital America, 5.68%, 26/06/2028  | 11.765.370  |
| 11.695.000 | CK Hutchison International 23 Ltd, 4.75%, 21/04/2028  | 11.671.376  |
| 10.000.000 | Energean Israel Finance Ltd, 4.50%, 30/03/2024  | 9.762.500   |
| 17.856.000 | El Salvador Government International Bond, 8.63%, 28/02/2029                                    | 9.431.799   |
| 9.800.000  | Guatemala Government Bond, 5.25%, 10/08/2029  | 9.373.700   |
| 9.680.000  | Dominican Republic International Bond, 5.50%, 22/02/2029  | 9.359.240   |
| 9.372.000  | Korea Development Bank, 4.38%, 15/02/2028   | 9.350.351   |
| 8.898.000  | Airport Authority, 4.75%, 12/01/2028  | 8.871.751   |

## Short Duration Emerging Market Debt – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile    | Wertpapierbezeichnung   | Erlöse US\$ |
|------------|---|-------------|
| 31.971.000 | Republic of Poland Government International Bond, 5.50%, 16/11/2027       | 32.951.872  |
| 29.710.000 | Qatar Government International Bond, 3.38%, 14/03/2024                    | 29.156.851  |
| 29.461.000 | Egypt Government International Bond, 5.75%, 29/05/2024                    | 26.748.498  |
| 25.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 02/05/2023                            | 24.944.517  |
| 23.104.000 | QatarEnergy Trading LLC, 1.38%, 12/09/2026                                | 20.636.570  |
| 17.799.000 | Serbia International Bond, 6.25%, 26/05/2028                              | 18.217.892  |
| 17.791.000 | Chile Government International Bond, 2.75%, 31/01/2027                    | 16.561.415  |
| 15.000.000 | Petroleos Mexicanos, 3.75%, 21/02/2024                                    | 15.640.014  |
| 14.157.000 | Shriram Finance Ltd, 4.40%, 13/03/2024                                    | 13.873.860  |
| 15.400.000 | Republic of Kenya Government International Bond, 7.00%, 22/05/2027        | 13.825.000  |
| 14.419.000 | ICBCIL Finance Co Ltd, 1.75%, 25/08/2025                                  | 13.135.709  |
| 12.680.000 | Comision Federal de Electricidad, 4.75%, 23/02/2027                       | 12.141.100  |
| 11.570.000 | Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III, 4.40%, 06/06/2027                 | 11.433.130  |
| 12.099.000 | The Egyptian Financial Company for Sovereign Taskeek, 10.88%, 28/02/2026  | 9.928.733   |
| 9.000.000  | Republic of Kenya Government International Bond, 6.88%, 24/06/2024        | 8.572.500   |
| 8.000.000  | AKCB Finance Ltd, 4.75%, 09/10/2023                                       | 7.956.000   |
| 8.640.000  | ICBCIL Finance Co Ltd, 2.25%, 02/11/2026                                  | 7.737.984   |
| 7.800.000  | ICBCIL Finance Co Ltd, 2.70%, 27/01/2027                                  | 7.132.492   |
| 7.000.000  | Ivory Coast Government International Bond, 6.38%, 03/03/2028              | 6.835.000   |
| 6.578.792  | Leviathan Bond Ltd, 5.75%, 30/06/2023                                     | 6.572.213   |
| 6.600.000  | BOC Aviation Ltd, 2.75%, 02/12/2023                                       | 6.503.112   |
| 12.500.000 | Ecuador Government International Bond, 5.50%, 31/07/2030                  | 6.198.350   |
| 5.948.000  | CSN Resources SA, 7.63%, 17/04/2026                                       | 6.010.604   |
| 6.000.000  | Republic of South Africa Government International Bond, 5.88%, 16/09/2025 | 5.995.200   |
| 6.000.000  | Oman Government International Bond, 4.88%, 01/02/2025                     | 5.937.000   |
| 17.775.000 | Unigel Luxembourg SA, 8.75%, 01/10/2026                                   | 5.934.397   |
| 6.000.000  | Petroleos Mexicanos, 6.88%, 04/08/2026                                    | 5.701.500   |
| 5.085.000  | Genneia SA, 8.75%, 02/09/2027   | 4.928.102   |
| 5.000.000  | Energean Israel Finance Ltd, 4.50%, 30/03/2024                            | 4.882.500   |
| 4.000.000  | CCBL Cayman 1 Corp Ltd, 3.50%, 16/05/2024                                 | 3.926.440   |

## Short Duration High Yield SDG Engagement – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung  | Kosten US\$ |
|-----------|--|-------------|
| 9.130.000 | Gen Digital Inc, 6.75%, 30/09/2027   | 9.165.511   |
| 8.665.000 | Air Canada, 3.88%, 15/08/2026  | 7.958.854   |
| 7.700.000 | Avient Corp, 5.75%, 15/05/2025   | 7.643.765   |
| 7.150.000 | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp, 5.13%, 01/05/2027                      | 6.751.854   |
| 6.295.000 | Mauser Packaging Solutions Holding Co, 7.88%, 15/08/2026                           | 6.311.370   |
| 6.710.000 | Hudbay Minerals Inc, 4.50%, 01/04/2026   | 6.275.840   |
| 5.960.000 | Uniti Group LP/Uniti Group Finance Inc/CSL Capital LLC, 10.50%, 15/02/2028         | 5.960.000   |
| 5.945.000 | LPL Holdings Inc, 4.63%, 15/11/2027  | 5.666.323   |
| 5.440.000 | EnerSys, 4.38%, 15/12/2027   | 5.075.164   |
| 5.300.000 | Standard Industries Inc, 5.00%, 15/02/2027   | 5.041.094   |
| 5.700.000 | Open Text Corp, 3.88%, 15/02/2028  | 5.015.344   |
| 5.380.000 | Mattamy Group Corp, 5.25%, 15/12/2027  | 4.972.294   |
| 5.325.000 | NextEra Energy Operating Partners LP, 3.88%, 15/10/2026                            | 4.967.399   |
| 4.980.000 | XHR LP, 6.38%, 15/08/2025  | 4.911.413   |
| 4.985.000 | Energizer Holdings Inc, 6.50%, 31/12/2027  | 4.884.480   |
| 4.965.000 | Camelot Return Merger Sub Inc, 8.75%, 01/08/2028                                   | 4.702.150   |
| 4.705.000 | Amsted Industries Inc, 5.63%, 01/07/2027   | 4.605.325   |
| 4.390.000 | Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC, 6.50%, 15/02/2028 | 4.386.879   |
| 4.580.000 | Advanced Drainage Systems Inc, 5.00%, 30/09/2027                                   | 4.337.700   |
| 4.230.000 | Regal Rexnord Corp, 6.05%, 15/02/2026  | 4.227.274   |

## Short Duration High Yield SDG Engagement – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung   | Erlöse US\$ |
|-----------|---|-------------|
| 7.795.000 | Garda World Security Corp, 4.63%, 15/02/2027                                  | 6.859.600   |
| 6.460.000 | Ally Financial Inc, 5.75%, 20/11/2025   | 6.062.836   |
| 6.060.000 | APX Group Inc, 6.75%, 15/02/2027  | 5.927.875   |
| 5.525.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 22/06/2023                                | 5.445.027   |
| 5.635.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 30/11/2023                                | 5.432.745   |
| 6.205.000 | Blackstone Mortgage Trust Inc, 3.75%, 15/01/2027                              | 5.282.006   |
| 5.580.000 | Sirius XM Radio Inc, 5.00%, 01/08/2027  | 5.201.380   |
| 5.195.000 | CSC Holdings LLC, 5.25%, 01/06/2024   | 5.113.474   |
| 5.210.000 | INEOS Quattro Finance 2 Plc, 3.38%, 15/01/2026                                | 4.777.413   |
| 4.760.000 | American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd, 5.50%, 20/04/2026           | 4.652.782   |
| 4.325.000 | Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp, 7.88%, 15/05/2026 | 4.414.014   |
| 4.490.000 | Openlane Inc, 5.13%, 01/06/2025   | 4.383.413   |
| 4.680.000 | Air Canada, 3.88%, 15/08/2026   | 4.315.923   |
| 4.195.000 | Uniti Group LP/Uniti Group Finance Inc/CSL Capital LLC, 10.50%, 15/02/2028    | 3.997.438   |
| 4.690.000 | Sunnova Energy Corp, 5.88%, 01/09/2026  | 3.986.500   |
| 4.230.000 | Presidio Holdings Inc, 4.88%, 01/02/2027                                      | 3.941.296   |
| 4.000.000 | OneMain Finance Corp, 6.88%, 15/03/2025                                       | 3.900.000   |
| 3.920.000 | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp, 5.13%, 01/05/2027                 | 3.637.125   |
| 3.930.000 | DISH Network Corp, 2.38%, 15/03/2024  | 3.469.725   |
| 3.830.000 | MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp, 5.25%, 01/08/2026              | 3.412.002   |
| 3.425.000 | Live Nation Entertainment Inc, 4.88%, 01/11/2024                              | 3.382.625   |
| 3.195.000 | Avient Corp, 5.75%, 15/05/2025  | 3.177.550   |
| 3.605.000 | Open Text Corp, 3.88%, 15/02/2028   | 3.120.313   |



## Strategic Income – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung  | Kosten US\$ |
|-------------|--|-------------|
| 104.355.000 | Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/05/2046                               | 100.850.543 |
| 100.715.000 | Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/06/2049                               | 96.805.117  |
| 95.955.000  | Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/02/2043                               | 94.319.676  |
| 92.790.000  | Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/05/2043                               | 91.714.039  |
| 87.140.000  | Fannie Mae Pool, 4.50%, 25/03/2044                               | 86.072.887  |
| 89.340.000  | Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/07/2052                               | 84.182.823  |
| 87.425.000  | Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/04/2046                               | 84.071.679  |
| 79.205.000  | Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/04/2043                               | 74.857.567  |
| 75.640.000  | Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/06/2049                               | 74.263.671  |
| 69.930.000  | Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/07/2052                               | 67.601.463  |
| 64.458.795  | United States Treasury Inflation Indexed Note, 1.63%, 15/10/2027 | 65.017.774  |
| 65.710.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 13/04/2023                   | 65.012.607  |
| 60.170.000  | Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/05/2053                               | 60.353.658  |
| 60.695.000  | Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/04/2054                               | 59.532.784  |
| 58.190.000  | Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/02/2043                               | 58.222.438  |
| 58.115.000  | Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/02/2043                               | 55.224.273  |
| 55.055.000  | Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/03/2043                               | 54.818.016  |
| 55.750.000  | Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/03/2043                               | 53.817.661  |
| 52.900.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 28/09/2023                   | 52.206.934  |
| 45.330.000  | Fannie Mae Pool, 3.50%, 01/05/2043                               | 42.501.997  |
| 39.245.000  | Fannie Mae Pool, 5.00%, 25/06/2045                               | 39.211.846  |
| 37.150.000  | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/05/2053                               | 37.661.469  |
| 36.470.000  | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/02/2041                               | 36.981.384  |
| 36.235.000  | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/04/2054                               | 36.090.278  |
| 35.615.000  | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/03/2054                               | 35.876.267  |
| 38.110.000  | Fannie Mae Pool, 3.50%, 01/06/2049                               | 35.641.390  |
| 36.510.000  | Fannie Mae Pool, 3.50%, 01/02/2043                               | 33.495.576  |
| 31.470.000  | Fannie Mae Pool, 3.50%, 01/07/2052                               | 28.783.641  |
| 30.340.000  | Fannie Mae Pool, 3.50%, 01/03/2043                               | 28.565.235  |

## Strategic Income – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung                          | Erlöse US\$ |
|-------------|--|-------------|
| 104.355.000 | Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/05/2046             | 100.188.986 |
| 100.715.000 | Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/06/2049             | 94.896.648  |
| 95.955.000  | Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/02/2043             | 94.815.429  |
| 92.790.000  | Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/05/2043             | 91.096.586  |
| 87.425.000  | Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/04/2046             | 86.437.923  |
| 87.140.000  | Fannie Mae Pool, 4.50%, 25/03/2044             | 83.740.348  |
| 79.205.000  | Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/04/2043             | 76.670.548  |
| 75.640.000  | Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/06/2049             | 73.071.869  |
| 60.695.000  | Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/04/2054             | 60.873.904  |
| 60.170.000  | Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/05/2053             | 60.044.145  |
| 58.190.000  | Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/02/2043             | 58.001.891  |
| 58.115.000  | Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/02/2043             | 56.101.403  |
| 55.055.000  | Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/03/2043             | 53.926.472  |
| 55.750.000  | Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/03/2043             | 52.064.280  |
| 44.510.000  | Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/01/2053             | 44.539.897  |
| 44.145.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 13/04/2023 | 44.043.452  |
| 45.330.000  | Fannie Mae Pool, 3.50%, 01/05/2043             | 42.291.888  |
| 39.245.000  | Fannie Mae Pool, 5.00%, 25/06/2045             | 38.611.557  |
| 37.150.000  | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/05/2053             | 37.475.155  |
| 36.470.000  | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/02/2041             | 36.818.527  |
| 36.235.000  | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/04/2054             | 36.752.710  |
| 35.615.000  | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/03/2054             | 35.461.051  |
| 38.110.000  | Fannie Mae Pool, 3.50%, 01/06/2049             | 34.848.171  |
| 36.510.000  | Fannie Mae Pool, 3.50%, 01/02/2043             | 34.354.885  |
| 34.370.000  | Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/01/2053             | 33.618.156  |
| 36.510.000  | Fannie Mae Pool, 3.50%, 01/01/2053             | 33.477.036  |
| 32.285.000  | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/01/2053             | 32.752.761  |
| 30.340.000  | Fannie Mae Pool, 3.50%, 01/03/2043             | 27.595.179  |
| 27.165.000  | Ginnie Mae, 5.00%, 01/06/2053                  | 26.728.367  |
| 26.105.000  | Ginnie Mae, 5.00%, 01/05/2053                  | 26.109.778  |
| 24.965.000  | Ginnie Mae, 5.00%, 01/04/2054                  | 25.064.223  |
| 24.420.000  | Ginnie Mae, 5.00%, 01/03/2054                  | 24.031.342  |
| 23.915.000  | Ginnie Mae, 5.00%, 01/02/2053                  | 23.971.025  |

## Sustainable Asia High Yield – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung                                       | Kosten US\$ |
|-----------|---|-------------|
| 1.150.000 | Standard Chartered Plc, 4.30%, 29/12/2049                   | 882.535     |
| 667.000   | Philippine Government International Bond, 5.50%, 17/01/2048 | 667.000     |
| 550.000   | Standard Chartered Plc, 0.00%, 15/02/2172                   | 558.600     |
| 510.000   | State Bank of India, 4.88%, 05/05/2028                      | 508.460     |
| 390.000   | CK Hutchison International 2 Ltd, 4.88%, 21/04/2033         | 388.171     |
| 400.000   | Studio City Finance Ltd, 6.50%, 15/01/2028                  | 349.800     |
| 350.000   | Shinhan Bank Co Ltd, 4.50%, 12/04/2028                      | 348.499     |
| 400.000   | Huarong Finance 2017 Co Ltd, 4.75%, 27/04/2027              | 348.250     |
| 400.000   | HDFC Bank Ltd, 3.70%, 29/12/2049                            | 347.700     |
| 400.000   | Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT, 4.30%, 29/12/2049     | 333.300     |
| 333.000   | Philippine Government International Bond, 5.00%, 17/07/2033 | 332.973     |
| 400.000   | Melco Resorts Finance Ltd, 5.38%, 04/12/2029                | 331.400     |
| 400.000   | Vedanta Resources Finance II Plc, 8.95%, 11/03/2025         | 307.000     |
| 500.000   | Sino-Ocean Land Treasure III Ltd, 4.90%, 31/12/2049         | 300.000     |
| 300.000   | POSCO, 5.75%, 17/01/2028                                    | 298.524     |
| 400.000   | Huarong Finance 2019 Co Ltd, 3.38%, 24/02/2030              | 288.000     |
| 300.000   | Bangkok Bank PCL, 5.00%, 29/12/2049                         | 275.625     |
| 300.000   | Krung Thai Bank PCL, 4.40%, 29/12/2049                      | 271.500     |
| 262.000   | Standard Chartered Plc, 6.30%, 06/07/2034                   | 262.000     |
| 250.000   | Woori Bank, 4.88%, 26/01/2028                               | 249.125     |
| 250.000   | BOC Aviation USA Corp, 4.88%, 03/05/2033                    | 247.275     |
| 550.000   | Sri Lanka Government International Bond, 6.85%, 03/11/2025  | 204.600     |
| 200.000   | Khazanah Capital Ltd, 4.88%, 01/06/2033                     | 200.000     |
| 200.000   | REC Ltd, 5.63%, 11/04/2028                                  | 199.708     |
| 200.000   | CK Hutchison International 23 Ltd, 4.75%, 21/04/2028        | 199.596     |
| 200.000   | Hyundai Capital America, 5.68%, 26/06/2028                  | 199.484     |
| 200.000   | Airport Authority, 4.75%, 12/01/2028                        | 199.410     |
| 200.000   | Export-Import Bank of Korea, 5.13%, 11/01/2033              | 199.180     |
| 200.000   | Airport Authority, 4.88%, 12/01/2030                        | 198.760     |
| 200.000   | Airport Authority, 4.88%, 12/01/2033                        | 198.516     |
| 200.000   | SK Hynix Inc, 6.50%, 17/01/2033                             | 196.820     |
| 200.000   | Sands China Ltd, 5.90%, 08/08/2028                          | 193.000     |
| 200.000   | ReNew Power Pvt Ltd, 5.88%, 05/03/2027                      | 187.750     |
| 200.000   | Huarong Finance II Co Ltd, 4.63%, 03/06/2026                | 178.000     |
| 200.000   | Axis Bank Ltd, 4.10%, 29/12/2049                            | 177.000     |
| 200.000   | Vedanta Resources Finance II Plc, 13.88%, 21/01/2024        | 177.000     |
| 200.000   | Melco Resorts Finance Ltd, 5.75%, 21/07/2028                | 173.000     |
| 250.000   | Country Garden Holdings Co Ltd, 3.13%, 22/10/2025           | 169.500     |

## Sustainable Asia High Yield – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen: (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung                              | Kosten US\$ |
|---------|--|-------------|
| 200.000 | Wynn Macau Ltd, 5.13%, 15/12/2029                  | 167.460     |
| 200.000 | GENM Capital Labuan Ltd, 3.88%, 19/04/2031         | 164.000     |
| 200.000 | Champion Path Holdings Ltd, 4.85%, 27/01/2028      | 164.000     |
| 200.000 | New Metro Global Ltd, 4.80%, 15/12/2024            | 161.500     |
| 200.000 | Huarong Finance 2019 Co Ltd, 4.50%, 29/05/2029     | 159.250     |
| 200.000 | Huarong Finance 2019 Co Ltd, 3.88%, 13/11/2029     | 152.000     |
| 200.000 | Standard Chartered Plc, 4.75%, 29/12/2049          | 147.500     |
| 200.000 | Fortune Star BVI Ltd, 5.00%, 18/05/2026            | 146.900     |
| 350.000 | Sino-Ocean Land Treasure IV Ltd, 2.70%, 13/01/2025 | 143.500     |
| 500.000 | Sino-Ocean Land Treasure IV Ltd, 4.75%, 05/08/2029 | 132.500     |

## Sustainable Asia High Yield – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung   | Erlöse US\$ |
|---------|---|-------------|
| 667.000 | Philippine Government International Bond, 5.50%, 17/01/2048                                     | 670.335     |
| 550.000 | Standard Chartered Plc, 0.00%, 15/02/2172   | 532.125     |
| 510.000 | State Bank of India, 4.88%, 05/05/2028  | 507.236     |
| 510.000 | Cathay Pacific MTN Financing HK Ltd, 4.88%, 17/08/2026  | 497.641     |
| 850.000 | Sino-Ocean Land Treasure IV Ltd, 2.70%, 13/01/2025  | 418.475     |
| 390.000 | CK Hutchison International 1 Ltd, 4.88%, 21/04/2033   | 390.027     |
| 400.000 | Medco Bell Pte Ltd, 6.38%, 30/01/2027   | 379.200     |
| 400.000 | Vedanta Resources Finance II Plc, 13.88%, 21/01/2024  | 376.500     |
| 400.000 | Singapore Airlines Ltd, 3.38%, 19/01/2029   | 365.204     |
| 400.000 | Melco Resorts Finance Ltd, 5.63%, 17/07/2027  | 359.000     |
| 350.000 | Shinhan Bank Co Ltd, 4.50%, 12/04/2028  | 349.461     |
| 400.000 | Bangkok Bank PCL, 3.73%, 25/09/2034   | 343.988     |
| 400.000 | CAS Capital No 1 Ltd, 4.00%, 29/12/2049   | 329.200     |
| 350.000 | Ca Magnum Holdings, 5.38%, 31/10/2026   | 326.375     |
| 330.000 | FWD Group Ltd, 8.05%, 29/12/2049  | 320.925     |
| 310.000 | FWD Group Ltd, 5.75%, 09/07/2024  | 306.125     |
| 300.000 | POSCO, 5.75%, 17/01/2028  | 301.344     |
| 300.000 | Wynn Macau Ltd,, 4.88%, 01/10/2024  | 292.500     |
| 300.000 | Sands China Ltd, 5.90%, 08/08/2028  | 289.500     |
| 305.000 | ReNew Power Pvt Ltd, 5.88%, 05/03/2027  | 286.319     |
| 300.000 | Kasikornbank PCL, 3.34%, 02/10/2031   | 266.481     |
| 300.000 | Central Plaza Development Ltd, 5.75%, 29/12/2049  | 265.800     |
| 300.000 | Krung Thai Bank PCL, 4.40%, 29/12/2049  | 265.125     |
| 300.000 | Melco Resorts Finance Ltd, 5.75%, 21/07/2028  | 259.500     |
| 250.000 | Woori Bank, 4.88%, 26/01/2028   | 255.375     |
| 250.000 | BOC Aviation USA Corp, 4.88%, 03/05/2033  | 248.435     |
| 300.000 | GENM Capital Labuan Ltd, 3.88%, 19/04/2031  | 243.000     |
| 200.000 | Export-Import Bank of Korea, 5.13%, 11/01/2033  | 208.362     |
| 200.000 | Airport Authority, 4.88%, 12/01/2030  | 202.350     |
| 200.000 | Airport Authority, 4.88%, 12/01/2033  | 201.510     |
| 200.000 | CK Hutchison International 23 Ltd, 4.75%, 21/04/2028  | 200.586     |
| 200.000 | Khazanah Capital Ltd, 4.88%, 01/06/2033   | 200.538     |
| 200.000 | Airport Authority, 4.75%, 12/01/2028  | 200.398     |
| 200.000 | REC Ltd, 5.63%, 11/04/2028  | 199.782     |
| 200.000 | Medco Oak Tree Pte Ltd, 7.38%, 14/05/2026   | 199.500     |
| 200.000 | Celestial Miles Ltd, 5.75%, 29/12/2049  | 198.000     |
| 200.000 | Adani Green Energy UP Ltd/Prayatna Developers Pvt Ltd/Parampujya Solar Energ, 6.25%, 10/12/2024 | 197.100     |
| 200.000 | Periama Holdings LLC, 5.95%, 19/04/2026   | 195.300     |
| 200.000 | MGM China Holdings Ltd, 5.88%, 15/05/2026   | 192.500     |

## Sustainable Asia High Yield – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen (Fortsetzung):

| Anteile | Wertpapierbezeichnung  | Erlöse US\$ |
|---------|--|-------------|
| 350.000 | Sino-Ocean Land Treasure Finance I Ltd, 6.00%, 30/07/2024        | 185.500     |
| 200.000 | ENN Clean Energy International Investment Ltd, 3.38%, 12/05/2026 | 183.332     |
| 200.000 | MGM China Holdings Ltd, 4.75%, 01/02/2027                        | 182.702     |
| 200.000 | Vanke Real Estate Hong Kong Co Ltd, 3.98%, 09/11/2027            | 182.000     |
| 200.000 | Yanlord Land HK Co Ltd, 5.13%, 20/05/2026                        | 169.200     |
| 200.000 | Wynn Macau Ltd, 5.13%, 15/12/2029                                | 165.800     |
| 200.000 | JSW Steel Ltd, 5.05%, 05/04/2032                                 | 165.160     |
| 191.000 | Greenko Power II Ltd, 4.30%, 13/12/2028                          | 162.828     |
| 162.160 | Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd, 6.75%, 24/04/2033       | 157.295     |
| 200.000 | New Metro Global Ltd, 4.80%, 15/12/2024                          | 150.100     |
| 400.000 | China SCE Group Holdings Ltd, 7.00%, 02/05/2025                  | 147.000     |

## Sustainable Emerging Market Corporate Debt – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung   | Kosten US\$ |
|---------|---|-------------|
| 887.000 | Ecopetrol SA, 8.88%, 13/01/2033                                     | 879.875     |
| 851.000 | Banco do Brasil SA, 6.25%, 18/04/2030                               | 839.188     |
| 800.000 | Kosmos Energy Ltd, 7.13%, 04/04/2026                                | 722.050     |
| 726.000 | Romanian Government International Bond, 7.13%, 17/01/2033           | 721.150     |
| 643.000 | Brazilian Government International Bond, 6.00%, 20/10/2033          | 635.599     |
| 559.000 | Energear Israel Finance Ltd, 5.38%, 26/01/2028                      | 559.767     |
| 600.000 | KazMunayGas National Co JSC, 4.75%, 19/04/2027                      | 556.245     |
| 546.000 | Colombia Government International Bond, 7.50%, 02/02/2034           | 537.170     |
| 534.000 | Cemex SAB de CV, 9.13%, 29/12/2049                                  | 534.000     |
| 485.000 | Bank Gospodarstwa Krajowego, 5.13%, 22/02/2033                      | 516.994     |
| 500.000 | Cencosud SA, 4.38%, 17/07/2027                                      | 485.000     |
| 483.000 | Standard Chartered Plc, 6.30%, 06/07/2032                           | 483.000     |
| 540.000 | Millicom International Cellular SA, 6.25%, 25/03/2029               | 480.330     |
| 550.000 | KazMunayGas National Co JSC, 5.75%, 19/04/2047                      | 453.400     |
| 407.000 | Republic of Poland Government International Bond, 4.25%, 14/02/2043 | 433.914     |
| 500.000 | TSMC Global Ltd, 1.75%, 23/04/2028                                  | 429.337     |
| 437.000 | Braskem Netherlands Finance BV, 7.25%, 13/02/2033                   | 427.500     |
| 477.500 | Greenko Power II Ltd, 4.30%, 13/12/2028                             | 415.425     |
| 450.000 | Anglo American Capital Plc, 3.88%, 16/03/2029                       | 407.948     |
| 400.000 | CK Hutchison International 23 Ltd, 4.88%, 21/04/2033                | 400.036     |
| 401.000 | Chile Government International Bond, 4.95%, 05/01/2036              | 399.228     |
| 399.000 | Dominican Republic International Bond, 7.05%, 03/02/2031            | 399.000     |
| 400.000 | Turkey Government International Bond, 9.13%, 13/07/2030             | 396.468     |
| 390.000 | Commercial Bank of Dubai PSC, 5.32%, 14/06/2028                     | 390.000     |
| 376.000 | Petroleos Mexicanos, 10.00%, 07/02/2033                             | 367.352     |
| 400.000 | Medco Bell Pte Ltd, 6.38%, 30/01/2027                               | 360.900     |
| 400.000 | Power Finance Corp Ltd, 3.95%, 23/04/2030                           | 360.320     |

## Sustainable Emerging Market Corporate Debt – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung   | Erlöse US\$ |
|---------|---|-------------|
| 726.000 | Romanian Government International Bond, 7.13%, 17/01/2033           | 720.555     |
| 656.000 | Colombia Government International Bond, 8.00%, 20/04/2033           | 686.242     |
| 574.000 | Celestial Miles Ltd, 5.75%, 29/12/2049                              | 567.360     |
| 559.000 | Energean Israel Finance Ltd, 5.38%, 26/01/2028                      | 559.154     |
| 600.000 | Vedanta Resources Finance II Plc, 13.88%, 21/01/2024                | 548.960     |
| 546.000 | Colombia Government International Bond, 7.50%, 02/02/2034           | 532.721     |
| 500.000 | Banco do Brasil SA, 6.25%, 18/04/2030                               | 493.000     |
| 446.000 | Shinhan Financial Group Co Lt, 5.88%, 29/12/2049                    | 440.209     |
| 500.000 | Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd, 2.30%, 08/01/2031      | 439.560     |
| 443.000 | Brazilian Government International Bond, 6.00%, 20/10/2033          | 436.423     |
| 425.700 | Millicom International Cellular SA, 6.25%, 25/03/2029               | 389.516     |
| 400.000 | Turkey Government International Bond, 9.13%, 13/07/2030             | 378.300     |
| 427.000 | Alibaba Group Holding Ltd, 4.00%, 06/12/2037                        | 377.846     |
| 376.000 | Petroleos Mexicanos, 10.00%, 07/02/2033                             | 366.600     |
| 435.000 | Banco de Credito e Inversiones SA, 2.88%, 14/10/2031                | 363.748     |
| 407.000 | Kosmos Energy Ltd, 7.13%, 04/04/2026                                | 358.400     |
| 368.000 | Aegea Finance Sarl, 6.75%, 20/05/2029                               | 356.960     |
| 359.000 | Banco Bradesco SA, 4.38%, 18/03/2027                                | 348.230     |
| 371.000 | Suzano Austria GmbH, 5.00%, 15/01/2030                              | 347.998     |
| 350.000 | Banco de Bogota SA, 6.25%, 12/05/2026                               | 346.150     |
| 350.000 | Grupo de Inversiones Suramericana SA, 5.50%, 29/04/2026             | 342.125     |
| 337.000 | Republic of Poland Government International Bond, 5.50%, 04/04/2053 | 335.989     |
| 600.000 | Gol Finance SA, 8.00%, 30/06/2026                                   | 332.926     |



## Sustainable Emerging Market Debt – Hard Currency – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile    | Wertpapierbezeichnung   | Kosten US\$ |
|------------|---|-------------|
| 9.060.000  | Chile Government International Bond, 1.88%, 27/05/2030              | 8.726.997   |
| 9.327.000  | Serbia International Bond, 1.65%, 03/03/2033                        | 6.731.103   |
| 6.740.000  | Romanian Government International Bond, 3.62%, 26/05/2030           | 6.343.277   |
| 6.580.000  | Oman Government International Bond, 6.75%, 17/01/2048               | 6.336.888   |
| 7.330.000  | Peruvian Government International Bond, 1.25%, 11/03/2033           | 5.923.678   |
| 6.950.000  | Republic of Armenia International Bond, 3.95%, 26/09/2029           | 5.775.700   |
| 5.764.000  | Brazilian Government International Bond, 6.00%, 20/10/2033          | 5.680.397   |
| 5.800.000  | Dominican Republic International Bond, 6.00%, 22/02/2033            | 5.388.708   |
| 19.770.000 | Argentine Republic Government International Bond, 1.50%, 09/07/2035 | 4.859.389   |
| 3.960.000  | Hungary Government International Bond, 7.63%, 29/03/2041            | 4.537.034   |
| 4.282.000  | Colombia Government International Bond, 7.50%, 02/02/2034           | 4.194.294   |
| 4.640.000  | Serbia International Bond, 1.50%, 26/06/2029                        | 3.916.661   |
| 4.670.000  | Romanian Government International Bond, 4.63%, 03/04/2049           | 3.815.485   |
| 4.300.000  | Dominican Republic International Bond, 4.50%, 30/01/2030            | 3.788.170   |
| 4.140.000  | Mexico Government International Bond, 5.75%, 12/10/2110             | 3.638.460   |
| 3.456.000  | Panama Government International Bond, 6.40%, 14/02/2035             | 3.606.606   |
| 10.340.000 | Ecuador Government International Bond, 2.50%, 31/07/2035            | 3.568.710   |
| 4.450.000  | Mexico Government International Bond, 2.25%, 12/08/2036             | 3.517.801   |
| 4.180.000  | Dominican Republic International Bond, 6.40%, 05/06/2049            | 3.503.049   |
| 3.700.000  | Colombia Government International Bond, 3.88%, 25/04/2027           | 3.357.051   |
| 3.250.000  | Mexico Government International Bond, 3.38%, 23/02/2031             | 3.351.673   |
| 3.240.000  | Panama Government International Bond, 6.85%, 28/03/2054             | 3.319.394   |
| 3.810.000  | Morocco Government International Bond, 5.50%, 11/12/2042            | 3.319.261   |
| 4.630.000  | Ghana Government International Bond, 10.75%, 14/10/2030             | 3.092.418   |
| 3.750.000  | Colombia Government International Bond, 6.13%, 18/01/2041           | 3.032.525   |
| 2.860.000  | Peruvian Government International Bond, 3.75%, 01/03/2030           | 3.007.199   |
| 3.220.000  | Republic of Uzbekistan International Bond, 5.38%, 20/02/2029        | 2.982.230   |
| 2.935.000  | Costa Rica Government International Bond, 6.55%, 03/04/2034         | 2.954.919   |
| 5.688.000  | El Salvador Government International Bond, 7.65%, 15/06/2035        | 2.880.303   |
| 2.740.000  | Oman Government International Bond, 6.25%, 25/01/2031               | 2.841.777   |
| 2.441.000  | Bank Gospodarstwa Krajowego, 5.13%, 22/02/2033                      | 2.692.633   |
| 2.701.000  | Turkey Government International Bond, 9.13%, 13/07/2030             | 2.676.685   |
| 2.564.000  | Morocco Government International Bond, 6.50%, 08/09/2033            | 2.609.124   |
| 2.580.000  | Costa Rica Government International Bond, 7.16%, 12/03/2045         | 2.562.521   |
| 2.950.000  | Latvia Government International Bond, 0.25%, 23/01/2030             | 2.554.595   |
| 2.440.000  | Uruguay Government International Bond, 4.38%, 23/01/2031            | 2.446.099   |
| 9.070.000  | Argentine Republic Government International Bond, 0.50%, 09/07/2030 | 2.441.105   |
| 2.840.000  | Brazilian Government International Bond, 5.63%, 21/02/2047          | 2.408.040   |
| 2.393.000  | Republic of Poland Government International Bond, 5.50%, 04/04/2053 | 2.395.656   |
| 2.180.000  | Bulgaria Government International Bond, 4.50%, 27/01/2033           | 2.313.254   |
| 2.650.000  | Romanian Government International Bond, 3.75%, 07/02/2034           | 2.299.476   |
| 4.002.000  | El Salvador Government International Bond, 9.50%, 15/07/2052        | 2.200.817   |

## Sustainable Emerging Market Debt – Hard Currency – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung   | Erlöse US\$ |
|-----------|---|-------------|
| 3.100.000 | Republic of Uzbekistan International Bond, 4.75%, 20/02/2024        | 3.070.625   |
| 3.390.000 | Morocco Government International Bond, 3.00%, 15/12/2032            | 2.751.292   |
| 2.620.000 | Costa Rica Government International Bond, 7.16%, 12/03/2045         | 2.553.922   |
| 2.393.000 | Republic of Poland Government International Bond, 5.50%, 04/04/2053 | 2.408.076   |
| 2.410.000 | UAE International Government Bond, 4.95%, 07/07/2052                | 2.362.282   |
| 8.850.000 | Argentine Republic Government International Bond, 1.50%, 09/07/2035 | 2.179.803   |
| 3.291.000 | El Salvador Government International Bond, 8.63%, 28/02/2029        | 1.926.310   |
| 2.309.000 | Hungary Government International Bond, 1.75%, 05/06/2035            | 1.793.177   |
| 1.801.000 | Chile Government International Bond, 4.34%, 07/03/2042              | 1.586.681   |
| 1.710.000 | Chile Government International Bond, 2.55%, 27/01/2032              | 1.468.035   |
| 1.500.000 | Chile Government International Bond, 2.75%, 31/01/2027              | 1.422.407   |
| 1.186.000 | Brazilian Government International Bond, 8.25%, 20/01/2034          | 1.353.855   |
| 1.207.741 | Uruguay Government International Bond, 5.75%, 28/10/2034            | 1.347.235   |
| 1.408.000 | Turkey Government International Bond, 9.13%, 13/07/2030             | 1.296.064   |
| 1.253.000 | Morocco Government International Bond, 6.50%, 08/09/2033            | 1.278.123   |
| 1.132.000 | Romanian Government International Bond, 7.13%, 17/01/2033           | 1.187.236   |
| 1.369.000 | Republic of Armenia International Bond, 3.60%, 02/02/2031           | 1.063.029   |
| 1.230.000 | Serbia International Bond, 1.00%, 23/09/2028                        | 1.003.212   |
| 970.000   | Mexico Government International Bond, 2.38%, 11/02/2030             | 943.986     |
| 970.000   | Oman Government International Bond, 6.75%, 17/01/2048               | 934.683     |
| 1.257.000 | Abu Dhabi Government International Bond, 3.00%, 15/09/2051          | 875.375     |
| 750.000   | Peruvian Government International Bond, 7.35%, 21/07/2025           | 791.723     |
| 770.000   | Serbia International Bond, 3.13%, 15/05/2027                        | 736.352     |
| 893.000   | Serbia International Bond, 1.50%, 26/06/2029                        | 726.356     |
| 1.209.694 | Ecuador Government International Bond, 5.50%, 31/07/2030            | 659.245     |
| 750.000   | Brazilian Government International Bond, 5.63%, 21/02/2047          | 630.796     |
| 758.000   | Dominican Republic International Bond, 6.40%, 05/06/2049            | 628.079     |
| 614.000   | Serbia International Bond, 6.50%, 26/09/2033                        | 608.377     |
| 486.000   | Hungary Government International Bond, 7.63%, 29/03/2041            | 533.409     |
| 486.000   | Romanian Government International Bond, 7.63%, 17/01/2053           | 522.567     |
| 1.690.000 | Argentine Republic Government International Bond, 1.00%, 09/07/2029 | 512.305     |
| 600.000   | Romanian Government International Bond, 4.63%, 03/04/2049           | 504.813     |

## Systematic Global Sustainable Value – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung                      | Kosten US\$ |
|---------|--|-------------|
| 27.196  | Shell Plc                                  | 797.520     |
| 37.829  | Iberdrola SA                               | 491.720     |
| 10.377  | Comcast Corp Class A                       | 399.162     |
| 3.354   | Simon Property Group Inc                   | 380.919     |
| 5.844   | TotalEnergies SE                           | 350.105     |
| 10.890  | CSX Corp                                   | 344.612     |
| 638     | Humana Inc                                 | 323.150     |
| 1.521   | Meta Platforms Inc Class A                 | 305.779     |
| 14.855  | Manulife Financial Corp                    | 290.463     |
| 345     | Broadcom Inc                               | 286.233     |
| 7.431   | Enbridge Inc                               | 283.118     |
| 4.139   | PulteGroup Inc                             | 274.939     |
| 2.200   | Expeditors International of Washington Inc | 251.698     |
| 17.276  | Fortescue Metals Group Ltd                 | 243.015     |
| 7.508   | Pembina Pipeline Corp                      | 241.953     |
| 7.152   | Fox Corp Class B                           | 237.518     |
| 3.983   | Coca-Cola Europacific Partners Plc         | 236.295     |
| 1.311   | AmerisourceBergen Corp Class A             | 233.477     |
| 11.865  | AT&T Inc                                   | 227.437     |
| 15.200  | Mizuho Financial Group Inc                 | 226.650     |
| 17.000  | Alibaba Group Holding Ltd                  | 225.555     |
| 9.718   | SSE Plc                                    | 225.036     |
| 1.694   | Ferguson Plc                               | 224.858     |
| 41      | NVR Inc                                    | 223.632     |
| 3.244   | Bristol-Myers Squibb Co                    | 223.183     |
| 1.858   | NIKE Inc Class B                           | 222.800     |
| 750     | Home Depot Inc                             | 222.225     |
| 2.612   | Loblaw Companies Ltd                       | 221.835     |
| 1.970   | Skyworks Solutions Inc                     | 220.049     |
| 739     | McDonald's Corp                            | 214.017     |
| 2.631   | State Street Corp                          | 209.945     |
| 732     | Kuehne + Nagel International AG            | 202.871     |
| 3.260   | Regency Centers Corp                       | 199.052     |
| 10.030  | National Australia Bank Ltd                | 198.856     |
| 1.776   | Merck & Co Inc                             | 197.894     |
| 1.703   | Vinci SA                                   | 196.290     |

## Systematic Global Sustainable Value – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung                     | Erlöse US\$ |
|---------|---|-------------|
| 5.437   | Phillips 66                               | 525.627     |
| 14.370  | Anglo American Plc                        | 498.596     |
| 8.907   | CRH Plc                                   | 439.316     |
| 1.470   | Microsoft Corp                            | 412.544     |
| 11.110  | Pembina Pipeline Corp                     | 355.635     |
| 4.733   | CVS Health Corp                           | 338.433     |
| 2.735   | QUALCOMM Inc                              | 316.493     |
| 152.102 | Barclays Plc                              | 297.773     |
| 116     | Booking Holdings Inc                      | 296.459     |
| 1.550   | Tesla Inc                                 | 289.875     |
| 1.579   | Apple Inc                                 | 280.294     |
| 6.703   | Pfizer Inc                                | 274.054     |
| 4.020   | ONEOK Inc                                 | 268.833     |
| 6.695   | Enbridge Inc                              | 261.258     |
| 3.389   | CBRE Group Inc Class A                    | 252.019     |
| 14.003  | Australia & New Zealand Banking Group Ltd | 248.865     |
| 2.305   | Starbucks Corp                            | 243.796     |
| 3.823   | TotalEnergies SE                          | 239.154     |
| 21      | Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG    | 239.062     |
| 7.905   | Weyerhaeuser Co                           | 236.185     |
| 5.012   | Deutsche Post AG                          | 235.945     |
| 2.709   | Emerson Electric Co                       | 234.910     |

## Tactical Macro – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe\*

Es gab keine Käufe oder Verkäufe im Berichtszeitraum.

\*Der Tactical Macro wurde am 30. Juni 2023 aufgelegt.

## Ultra Short Term Euro Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

| Anteile    | Wertpapierbezeichnung  | Kosten EUR |
|------------|--|------------|
| 15.000.000 | Sumitomo Mitsui Banking Corp, 3.60%, 16/02/2026                    | 14.948.874 |
| 15.000.000 | Bank of Nova Scotia, 3.05%, 31/10/2024                             | 14.865.900 |
| 10.000.000 | Westpac Banking Corp, 3.46%, 04/04/2025                            | 10.004.890 |
| 10.000.000 | Australia & New Zealand Banking Group Ltd, 3.44%, 04/04/2025       | 9.976.660  |
| 10.000.000 | Lloyds Bank Plc, 3.25%, 02/02/2026                                 | 9.948.440  |
| 10.000.000 | Federation des Caisses Desjardins du Quebec, 2.88%, 28/11/2024     | 9.895.600  |
| 9.839.765  | Dutch Property Finance BV Series 2021-2 Class A, 3.94%, 28/04/2059 | 9.782.694  |
| 9.000.000  | Finland T-Bill, 0.00%, 13/02/2024                                  | 8.792.007  |
| 8.300.000  | US Bancorp, 0.85%, 07/06/2024                                      | 7.953.551  |
| 7.000.000  | Quarzo 2023-1 Series Class A1, 0.00%, 15/12/2039                   | 7.000.000  |
| 6.050.000  | Spain Government Bond, 3.15%, 30/04/2033                           | 6.013.944  |
| 6.000.000  | ALD SA, 1.25%, 02/03/2026  | 5.490.000  |
| 5.500.000  | Intesa Sanpaolo SpA, 5.00%, 08/03/2028                             | 5.481.267  |
| 6.000.000  | Nationale-Nederlanden Bank NV, 1.00%, 25/09/2028                   | 5.388.300  |
| 5.500.000  | UBS Group AG, 2.13%, 13/10/2026                                    | 5.117.850  |
| 5.100.000  | Federation des Caisses Desjardins du Quebec, 3.25%, 18/04/2028     | 5.077.815  |
| 6.000.000  | Heimstaden Bostad AB, 1.13%, 21/01/2026                            | 4.990.680  |
| 4.900.000  | Swedbank AB, 4.63%, 30/05/2026                                     | 4.895.982  |
| 5.000.000  | UniCredit SpA, 1.25%, 16/06/2026                                   | 4.700.000  |
| 4.400.000  | Banco BPM SpA, 6.00%, 14/06/2028                                   | 4.398.020  |

## Ultra Short Term Euro Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung   | Erlöse EUR |
|-----------|---|------------|
| 6.770.000 | Heimstaden Bostad AB, 2.13%, 05/09/2023                       | 6.652.291  |
| 6.375.759 | MIRAVET Sarl Series 2019-1 Class A Class A, 4.17%, 26/05/2065 | 6.299.250  |
| 6.300.000 | Goldman Sachs Group Inc, 1.38%, 15/05/2024                    | 6.145.596  |
| 5.300.000 | Bayer AG, 0.05%, 12/01/2025                                   | 4.983.590  |
| 5.000.000 | Barclays Plc, 3.38%, 02/04/2025                               | 4.951.120  |
| 5.000.000 | UniCredit SpA, 0.33%, 19/01/2026                              | 4.543.000  |
| 4.100.000 | Bank of Nova Scotia, 3.25%, 18/01/2028                        | 4.145.674  |
| 4.200.000 | Spain Government Bond, 3.15%, 30/04/2033                      | 4.141.083  |
| 4.000.000 | Vonovia SE, 4.75%, 23/05/2027                                 | 4.042.340  |
| 3.900.000 | ING Groep NV, 4.75%, 23/05/2034                               | 3.933.190  |
| 4.000.000 | Smurfit Kappa Acquisitions ULC, 2.88%, 15/01/2026             | 3.930.930  |
| 3.750.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.40%, 01/05/2033          | 3.867.863  |
| 3.918.978 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.60%, 22/11/2028          | 3.768.489  |
| 3.800.000 | Arval Service Lease SA, 3.38%, 04/01/2026                     | 3.714.500  |
| 3.770.000 | Slovakia Government Bond, 3.75%, 23/02/2035                   | 3.677.250  |
| 4.983.000 | European Union, 1.25%, 04/02/2043                             | 3.606.895  |
| 3.600.000 | American Tower Corp, 4.13%, 16/05/2027                        | 3.580.776  |
| 3.675.000 | Intesa Sanpaolo SpA, 1.00%, 04/07/2024                        | 3.559.605  |
| 3.681.000 | Netherlands Government Bond, 2.50%, 15/07/2033                | 3.528.781  |
| 3.670.000 | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 1.95%, 15/06/2029          | 3.504.897  |
| 3.830.000 | French Republic Government Bond OAT, 0.75%, 25/02/2028        | 3.493.381  |
| 3.300.000 | NatWest Group Plc, 4.77%, 16/02/2029                          | 3.321.780  |

## Uncorrelated Strategies – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Käufe insgesamt:

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung                          | Kosten US\$ |
|-------------|--|-------------|
| 1.066.441   | Dr ING hc F Porsche AG - Preferred Shares      | 131.298.671 |
| 125.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 05/07/2023 | 122.985.000 |
| 115.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 06/06/2023 | 113.258.204 |
| 105.000.000 | United States Treasury Bill, 0,00%, 02/05/2023 | 103.435.935 |
| 105.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 13/06/2023 | 103.366.105 |
| 105.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 20/06/2023 | 103.345.974 |
| 100.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 16/05/2023 | 98.511.500  |
| 100.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 22/06/2023 | 98.489.108  |
| 100.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00% 09/05/2023  | 98.485.667  |
| 100.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 27/06/2023 | 98.450.272  |
| 85.000.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 17/08/2023 | 83.648.875  |
| 80.000.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 24/08/2023 | 78.830.584  |
| 80.000.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 01/08/2023 | 78.737.146  |
| 80.000.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 10/08/2023 | 78.646.413  |
| 70.000.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 23/05/2023 | 68.940.999  |
| 70.000.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 30/05/2023 | 68.927.397  |
| 60.000.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 31/08/2023 | 59.160.068  |
| 2.600       | Baskets-United States, 0.00%, 18/08/2023       | 245.700     |
| 188.000     | Goldman Sachs International, 0.00%, 23/05/2023 | 141.000     |



## Uncorrelated Strategies – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Verkäufe insgesamt:

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung                          | Erlöse US\$ |
|-------------|--|-------------|
| 1.093.653   | Dr ING hc F Porsche AG - Preferred Shares      | 135.273.232 |
| 105.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 02/05/2023 | 104.935.731 |
| 100.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 16/05/2023 | 99.940.867  |
| 75.000.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 27/04/2023 | 74.976.259  |
| 45.000.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 30/05/2023 | 44.983.873  |
| 20.000.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 09/05/2023 | 19.974.517  |
| 17.000.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 23/05/2023 | 16.980.617  |
| 10.000.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 13/04/2023 | 9.991.917   |

## Uncorrelated Trading – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

| Anteile       | Wertpapierbezeichnung                            | Kosten US\$ |
|---------------|--|-------------|
| 48.000.000    | United States Treasury Bill, 0.00%, 09/05/2023   | 47.273.120  |
| 47.000.000    | United States Treasury Bill, 0.00%, 13/06/2023   | 46.268.638  |
| 45.000.000    | United States Treasury Bill, 0.00%, 30/03/2023   | 44.549.925  |
| 41.000.000    | United States Treasury Bill, 0.00%, 06/06/2023   | 40.379.012  |
| 40.000.000    | United States Treasury Bill, 0.00%, 23/05/2023   | 39.394.857  |
| 24.000.000    | Siemens Energy Finance BV, 5.63%, 14/09/2025     | 35.087.468  |
| 30.000.000    | United States Treasury Bill, 0.00%, 16/05/2023   | 29.553.450  |
| 16.500.000    | Palo Alto Networks Inc, 0.38%, 01/06/2025        | 27.941.707  |
| 2.480.000.000 | ANA Holdings Inc, 0.00%, 10/12/2031              | 20.443.011  |
| 20.000.000    | United States Treasury Bill, 0.00%, 30/05/2023   | 19.693.542  |
| 20.000.000    | United States Treasury Bill, 0.00%, 27/06/2023   | 19.690.054  |
| 966.454       | Volvo AB   | 19.309.920  |
| 1.788.123     | Deutsche Lufthansa AG                            | 18.944.704  |
| 14.700.000    | Deutsche Lufthansa AG, 2.00%, 17/11/2025         | 17.978.801  |
| 15.800.000    | Sasol Financing USA LLC, 4.50%, 08/11/2027       | 16.913.853  |
| 115.833       | Safran SA  | 16.622.731  |
| 16.200.000    | Live Nation Entertainment Inc, 3.13%, 15/01/2029 | 16.324.209  |
| 101.262       | Siemens AG                                       | 15.830.224  |
| 11.461.000    | Safran SA, 0.88%, 15/05/2027                     | 15.082.689  |
| 15.800.000    | Dufry One BV, 0.75%, 30/03/2026                  | 14.749.192  |

## Uncorrelated Trading - Hard Currency – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

| Anteile       | Wertpapierbezeichnung                          | Erlöse US\$ |
|---------------|--|-------------|
| 47.000.000    | United States Treasury Bill, 0.00%, 08/06/2023 | 46.880.087  |
| 47.000.000    | United States Treasury Bill, 0.00%, 13/06/2023 | 46.849.332  |
| 29.400.000    | Siemens Energy Finance BV, 5.63%, 14/09/2025   | 45.327.951  |
| 41.000.000    | United States Treasury Bill, 0.00%, 06/06/2023 | 40.907.674  |
| 16.500.000    | Palo Alto Networks Inc, 0.38%, 01/06/2025      | 32.177.849  |
| 3.870.000.000 | ANA Holdings Inc, 0.00%, 10/12/2031            | 31.554.679  |
| 21.500.000    | Deutsche Lufthansa AG, 2.00%, 17/11/2025       | 26.831.904  |
| 2.390.219     | Deutsche Lufthansa AG                          | 25.303.215  |
| 1.240.354     | Volvo AB                                       | 24.835.786  |
| 23.200.000    | Sasol Financing USA LLC, 4.50%, 08/11/2027     | 24.347.278  |
| 24.800.000    | Dufry One BV, 0.75%, 30/03/2026                | 23.524.721  |
| 150.399       | Safran SA                                      | 21.685.835  |
| 20.000.000    | United States Treasury Bill, 0.00%, 30/05/2023 | 19.984.672  |
| 20.000.000    | United States Treasury Bill, 0.00%, 27/06/2023 | 19.896.079  |
| 13.400.000    | Safran SA, 0.88%, 15/05/2027                   | 18.621.023  |
| 142.659       | Dr ING hc F Porsche AG                         | 17.476.232  |
| 107.740       | Siemens AG                                     | 16.872.187  |
| 15.400.000    | ELM BV for Swiss Re Ltd, 3.25%, 13/06/2024     | 16.552.561  |
| 21.300.000    | ams-OSRAM AG, 2.13%, 03/11/2027                | 16.157.884  |
| 8.612.639     | Melrose Industries Plc                         | 16.121.277  |

## US Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung      | Kosten US\$ |
|---------|----------------------------|-------------|
| 3.604   | Microsoft Corp             | 955.115     |
| 3.101   | NVIDIA Corp                | 832.714     |
| 5.382   | Dollar Tree Inc            | 777.637     |
| 17.089  | Match Group Inc            | 713.529     |
| 4.453   | Progressive Corp           | 593.644     |
| 5.089   | Amazon.com Inc             | 550.830     |
| 1.158   | Intuit Inc                 | 498.951     |
| 2.638   | Salesforce Inc             | 450.770     |
| 892     | ServiceNow Inc             | 399.867     |
| 2.154   | Analog Devices Inc         | 373.348     |
| 2.390   | AbbVie Inc                 | 373.109     |
| 716     | UnitedHealth Group Inc     | 344.169     |
| 2.181   | Johnson & Johnson          | 341.966     |
| 1.853   | Workday Inc Class A        | 332.205     |
| 1.224   | Meta Platforms Inc Class A | 321.471     |
| 9.454   | Keurig Dr Pepper Inc       | 314.653     |
| 756     | Netflix Inc                | 300.214     |
| 1.025   | McDonald's Corp            | 282.522     |
| 3.899   | Okta Inc Class A           | 274.475     |
| 1.124   | Visa Inc Class A           | 255.811     |
| 3.250   | NextEra Energy Inc         | 246.293     |
| 3.155   | TJX Cos Inc                | 244.778     |
| 1.796   | TE Connectivity Ltd        | 226.456     |
| 1.344   | Apple Inc                  | 212.175     |
| 1.684   | Alphabet Inc Class A       | 173.316     |
| 1.014   | Avery Dennison Corp        | 171.372     |
| 440     | Mastercard Inc Class A     | 164.762     |
| 1.971   | Activision Blizzard Inc    | 154.414     |
| 3.798   | Chewy Inc Class A          | 146.788     |
| 706     | CME Group Inc Class A      | 129.991     |
| 310     | Adobe Inc                  | 125.552     |

## US Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung                      | Erlöse US\$ |
|---------|--|-------------|
| 5.409   | Apple Inc                                  | 890.557     |
| 2.403   | Microsoft Corp                             | 725.680     |
| 5.518   | Alphabet Inc Class A                       | 540.048     |
| 2.133   | SBA Communications Corp Class A            | 476.355     |
| 2.234   | Salesforce Inc                             | 449.369     |
| 817     | ServiceNow Inc                             | 416.311     |
| 3.095   | Amazon.com Inc                             | 318.139     |
| 2.792   | Walt Disney Co                             | 294.571     |
| 886     | Home Depot Inc                             | 273.715     |
| 611     | S&P Global Inc                             | 218.998     |
| 5.713   | Brookfield Corp                            | 203.510     |
| 438     | Adobe Inc                                  | 203.402     |
| 2.458   | TJX Cos Inc                                | 200.170     |
| 888     | Meta Platforms Inc Class A                 | 191.936     |
| 1.521   | NIKE Inc Class B                           | 181.051     |
| 337     | Costco Wholesale Corp                      | 176.918     |
| 943     | CME Group Inc Class A                      | 167.859     |
| 424     | Netflix Inc                                | 148.675     |
| 655     | Union Pacific Corp                         | 131.027     |
| 671     | Analog Devices Inc                         | 128.645     |
| 900     | TE Connectivity Ltd                        | 119.738     |
| 1.466   | Fidelity National Information Services Inc | 109.071     |
| 2.164   | Chewy Inc Class A                          | 93.193      |
| 5.858   | PG&E Corp                                  | 93.147      |
| 483     | CDW Corp                                   | 85.833      |
| 2.863   | Uber Technologies Inc                      | 85.232      |

## US Equity Index PutWrite – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Käufe insgesamt:

| Anteile    | Wertpapierbezeichnung                          | Kosten US\$ |
|------------|--|-------------|
| 75.600.000 | United States Treasury Note, 1.75%, 15/03/2025 | 71.970.867  |
| 65.900.000 | United States Treasury Note, 2.88%, 15/06/2025 | 63.717.063  |

Verkäufe insgesamt:

| Anteile    | Wertpapierbezeichnung                          | Erlöse US\$ |
|------------|--|-------------|
| 72.200.000 | United States Treasury Note, 0.50%, 15/03/2023 | 71.683.882  |

## US Large Cap Value – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung              | Kosten US\$ |
|---------|------------------------------------|-------------|
| 266.730 | Johnson & Johnson                  | 43.926.728  |
| 234.358 | Procter & Gamble Co                | 33.918.958  |
| 103.009 | Berkshire Hathaway Inc Class B     | 33.105.206  |
| 199.407 | Walmart Inc                        | 29.970.365  |
| 352.875 | Medtronic Plc                      | 29.753.628  |
| 760.909 | Verizon Communications Inc         | 29.657.075  |
| 685.764 | Exelon Corp                        | 28.283.668  |
| 587.810 | Boston Scientific Corp             | 27.891.395  |
| 571.915 | Kroger Co                          | 27.389.708  |
| 97.691  | McDonald's Corp                    | 26.594.257  |
| 102.493 | Becton Dickinson & Co              | 25.966.671  |
| 269.362 | Duke Energy Corp                   | 25.796.720  |
| 291.784 | Gilead Sciences Inc                | 23.853.781  |
| 512.874 | Comcast Corp Class A               | 19.971.701  |
| 109.541 | PepsiCo Inc                        | 19.162.962  |
| 167.791 | DTE Energy Co                      | 18.499.673  |
| 199.454 | American Electric Power Co Inc     | 17.541.065  |
| 215.699 | Mondelez International Inc Class A | 14.372.785  |
| 130.181 | Merck & Co Inc                     | 14.086.604  |
| 86.230  | Sempra Energy                      | 13.313.017  |
| 144.512 | Alphabet Inc Class A               | 12.889.516  |
| 100.864 | 3M Co                              | 12.167.208  |
| 317.167 | Truist Financial Corp              | 11.094.486  |
| 45.873  | Amgen Inc                          | 10.964.215  |
| 96.116  | Exxon Mobil Corp                   | 10.764.699  |
| 105.885 | Philip Morris International Inc    | 10.693.077  |
| 63.142  | Analog Devices Inc                 | 10.684.813  |
| 144.202 | Rio Tinto Plc ADR                  | 10.684.573  |
| 243.213 | Pfizer Inc                         | 10.579.012  |
| 87.362  | Advanced Micro Devices Inc         | 10.271.167  |
| 286.123 | US Bancorp                         | 10.059.497  |
| 33.706  | Air Products & Chemicals Inc       | 9.934.131   |
| 193.869 | Citigroup Inc                      | 9.750.289   |
| 67.711  | PNC Financial Services Group Inc   | 9.151.013   |
| 64.163  | Salesforce Inc                     | 9.112.289   |
| 64.683  | JPMorgan Chase & Co                | 8.989.647   |

## US Large Cap Value – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung                | Erlöse US\$ |
|-----------|--------------------------------------|-------------|
| 1.536.736 | Bank of America Corp                 | 48.608.548  |
| 193.481   | Cummins Inc                          | 44.417.447  |
| 60.475    | Humana Inc                           | 29.048.688  |
| 669.299   | Freeport-McMoRan Inc                 | 24.748.642  |
| 255.194   | Morgan Stanley                       | 24.320.227  |
| 665.474   | Truist Financial Corp                | 23.302.914  |
| 48.398    | Elevance Health Inc                  | 22.943.373  |
| 102.614   | Caterpillar Inc                      | 22.739.708  |
| 72.789    | Parker-Hannifin Corp                 | 22.377.239  |
| 197.194   | Exxon Mobil Corp                     | 21.754.608  |
| 110.849   | Honeywell International Inc          | 21.578.622  |
| 92.635    | Constellation Brands Inc Class A     | 20.169.240  |
| 174.895   | Walt Disney Co                       | 19.055.219  |
| 181.032   | ConocoPhillips                       | 19.017.731  |
| 222.501   | Emerson Electric Co                  | 18.907.186  |
| 292.309   | Johnson Controls International Plc   | 18.457.851  |
| 272.126   | MetLife Inc                          | 17.483.267  |
| 129.705   | International Business Machines Corp | 17.315.371  |
| 47.154    | Goldman Sachs Group Inc              | 17.249.129  |
| 71.222    | Danaher Corp                         | 16.456.810  |
| 826.616   | Regions Financial Corp               | 16.238.453  |
| 238.874   | Rio Tinto Plc ADR                    | 15.339.506  |
| 152.089   | Raytheon Technologies Corp           | 14.488.945  |
| 144.512   | Alphabet Inc Class A                 | 13.714.553  |
| 117.900   | Oracle Corp                          | 12.321.223  |
| 64.163    | Salesforce Inc                       | 10.538.471  |
| 68.064    | Nucor Corp                           | 10.023.585  |
| 192.199   | Alcoa Corp                           | 9.707.279   |
| 60.864    | M&T Bank Corp                        | 9.410.716   |
| 67.348    | JPMorgan Chase & Co                  | 9.391.569   |
| 270.512   | Delta Air Lines Inc                  | 9.340.412   |
| 353.045   | Intel Corp                           | 9.246.971   |
| 286.123   | US Bancorp                           | 9.166.391   |
| 19.343    | Lockheed Martin Corp                 | 8.904.539   |
| 65.309    | Prologis Inc                         | 7.915.272   |
| 144.758   | Newmont Corp                         | 7.645.225   |



## US Long Short Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung              | Kosten US\$ |
|---------|------------------------------------|-------------|
| 17.404  | Progressive Corp                   | 2.382.709   |
| 48.894  | Match Group Inc                    | 2.007.797   |
| 13.551  | Dollar Tree Inc                    | 1.936.310   |
| 13.202  | Jacobs Solutions Inc               | 1.590.498   |
| 47.242  | Keurig Dr Pepper Inc               | 1.572.027   |
| 10.458  | JPMorgan Chase & Co                | 1.430.992   |
| 16.709  | NextEra Energy Inc                 | 1.269.401   |
| 16.900  | TransUnion                         | 1.119.447   |
| 17.441  | Apollo Global Management Inc       | 1.074.734   |
| 1.154   | Equinix Inc                        | 898.405     |
| 2.559   | Goldman Sachs Group Inc            | 884.092     |
| 2.976   | NVIDIA Corp                        | 861.308     |
| 3.186   | McDonald's Corp                    | 855.990     |
| 10.258  | TJX Cos Inc                        | 784.955     |
| 8.710   | WEC Energy Group Inc               | 773.723     |
| 4.435   | Chevron Corp                       | 712.534     |
| 2.380   | Meta Platforms Inc Class A         | 684.302     |
| 17.596  | Foot Locker Inc                    | 670.638     |
| 2.337   | Microsoft Corp                     | 641.754     |
| 29.000  | Kenvue Inc                         | 638.000     |
| 17.867  | Brookfield Corp                    | 628.000     |
| 1.389   | Intuit Inc                         | 627.463     |
| 15.978  | Enbridge Inc                       | 607.086     |
| 7.587   | Mondelez International Inc Class A | 507.697     |
| 7.732   | Freshpet Inc                       | 507.478     |
| 3.235   | Walmart Inc                        | 475.139     |
| 6.088   | Activision Blizzard Inc            | 463.339     |
| 906     | UnitedHealth Group Inc             | 438.437     |
| 728     | Thermo Fisher Scientific Inc       | 425.175     |
| 2.441   | Salesforce Inc                     | 424.956     |
| 7.303   | Boston Scientific Corp             | 349.823     |
| 3.151   | Walt Disney Co                     | 344.982     |

## US Long Short Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung                      | Erlöse US\$ |
|---------|--|-------------|
| 46.470  | Apollo Global Management Inc               | 3.360.928   |
| 17.832  | Apple Inc                                  | 2.978.198   |
| 10.784  | Meta Platforms Inc Class A                 | 2.317.118   |
| 9.879   | Salesforce Inc                             | 1.988.144   |
| 6.203   | Microsoft Corp                             | 1.845.382   |
| 16.262  | Amazon.com Inc                             | 1.676.492   |
| 3.826   | Adobe Inc                                  | 1.653.408   |
| 27.799  | Fidelity National Information Services Inc | 1.452.855   |
| 12.842  | Walt Disney Co                             | 1.313.471   |
| 3.288   | S&P Global Inc                             | 1.165.091   |
| 23.900  | nVent Electric Plc                         | 1.015.475   |
| 7.900   | TE Connectivity Ltd                        | 986.498     |
| 11.821  | NextEra Energy Inc                         | 908.434     |
| 5.838   | Procter & Gamble Co                        | 876.434     |
| 2.559   | Goldman Sachs Group Inc                    | 850.976     |
| 3.260   | Becton Dickinson & Co                      | 813.887     |
| 15.501  | Alcoa Corp                                 | 720.806     |
| 6.797   | Expedia Group Inc                          | 698.127     |
| 2.407   | Air Products and Chemicals Inc             | 674.388     |
| 2.001   | Home Depot Inc                             | 623.460     |
| 2.567   | Equifax Inc                                | 589.516     |
| 7.237   | Okta Inc Class A                           | 556.349     |
| 2.911   | Analog Devices Inc                         | 554.152     |
| 946     | ServiceNow Inc                             | 532.304     |
| 17.596  | Foot Locker Inc                            | 495.975     |
| 3.300   | JPMorgan Chase & Co                        | 462.000     |
| 5.140   | Floor & Decor Holdings Inc Class A         | 438.044     |
| 6.004   | Mondelez International Inc Class A         | 437.158     |
| 12.041  | Keurig Dr Pepper Inc                       | 431.143     |
| 3.377   | NIKE Inc Class B                           | 414.019     |
| 4.753   | Ashland Inc                                | 411.930     |
| 1.807   | Asbury Automotive Group Inc                | 409.661     |

## US Multi Cap Opportunities – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Käufe insgesamt:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung                    | Kosten US\$ |
|---------|--|-------------|
| 32.000  | Verisk Analytics Inc Class A             | 5.754.651   |
| 36.000  | EOG Resources Inc                        | 3.972.781   |
| 26.000  | Dollar Tree Inc                          | 3.801.155   |
| 53.000  | TransUnion                               | 3.599.869   |
| 19.500  | Avery Dennison Corp                      | 3.289.325   |
| 23.000  | Electronic Arts Inc                      | 2.882.438   |
| 63.000  | Simply Good Foods Co                     | 2.242.428   |
| 7.400   | WD-40 Co                                 | 1.274.002   |
| 8.800   | QUALCOMM Inc                             | 1.139.786   |
| 23.800  | Brookfield Renewable Corp Class A        | 739.217     |
| 2.000   | Nordson Corp                             | 439.280     |
| 16.400  | Graphic Packaging Holding Co             | 383.752     |
| 10.000  | Brookfield Corp                          | 356.606     |
| 10.200  | CSX Corp                                 | 308.244     |
| 3.000   | Westinghouse Air Brake Technologies Corp | 304.388     |
| 3.000   | Walt Disney Co                           | 299.730     |
| 1.000   | Becton Dickinson & Co                    | 248.730     |

## US Multi Cap Opportunities – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung                   | Erlöse US\$ |
|---------|---|-------------|
| 125.000 | Raytheon Technologies Corp              | 12.405.764  |
| 30.000  | Sherwin-Williams Co                     | 6.616.771   |
| 22.500  | HCA Healthcare Inc                      | 6.004.516   |
| 19.000  | Motorola Solutions Inc                  | 5.269.837   |
| 14.000  | Berkshire Hathaway Inc Class B          | 4.480.504   |
| 13.600  | Microsoft Corp                          | 4.278.718   |
| 38.100  | Lamb Weston Holdings Inc                | 3.668.197   |
| 21.000  | Apple Inc                               | 3.488.360   |
| 46.600  | Charles Schwab Corp                     | 3.485.484   |
| 29.300  | Alphabet Inc Class C                    | 3.377.906   |
| 103.825 | Brookfield Asset Management Ltd Class A | 3.256.259   |
| 58.000  | Ball Corp                               | 3.232.886   |
| 76.300  | US Foods Holding Corp                   | 2.978.585   |
| 8.900   | McDonald's Corp                         | 2.570.655   |
| 17.000  | Eagle Materials Inc                     | 2.545.179   |
| 31.000  | Brunswick Corp                          | 2.515.065   |
| 77.000  | CSX Corp                                | 2.452.072   |
| 32.800  | BJ's Wholesale Club Holdings Inc        | 2.447.714   |
| 67.600  | Brookfield Corp                         | 2.438.959   |
| 10.500  | Lowe's Cos Inc                          | 2.253.783   |
| 54.500  | Aramark                                 | 2.216.666   |
| 54.700  | Pfizer Inc                              | 2.196.468   |
| 18.000  | NIKE Inc Class B                        | 2.188.264   |
| 17.000  | Electronic Arts Inc                     | 2.125.875   |
| 19.500  | Columbia Sportswear Co                  | 1.798.961   |
| 25.200  | Mondelez International Inc Class A      | 1.777.591   |
| 11.100  | JPMorgan Chase & Co                     | 1.553.734   |
| 600     | Booking Holdings Inc                    | 1.553.521   |
| 4.500   | Rockwell Automation Inc                 | 1.352.360   |
| 5.200   | Chubb Ltd                               | 1.076.727   |

## US Real Estate Securities – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung           | Kosten US\$ |
|---------|---------------------------------|-------------|
| 431.449 | VICI Properties Inc Class A     | 14.078.187  |
| 18.947  | Equinix Inc                     | 13.608.164  |
| 167.831 | Realty Income Corp              | 10.950.261  |
| 112.964 | Boston Properties Inc           | 6.016.198   |
| 20.055  | Public Storage                  | 5.977.154   |
| 42.259  | Crown Castle Inc                | 5.806.506   |
| 369.287 | Urban Edge Properties           | 5.564.814   |
| 194.043 | Weyerhaeuser Co                 | 5.544.800   |
| 173.837 | Omega Healthcare Investors Inc  | 5.430.868   |
| 70.915  | Equity LifeStyle Properties Inc | 4.614.933   |
| 111.942 | Invitation Homes Inc            | 3.679.237   |
| 176.014 | Kimco Realty Corp               | 3.211.120   |
| 92.903  | Apartment Income REIT Corp      | 3.176.911   |
| 19.798  | Simon Property Group Inc        | 2.105.310   |
| 38.704  | Iron Mountain Inc               | 2.099.220   |
| 5.390   | American Tower Corp             | 1.068.532   |
| 8.706   | Prologis Inc                    | 1.032.556   |
| 7.775   | Welltower Inc                   | 544.997     |
| 1.821   | Essex Property Trust Inc        | 373.529     |
| 7.936   | Ventas Inc                      | 348.956     |

## US Real Estate Securities – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung           | Erlöse US\$ |
|-----------|---------------------------------|-------------|
| 227.876   | Digital Realty Trust Inc        | 21.620.456  |
| 18.456    | Equinix Inc                     | 13.374.713  |
| 106.922   | Prologis Inc                    | 13.312.508  |
| 148.619   | Welltower Inc                   | 11.447.237  |
| 1.022.272 | Medical Properties Trust Inc    | 10.129.056  |
| 34.060    | Public Storage                  | 9.919.245   |
| 44.121    | American Tower Corp             | 8.960.059   |
| 144.312   | Boston Properties Inc           | 8.252.100   |
| 192.153   | Spirit Realty Capital Inc       | 7.495.440   |
| 49.298    | Sun Communities Inc             | 6.729.551   |
| 50.226    | Crown Castle Inc                | 6.426.614   |
| 293.224   | Kimco Realty Corp               | 6.161.930   |
| 96.558    | Equity Residential              | 5.905.107   |
| 87.316    | Realty Income Corp              | 5.466.546   |
| 154.709   | VICI Properties Inc Class A     | 4.953.529   |
| 92.248    | Iron Mountain Inc               | 4.942.814   |
| 78.167    | Rexford Industrial Realty Inc   | 4.860.216   |
| 28.677    | Simon Property Group Inc        | 3.271.434   |
| 14.910    | Essex Property Trust Inc        | 3.270.213   |
| 89.007    | Apartment Income REIT Corp      | 3.212.362   |
| 64.977    | Ventas Inc                      | 3.042.959   |
| 19.032    | Extra Space Storage Inc         | 2.934.099   |
| 86.122    | Invitation Homes Inc            | 2.795.486   |
| 41.244    | Equity LifeStyle Properties Inc | 2.774.434   |
| 10.586    | SBA Communications Corp Class A | 2.726.832   |
| 73.349    | Weyerhaeuser Co                 | 2.267.098   |
| 52.725    | UDR Inc                         | 2.173.132   |
| 86.132    | Healthpeak Properties Inc       | 1.961.986   |

## US Small Cap – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung         | Kosten US\$ |
|---------|-------------------------------|-------------|
| 124.017 | Tidewater Inc                 | 5.422.648   |
| 51.761  | SPX Technologies Inc          | 3.760.323   |
| 57.146  | ESAB Corp                     | 3.346.432   |
| 37.056  | QuidelOrtho Corp              | 3.300.252   |
| 10.346  | Winmark Corp                  | 3.233.668   |
| 134.446 | Stevanato Group SpA           | 3.229.365   |
| 86.557  | Simply Good Foods Co          | 3.189.214   |
| 46.647  | Shift4 Payments Inc Class A   | 3.166.604   |
| 68.436  | Amphastar Pharmaceuticals Inc | 2.795.977   |
| 140.921 | Element Solutions Inc         | 2.759.109   |
| 21.677  | Standex International Corp    | 2.716.293   |
| 142.880 | Oceaneering International Inc | 2.707.215   |
| 90.080  | Sitio Royalties Corp Class A  | 2.300.070   |
| 43.374  | Cactus Inc Class A            | 2.106.133   |
| 51.426  | United Community Banks Inc    | 1.666.692   |
| 22.372  | Arcosa Inc                    | 1.624.008   |
| 13.272  | CRA International Inc         | 1.536.241   |
| 54.313  | Driven Brands Holdings Inc    | 1.502.397   |
| 13.520  | ESCO Technologies Inc         | 1.304.697   |
| 154.803 | Hillman Solutions Corp        | 1.266.969   |
| 6.546   | FTI Consulting Inc            | 1.126.378   |
| 1.282   | Cable One Inc                 | 912.995     |
| 52.118  | Utz Brands Inc                | 880.536     |
| 9.501   | Bio-Techne Corp               | 735.164     |

## US Small Cap – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung                         | Erlöse US\$ |
|---------|---|-------------|
| 92.496  | National Instruments Corp                     | 4.866.670   |
| 8.829   | IDEXX Laboratories Inc                        | 4.283.190   |
| 112.053 | FormFactor Inc                                | 3.479.421   |
| 9.667   | Pool Corp                                     | 3.448.823   |
| 8.790   | West Pharmaceutical Services Inc              | 3.127.762   |
| 16.454  | Manhattan Associates Inc                      | 2.676.070   |
| 13.781  | Quaker Chemical Corp                          | 2.631.491   |
| 24.821  | Church & Dwight Co Inc                        | 2.156.869   |
| 87.331  | Certara Inc                                   | 2.013.263   |
| 12.295  | SPS Commerce Inc                              | 1.970.474   |
| 24.189  | BOK Financial Corp                            | 1.937.681   |
| 12.382  | Novanta Inc                                   | 1.925.858   |
| 23.321  | AAON Inc                                      | 1.905.662   |
| 17.092  | Fox Factory Holding Corp                      | 1.828.267   |
| 10.703  | Jack Henry & Associates Inc                   | 1.562.164   |
| 2.018   | Fair Isaac Corp                               | 1.518.589   |
| 17.974  | Lattice Semiconductor Corp                    | 1.476.902   |
| 27.715  | Matador Resources Co                          | 1.400.454   |
| 7.219   | FTI Consulting Inc                            | 1.360.418   |
| 42.516  | Glacier Bancorp Inc                           | 1.265.671   |
| 8.516   | Lindsay Corp                                  | 1.216.636   |
| 14.427  | Bio-Techne Corp                               | 1.182.549   |
| 29.752  | Bank of Hawaii Corp                           | 1.173.908   |
| 5.892   | WD-40 Co                                      | 1.097.230   |
| 1.924   | Chemed Corp                                   | 1.042.678   |
| 81.444  | CVB Financial Corp                            | 1.030.825   |
| 8.959   | LCI Industries                                | 1.027.582   |
| 11.635  | Power Integrations Inc                        | 1.003.832   |
| 26.596  | Artisan Partners Asset Management Inc Class A | 985.842     |
| 3.012   | MarketAxess Holdings Inc                      | 967.233     |
| 11.181  | Haemonetics Corp                              | 953.483     |



## US Small Cap Intrinsic Value – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung                           | Kosten US\$ |
|---------|---|-------------|
| 161.968 | Kyndryl Holdings Inc                            | 2.321.789   |
| 31.030  | KBR Inc   | 1.727.002   |
| 31.899  | Devon Energy Corp                               | 1.709.446   |
| 51.254  | Criteo SA ADR                                   | 1.596.027   |
| 52.230  | International Game Technology Plc               | 1.361.081   |
| 39.384  | Viasat Inc                                      | 1.336.871   |
| 92.366  | Stratasys Ltd                                   | 1.309.525   |
| 19.825  | MACOM Technology Solutions Holdings Inc Class H | 1.282.298   |
| 25.831  | Ciena Corp                                      | 1.238.792   |
| 13.580  | Ormat Technologies Inc                          | 1.158.628   |
| 27.084  | ODP Corp  | 1.156.926   |
| 15.723  | Acadia Healthcare Co Inc                        | 1.146.069   |
| 6.479   | Avery Dennison Corp                             | 1.139.694   |
| 85.700  | Patterson-UTI Energy Inc                        | 1.105.528   |
| 13.295  | Crown Holdings Inc                              | 1.101.171   |
| 56.948  | Cleveland-Cliffs Inc                            | 1.027.165   |
| 48.226  | Veeco Instruments Inc                           | 988.042     |
| 14.671  | Arcosa Inc                                      | 984.704     |
| 21.604  | Rambus Inc                                      | 942.574     |
| 53.224  | Resideo Technologies Inc                        | 923.321     |
| 129.020 | Under Armour Inc Class C                        | 907.571     |
| 15.702  | AerCap Holdings NV                              | 899.230     |
| 18.024  | TreeHouse Foods Inc                             | 881.620     |
| 3.065   | Molina Healthcare Inc                           | 866.333     |
| 42.413  | Cannae Holdings Inc                             | 856.781     |
| 20.254  | Mercury Systems Inc                             | 845.898     |
| 51.966  | Banc of California Inc                          | 844.961     |
| 19.721  | AtriCure Inc                                    | 844.046     |
| 82.977  | Lions Gate Entertainment Corp Class B           | 813.135     |
| 49.982  | Hain Celestial Group Inc                        | 810.920     |
| 32.770  | Vistra Corp                                     | 806.756     |
| 9.517   | Wix.com Ltd                                     | 782.952     |
| 10.085  | New Relic Inc                                   | 741.821     |
| 204.290 | Conduent Inc                                    | 738.076     |
| 90.757  | ZimVie Inc                                      | 722.757     |
| 57.542  | Huntington Bancshares Inc                       | 704.158     |
| 12.500  | Texas Capital Bancshares Inc                    | 691.811     |
| 16.785  | Integra LifeSciences Holdings Corp              | 677.058     |
| 46.081  | TechnipFMC Plc                                  | 647.833     |
| 7.918   | Haemonetics Corp                                | 639.139     |
| 21.434  | Patterson Cos Inc                               | 633.003     |
| 14.058  | Stericycle Inc                                  | 630.074     |
| 44.754  | OPENLANE Inc                                    | 629.107     |

## US Small Cap Intrinsic Value – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Verkäufe insgesamt:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung                   | Erlöse US\$ |
|---------|---|-------------|
| 75.634  | Rambus Inc                              | 3.333.645   |
| 21.289  | KBR Inc                                 | 1.260.292   |
| 22.957  | Tempur Sealy International Inc Class I  | 966.306     |
| 48.162  | Cardiovascular Systems Inc              | 961.335     |
| 27.243  | Spirit AeroSystems Holdings Inc Class A | 942.202     |
| 9.790   | Haemonetics Corp                        | 830.418     |
| 72.094  | Sunstone Hotel Investors Inc            | 697.313     |
| 2.164   | Clean Harbors Inc                       | 293.071     |
| 114.241 | Diebold Nixdorf Inc                     | 268.147     |

# ANMERKUNGEN ZUM UNGEPRÜFTEN VERKÜRZTEN HALBJAHRESABSCHLUSS

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

### 1. WESENTLICHE BILANZIERUNGSGRUNDSÄTZE

Die wesentlichen von Neuberger Berman Investment Funds plc (der „Fonds“) angewandten Bilanzierungsgrundsätze sind im Folgenden beschrieben:

#### Grundlage für die Aufstellung des Abschlusses

Der vorliegende Abschluss ist ein ungeprüfter verkürzter Halbjahresabschluss für den Sechsmonatszeitraum zum 30. Juni 2023. Er wurde gemäß dem vom Financial Reporting Council („FRC“) veröffentlichten Financial Reporting Standard („FRS“) 104: 'Zwischenberichterstattung' erstellt. Der verkürzte, nicht geprüfte Zwischenabschluss muss zusammen mit dem Jahresabschluss für das Geschäftsjahr bis 31. Dezember 2022, der in Übereinstimmung mit den in Irland allgemein anerkannten Bilanzierungsgrundsätzen, der irischen Gesetzgebung, die den Companies Act 2014, in ihrer jeweils gültigen Fassung, die European Communities (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations, 2011, in ihrer jeweils gültigen Fassung und den Central Bank (Supervision and Enforcement) Act 2013 (Section 48(1)) (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations 2019 (die „OGAW-Vorschriften der Central Bank“) umfasst, gelesen werden. Er wurde gemäß dem vom Financial Reporting Council („FRC“) veröffentlichten FRS 102: „The financial reporting standard applicable in the UK and Republic of Ireland“ erstellt. Die in Irland allgemein anerkannten, ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild vermittelnden Bilanzierungsgrundsätze für die Erstellung von Abschlüssen sind diejenigen, die vom Institute of Chartered Accountants in Irland veröffentlicht und vom FRC herausgegeben worden sind.

Der Abschluss wird nach dem Anschaffungskostenprinzip erstellt, berichtigt um die erfolgswirksame Neubewertung finanzieller Vermögenswerte und finanzieller Verbindlichkeiten zum beizulegenden Zeitwert. Bewertungszeitpunkt ist Marktschluss am jeweiligen Handelstag. Der Handelstag ist jeder Geschäftstag oder sonstige Tag, den die Direktoren festlegen und der Verwaltungsstelle und den Anteilhabern im Voraus mitteilen. Das Direktorium hat die Fähigkeit des Fonds zur weiteren Unternehmensfortführung bewertet und hat sich vergewissert, dass der Fonds über die Ressourcen verfügt, um seine Geschäfte auf absehbare Zeit und für mindestens zwölf Monate ab dem Datum der Genehmigung dieses Abschlusses fortzuführen. Ferner sind den Direktoren keine wesentlichen Unsicherheiten bekannt, die erhebliche Zweifel an der Fähigkeit des Fonds zur Unternehmensfortführung wecken könnten. Der Abschluss wird daher auf der Grundlage der Unternehmensfortführung aufgestellt.

Das Format und bestimmte Passagen des Wortlauts des Abschlusses weichen in bestimmten Punkten von den im Companies Act von 2014 (in ihrer geltenden Fassung) und FRS 102 enthaltenen ab, so dass sie nach Auffassung der Direktoren den Charakter des Geschäfts des Fonds als Investmentfonds besser widerspiegeln. Der Fonds erfüllt die entsprechenden Kriterien, um von der für bestimmte offene Investmentgesellschaften nach FRS 102 möglichen Befreiung von der Erstellung einer Kapitalflussrechnung Gebrauch zu machen.

#### Ausschüttungspolitik

Die Direktoren haben beschlossen, sämtliche Nettoerträge und realisierten Nettokapitalgewinne, die den thesaurierenden Klassen zuzurechnen sind, wiederanzulegen, und sie beabsichtigen daher nicht, für Anteile dieser Klassen Dividenden festzusetzen.

#### Quelle der Ausschüttungen

Satzungsgemäß können die Direktoren Dividenden auf Anteile aus den Nettoerträgen (einschließlich Dividendenerträge und Zinserträge) und/oder dem Überschuss aus realisierten und nicht realisierten Gewinnen nach Abzug der realisierten und nicht realisierten Verluste aus den Anlagen des Fonds (gemeinsam „Nettoertrag“) und auch aus dem Kapital beschließen. Dividenden, die aus dem Kapital gezahlt werden, kommen einer Rückzahlung oder Entnahme eines Teils der ursprünglichen Anlage eines Anteilhabers oder aus Kapitalerträgen, die dieser ursprünglichen Anlage zuzurechnen sind, gleich. Solche Dividenden können unmittelbar zu einem Rückgang des NIW der betreffenden Anteile führen.

Die Direktoren beabsichtigen derzeit, vorbehaltlich einer „de-minimis“-Grenze, mindestens 85 % der Nettoerträge, die jeder ausschüttenden Klasse zurechenbar sind, als Dividende festzusetzen und auszuschütten; ausgenommen sind hiervon (i) die (wöchentlich) ausschüttenden Klassen, (ii) die (monatlich) ausschüttenden Klassen, (iii) die (CG) ausschüttenden Klassen und (iv) alle sonstigen ausschüttenden Klassen in einem Portfolio, die laut dem maßgeblichen Prospektzusatz Dividenden aus Kapital und Nettoertrag ausschütten. Die Anteilhaber sollten jedoch beachten, dass die Direktoren sich in Bezug auf eine ausschüttende Klasse in ihrem eigenen Ermessen für oder gegen eine solche Festsetzung und Ausschüttung entscheiden können.

Im Bezug auf die monatlich ausschüttenden Klassen, die wöchentlich ausschüttenden Klassen und die (CG) ausschüttenden Klassen beabsichtigen die Direktoren, eine den Anteilen dieser Klassen zuweisbare, (wie zutreffend) monatliche, wöchentliche oder halbjährliche Dividende festzusetzen und zu zahlen; dies geschieht durch eine Kombination aus Nettoertrag und Kapital, so dass, falls der Nettoertrag für den entsprechenden Zeitraum weniger als der festgesetzte Betrag ist, die Differenz aus dem die betreffenden Anteile repräsentierenden Kapital gezahlt wird, was es den Klassen ermöglicht, regelmäßige, feste Dividenden auszuschütten. Falls die Nettoeinkünfte, die den (wöchentlich) ausschüttenden Klassen, den (monatlich) ausschüttenden Klassen oder den (CG) ausschüttenden Klassen zuschreiben sind, den Betrag übersteigen, der während des entsprechenden Zeitraums erklärt wurde, wird der Betrag der Nettoeinkünfte, der diesen Betrag übersteigt, in einem Ausschüttungskonto für die jeweiligen Anteile gehalten und bildet Teil der Dividende, die für spätere Ausschüttungszeiträume zu zahlen ist. Vorstehendes gibt die derzeitige Absicht der Direktoren bezüglich der Festsetzung und Zahlung von Dividenden für die (monatlich) ausschüttenden Klassen und die (wöchentlich) ausschüttenden Klassen wieder. Die Direktoren können sich jedoch in ihrem eigenen Ermessen gegen eine solche Festsetzung und Zahlung entscheiden, und es gibt keine Garantie dafür, dass solche Dividenden gezahlt werden.

**FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023****1. WESENTLICHE BILANZIERUNGSGRUNDSÄTZE (FORTSETZUNG)****Ausschüttungspolitik (Fortsetzung)***Ausschüttungshäufigkeit*

Unter normalen Umständen beabsichtigen die Direktoren, die Dividenden wie folgt zu zahlen:

- (a) Bei allen (wöchentlich) ausschüttenden Klassen in allen Portfolios werden Dividenden am oder vor dem letzten Geschäftstag einer jeden Woche erklärt und gezahlt;
- (b) Bei allen (monatlich) ausschüttenden Klassen in allen Portfolios werden Dividenden am oder vor dem letzten Geschäftstag eines jeden Monats festgesetzt und drei Geschäftstage später gezahlt;
- (c) bei allen (CG) ausschüttenden Klassen aller Portfolios ist beabsichtigt, dass etwaige Dividenden auf halbjährlicher Basis festgesetzt und innerhalb von dreißig Geschäftstagen gezahlt werden;
- (d) bei allen anderen ausschüttenden Klassen des China Bond, des Euro Bond Absolute Return, des Euro Opportunistic Bond, des Global Equity Megatrends und des Ultra Short Term Euro Bond werden Dividenden vierteljährlich erklärt und innerhalb von dreißig Geschäftstagen in Bezug auf den Nettoertrag der ausschüttenden Klassen für das vorhergehende Quartal gezahlt;
- (e) bei jeder der ausschüttenden Klassen des CLO Income, des Commodities, des Corporate Hybrid Bond, the Emerging Market Debt - Hard Currency, the Emerging Market Debt - Local Currency, des Emerging Market Debt Blend, des Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend, des European High Yield Bond, des Event Driven, des Global Bond, des Global Diversified Income FMP – 2024, des Global Flexible Credit Income, des Global High Yield SDG Engagement, des Global Investment Grade Credit, des Global Opportunistic Bond, des Global Real Estate Securities, des High Yield Bond, des Multi-Asset Income, des Short Duration Emerging Market Debt, des Short Duration High Yield SDG Engagement, des Strategic Income, des Sustainable Asia High Yield, des Sustainable Emerging Market Corporate Debt, des Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency, des Tactical Macro, des US Equity Index PutWrite und des US Real Estate Securities werden Dividenden vierteljährlich erklärt und innerhalb von dreißig Geschäftstagen gezahlt;
- (f) bei allen anderen ausschüttenden Klassen des US Long Short Equity ist beabsichtigt, dass etwaige Dividenden halbjährlich erklärt und innerhalb von dreißig Geschäftstagen gezahlt werden;
- (g) Ausschüttungen der anderen ausschüttenden Klassen des Next Generation Space Economy, des Uncorrelated Strategies, des US Equity, des US Large Cap Value, des US Multi Cap Opportunities, des US Small Cap und des US Small Cap Intrinsic Value werden jährlich erklärt und innerhalb von dreißig Geschäftstagen gezahlt;
- (h) bei allen anderen ausschüttenden Klassen aller anderen Portfolios ist beabsichtigt, dass etwaige Dividenden auf jährlicher Basis festgesetzt und innerhalb von dreißig Geschäftstagen in Bezug auf den Nettoertrag der ausschüttenden Klassen für das am vorhergehenden 31. Dezember abgelaufene Kalenderjahr gezahlt werden;
- (i) Bei allen (monatlich) Bruttoerträge ausschüttenden Klassen in den Portfolios werden Dividenden am oder vor dem letzten Geschäftstag eines jeden Monats festgesetzt und innerhalb von drei Geschäftstagen gezahlt; und
- (j) bei allen übrigen (Brutto-)Erträge ausschüttenden Klassen in den Portfolios werden Dividenden auf vierteljährlicher Basis festgesetzt und innerhalb von dreißig Geschäftstagen gezahlt.

Unter dem Vorbehalt, dass Erträge zur Ausschüttung zur Verfügung stehen, können die Direktoren auch beschließen, für jede der ausschüttenden Klassen Zwischendividenden festzusetzen und auszuschütten. Alle Anteile einer ausschüttenden Klasse, die an einem Datum, an dem die Direktoren beschließen, für diese ausschüttende Klasse eine Dividende festzusetzen, ausgegeben sind, haben Anspruch auf diese Dividende.

Die Direktoren behalten sich das Recht vor, die Dividendenpolitik jeder Anteilklasse nach ihrem eigenen Ermessen ohne vorherige Mitteilung an die Anteilinhaber der betreffenden Klasse zu ändern. Jede Dividende, die nicht innerhalb eines Zeitraums von sechs Jahren ab dem Datum des Dividendenbeschlusses in Anspruch genommen wird, verjährt und fällt dem jeweiligen Portfolio wieder zu.

**FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023****2. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE**

Alle Kassenbestände werden bei Brown Brothers Harriman & Co. oder bei vom Fonds genehmigten Drittinstituten als Tagesgeldeinlagen oder direkt bei einer Unterdepotbank gehalten.

Einige der Kassenbestände des Fonds werden gemäß den Leitlinien der Central Bank of Ireland mit dem Titel „Umbrella Funds – Cash Accounts Holding Subscription, Redemption and Dividend Monies“ (Kassenbestände mit Zeichnungs- Rücknahme- und Ausschüttungsgeldern) von der Verwaltungsstelle im Auftrag des Fonds gehalten. Derlei Konten für Kassenbestände sind dazu gedacht, nicht abgewickelte Zeichnungsgelder von Anlegern, an Anleger zahlbare Rücknahmegelder und/oder sonstige an Anleger fällige Beträge zu halten. Zum 30. Juni 2023 beliefen sich die Gelder in diesen Konten auf 968.313 US\$ (31. Dezember 2022: 1.424.081 US\$). Jegliche zum Ende des Berichtszeitraums auf diesen Barkonten gehaltenen Gelder werden in den Gesamtbilanzen des Fonds ausgewiesen.

**3. KONTENÜBERZIEHUNG**

Per 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022 werden alle in der Bilanz ausgewiesenen Überziehungskredite bei Brown Brothers Harriman & Co. gehalten.

**4. ANTEILKAPITAL**

Das genehmigte Anteilkapital des Fonds beträgt 500.000.040.000 nennwertlose Anteile und besteht aus 40.000 Zeichneranteilen ohne Nennwert sowie 500.000.000.000 gewinnberechtigten Anteilen ohne Nennwert. Die Direktoren sind befugt, bis zu 500.000.000.000 nennwertlose Anteile des Fonds zu den von ihnen für geeignet erachteten Konditionen auszugeben.

Der Fonds ist aufgrund seiner Fähigkeit, Anteile auf Aufforderung auszugeben und zurückzunehmen, eine Investmentgesellschaft mit variablem Kapital. Das Anteilkapital des Fonds ist in verschiedene Anteilsserien aufgeteilt, wobei jede Anteilsserie ein separates Investmentportfolio mit Vermögenswerten darstellt. Die Portfolios verwalten Kapital in Übereinstimmung mit den OGAW-Vorschriften und den Anlagezielen und der Anlagepolitik, die für solch ein Portfolio gelten und im vorliegenden Prospekt und jeweiligen Nachtrag des Portfolios festgelegt sind. Die Portfolios unterliegen keinen extern vorgeschriebenen Kapitalerfordernissen. Während die Portfolios in übertragbare Wertpapiere und andere liquide Finanzanlagen investieren, verfolgt der Manager auch einen angemessenen Prozess zur Überwachung des Liquiditätsrisikos, der die von den Portfolios eingesetzten Transaktionen für ein effizientes Portfoliomanagement berücksichtigt, um sicherzustellen, dass jedes Portfolio in der Lage ist, die angegebenen Bedingungen bei Anteilsrücknahmen zu erfüllen.

Um potenzielle Liquiditätsrisiken zu mindern, passt der Manager seine Kontrollen an die verschiedenen Anlagestrategien, Liquiditätsbedingungen und das Kundenverhalten in der Vergangenheit an. Als Teil der Risikoüberwachung kann der Manager auf verschiedene Liquiditätstests zurückgreifen, deren Ergebnisse zahlreiche Lösungen bedingen können, darunter eine Anpassung der Zusammensetzung der Vermögenswerte, die Inanspruchnahme von Überziehungs- oder Kreditfazilitäten oder anderer geeigneter Maßnahmen, um ein hinlängliches Liquiditätsniveau sicherzustellen. Alle Vereinbarungen auf Portfolioebene werden von der Risikofunktion des Managers, den Portfoliomanagern des betreffenden Portfolios, dem Chief Investment Officer des Managers sowie den Direktoren des Managers und den Direktoren der Gesellschaft überprüft. Das Risikoteam des Managers führt regelmäßig Portfoliostresstests im Kontext der Zusammensetzung des jeweiligen Portfolios und der aktuellen/potenziellen Marktbedingungen durch. Dabei werden Stressszenarien mit verschiedenen hypothetischen Rücknahmeniveaus durchgespielt und die Fähigkeit der Portfolios bewertet, Rücknahmeanträge auf diesen Niveaus auf ordnungsgemäße Weise zu erfüllen. Sollte die Analyse ergeben, dass eines der Portfolios eine niedrige Liquiditätsdeckungsquote aufweist, werden Rücksprachen seitens des Risikoteams des Managers und des Portfolioteams gehalten und relevante Schritte unternommen, um die damit verbundenen Risiken zu bewerten und auf bestmögliche Weise zu verringern. Ferner werden auf Tagesbasis die Liquiditätspuffer im Rahmen der Berichterstattung überwacht, um das Liquiditätsrisiko eines jeden Portfolios zu erfassen. Abgesehen davon werden die Marktliquidität betreffende Faktoren überwacht, um diesbezügliche potenzielle Anomalien zu erfassen.

Am 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022 waren 2 Zeichneranteile ausgegeben. Die Zeichneranteile berechtigen die Inhaber zur Teilnahme und Abstimmung auf Hauptversammlungen des Fonds, berechtigen die Inhaber jedoch nicht am Gewinn oder am Vermögen des Fonds zu partizipieren, mit Ausnahme einer Kapitalrückzahlung im Falle einer Liquidation. Die gewinnberechtigten Anteile ermächtigen die Inhaber zur Teilnahme und Stimmabgabe bei Hauptversammlungen des Fonds sowie zur Beteiligung an den Gewinnen und den Vermögenswerten des Fonds.

Die Zeichneranteile werden wie folgt gehalten:

| <b>Name des Anteilinhabers</b>  | <b>Anzahl der Anteile</b> |
|---------------------------------|---------------------------|
| Matsack Nominees Limited        | 1                         |
| Neuberger Berman Europe Limited | 1                         |

Die Mindestzeichnungs- und Rücknahmegrenzen für jeden Teilfonds finden sich im Verkaufsprospekt des Fonds.

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 5. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE

Der Manager hat für jede Klasse Anspruch auf eine Gebühr in Bezug auf Managementdienste, die er für jedes Portfolio erbringt (die „Managementgebühr“). Darüber hinaus hat der Manager Anspruch auf eine Gebühr von 0,025 % in Bezug auf die von ihm der Gesellschaft bereitgestellten administrativen Supportdienste.

Die maximale jährliche Gebühr, die der Gesellschaft in Bezug auf ein Portfolio in Rechnung gestellt wird, beträgt 2,5 % seines NIW. Die aktuelle Managementgebühr, die in Bezug auf jedes Portfolio zahlbar ist, wird im betreffenden Nachtrag veröffentlicht. Die aktuellen Sätze für die Managementgebühr der einzelnen Anlageklassen sind nachstehend aufgeführt.

Die Managementgebühr läuft täglich auf und ist monatlich rückwirkend am Ende eines jeden Kalendermonats zahlbar. Sofern im Nachtrag des betreffenden Portfolios keine anders lautenden Angaben gemacht werden, bezahlt der Manager die in Bezug auf ein Portfolio bestellten Sub-Investment-Manager oder Anlageberater aus seiner Managementgebühr. Der Manager hat ferner Anspruch auf Erstattung aller Spesen durch die Gesellschaft, die ihm (oder seinen Beauftragten) bei der Erfüllung seiner (ihrer) Pflichten entstehen, und zahlt diese erstatteten Spesen an den jeweiligen Dienstleister.

| 5G Connectivity                                       | Management-<br>gebühr | Asian Debt - Hard Currency (Fortsetzung)                         | Management-<br>gebühr |
|---|-----------------------|--|-----------------------|
| Thesaurierende Klasse AUD A                           | 1,70 %                | Ausschüttende Klasse USD I                                       | 0,60 %                |
| Thesaurierende Klasse CNY A                           | 1,70 %                | Thesaurierende Klasse USD I4                                     | 0,36 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR A                           | 1,70 %                | Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich)                          | 0,36 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert) | 1,70 %                | Thesaurierende Klasse USD M                                      | 1,20 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR I                           | 0,85 %                | Thesaurierende Klasse USD X                                      | 1,10 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) | 0,85 %                | Ausschüttende Klasse USD X (Monatlich)                           | 1,10 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR I5                          | 0,43 %                | Thesaurierende Klasse USD Z                                      | 0,00 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) | 1,70 %                |  |                       |
| Thesaurierende Klasse GBP A                           | 1,70 %                | <b>China A-Share Equity</b>                                      |                       |
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | 0,85 %                | Thesaurierende Klasse CNY I                                      | 0,90 %                |
| Thesaurierende Klasse HKD A                           | 1,70 %                | Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)            | 0,90 %                |
| Thesaurierende Klasse SGD A                           | 1,70 %                | Ausschüttende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)             | 0,90 %                |
| Thesaurierende Klasse USD A                           | 1,70 %                |  |                       |
| Thesaurierende Klasse USD E                           | 1,80 %                | <b>China Bond</b>  |                       |
| Thesaurierende Klasse USD I                           | 0,85 %                | Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)                           | 1,30 %                |
| Ausschüttende Klasse USD I                            | 0,85 %                | Ausschüttende Klasse CNY I                                       | 0,65 %                |
| Thesaurierende Klasse USD I2                          | 0,68 %                | Thesaurierende Klasse CNY Z                                      | 0,00 %                |
| Thesaurierende Klasse USD I3                          | 0,60 %                | Thesaurierende Klasse GBP I2                                     | 0,52 %                |
| Thesaurierende Klasse USD I5                          | 0,43 %                | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) (nicht währungsgesichert) | 1,30 %                |
| Thesaurierende Klasse USD M                           | 1,70 %                | Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)            | 0,65 %                |
| Thesaurierende Klasse USD Z                           | 0,00 %                | Thesaurierende Klasse USD Z                                      | 0,00 %                |
| Thesaurierende Klasse ZAR A                           | 1,70 %                | Thesaurierende Klasse USD Z (nicht währungsgesichert)            | 0,00 %                |
| Thesaurierende Klasse ZAR E                           | 1,80 %                |  |                       |
|   |                       | <b>China Equity</b>  |                       |
| <b>Asian Debt - Hard Currency</b>                     |                       | Thesaurierende Klasse CHF I                                      | 1,10 %                |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)                | 1,20 %                | Thesaurierende Klasse EUR A                                      | 1,85 %                |
| Thesaurierende Klasse USD A                           | 1,20 %                | Thesaurierende Klasse EUR I                                      | 1,10 %                |
| Thesaurierende Klasse USD C1                          | 1,20 %                | Thesaurierende Klasse EUR Z                                      | 0,00 %                |
| Thesaurierende Klasse USD I                           | 0,60 %                | Ausschüttende Klasse GBP A                                       | 1,85 %                |

FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

5. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

| China Equity (Fortsetzung)                            | Management-<br>gebühr |
|---|-----------------------|
| Thesaurierende Klasse SGD A                           | 1,85 %                |
| Thesaurierende Klasse USD A                           | 1,85 %                |
| Ausschüttende Klasse USD A                            | 1,85 %                |
| Thesaurierende Klasse USD I                           | 1,10 %                |
| Thesaurierende Klasse USD I2                          | 0,88 %                |
| Thesaurierende Klasse USD M                           | 1,85 %                |
| Thesaurierende Klasse USD U                           | 1,45 %                |
| Thesaurierende Klasse USD Z                           | 0,00 %                |
| <b>CLO Income</b>                                     |                       |
| Thesaurierende Klasse EUR A                           | 1,50 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR I                           | 0,75 %                |
| Ausschüttende Klasse EUR I2                           | 0,60 %                |
| Ausschüttende Klasse GBP I2                           | 0,60 %                |
| Thesaurierende Klasse GBP Z                           | 0,00 %                |
| Thesaurierende Klasse SEK I                           | 0,75 %                |
| Thesaurierende Klasse USD A                           | 1,50 %                |
| Thesaurierende Klasse USD I                           | 0,75 %                |
| Ausschüttende Klasse USD I2                           | 0,60 %                |
| Ausschüttende Klasse USD I5                           | 0,38 %                |
| Thesaurierende Klasse USD Z                           | 0,00 %                |
| <b>Commodities</b>                                    |                       |
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | 0,65 %                |
| Thesaurierende Klasse GBP I5                          | 0,33 %                |
| Thesaurierende Klasse USD A                           | 1,40 %                |
| Thesaurierende Klasse USD I                           | 0,65 %                |
| Thesaurierende Klasse USD I5                          | 0,33 %                |
| Thesaurierende Klasse USD M                           | 1,40 %                |
| Thesaurierende Klasse USD Z                           | 0,00 %                |
| <b>Corporate Hybrid Bond</b>                          |                       |
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)                | 1,20 %                |
| Thesaurierende Klasse CHF P                           | 0,57 %                |
| Ausschüttende Klasse CHF P                            | 0,57 %                |
| Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)                | 1,20 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR A                           | 1,20 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR I                           | 0,60 %                |
| Ausschüttende Klasse EUR I                            | 0,60 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR I2                          | 0,48 %                |
| Ausschüttende Klasse EUR I2                           | 0,48 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR I3                          | 0,42 %                |

| Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)                    | Management-<br>gebühr |
|--|-----------------------|
| Thesaurierende Klasse EUR I5                           | 0,30 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR M                            | 1,20 %                |
| Ausschüttende Klasse EUR M                             | 1,20 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR P                            | 0,57 %                |
| Ausschüttende Klasse EUR P                             | 0,57 %                |
| Thesaurierende Klasse GBP I                            | 0,60 %                |
| Thesaurierende Klasse GBP I2                           | 0,48 %                |
| Ausschüttende Klasse GBP I2                            | 0,48 %                |
| Thesaurierende Klasse GBP P                            | 0,57 %                |
| Ausschüttende Klasse GBP P                             | 0,57 %                |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)                 | 1,20 %                |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)                 | 1,20 %                |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 1,20 %                |
| Ausschüttende Klasse USD A                             | 1,20 %                |
| Thesaurierende Klasse USD C1                           | 1,20 %                |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 0,60 %                |
| Ausschüttende Klasse USD I                             | 0,60 %                |
| Thesaurierende Klasse USD I2                           | 0,48 %                |
| Ausschüttende Klasse USD I2                            | 0,48 %                |
| Thesaurierende Klasse USD M                            | 1,20 %                |
| Ausschüttende Klasse USD M                             | 1,20 %                |
| Thesaurierende Klasse USD P                            | 0,57 %                |
| Thesaurierende Klasse USD Z                            | 0,00 %                |
| <b>Emerging Market Debt - Hard Currency</b>            |                       |
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)                 | 1,40 %                |
| Ausschüttende Klasse AUD I                             | 0,70 %                |
| Thesaurierende Klasse CAD I3 (nicht währungsgesichert) | 0,49 %                |
| Thesaurierende Klasse CHF I2                           | 0,56 %                |
| Thesaurierende Klasse CHF P                            | 0,67 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)  | 0,70 %                |
| Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)                 | 1,40 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR A                            | 1,40 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR I                            | 0,70 %                |
| Ausschüttende Klasse EUR I                             | 0,70 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR I2                           | 0,56 %                |
| Ausschüttende Klasse EUR I2                            | 0,56 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR I3                           | 0,49 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert) | 0,49 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR I4                           | 0,42 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert) | 0,35 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR M                            | 1,40 %                |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 5. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

| <b>Emerging Market Debt - Hard Currency<br/>(Fortsetzung)</b> | <b>Management-<br/>gebühr</b> | <b>Emerging Market Debt - Local Currency<br/>(Fortsetzung)</b> | <b>Management-<br/>gebühr</b> |
|---|-------------------------------|--|-------------------------------|
| Ausschüttende Klasse EUR M                                    | 1,40 %                        | Thesaurierende Klasse GBP I                                    | 0,75 %                        |
| Thesaurierende Klasse EUR P                                   | 0,67 %                        | Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)         | 0,45 %                        |
| Thesaurierende Klasse EUR Z                                   | 0,00 %                        | Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)          | 0,45 %                        |
| Thesaurierende Klasse GBP I                                   | 0,70 %                        | Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)          | 0,36 %                        |
| Ausschüttende Klasse GBP I                                    | 0,70 %                        | Thesaurierende Klasse SEK A                                    | 1,50 %                        |
| Thesaurierende Klasse GBP I2                                  | 0,56 %                        | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)                         | 1,50 %                        |
| Ausschüttende Klasse GBP I2                                   | 0,56 %                        | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)                         | 1,50 %                        |
| Thesaurierende Klasse GBP P                                   | 0,67 %                        | Thesaurierende Klasse USD A                                    | 1,50 %                        |
| Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)                        | 1,40 %                        | Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich)                         | 1,80 %                        |
| Thesaurierende Klasse JPY I                                   | 0,70 %                        | Thesaurierende Klasse USD B                                    | 1,80 %                        |
| Thesaurierende Klasse SEK A                                   | 1,40 %                        | Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich)                        | 1,80 %                        |
| Thesaurierende Klasse SEK I2                                  | 0,56 %                        | Thesaurierende Klasse USD C2                                   | 1,80 %                        |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)                        | 1,40 %                        | Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich)                         | 1,80 %                        |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)                        | 1,40 %                        | Thesaurierende Klasse USD E                                    | 1,80 %                        |
| Thesaurierende Klasse USD A                                   | 1,40 %                        | Thesaurierende Klasse USD I                                    | 0,75 %                        |
| Ausschüttende Klasse USD A                                    | 1,40 %                        | Ausschüttende Klasse USD I                                     | 0,75 %                        |
| Thesaurierende Klasse USD C1                                  | 1,40 %                        | Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)                         | 0,75 %                        |
| Thesaurierende Klasse USD I                                   | 0,70 %                        | Thesaurierende Klasse USD I2                                   | 0,60 %                        |
| Ausschüttende Klasse USD I                                    | 0,70 %                        | Thesaurierende Klasse USD I5                                   | 0,38 %                        |
| Thesaurierende Klasse USD I2                                  | 0,56 %                        | Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)                         | 1,80 %                        |
| Ausschüttende Klasse USD I2                                   | 0,56 %                        | Thesaurierende Klasse USD T                                    | 1,80 %                        |
| Ausschüttende Klasse USD I3                                   | 0,49 %                        | Thesaurierende Klasse USD X                                    | 0,38 %                        |
| Thesaurierende Klasse USD M                                   | 1,40 %                        | Thesaurierende Klasse USD Y                                    | 0,36 %                        |
| Ausschüttende Klasse USD M                                    | 1,40 %                        | Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich)                         | 1,80 %                        |
| Thesaurierende Klasse USD P                                   | 0,67 %                        | Thesaurierende Klasse ZAR B                                    | 1,80 %                        |
| Thesaurierende Klasse USD X                                   | 0,47 %                        | Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich)                        | 1,80 %                        |
| Thesaurierende Klasse USD Z                                   | 0,00 %                        | Thesaurierende Klasse ZAR C2                                   | 1,80 %                        |
|   |                               | Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)                         | 1,80 %                        |
|   |                               | Thesaurierende Klasse ZAR E                                    | 1,80 %                        |
|   |                               | Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)                         | 1,80 %                        |
|   |                               | Thesaurierende Klasse ZAR T                                    | 1,80 %                        |
|   |                               |  |                               |
|   |                               | <b>Emerging Market Debt Blend</b>                              |                               |
|   |                               | Ausschüttende Klasse AUD I3                                    | 0,49 %                        |
|   |                               | Thesaurierende Klasse EUR A                                    | 1,40 %                        |
|   |                               | Thesaurierende Klasse EUR I                                    | 0,70 %                        |
|   |                               | Ausschüttende Klasse EUR I                                     | 0,70 %                        |
|   |                               | Thesaurierende Klasse EUR I2                                   | 0,56 %                        |
|   |                               | Ausschüttende Klasse EUR I2                                    | 0,56 %                        |
|   |                               | Ausschüttende Klasse EUR I3                                    | 0,49 %                        |
|   |                               | Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)         | 0,42 %                        |
|   |                               | Thesaurierende Klasse EUR I5                                   | 0,35 %                        |
|   |                               | Thesaurierende Klasse EUR M                                    | 1,40 %                        |
|   |                               |  |                               |
| <b>Emerging Market Debt - Local Currency</b>                  |                               |  |                               |
| Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich)                        | 1,80 %                        |  |                               |
| Thesaurierende Klasse AUD B                                   | 1,80 %                        |  |                               |
| Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich)                       | 1,80 %                        |  |                               |
| Thesaurierende Klasse AUD C2                                  | 1,80 %                        |  |                               |
| Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)                        | 1,80 %                        |  |                               |
| Thesaurierende Klasse AUD E                                   | 1,80 %                        |  |                               |
| Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)                        | 1,80 %                        |  |                               |
| Thesaurierende Klasse AUD T                                   | 1,80 %                        |  |                               |
| Thesaurierende Klasse EUR A                                   | 1,50 %                        |  |                               |
| Thesaurierende Klasse EUR I                                   | 0,75 %                        |  |                               |
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)         | 0,75 %                        |  |                               |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungsgesichert)        | 0,60 %                        |  |                               |
| Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)         | 0,45 %                        |  |                               |
| Thesaurierende Klasse EUR Y (nicht währungsgesichert)         | 0,36 %                        |  |                               |



FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

5. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

| Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)              | Management-<br>gebühr |
|---|-----------------------|
| Ausschüttende Klasse EUR M                            | 1,40 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR Z                           | 0,00 %                |
| Thesaurierende Klasse GBP I                           | 0,70 %                |
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | 0,70 %                |
| Ausschüttende Klasse GBP I                            | 0,70 %                |
| Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)  | 0,70 %                |
| Thesaurierende Klasse GBP P                           | 0,67 %                |
| Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) | 0,67 %                |
| Thesaurierende Klasse GBP Z                           | 0,00 %                |
| Thesaurierende Klasse NOK U                           | 1,05 %                |
| Thesaurierende Klasse SEK A                           | 1,40 %                |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)                | 1,40 %                |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)                | 1,40 %                |
| Thesaurierende Klasse USD A                           | 1,40 %                |
| Thesaurierende Klasse USD C1                          | 1,40 %                |
| Thesaurierende Klasse USD I                           | 0,70 %                |
| Ausschüttende Klasse USD I                            | 0,70 %                |
| Ausschüttende Klasse USD I2                           | 0,56 %                |
| Thesaurierende Klasse USD I3                          | 0,49 %                |
| Thesaurierende Klasse USD M                           | 1,40 %                |
| Ausschüttende Klasse USD M                            | 1,40 %                |
| Thesaurierende Klasse USD Z                           | 0,00 %                |

**Emerging Market Debt Sustainable  
Investment Grade Blend**

|                              |        |
|------------------------------|--------|
| Thesaurierende Klasse AUD I2 | 0,48 % |
| Thesaurierende Klasse NOK I  | 0,60 % |
| Thesaurierende Klasse USD I  | 0,60 % |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 0,48 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z  | 0,00 % |

**Emerging Markets Equity**

|  |        |
|--|--------|
| Thesaurierende Klasse AUD B                          | 2,00 % |
| Thesaurierende Klasse AUD C2                         | 2,00 % |
| Thesaurierende Klasse AUD E                          | 2,00 % |
| Thesaurierende Klasse AUD T                          | 2,00 % |
| Ausschüttende Klasse CAD I (nicht währungsgesichert) | 1,00 % |
| Ausschüttende Klasse CAD I2                          | 0,80 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I                          | 1,00 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M                          | 2,00 % |
| Thesaurierende Klasse EUR Z                          | 0,00 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I                          | 1,00 % |

| Emerging Markets Equity (Fortsetzung) | Management-<br>gebühr |
|---------------------------------------|-----------------------|
| Thesaurierende Klasse GBP Z           | 0,00 %                |
| Thesaurierende Klasse USD A           | 2,00 %                |
| Thesaurierende Klasse USD B           | 2,00 %                |
| Thesaurierende Klasse USD C2          | 2,00 %                |
| Thesaurierende Klasse USD E           | 2,00 %                |
| Thesaurierende Klasse USD I           | 1,00 %                |
| Thesaurierende Klasse USD M           | 2,00 %                |
| Thesaurierende Klasse USD T           | 2,00 %                |
| Thesaurierende Klasse USD Z           | 0,00 %                |
| Thesaurierende Klasse ZAR B           | 2,00 %                |
| Thesaurierende Klasse ZAR C2          | 2,00 %                |
| Thesaurierende Klasse ZAR E           | 2,00 %                |
| Thesaurierende Klasse ZAR T           | 2,00 %                |

**Emerging Markets Select Equity**

|   |        |
|---|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) | 0,85 % |
| Thesaurierende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert) | 0,85 % |
| Thesaurierende Klasse USD I                           | 0,85 % |
| Thesaurierende Klasse USD I5                          | 0,43 % |

**Euro Bond Absolute Return**

|                              |        |
|------------------------------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR I5 | 0,23 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I  | 0,45 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I   | 0,45 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z  | 0,00 % |

**Euro Opportunistic Bond**

|                             |        |
|-----------------------------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR I | 0,35 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I  | 0,35 % |

**European High Yield Bond**

|  |        |
|--|--------|
| Thesaurierende Klasse CHF I            | 0,60 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I            | 0,60 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M            | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse EUR X            | 0,20 % |
| Thesaurierende Klasse EUR Y            | 0,10 % |
| Ausschüttende Klasse EUR Y             | 1,20 % |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse USD I            | 0,60 % |
| Thesaurierende Klasse USD X            | 0,20 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z            | 0,00 % |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 5. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

| European Sustainable Equity                           | Management-<br>gebühr |
|---|-----------------------|
| Ausschüttende Klasse EUR A                            | 1,50 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR I                           | 0,60 %                |
| Ausschüttende Klasse EUR I                            | 0,60 %                |
| Ausschüttende Klasse EUR I3                           | 0,42 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR I5                          | 0,30 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR M                           | 1,50 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR Z                           | 0,00 %                |
| Thesaurierende Klasse USD A (nicht währungsgesichert) | 1,50 %                |
| Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) | 0,60 %                |
| Thesaurierende Klasse USD M (nicht währungsgesichert) | 1,50 %                |

**Event Driven**

|                              |        |
|------------------------------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR I  | 1,00 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I5 | 0,50 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I5  | 0,50 % |
| Thesaurierende Klasse GBP P  | 0,95 % |
| Thesaurierende Klasse USD I  | 1,00 % |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 0,50 % |

**Global Bond**

|   |        |
|---|--------|
| Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)                          | 0,75 % |
| Thesaurierende Klasse USD C1                                    | 0,40 % |
| Thesaurierende Klasse USD I Benchmark Währungsgesicherte Klasse | 0,40 % |
| Thesaurierende Klasse USD I                                     | 0,20 % |
| Thesaurierende Klasse USD M                                     | 0,40 % |
| Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)                          | 0,75 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z                                     | 0,00 % |
| Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)                          | 0,75 % |

**Global Diversified Income FMP – 2024**

|                             |        |
|-----------------------------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR A | 0,75 % |
| Ausschüttende Klasse EUR A  | 0,75 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I  | 0,35 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I  | 0,35 % |
| Ausschüttende Klasse HKD A  | 0,75 % |
| Ausschüttende Klasse SGD A  | 0,75 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 0,75 % |
| Ausschüttende Klasse USD A  | 0,75 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,35 % |
| Ausschüttende Klasse USD I  | 0,35 % |
| Thesaurierende Klasse USD X | 0,40 % |
| Ausschüttende Klasse USD X  | 0,40 % |

| Global Equity Megatrends                              | Management-<br>gebühr |
|---|-----------------------|
| Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) | 1,70 %                |
| Thesaurierende Klasse USD A                           | 1,70 %                |
| Thesaurierende Klasse USD C1                          | 1,70 %                |
| Thesaurierende Klasse USD I                           | 0,85 %                |
| Thesaurierende Klasse USD M                           | 1,70 %                |
| Thesaurierende Klasse USD Z                           | 0,00 %                |

**Global Flexible Credit Income**

|                              |        |
|------------------------------|--------|
| Thesaurierende Klasse CAD I5 | 0,30 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I  | 0,60 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M  | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I5 | 0,30 % |
| Thesaurierende Klasse USD A  | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse USD I  | 0,60 % |
| Ausschüttende Klasse USD I   | 0,60 % |
| Thesaurierende Klasse USD M  | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z  | 0,00 % |

**Global High Yield SDG Engagement**

|                                  |        |
|----------------------------------|--------|
| Ausschüttende Klasse AUD I       | 0,60 % |
| Thesaurierende Klasse CHF I4     | 0,37 % |
| Ausschüttende Klasse CHF I4      | 0,37 % |
| Thesaurierende Klasse CHF X      | 1,10 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I4     | 0,37 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I4      | 0,37 % |
| Thesaurierende Klasse EUR X      | 1,10 % |
| Thesaurierende Klasse EUR Z (PF) | 0,10 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I4     | 0,37 % |
| Thesaurierende Klasse GBP X      | 1,10 % |
| Thesaurierende Klasse USD A      | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse USD I      | 0,60 % |
| Thesaurierende Klasse USD I4     | 0,37 % |
| Ausschüttende Klasse USD M       | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse USD X      | 1,10 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z      | 0,00 % |

**Global Investment Grade Credit**

|                             |        |
|-----------------------------|--------|
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,30 % |
| Thesaurierende Klasse USD X | 0,10 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,00 % |

FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

5. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

| Global Opportunistic Bond                              | Management-<br>gebühr | High Yield Bond (Fortsetzung)            | Management-<br>gebühr |
|--|-----------------------|--|-----------------------|
| Thesaurierende Klasse EUR I                            | 0,30 %                | Ausschüttende Klasse AUD T (Wöchentlich) | 1,80 %                |
| Thesaurierende Klasse GBP P                            | 0,29 %                | Thesaurierende Klasse AUD T              | 1,80 %                |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 0,60 %                | Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich)   | 1,20 %                |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 0,30 %                | Thesaurierende Klasse CHF A              | 1,20 %                |
| Ausschüttende Klasse USD I                             | 0,30 %                | Thesaurierende Klasse CHF I              | 0,60 %                |
| Thesaurierende Klasse USD I2                           | 0,24 %                | Thesaurierende Klasse CHF I2             | 0,50 %                |
| Thesaurierende Klasse USD Z                            | 0,00 %                | Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)   | 1,20 %                |
|  |                       | Ausschüttende Klasse CNY I (Monatlich)   | 0,60 %                |
| <b>Global Real Estate Securities</b>                   |                       | Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)   | 1,20 %                |
| Ausschüttende Klasse EUR I5                            | 0,38 %                | Thesaurierende Klasse EUR A              | 1,20 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR M                            | 1,50 %                | Ausschüttende Klasse EUR A               | 1,20 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert)  | 0,00 %                | Thesaurierende Klasse EUR I              | 0,60 %                |
| Thesaurierende Klasse GBP Z                            | 0,00 %                | Ausschüttende Klasse EUR I               | 0,60 %                |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 1,50 %                | Thesaurierende Klasse EUR I2             | 0,50 %                |
| Thesaurierende Klasse USD CI                           | 1,50 %                | Ausschüttende Klasse EUR I2              | 0,50 %                |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 0,75 %                | Thesaurierende Klasse EUR M              | 1,20 %                |
| Ausschüttende Klasse USD I5                            | 0,38 %                | Thesaurierende Klasse EUR Z              | 0,00 %                |
| Thesaurierende Klasse USD M                            | 1,50 %                | Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich)   | 1,20 %                |
| Thesaurierende Klasse USD Z                            | 0,00 %                | Thesaurierende Klasse GBP A              | 1,20 %                |
|  |                       | Ausschüttende Klasse GBP A               | 1,20 %                |
| <b>Global Sustainable Equity</b>                       |                       | Thesaurierende Klasse GBP I              | 0,60 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert) | 0,30 %                | Ausschüttende Klasse GBP I               | 0,60 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)  | 1,50 %                | Thesaurierende Klasse GBP I2             | 0,50 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert)  | 0,00 %                | Ausschüttende Klasse GBP I2              | 0,50 %                |
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)  | 0,60 %                | Thesaurierende Klasse GBP Z              | 0,00 %                |
| Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert) | 0,30 %                | Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)   | 1,20 %                |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 1,50 %                | Thesaurierende Klasse SEK A              | 1,20 %                |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 0,60 %                | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)   | 1,20 %                |
| Ausschüttende Klasse USD I                             | 0,60 %                | Thesaurierende Klasse SGD A              | 1,20 %                |
| Thesaurierende Klasse USD M                            | 1,50 %                | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)   | 1,20 %                |
| Thesaurierende Klasse USD Z                            | 0,00 %                | Ausschüttende Klasse USD A (Wöchentlich) | 1,20 %                |
|  |                       | Thesaurierende Klasse USD A              | 1,20 %                |
| <b>High Yield Bond</b>                                 |                       | Ausschüttende Klasse USD A               | 1,20 %                |
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)                 | 1,20 %                | Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich)   | 1,80 %                |
| Thesaurierende Klasse AUD A                            | 1,20 %                | Thesaurierende Klasse USD B              | 1,80 %                |
| Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich)                 | 1,80 %                | Thesaurierende Klasse USD C              | 0,80 %                |
| Thesaurierende Klasse AUD B                            | 1,80 %                | Thesaurierende Klasse USD C1             | 1,20 %                |
| Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich)                | 1,80 %                | Ausschüttende Klasse USD C1              | 1,20 %                |
| Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)                 | 1,80 %                | Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich)  | 1,80 %                |
| Thesaurierende Klasse AUD E                            | 1,80 %                | Thesaurierende Klasse USD C2             | 1,80 %                |
| Ausschüttende Klasse AUD I                             | 0,60 %                | Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich)   | 1,80 %                |
| Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)                 | 1,80 %                | Thesaurierende Klasse USD E              | 1,80 %                |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 5. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

| High Yield Bond (Fortsetzung)                         | Management-<br>gebühr | Japan Equity Engagement (Fortsetzung)                  | Management-<br>gebühr |
|---|-----------------------|--|-----------------------|
| Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)                | 0,60 %                | Thesaurierende Klasse JPY I                            | 0,85 %                |
| Thesaurierende Klasse USD I                           | 0,60 %                | Ausschüttende Klasse JPY I                             | 0,85 %                |
| Ausschüttende Klasse USD I                            | 0,60 %                | Thesaurierende Klasse JPY I5                           | 0,43 %                |
| Ausschüttende Klasse USD I2 (Monatlich)               | 0,50 %                | Thesaurierende Klasse JPY Z                            | 0,00 %                |
| Thesaurierende Klasse USD I2                          | 0,50 %                |  |                       |
| Ausschüttende Klasse USD I2                           | 0,50 %                | <b>Macro Opportunities FX</b>                          |                       |
| Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich)               | 0,36 %                | Thesaurierende Klasse EUR I                            | 0,60 %                |
| Thesaurierende Klasse USD M                           | 1,20 %                | Thesaurierende Klasse GBP Z                            | 0,00 %                |
| Ausschüttende Klasse USD M                            | 1,20 %                | Thesaurierende Klasse SEK I                            | 0,60 %                |
| Thesaurierende Klasse USD P                           | 0,57 %                | Ausschüttende Klasse SEK I                             | 0,60 %                |
| Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)                | 1,80 %                | Thesaurierende Klasse USD I                            | 0,60 %                |
| Ausschüttende Klasse USD T (Wöchentlich)              | 1,80 %                | Thesaurierende Klasse USD Z                            | 0,00 %                |
| Thesaurierende Klasse USD T                           | 1,80 %                |  |                       |
| Ausschüttende Klasse USD U (Monatlich)                | 0,90 %                | <b>Multi-Asset Income</b>                              |                       |
| Thesaurierende Klasse USD U                           | 0,90 %                | Ausschüttende Klasse GBP P                             | 0,62 %                |
| Thesaurierende Klasse USD Z                           | 0,00 %                | Thesaurierende Klasse USD A                            | 1,30 %                |
| Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich)                | 1,80 %                | Thesaurierende Klasse USD C1                           | 1,30 %                |
| Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich)               | 1,80 %                | Thesaurierende Klasse USD I                            | 0,65 %                |
| Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)                | 1,80 %                | Ausschüttende Klasse USD I                             | 0,65 %                |
| Thesaurierende Klasse ZAR E                           | 1,80 %                | Thesaurierende Klasse USD M                            | 1,30 %                |
| Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)                | 1,80 %                |  |                       |
| Thesaurierende Klasse ZAR T                           | 1,80 %                | <b>Next Generation Mobility</b>                        |                       |
|   |                       | Thesaurierende Klasse EUR A                            | 1,70 %                |
| <b>InnovAsia 5G</b>                                   |                       | Thesaurierende Klasse EUR I                            | 0,85 %                |
| Thesaurierende Klasse CHF I4                          | 0,51 %                | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)  | 0,85 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR A                           | 1,70 %                | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)  | 1,70 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR I4                          | 0,51 %                | Thesaurierende Klasse USD A                            | 1,70 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) | 1,70 %                | Thesaurierende Klasse USD C1                           | 1,70 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR X                           | 1,45 %                | Thesaurierende Klasse USD I                            | 0,85 %                |
| Thesaurierende Klasse SGD A                           | 1,70 %                | Ausschüttende Klasse USD I                             | 0,85 %                |
| Thesaurierende Klasse SGD I4                          | 0,51 %                | Thesaurierende Klasse USD M                            | 1,70 %                |
| Thesaurierende Klasse SGD X                           | 1,45 %                | Thesaurierende Klasse USD X                            | 1,55 %                |
| Thesaurierende Klasse USD A                           | 1,70 %                |  |                       |
| Thesaurierende Klasse USD I                           | 0,85 %                | <b>Next Generation Space Economy</b>                   |                       |
| Thesaurierende Klasse USD I4                          | 0,51 %                | Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert) | 0,60 %                |
| Thesaurierende Klasse USD M                           | 1,70 %                | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)  | 1,70 %                |
| Thesaurierende Klasse USD X                           | 1,45 %                | Thesaurierende Klasse USD I                            | 0,85 %                |
|   |                       |  |                       |
| <b>Japan Equity Engagement</b>                        |                       |  |                       |
| Ausschüttende Klasse EUR I5                           | 0,43 %                |  |                       |
| Thesaurierende Klasse GBP I5                          | 0,43 %                |  |                       |
| Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) | 0,81 %                |  |                       |

FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

5. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

| Short Duration Emerging Market Debt    | Management-<br>gebühr |
|--|-----------------------|
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) | 1,00 %                |
| Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich) | 1,00 %                |
| Thesaurierende Klasse CHF A            | 1,00 %                |
| Ausschüttende Klasse CHF A             | 1,00 %                |
| Thesaurierende Klasse CHF I            | 0,50 %                |
| Ausschüttende Klasse CHF I             | 0,50 %                |
| Thesaurierende Klasse CHF I2           | 0,40 %                |
| Ausschüttende Klasse CHF I2            | 0,40 %                |
| Thesaurierende Klasse CHF I5           | 0,25 %                |
| Thesaurierende Klasse CHF P            | 0,48 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR A            | 1,00 %                |
| Ausschüttende Klasse EUR A             | 1,00 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR I            | 0,50 %                |
| Ausschüttende Klasse EUR I             | 0,50 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR I2           | 0,40 %                |
| Ausschüttende Klasse EUR I2            | 0,40 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR I5           | 0,25 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR M            | 1,00 %                |
| Ausschüttende Klasse EUR M             | 1,00 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR P            | 0,48 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR U            | 0,75 %                |
| Ausschüttende Klasse EUR X             | 0,40 %                |
| Thesaurierende Klasse GBP A            | 1,00 %                |
| Thesaurierende Klasse GBP I            | 0,50 %                |
| Ausschüttende Klasse GBP I             | 0,50 %                |
| Thesaurierende Klasse GBP I2           | 0,40 %                |
| Ausschüttende Klasse GBP I2            | 0,40 %                |
| Ausschüttende Klasse GBP I5            | 0,25 %                |
| Thesaurierende Klasse GBP P            | 0,48 %                |
| Thesaurierende Klasse JPY I            | 0,50 %                |
| Ausschüttende Klasse JPY I             | 0,50 %                |
| Thesaurierende Klasse SEK A            | 1,00 %                |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | 1,00 %                |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 1,00 %                |
| Thesaurierende Klasse USD A            | 1,00 %                |
| Ausschüttende Klasse USD A             | 1,00 %                |
| Thesaurierende Klasse USD C1           | 1,00 %                |
| Ausschüttende Klasse USD C1            | 1,00 %                |
| Thesaurierende Klasse USD I            | 0,50 %                |
| Ausschüttende Klasse USD I             | 0,50 %                |
| Thesaurierende Klasse USD I2           | 0,40 %                |

| Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung) | Management-<br>gebühr |
|---|-----------------------|
| Ausschüttende Klasse USD I2                       | 0,40 %                |
| Thesaurierende Klasse USD I5                      | 0,25 %                |
| Ausschüttende Klasse USD I5                       | 0,25 %                |
| Thesaurierende Klasse USD M                       | 1,00 %                |
| Ausschüttende Klasse USD M                        | 1,00 %                |
| Thesaurierende Klasse USD P                       | 0,48 %                |
| Thesaurierende Klasse USD Z                       | 0,00 %                |

**Short Duration High Yield SDG  
Engagement**

|  |        |
|--|--------|
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse CHF A            | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse CHF I            | 0,60 % |
| Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich) | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A            | 1,20 % |
| Ausschüttende Klasse EUR A             | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I            | 0,60 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I2           | 0,50 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M            | 1,20 % |
| Ausschüttende Klasse EUR M             | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I            | 0,60 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I             | 0,60 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I2           | 0,50 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I2            | 0,50 % |
| Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse JPY I            | 0,60 % |
| Ausschüttende Klasse JPY I             | 0,60 % |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | 1,20 % |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse USD A            | 1,20 % |
| Ausschüttende Klasse USD A             | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse USD C1           | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse USD I            | 0,60 % |
| Ausschüttende Klasse USD I             | 0,60 % |
| Thesaurierende Klasse USD I2           | 0,50 % |
| Ausschüttende Klasse USD I2            | 0,50 % |
| Thesaurierende Klasse USD I4           | 0,36 % |
| Thesaurierende Klasse USD I5           | 0,30 % |
| Thesaurierende Klasse USD M            | 1,20 % |
| Ausschüttende Klasse USD M             | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z            | 0,00 % |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 5. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

| Strategic Income                                      | Management-<br>gebühr | Sustainable Emerging Market Corporate Debt<br>(Fortsetzung) | Management-<br>gebühr |
|---|-----------------------|---|-----------------------|
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)                | 1,00 %                | Ausschüttende Klasse EUR M                                  | 1,60 %                |
| Ausschüttende Klasse AUD Z (Monatlich)                | 0,00 %                | Thesaurierende Klasse EUR X                                 | 0,46 %                |
| Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)                | 1,00 %                | Thesaurierende Klasse GBP I                                 | 0,80 %                |
| Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)                | 1,00 %                | Thesaurierende Klasse SEK A                                 | 1,60 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR A                           | 1,00 %                | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)                      | 1,60 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR I                           | 0,50 %                | Thesaurierende Klasse USD A                                 | 1,60 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR M                           | 1,00 %                | Thesaurierende Klasse USD C1                                | 1,60 %                |
| Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich)                | 1,00 %                | Thesaurierende Klasse USD I                                 | 0,80 %                |
| Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)                | 1,00 %                | Ausschüttende Klasse USD I                                  | 0,80 %                |
| Thesaurierende Klasse JPY I                           | 0,50 %                | Thesaurierende Klasse USD I2                                | 0,64 %                |
| Thesaurierende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert) | 0,50 %                | Thesaurierende Klasse USD I5                                | 0,40 %                |
| Ausschüttende Klasse JPY I CG                         | 0,50 %                | Thesaurierende Klasse USD M                                 | 1,60 %                |
| Ausschüttende Klasse JPY I                            | 0,50 %                | Ausschüttende Klasse USD M                                  | 1,60 %                |
| Thesaurierende Klasse JPY Z                           | 0,00 %                |   |                       |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)                | 1,00 %                | <b>Sustainable Emerging Market Debt -<br/>Hard Currency</b> |                       |
| Thesaurierende Klasse SGD A                           | 1,00 %                | Thesaurierende Klasse EUR I3                                | 0,49 %                |
| Ausschüttende Klasse SGD I (Monatlich)                | 0,50 %                | Thesaurierende Klasse EUR I4                                | 0,42 %                |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)                | 1,00 %                | Thesaurierende Klasse EUR X                                 | 0,35 %                |
| Thesaurierende Klasse USD A                           | 1,00 %                | Thesaurierende Klasse USD I                                 | 0,70 %                |
| Ausschüttende Klasse USD A                            | 1,00 %                | Thesaurierende Klasse USD I5                                | 0,35 %                |
| Thesaurierende Klasse USD C1                          | 1,00 %                |   |                       |
| Thesaurierende Klasse USD I                           | 0,50 %                | <b>Systematic Global Sustainable Value</b>                  |                       |
| Ausschüttende Klasse USD I                            | 0,50 %                | Thesaurierende Klasse EUR M                                 | 0,90 %                |
| Thesaurierende Klasse USD M                           | 1,00 %                | Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)      | 0,23 %                |
| Ausschüttende Klasse USD M                            | 1,00 %                | Thesaurierende Klasse USD A                                 | 0,90 %                |
| Thesaurierende Klasse USD Z                           | 0,00 %                | Thesaurierende Klasse USD I                                 | 0,45 %                |
|   |                       | Thesaurierende Klasse USD I3                                | 0,32 %                |
|   |                       | Thesaurierende Klasse USD Z                                 | 0,00 %                |
|   |                       |   |                       |
| <b>Sustainable Asia High Yield</b>                    |                       | <b>Tactical Macro</b>                                       |                       |
| Thesaurierende Klasse EUR X                           | 0,40 %                | Thesaurierende Klasse USD I                                 | 0,80 %                |
| Thesaurierende Klasse GBP X                           | 0,40 %                | Thesaurierende Klasse USD I5                                | 0,40 %                |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)                | 1,20 %                | Thesaurierende Klasse USD Z                                 | 0,00 %                |
| Thesaurierende Klasse USD A                           | 1,20 %                |   |                       |
| Thesaurierende Klasse USD I                           | 0,60 %                | <b>Ultra Short Term Euro Bond</b>                           |                       |
| Thesaurierende Klasse USD Z                           | 0,00 %                | Thesaurierende Klasse CHF P                                 | 0,18 %                |
| Ausschüttende Klasse USD Z                            | 0,00 %                | Thesaurierende Klasse CHF U                                 | 0,29 %                |
|   |                       | Thesaurierende Klasse EUR I5                                | 0,09 %                |
|   |                       | Thesaurierende Klasse EUR A                                 | 0,38 %                |
|   |                       |   |                       |
| <b>Sustainable Emerging Market Corporate Debt</b>     |                       |   |                       |
| Thesaurierende Klasse CHF I                           | 0,80 %                |   |                       |
| Thesaurierende Klasse EUR A                           | 1,60 %                |   |                       |
| Thesaurierende Klasse EUR I                           | 0,80 %                |   |                       |
| Thesaurierende Klasse EUR I3                          | 0,48 %                |   |                       |
| Thesaurierende Klasse EUR M                           | 1,60 %                |   |                       |

FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

5. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

| Ultra Short Term Euro Bond (Fortsetzung) | Management-<br>gebühr |
|--|-----------------------|
| Thesaurierende Klasse EUR I              | 0,19 %                |
| Ausschüttende Klasse EUR I               | 0,19 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR I2             | 0,15 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR M              | 0,38 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR U              | 0,29 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR Z              | 0,00 %                |
| Thesaurierende Klasse USD Z              | 0,00 %                |
| Thesaurierende Klasse USD I              | 0,19 %                |
| <b>Uncorrelated Strategies</b>           |                       |
| Thesaurierende Klasse CHF I              | 0,75 %                |
| Thesaurierende Klasse CHF I5             | 0,38 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR A              | 1,50 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR I              | 0,75 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR I2             | 0,60 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR I5             | 0,38 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR M              | 1,50 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR P              | 0,71 %                |
| Thesaurierende Klasse GBP I              | 0,75 %                |
| Thesaurierende Klasse GBP I2             | 0,60 %                |
| Ausschüttende Klasse GBP I2              | 0,60 %                |
| Thesaurierende Klasse GBP I5             | 0,38 %                |
| Thesaurierende Klasse GBP P              | 0,71 %                |
| Thesaurierende Klasse GBP Z              | 0,00 %                |
| Thesaurierende Klasse JPY I              | 0,75 %                |
| Thesaurierende Klasse SGD A              | 1,50 %                |
| Thesaurierende Klasse USD A              | 1,50 %                |
| Thesaurierende Klasse USD C1             | 1,50 %                |
| Thesaurierende Klasse USD I              | 0,75 %                |
| Thesaurierende Klasse USD I2             | 0,60 %                |
| Thesaurierende Klasse USD I5             | 0,38 %                |
| Thesaurierende Klasse USD M              | 1,50 %                |
| Thesaurierende Klasse USD P              | 0,71 %                |
| Thesaurierende Klasse USD Z              | 0,00 %                |
| <b>US Equity</b>                         |                       |
| Thesaurierende Klasse JPY I3             | 0,53 %                |
| Thesaurierende Klasse USD A              | 1,50 %                |
| Thesaurierende Klasse USD I              | 0,75 %                |
| Ausschüttende Klasse USD I               | 0,75 %                |
| Thesaurierende Klasse USD M              | 1,50 %                |

| US Equity Index PutWrite                               | Management-<br>gebühr |
|--|-----------------------|
| Thesaurierende Klasse EUR I                            | 0,60 %                |
| Ausschüttende Klasse EUR I3                            | 0,42 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR I4                           | 0,36 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR M                            | 1,20 %                |
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)  | 0,60 %                |
| Thesaurierende Klasse GBP I3                           | 0,42 %                |
| Ausschüttende Klasse GBP I3                            | 0,42 %                |
| Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert)  | 0,42 %                |
| Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert) | 0,36 %                |
| Ausschüttende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)   | 0,57 %                |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)                 | 1,20 %                |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 1,20 %                |
| Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)                 | 0,60 %                |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 0,60 %                |
| Ausschüttende Klasse USD I3                            | 0,42 %                |
| Thesaurierende Klasse USD I4                           | 0,36 %                |
| Thesaurierende Klasse USD M                            | 1,20 %                |
| Thesaurierende Klasse USD Z                            | 0,00 %                |
| <b>US Large Cap Value</b>                              |                       |
| Thesaurierende Klasse EUR A                            | 1,50 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)  | 1,50 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR I                            | 0,70 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)  | 0,70 %                |
| Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)  | 0,42 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert) | 0,35 %                |
| Thesaurierende Klasse GBP I                            | 0,70 %                |
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)  | 0,70 %                |
| Ausschüttende Klasse GBP I                             | 0,70 %                |
| Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)   | 0,70 %                |
| Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)  | 0,42 %                |
| Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)  | 0,67 %                |
| Ausschüttende Klasse GBP P                             | 0,67 %                |
| Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)  | 0,63 %                |
| Ausschüttende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)   | 0,63 %                |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 1,50 %                |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 0,70 %                |
| Ausschüttende Klasse USD I4                            | 0,42 %                |
| Thesaurierende Klasse USD I5                           | 0,35 %                |
| Thesaurierende Klasse USD M                            | 1,50 %                |
| Thesaurierende Klasse USD Z                            | 0,00 %                |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 5. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

| <b>US Long Short Equity</b>                           | <b>Management-<br/>gebühr</b> | <b>US Real Estate Securities</b>        | <b>Management-<br/>gebühr</b> |
|---|-------------------------------|---|-------------------------------|
| Thesaurierende Klasse EUR A                           | 2,25 %                        | Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)  | 1,50 %                        |
| Thesaurierende Klasse EUR I                           | 1,35 %                        | Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich)  | 1,80 %                        |
| Thesaurierende Klasse EUR I3                          | 0,95 %                        | Thesaurierende Klasse AUD B             | 1,80 %                        |
| Thesaurierende Klasse EUR M                           | 2,25 %                        | Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich) | 1,80 %                        |
| Ausschüttende Klasse GBP I3                           | 0,95 %                        | Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)  | 1,80 %                        |
| Thesaurierende Klasse SGD A1                          | 1,80 %                        | Thesaurierende Klasse AUD E             | 1,80 %                        |
| Thesaurierende Klasse USD A (PF)                      | 1,70 %                        | Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)  | 1,80 %                        |
| Thesaurierende Klasse USD A                           | 2,25 %                        | Thesaurierende Klasse AUD T             | 1,80 %                        |
| Thesaurierende Klasse USD A1                          | 1,80 %                        | Thesaurierende Klasse CHF A             | 1,50 %                        |
| Ausschüttende Klasse USD I (PF)                       | 1,00 %                        | Thesaurierende Klasse EUR A             | 1,50 %                        |
| Thesaurierende Klasse USD I                           | 1,35 %                        | Thesaurierende Klasse EUR I             | 0,75 %                        |
| Thesaurierende Klasse USD I3                          | 0,95 %                        | Thesaurierende Klasse EUR M             | 1,50 %                        |
| Thesaurierende Klasse USD M                           | 2,25 %                        | Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)  | 1,50 %                        |
| Thesaurierende Klasse USD U                           | 1,80 %                        | Thesaurierende Klasse SGD A             | 1,50 %                        |
| Thesaurierende Klasse USD Z                           | 0,00 %                        | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)  | 1,50 %                        |
|   |                               | Thesaurierende Klasse USD A             | 1,50 %                        |
|   |                               | Ausschüttende Klasse USD A              | 1,50 %                        |
|   |                               | Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich)  | 1,80 %                        |
|   |                               | Thesaurierende Klasse USD B             | 1,80 %                        |
|   |                               | Thesaurierende Klasse USD C1            | 1,50 %                        |
|   |                               | Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich) | 1,80 %                        |
|   |                               | Thesaurierende Klasse USD C2            | 1,80 %                        |
|   |                               | Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich)  | 1,80 %                        |
|   |                               | Thesaurierende Klasse USD E             | 1,80 %                        |
|   |                               | Thesaurierende Klasse USD I             | 0,75 %                        |
|   |                               | Ausschüttende Klasse USD I              | 0,75 %                        |
|   |                               | Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)  | 0,75 %                        |
|   |                               | Thesaurierende Klasse USD I2            | 0,54 %                        |
|   |                               | Thesaurierende Klasse USD M             | 1,50 %                        |
|   |                               | Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)  | 1,80 %                        |
|   |                               | Thesaurierende Klasse USD T             | 1,80 %                        |
|   |                               | Thesaurierende Klasse USD Z             | 0,00 %                        |
|   |                               | Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich)  | 1,80 %                        |
|   |                               | Thesaurierende Klasse ZAR B             | 1,80 %                        |
|   |                               | Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich) | 1,80 %                        |
|   |                               | Thesaurierende Klasse ZAR C2            | 1,80 %                        |
|   |                               | Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)  | 1,80 %                        |
|   |                               | Thesaurierende Klasse ZAR E             | 1,80 %                        |
|   |                               | Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)  | 1,80 %                        |
|   |                               | Thesaurierende Klasse ZAR T             | 1,80 %                        |
|   |                               |   |                               |
| <b>US Multi Cap Opportunities</b>                     |                               |   |                               |
| Thesaurierende Klasse AUD E                           | 1,80 %                        |   |                               |
| Thesaurierende Klasse AUD T                           | 1,80 %                        |   |                               |
| Thesaurierende Klasse EUR1 A                          | 1,70 %                        |   |                               |
| Thesaurierende Klasse EUR1 I                          | 0,85 %                        |   |                               |
| Thesaurierende Klasse EUR I3                          | 0,50 %                        |   |                               |
| Thesaurierende Klasse EUR M                           | 1,70 %                        |   |                               |
| Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert) | 0,50 %                        |   |                               |
| Thesaurierende Klasse SGD A                           | 1,70 %                        |   |                               |
| Thesaurierende Klasse USD1 A                          | 1,70 %                        |   |                               |
| Thesaurierende Klasse USD1 I                          | 0,85 %                        |   |                               |
| Ausschüttende Klasse USD1 I                           | 0,85 %                        |   |                               |
| Thesaurierende Klasse USD B                           | 1,80 %                        |   |                               |
| Thesaurierende Klasse USD C1                          | 1,70 %                        |   |                               |
| Thesaurierende Klasse USD C2                          | 1,80 %                        |   |                               |
| Thesaurierende Klasse USD E                           | 1,80 %                        |   |                               |
| Thesaurierende Klasse USD I2                          | 0,68 %                        |   |                               |
| Thesaurierende Klasse USD I3                          | 0,50 %                        |   |                               |
| Ausschüttende Klasse USD I3                           | 0,50 %                        |   |                               |
| Thesaurierende Klasse USD M                           | 1,70 %                        |   |                               |
| Thesaurierende Klasse USD T                           | 1,80 %                        |   |                               |
| Thesaurierende Klasse USD U                           | 1,25 %                        |   |                               |
| Thesaurierende Klasse USD Z                           | 0,00 %                        |   |                               |
| Thesaurierende Klasse ZAR B                           | 1,80 %                        |   |                               |
| Thesaurierende Klasse ZAR C2                          | 1,80 %                        |   |                               |
| Thesaurierende Klasse ZAR E                           | 1,80 %                        |   |                               |
| Thesaurierende Klasse ZAR T                           | 1,80 %                        |   |                               |



FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

5. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

| US Small Cap   | Management-<br>gebühr | US Small Cap (Fortsetzung)                             | Management-<br>gebühr |
|--|-----------------------|--|-----------------------|
| Thesaurierende Klasse AUD B                            | 1,80 %                | Thesaurierende Klasse USD I                            | 0,85 %                |
| Thesaurierende Klasse AUD C2                           | 1,80 %                | Ausschüttende Klasse USD I                             | 0,85 %                |
| Thesaurierende Klasse AUD E                            | 1,80 %                | Thesaurierende Klasse USD I3                           | 0,60 %                |
| Thesaurierende Klasse AUD T                            | 1,80 %                | Thesaurierende Klasse USD M                            | 1,70 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR A                            | 1,70 %                | Thesaurierende Klasse USD T                            | 1,80 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)  | 1,70 %                | Thesaurierende Klasse USD Z                            | 0,00 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR I                            | 0,85 %                | Thesaurierende Klasse ZAR E                            | 1,80 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)  | 0,85 %                | Thesaurierende Klasse ZAR T                            | 1,80 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungsgesichert) | 0,68 %                |  |                       |
| Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert) | 0,51 %                | <b>US Small Cap Intrinsic Value</b>                    |                       |
| Thesaurierende Klasse EUR M                            | 1,70 %                | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)  | 0,85 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR Z                            | 0,00 %                | Thesaurierende Klasse GBP I2 (nicht währungsgesichert) | 0,68 %                |
| Ausschüttende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert)   | 0,85 %                | Thesaurierende Klasse USD A                            | 1,70 %                |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 1,70 %                | Thesaurierende Klasse USD I                            | 0,85 %                |
| Ausschüttende Klasse USD A                             | 1,70 %                | Thesaurierende Klasse USD I2                           | 0,68 %                |
| Thesaurierende Klasse USD B                            | 1,80 %                | Thesaurierende Klasse USD M                            | 1,70 %                |
| Thesaurierende Klasse USD C2                           | 1,80 %                |  |                       |
| Thesaurierende Klasse USD E                            | 1,80 %                |  |                       |

Gegebenenfalls wird auf die o. g. Gebühren ein Rabatt eingeräumt.

Der Manager kann auf seine Gebühren verzichten, um die Gesamtkostenquoten („TERS“) der Portfolios nach oben zu begrenzen. Diese Gebührenverzichtete sind freiwillig und können vom Manager jederzeit ohne vorherige Mitteilung zurückgenommen werden. Gebühren, auf die freiwillig verzichtet wurde, können nicht vom Manager zurückgefordert werden. Eine Aufgliederung der TERS der einzelnen Portfolios ist in Anhang I enthalten.

Die Gesellschaft bezahlt Verwaltungsgebühren, die nicht mehr als 0,20 % des NIW des betreffenden Portfolios betragen werden. Die Verwaltungsgebühr setzt sich zusammen aus einer Gebühr, die an die Verwaltungsstelle für die von ihr in Bezug auf jedes Portfolio erbrachten Verwaltungsdienste zu zahlen ist, und einer Gebühr, die an den Manager für die von ihm für jedes Portfolio erbrachten administrativen Supportdienste zu zahlen ist; sie läuft monatlich auf und ist monatlich rückwirkend zu zahlen.

Der Fonds zahlt/zahlte an die Verwaltungsstelle Verwaltungsgebühren auf der Grundlage der Bewertung des Nettovermögens des Uncorrelated Strategies und Uncorrelated Trading am Monatsende mit den folgenden Sätzen:

|  |         |
|--|---------|
| Vermögenswerte von 0 – 500 Mio. US\$     | 0,055 % |
| Vermögenswerte von 500 – 2.000 Mio. US\$ | 0,05 %  |
| Vermögenswerte über 2.000 Mio. US\$      | 0,04 %  |

**FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023****5. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)**

Der Fonds zahlt an die Verwaltungsstelle Verwaltungsgebühren auf der Grundlage des Nettoinventarwertes am Monatsende, und zwar für jedes von der Verwaltungsstelle verwaltete Portfolio und mit den folgenden Sätzen:

|   |         |
|---|---------|
| Vermögenswerte von 0 – 25.000 Mio. US\$ | 0,008 % |
| Vermögenswerte über 25.000 Mio. US\$    | 0,005 % |

Die oben genannten Gebühren unterliegen einer monatlichen Mindestgebühr von 4.000 US\$ pro Portfolio und umfassen vier Anteilklassen pro Portfolio. Bei Portfolios, die mehr als vier Anteilklassen haben, wird für jede zusätzliche Anteilklasse eine monatliche Gebühr von 150 US\$ erhoben.

Darüber hinaus hat die Verwaltungsstelle Anspruch auf eine weitere Gebühr in Bezug auf die Transferstellendienste, die sie für das Portfolio erbringt.

In Bezug auf Anteile der Klassen B, C, E, C1 und C2 des jeweiligen Portfolios hat/haben der Manager und/oder die betreffende Vertriebsstelle für ihre Vertriebsdienstleistungen, die er/sie für diese Klassen erbringt/erbringen, Anspruch auf eine Vertriebsgebühr zu einem jährlichen Satz von 1,00 % des NIW der betreffenden Klassen. Diese wird taggenau berechnet und monatlich rückwirkend am Ende eines jeden Kalendermonats gezahlt. In Bezug auf Anteile der Klasse M des jeweiligen Portfolios hat/haben der Manager und/oder die betreffende Vertriebsstelle für seine/ihre Vertriebsdienstleistungen, die er/sie für diese Klassen erbringt/erbringen, Anspruch auf eine Vertriebsgebühr zu einem jährlichen Satz in Höhe eines Prozentsatzes des NIW der jeweiligen Klasse. Diese wird taggenau berechnet und monatlich rückwirkend am Ende eines jeden Kalendermonats gezahlt. Der Satz für diese Vertriebsgebühr variiert zwischen den Portfolios und ist im Nachtrag für die einzelnen Portfolios aufgeführt. In Bezug auf alle anderen Klassen kann der Manager der Vertriebsstelle für ihre Vertriebsdienste eine Gebühr (zu normalen kommerziellen Sätzen) zahlen, die ebenfalls durch Managementgebühr abgedeckt wird.

*Gebühren der nicht verbundenen Unterberater*

Die an die vom Manager und/oder Sub-Investment-Manager ernannten nicht verbundenen Unterberater gezahlten Gebühren werden mit Ausnahme der Green Court Capital Management Limited und den Unterberatern zu Uncorrelated Strategies aus dem Portfoliovermögen bestritten. Die insgesamt an alle Berater gezahlten Gebühren lagen zwischen 0,65 % und 1,50 % des NIW des Portfolios. Die aggregierten Beratungsgebühren für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 betragen 1.145.544 US\$ (30. Juni 2022: 30.627 US\$).

**Erfolgsabhängige Gebühren**

Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 wird eine erfolgsabhängige Gebühr für den US Long Short Equity, den Global High Yield SDG Engagement, den Event Driven, den Tactical Macro, den Uncorrelated Strategies und den Uncorrelated Trading berechnet.

*An den Manager und einen Sub-Investment-Manager gezahlte erfolgsabhängige Gebühr*

Der Manager und ein Sub-Investment-Manager haben unter Umständen Anspruch auf eine erfolgsabhängige Gebühr (die „erfolgsabhängige Gebühr“) die aus dem Portfoliovermögen in Bezug auf jede PF-Klasse des betreffenden Portfolios zahlbar ist. Die Verwahrstelle überprüft die Berechnung der erfolgsabhängigen Gebühr. Die Direktoren können mit Zustimmung des Managers die erfolgsabhängige Gebühr, die von einer Anteilklasse zu zahlen ist, reduzieren. Erfolgsabhängige Gebühren fallen auf realisierte und nicht realisierte Kapitalerträge unter Berücksichtigung der realisierten und nicht realisierten Verluste zum Ende des unten für jedes Portfolio definierten Berechnungszeitraums an. Daher können erfolgsabhängige Gebühren auf nicht realisierte Gewinne gezahlt werden, die in der Folge niemals realisiert werden.

Anteilinhaber werden darauf hingewiesen, dass die erfolgsabhängige Gebühr auf Anteilklassenebene und nicht auf Ebene des individuellen Anteilinhabers berechnet wird und Anteilhabern somit eine erfolgsabhängige Gebühr in Rechnung gestellt werden kann, auch wenn der NIW ihrer Anteile gleichgeblieben oder zurückgegangen ist. Dies ist unter Umständen der Fall, wenn Anteilinhaber Anteile zu einem Zeitpunkt kaufen oder verkaufen, bei dem es sich nicht um den Beginn oder das Ende des Berechnungszeitraums handelt.

Wird der Managementvertrag in einem beliebigen Jahr vor Ende des Berechnungszeitraums beendet oder dem Sub-Investment-Manager gekündigt, dann wird die erfolgsabhängige Gebühr in Bezug auf den laufenden Berechnungszeitraum so berechnet und ausbezahlt, als ob das Datum, zu dem dieser Vertrag beendet wird, dem Ende des betreffenden Berechnungszeitraums entspräche.

Die erfolgsabhängige Gebühr läuft an jedem Handelstag im NIW auf und ist gewöhnlich an den Manager oder einen Sub-Investment-Manager rückwirkend innerhalb von 30 Geschäftstagen am Ende eines jeden Berechnungszeitraums zu zahlen. Im Falle von während des Berechnungszeitraums zurückgenommenen Anteilen ist die aufgelaufene erfolgsabhängige Gebühr in Bezug auf diese Anteile jedoch an den Manager oder einen Sub-Investment-Manager innerhalb von 30 Geschäftstagen des Rücknahmedatums zahlbar. Festgestellte erfolgsabhängige Gebühren verbleiben in der betreffenden Klasse (partizipieren jedoch nicht an darauffolgenden Gewinnen und Verlusten der betreffenden Klasse), bis sie an den Manager oder einen Sub-Investment-Manager gezahlt werden, und werden nicht zur Bedienung von Rücknahmeanträgen oder zur Zahlung von Gebühren und Aufwendungen der betreffenden Klasse herangezogen oder zur Verfügung gestellt.

**FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023**

**5. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)**

**Erfolgsabhängige Gebühren (Fortsetzung)**

*An den Manager und einen Sub-Investment-Manager gezahlte erfolgsabhängige Gebühr (Fortsetzung)*

Die zur Berechnung der erfolgsabhängigen Gebühr verwendete Methode für jedes betreffenden Portfolio gestaltet sich wie folgt:

**US Long Short Equity**

Der Manager hat unter Umständen Anspruch auf eine erfolgsabhängige Gebühr, die aus dem Portfoliovermögen in Bezug auf jede PF-Klasse des betreffenden Portfolios zahlbar ist.

Definitionen

|                               |   |
|-------------------------------|---|
| Berechnungszeitraum           | <p>Der Berechnungszeitraum geht normalerweise jährlich vom 1. Januar bis zum 31. Dezember, mit Ausnahme, dass:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• im Fall der Erstausgabe von Anteilen in jeder PF-Klasse der erste Berechnungszeitraum vom Ausgabedatum bis zum 31. Dezember geht;</li> <li>• im Fall der Auflösung einer PF-Klasse der Berechnungszeitraum am Datum der Auflösung endet; und</li> <li>• im Fall der Auflösung des Managementvertrags während eines Jahres der Berechnungszeitraum am Datum der Auflösung endet.</li> </ul> <p>Der erste Wert, auf dessen Grundlage die erste erfolgsabhängige Gebühr für alle PF-Klassen ermittelt wird, ist der Erstangebotspreis.</p> |
| Festlegung (Kristallisierung) | <p>Der Punkt, an dem eine erfolgsabhängige Gebühr an den Manager zahlbar wird. Die Festlegung erfolgt entweder am Ende des Berechnungszeitraums oder an einem Handelstag, an dem ein Anteilinhaber den gesamten oder einen Teil seines Anteilsbestands zurückgibt oder umtauscht.</p>   |
| High Water Mark (Höchstmarke) | <p>Ist entweder (i) der Erstangebotspreis je Anteil oder (ii) der NIW je Anteil am Ende des vorherigen Berechnungszeitraums, in Bezug auf den eine erfolgsabhängige Gebühr gezahlt wurde, je nachdem, welcher Wert höher ist.</p>   |

Methode

Für jeden Berechnungszeitraum wird eine erfolgsabhängige Gebühr in Bezug auf jede im Umlauf befindliche PF-Klasse fällig, wenn der NIW je Anteil am Ende des Berechnungszeitraums die High Water Mark für diese spezielle PF-Klasse übersteigt.

Die erfolgsabhängige Gebühr wird an jedem Handelstag berechnet und entspricht 15 % des Betrags, um den das prozentuale Wachstum im NIW je Anteil im Berechnungszeitraum das der High Water Mark übersteigt. Die erfolgsabhängige Gebühr läuft an jedem Handelstag auf und bildet Teil des NIW je Anteil für jede PF-Klasse, wo zutreffend. Jede an einem Handelstag aufgelaufene erfolgsabhängige Gebühr wird von einem am folgenden Handelstag erfolgten Zuwachs bis zum letzten Handelstag des Berechnungszeitraums ersetzt.

In allen Fällen erfolgte beim zur Berechnung der erfolgsabhängigen Gebühr angewandten NIW je Anteil keine vorherige Verwässerungsanpassung, d. h. er enthält keine Swing-Pricing-Anpassung.

Eine erfolgsabhängige Gebühr wird erst gezahlt, wenn der NIW je Anteil die High Water Mark überschreitet, und derlei Gebühr wird nur bei einer Outperformance des über die Hurdle Rate (Mindestrendite) hinausgehenden NIW je Anteil, wie vorstehend beschrieben, zahlbar.

Anteilinhaber werden darauf hingewiesen, dass die erfolgsabhängige Gebühr auf Anteilklassenebene und nicht auf Ebene des individuellen Anteilinhabers berechnet wird und ihnen daher eine erfolgsabhängige Gebühr in Rechnung gestellt werden kann, auch wenn der NIW ihrer Anteile gleichgeblieben oder zurückgegangen ist. Dies ist unter Umständen der Fall, wenn Anteilinhaber Anteile zu einem Zeitpunkt kaufen oder verkaufen, bei dem es sich nicht um den Beginn oder das Ende des Berechnungszeitraums handelt.

Die erfolgsabhängige Gebühr läuft an jedem Handelstag im NIW auf und ist gewöhnlich an den Manager rückwirkend innerhalb von 30 Geschäftstagen am Ende eines jeden Berechnungszeitraums zu zahlen. Im Falle von während des Berechnungszeitraums zurückgenommenen Anteilen ist die aufgelaufene erfolgsabhängige Gebühr in Bezug auf diese Anteile jedoch an den Manager innerhalb von 30 Geschäftstagen des Rücknahmedatums zahlbar.

**FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023****5. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)****Erfolgsabhängige Gebühren (Fortsetzung)**

An den Manager und einen Sub-Investment-Manager gezahlte erfolgsabhängige Gebühr (Fortsetzung)

**US Long Short Equity (Fortsetzung)**Methode (Fortsetzung)

Festgestellte erfolgsabhängige Gebühren verbleiben in der betreffenden PF-Klasse (partizipieren jedoch nicht an darauffolgenden Gewinnen und Verlusten der betreffenden Klasse), bis sie an den Manager gezahlt werden, und werden nicht zur Bedienung von Rücknahmeanträgen oder zur Zahlung von Gebühren und Aufwendungen der betreffenden PF-Klasse herangezogen oder zur Verfügung gestellt.

Die Verwahrstelle überprüft die Berechnung der erfolgsabhängigen Gebühr.

Die Direktoren können mit Zustimmung des Managers die erfolgsabhängige Gebühr, die von einer PF-Klasse zu zahlen ist, reduzieren. Erfolgsabhängige Gebühren fallen auf realisierte und nicht realisierte Kapitalerträge (zur Klarstellung: einschließlich Anlageerträgen) unter Berücksichtigung der realisierten und nicht realisierten Verluste zum Ende des Berechnungszeitraums an. Daher können erfolgsabhängige Gebühren auf nicht realisierte Gewinne gezahlt werden, die in der Folge niemals realisiert werden.

Für die Berichtszeiträume zum 30. Juni 2023 und 30. Juni 2022 wurden vom Portfolio keine erfolgsabhängigen Gebühren an den Manager gezahlt.

**Global High Yield SDG Engagement**

Der Manager hat unter Umständen Anspruch auf eine erfolgsabhängige Gebühr, die aus dem Portfoliovermögen in Bezug auf jede PF-Klasse des betreffenden Portfolios zahlbar ist.

Definitionen

|                               |   |
|-------------------------------|---|
| Benchmark                     | ICE BofA Global High Yield Constrained Index in der entsprechenden Klassenwährung (wie nachstehend beschrieben)   |
| Berechnungszeitraum           | <p>Der Berechnungszeitraum geht normalerweise jährlich vom 1. Januar bis zum 31. Dezember, mit Ausnahme, dass:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>im Fall der Erstausgabe von Anteilen in jeder PF-Klasse der erste Berechnungszeitraum vom Ausgabedatum bis zum 31. Dezember geht;</li> <li>im Fall der Auflösung einer PF-Klasse der Berechnungszeitraum am Datum der Auflösung endet; und</li> <li>im Fall der Auflösung des Managementvertrags während eines Jahres der Berechnungszeitraum am Datum der Auflösung endet.</li> </ul> <p>Der erste Wert, auf dessen Grundlage die erste erfolgsabhängige Gebühr für alle PF-Klassen ermittelt wird, ist der Erstangebotspreis.</p> |
| Festlegung (Kristallisierung) | Der Punkt, an dem eine nicht ausgleichende erfolgsabhängige Gebühr an den Manager zahlbar wird. Die Festlegung erfolgt entweder am Ende des Berechnungszeitraums oder an einem Handelstag, an dem ein Anteilinhaber den gesamten oder einen Teil seines Anteilsbestands zurückgibt oder umwandelt.  |
| Outperformance                | Die überdurchschnittlich positive Entwicklung des NIW je Anteil über der Performance der Benchmark im Berechnungszeitraum.  |

Methode

Für jeden Berechnungszeitraum wird eine erfolgsabhängige Gebühr in Bezug auf jede im Umlauf befindliche PF-Klasse bei einer Outperformance, d. h. einer überdurchschnittlich positiven Entwicklung des NIW je Anteil gegenüber der Performance der für diese spezielle PF-Klasse im Berechnungszeitraum geltenden Benchmark, fällig. Die prozentuale Gebühr wird an jedem Handelstag berechnet und entspricht 20 % der für diese spezielle PF-Klasse im selben Zeitraum geltenden Outperformance.

In allen Fällen erfolgte beim zur Berechnung der erfolgsabhängigen Gebühr angewandten NIW je Anteil keine vorherige Verwässerungsanpassung, d. h. er enthält keine Swing-Pricing-Anpassung.

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 5. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

## Erfolgsabhängige Gebühren (Fortsetzung)

An den Manager und einen Sub-Investment-Manager gezahlte erfolgsabhängige Gebühr (Fortsetzung)

## Global High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

## Methode (Fortsetzung)

Für den Fall, dass die Performance einer PF-Klasse über einen Berechnungszeitraum geringer ist als die der Benchmark, fällt in Bezug auf diese PF-Klasse keine erfolgsabhängige Gebühr an, bis eine solche kumulative Underperformance gegenüber ihrer Benchmark hereingeholt wurde.

Im Fall, dass die PF-Klasse eine Outperformance in einem Berechnungszeitraum erzielt hat, wird eine erfolgsabhängige Gebühr in Bezug auf diese PF-Klasse zahlbar. Nach der Zahlung wird die Benchmark angepasst, dieser Prozess gewährleistet, dass der NIW je Anteil und die Benchmark zu Beginn des Berechnungszeitraums von derselben Stelle ausgehen. Folglich entspricht der anfängliche Benchmark-Wert für den nächsten Berechnungszeitraum dem NIW in Bezug auf die PF-Klasse, für die die erfolgsabhängige Gebühr gezahlt wurde, d. h., wenn der NIW 110 entsprechen würde, läge der Benchmark-Wert ebenfalls bei 110.

## Benchmarkindizes

| Klassen                     | Index   | Code                         |
|-----------------------------|---|------------------------------|
| USD PF-Klassen:             | ICE BofA Global High Yield Constrained Index                      | HWOC ausgewählte Währung USD |
| Abgesicherte PF-Klassen EUR | ICE BofA Global High Yield Constrained Index – in EUR abgesichert | HWOC ausgewählte Währung EUR |
| Abgesicherte PF-Klassen GBP | ICE BofA Global High Yield Constrained Index – in GBP abgesichert | HWOC ausgewählte Währung GBP |

Anteilinhaber werden darauf hingewiesen, dass im Falle einer zahlbaren erfolgsabhängigen Gebühr auf die Outperformance gegenüber der Benchmark ihnen auch dann eine erfolgsabhängige Gebühr in Rechnung gestellt wird, wenn der NIW ihrer Anteile zurückgegangen ist, allerdings in einem geringeren Ausmaß als die Benchmark.

Anteilinhaber werden darauf hingewiesen, dass die erfolgsabhängige Gebühr auf Anteilklassenebene und nicht auf Ebene des individuellen Anteilinhabers berechnet wird und ihnen daher eine erfolgsabhängige Gebühr in Rechnung gestellt werden kann, auch wenn der NIW ihrer Anteile gleichgeblieben oder zurückgegangen ist. Dies ist unter Umständen der Fall, wenn Anteilinhaber Anteile zu einem Zeitpunkt kaufen oder verkaufen, bei dem es sich nicht um den Beginn oder das Ende eines Berechnungszeitraums handelt.

Die erfolgsabhängige Gebühr läuft an jedem Handelstag im NIW auf und ist gewöhnlich an den Manager rückwirkend innerhalb von 30 Geschäftstagen am Ende eines jeden Berechnungszeitraums zu zahlen. Im Falle von während des Berechnungszeitraums zurückgenommenen Anteilen ist die aufgelaufene erfolgsabhängige Gebühr in Bezug auf diese Anteile jedoch an den Manager innerhalb von 30 Geschäftstagen des Rücknahmedatums zahlbar.

Festgestellte erfolgsabhängige Gebühren verbleiben in der betreffenden PF-Klasse (partizipieren jedoch nicht an darauffolgenden Gewinnen und Verlusten der betreffenden Klasse), bis sie an den Manager gezahlt werden, und werden nicht zur Bedienung von Rücknahmeanträgen oder zur Zahlung von Gebühren und Aufwendungen der betreffenden PF-Klasse herangezogen oder zur Verfügung gestellt.

Die Verwahrstelle überprüft die Berechnung der erfolgsabhängigen Gebühr.

Die Direktoren können mit Zustimmung des Managers die erfolgsabhängige Gebühr, die von einer PF-Klasse zu zahlen ist, reduzieren. Erfolgsabhängige Gebühren fallen auf realisierte und nicht realisierte Kapitalerträge (zur Klarstellung: einschließlich Anlageerträgen) unter Berücksichtigung der realisierten und nicht realisierten Verluste zum Ende des Berechnungszeitraums an. Daher können erfolgsabhängige Gebühren auf nicht realisierte Gewinne gezahlt werden, die in der Folge niemals realisiert werden.

Für die Berichtszeiträume zum 30. Juni 2023 und 30. Juni 2022 wurden vom Portfolio keine erfolgsabhängigen Gebühren an den Manager gezahlt.

**FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023****5. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)****Erfolgsabhängige Gebühren (Fortsetzung)**

An den Manager und einen Sub-Investment-Manager gezahlte erfolgsabhängige Gebühr (Fortsetzung)

**Event Driven**

Der Manager hat unter Umständen Anspruch auf eine erfolgsabhängige Gebühr, die aus dem Portfoliovermögen in Bezug auf jede PF-Klasse des betreffenden Portfolios zahlbar ist. Alle Anteilkassen im Portfolio sind PF-Klassen.

Definitionen

|                               |   |
|-------------------------------|---|
| Berechnungszeitraum           | <p>Der Berechnungszeitraum geht normalerweise jährlich vom 1. Januar bis zum 31. Dezember, mit Ausnahme, dass:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• im Fall der Erstausgabe von Anteilen in jeder PF-Klasse der erste Berechnungszeitraum vom Ausgabedatum bis zum 31. Dezember geht;</li> <li>• im Fall der Auflösung einer PF-Klasse der Berechnungszeitraum am Datum der Auflösung endet; und</li> <li>• im Fall der Auflösung des Managementvertrags während eines Jahres der Berechnungszeitraum am Datum der Auflösung endet.</li> </ul> <p>Der erste Wert, auf dessen Grundlage die erste erfolgsabhängige Gebühr für alle PF-Klassen ermittelt wird, ist der Erstangebotspreis.</p> |
| Festlegung (Kristallisierung) | <p>Der Punkt, an dem eine erfolgsabhängige Gebühr an den Manager zahlbar wird. Die Festlegung erfolgt entweder am Ende des Berechnungszeitraums oder an einem Handelstag, an dem ein Anteilinhaber den gesamten oder einen Teil seines Anteilsbestands zurückgibt oder umtauscht.</p>   |
| High Water Mark (Höchstmarke) | <p>Ist entweder (i) der Erstangebotspreis je Anteil oder (ii) der NIW je Anteil am Ende des vorherigen Berechnungszeitraums, in Bezug auf den eine erfolgsabhängige Gebühr gezahlt wurde, je nachdem, welcher Wert höher ist.</p>   |

Methode

Für jeden Berechnungszeitraum wird eine erfolgsabhängige Gebühr in Bezug auf jede im Umlauf befindliche PF-Klasse fällig, wenn der NIW je Anteil am Ende des Berechnungszeitraums die High Water Mark (nach Abzug aller Kosten vor dem Abzug einer aufgelaufenen erfolgsabhängigen Gebühr, sofern dies im besten Interesse des Anteilinhabers liegt) für diese spezielle PF-Klasse übersteigt.

Die erfolgsabhängige Gebühr wird an jedem Handelstag berechnet und entspricht 15 % des Betrags, um den das prozentuale Wachstum im Nettoinventarwert je Anteil im Berechnungszeitraum das der High Water Mark übersteigt, mit Ausnahme der Klassen I5, für die die erfolgsabhängige Gebühr 15 % des Betrags, um den das prozentuale Wachstum im Nettoinventarwert je Anteil im Berechnungszeitraum das der High Water Mark übersteigt, entspricht.

Die erfolgsabhängige Gebühr läuft an jedem Handelstag auf und bildet Teil des Nettoinventarwerts je Anteil für jede PF-Klasse, wo zutreffend. Jede an einem Handelstag aufgelaufene erfolgsabhängige Gebühr wird von einem am folgenden Handelstag erfolgten Zuwachs bis zum letzten Handelstag des Berechnungszeitraums ersetzt.

In allen Fällen erfolgte beim zur Berechnung der erfolgsabhängigen Gebühr angewandten Nettoinventarwert je Anteil keine vorherige Verwässerungsanpassung, d. h. er enthält keine Swing-Pricing-Anpassung.

Es wird keine erfolgsabhängige Gebühr gezahlt, wenn der Nettoinventarwert je Anteil die High Water Mark überschreitet, und derlei Gebühr wird nur bei einer Outperformance des über die High Water Mark hinausgehenden Nettoinventarwerts je Anteil, wie vorstehend beschrieben, zahlbar.

**FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023**

**5. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)**

**Erfolgsabhängige Gebühren (Fortsetzung)**

*An den Manager und einen Sub-Investment-Manager gezahlte erfolgsabhängige Gebühr (Fortsetzung)*

**Event Driven (Fortsetzung)**

Methode (Fortsetzung)

Anteilinhaber werden darauf hingewiesen, dass die erfolgsabhängige Gebühr auf Anteilklassenebene und nicht auf Ebene des individuellen Anteilinhabers berechnet wird und ihnen daher unter Umständen eine erfolgsabhängige Gebühr in Rechnung gestellt wird, selbst wenn der Nettoinventarwert ihrer Anteile gleich geblieben oder zurückgegangen ist, zum Beispiel, wenn Anteilinhaber Anteile zu einem Zeitpunkt kaufen oder verkaufen, bei dem es sich nicht um den Beginn oder das Ende des Berechnungszeitraums handelt.

Die erfolgsabhängige Gebühr läuft an jedem Handelstag im Nettoinventarwert auf und ist gewöhnlich an den Manager rückwirkend innerhalb von 30 Geschäftstagen am Ende eines jeden Berechnungszeitraums zu zahlen. Im Falle von während des Berechnungszeitraums zurückgenommenen Anteilen ist die aufgelaufene erfolgsabhängige Gebühr in Bezug auf diese Anteile jedoch an den Manager innerhalb von 30 Geschäftstagen des Rücknahmedatums zahlbar.

Festgestellte erfolgsabhängige Gebühren verbleiben in der betreffenden PF-Klasse (partizipieren jedoch nicht an darauffolgenden Gewinnen und Verlusten der betreffenden Klasse), bis sie an den Manager gezahlt werden, und werden nicht zur Bedienung von Rücknahmeanträgen oder zur Zahlung von Gebühren und Aufwendungen der betreffenden PF-Klasse herangezogen oder zur Verfügung gestellt.

Die Verwahrstelle prüft die Berechnung der erfolgsabhängigen Gebühr und stellt sicher, dass sie nicht manipuliert werden kann.

Die Direktoren können mit Zustimmung des Managers die erfolgsabhängige Gebühr, die von einer PF-Klasse zu zahlen ist, reduzieren. Erfolgsabhängige Gebühren fallen auf realisierte und nicht realisierte Kapitalerträge (zur Klarstellung: einschließlich Anlageerträgen) unter Berücksichtigung der realisierten und nicht realisierten Verluste zum Ende des Berechnungszeitraums an. Daher können erfolgsabhängige Gebühren auf nicht realisierte Gewinne gezahlt werden, die in der Folge niemals realisiert werden.

Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 verdiente der Manager eine erfolgsabhängige Gebühr in Höhe von 211.938 USD.

**Tactical Macro**

Der Sub-Investment-Manager hat unter Umständen Anspruch auf eine erfolgsabhängige Gebühr, die aus dem Portfoliovermögen in Bezug auf jede PF-Klasse des betreffenden Portfolios zahlbar ist. Alle Anteilkassen im Portfolio sind PF-Klassen.

Definitionen

|                               |  |
|-------------------------------|--|
| Berechnungszeitraum           | <p>Der Berechnungszeitraum geht normalerweise jährlich vom 1. Januar bis zum 31. Dezember, mit Ausnahme, dass:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• im Fall der Erstausgabe von Anteilen in jeder Klasse der erste Berechnungszeitraum vom Ausgabedatum bis zum 31. Dezember des folgenden Jahres geht;</li> <li>• im Fall der Auflösung einer Klasse der Berechnungszeitraum am Datum der Auflösung endet; und</li> <li>• im Fall der Auflösung des Vertrags des Sub-Investment-Managers während eines Jahres, der Berechnungszeitraum am Datum der Auflösung endet.</li> </ul> |
| Festlegung (Kristallisierung) | <p>Der Punkt, an dem eine erfolgsabhängige Gebühr an den Sub-Investment-Manager zahlbar wird. Die Festlegung erfolgt entweder (i) am Ende des Berechnungszeitraums, (ii) bei Beendigung der Bestellung des Sub-Investment-Managers oder (iii) an einem Handelstag, an dem ein Anteilinhaber den gesamten oder einen Teil seines Anteilsbestands zurückgibt oder umtauscht.</p>   |
| Outperformance                | <p>Die überdurchschnittlich positive Entwicklung des Nettoinventarwerts je Anteil über der Performance der Benchmark im Berechnungszeitraum.</p>   |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 5. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

## Erfolgsabhängige Gebühren (Fortsetzung)

An den Manager und einen Sub-Investment-Manager gezahlte erfolgsabhängige Gebühr (Fortsetzung)

## Tactical Macro (Fortsetzung)

## Benchmarkindizes

| Klassen                  | Index   |
|--------------------------|---|
| USD-Klassen              | ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return, USD)         |
| Abgesicherte Klassen EUR | ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return - EUR Hedged) |
| Abgesicherte Klassen GBP | ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return - GBP Hedged) |
| Abgesicherte Klassen CHF | ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return - CHF Hedged) |
| Abgesicherte Klassen JPY | ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return - JPY Hedged) |

Die Benchmark ist ein weit verbreiteter Richtwert für kurzfristige Zinssätze, der einen Anhaltspunkt für die Durchschnittskurse liefert, zu denen Banken für bestimmte Zeiträume in bestimmten Währungen ungesicherte Interbankkredite aufnehmen können.

Für Klassen, die in anderen als die oben genannten Währungen denominated sind, wird der ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return, USD) die Benchmark sein. Der Index ist gegenüber der jeweiligen Klassenwährung abgesichert und stellt für die Anleger dieser Klassen eine besser geeignete Vergleichsgröße dar.

## Methode

Für jeden Berechnungszeitraum wird bzgl. jeder ausgegebenen Klasse eine erfolgsabhängige Gebühr für eine Outperformance fällig, d. h. die überdurchschnittlich positive Wertentwicklung des Nettoinventarwerts je Anteil (nach Abzug aller Kosten vor dem Abzug einer aufgelaufenen erfolgsabhängigen Gebühr, sofern dies im besten Interesse des Anteilinhabers liegt) gegenüber der Wertentwicklung der für die jeweilige Klasse geltenden Benchmark während des Berechnungszeitraums. Die erfolgsabhängige Gebühr wird an jedem Handelstag berechnet und entspricht bis zu 20 % der für diese spezielle Klasse im selben Zeitraum geltenden Outperformance.

Für den Fall, dass die Performance einer Klasse über einen Berechnungszeitraum geringer ist als die der Benchmark, fällt in Bezug auf diese Klasse keine erfolgsabhängige Gebühr an, bis eine solche kumulative Underperformance gegenüber ihrer Benchmark hereingeholt wurde.

Im Fall, dass die Klasse eine Outperformance in einem Berechnungszeitraum erzielt hat, wird eine erfolgsabhängige Gebühr in Bezug auf diese Klasse zahlbar. Nach der Zahlung wird die Benchmark angepasst, dieser Prozess gewährleistet, dass der Nettoinventarwert je Anteil und die Benchmark zu Beginn des Berechnungszeitraums von derselben Stelle ausgehen. Folglich entspricht der anfängliche Benchmarkwert für den nächsten Berechnungszeitraum dem Nettoinventarwert in Bezug auf die Klasse, für die die erfolgsabhängige Gebühr gezahlt wurde, d. h. wenn der Nettoinventarwert am Ende eines Berechnungszeitraums, in dem eine erfolgsabhängige Gebühr gezahlt wurde, 110 betragen würde, würde der Benchmarkwert zu Beginn des folgenden Berechnungszeitraums ebenfalls 110 betragen.

Anteilinhaber werden darauf hingewiesen, dass im Falle einer zahlbaren erfolgsabhängigen Gebühr auf die Outperformance gegenüber der Benchmark ihnen auch dann eine erfolgsabhängige Gebühr in Rechnung gestellt wird, wenn der Nettoinventarwert je Anteil zurückgegangen ist, allerdings in einem geringeren Ausmaß als die Benchmark.

Anteilinhaber werden darauf hingewiesen, dass die erfolgsabhängige Gebühr auf Anteilklassenebene und nicht auf Ebene des individuellen Anteilinhabers berechnet wird, und da in Bezug auf die erfolgsabhängige Gebühr kein Series Accounting Anwendung findet ihnen daher unter Umständen eine erfolgsabhängige Gebühr in Rechnung gestellt wird, selbst wenn der Nettoinventarwert ihrer Anteile gleich geblieben oder zurückgegangen ist, zum Beispiel, wenn Anteilinhaber Anteile zu einem Zeitpunkt kaufen oder verkaufen, bei dem es sich nicht um den Beginn oder das Ende des Berechnungszeitraums handelt.

Die erfolgsabhängige Gebühr wird täglich zu jedem Bewertungszeitpunkt ermittelt und läuft zu diesem auf. Die erfolgsabhängige Gebühr wird auf den nicht für eine Verwässerungsgebühr angepassten Nettoinventarwert je Anteil berechnet, d. h. bevor eine Swing-Pricing-Anpassung erfolgte (weitere Informationen in Bezug auf „Swing Pricing“ sind im Abschnitt „Ermittlung des Nettoinventarwerts – Bewertungsanpassungen und Swing Pricing“ des Verkaufsprospekts enthalten).

Die erfolgsabhängige Gebühr wird gewöhnlich rückwirkend innerhalb von 30 Geschäftstagen nach dem 31. Dezember jeden Jahres an den Sub-Investment-Manager gezahlt. Für den Fall der Feststellung einer erfolgsabhängigen Gebühr während eines Berechnungszeitraums wird die aufgelaufene erfolgsabhängige Gebühr für solche Beträge innerhalb von 30 Geschäftstagen nach Ende des Kalenderquartals zahlbar, in dem die Feststellung erfolgte.



**FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023**

**5. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)**

**Erfolgsabhängige Gebühren (Fortsetzung)**

*An den Manager und einen Sub-Investment-Manager gezahlte erfolgsabhängige Gebühr (Fortsetzung)*

**Tactical Macro (Fortsetzung)**

Methode (Fortsetzung)

Festgestellte erfolgsabhängige Gebühren verbleiben im Portfolio, bis sie an den Sub-Investment-Manager gezahlt werden, und partizipieren nicht an darauffolgenden Gewinnen oder Verlusten des Portfolios. Festgestellte erfolgsabhängige Gebühren werden nicht zur Bedienung von Rücknahmeanträgen oder zur Zahlung von Gebühren und Aufwendungen des Portfolios oder des Fonds (außer den an den Sub-Investment-Manager zahlbaren Gebühren) herangezogen oder zu Verfügung gestellt.

Die Verwahrstelle prüft die Berechnung der erfolgsabhängigen Gebühr und stellt sicher, dass sie nicht manipuliert werden kann.

Erfolgsabhängige Gebühren fallen auf realisierte und nicht realisierte Kapitalerträge (zur Klarstellung: einschließlich Anlageerträgen) unter Berücksichtigung der realisierten und nicht realisierten Verluste zum Ende des Berechnungszeitraums an. Daher können erfolgsabhängige Gebühren auf nicht realisierte Gewinne gezahlt werden, die in der Folge niemals realisiert werden.

Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 wurden vom Portfolio keine erfolgsabhängigen Gebühren an den Sub-Investment-Manager gezahlt.

**Uncorrelated Strategies**

Der Sub-Investment-Manager hat unter Umständen Anspruch auf eine erfolgsabhängige Gebühr, die aus dem Portfoliovermögen in Bezug auf jede PF-Klasse des betreffenden Portfolios zahlbar ist. Alle Anteilkassen im Portfolio sind PF-Klassen.

Definitionen

|                               |  |
|-------------------------------|--|
| Berechnungszeitraum           | <p>Der Berechnungszeitraum geht normalerweise jährlich vom 1. Januar bis zum 31. Dezember, mit Ausnahme, dass:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• im Fall der Erstausgabe von Anteilen in jeder Klasse der erste Berechnungszeitraum vom Ausgabedatum bis zum 31. Dezember des folgenden Jahres geht;</li> <li>• im Fall der Auflösung einer Klasse der Berechnungszeitraum am Datum der Auflösung endet; und</li> <li>• im Fall der Auflösung des Vertrags des Sub-Investment-Managers während eines Jahres, der Berechnungszeitraum am Datum der Auflösung endet.</li> </ul> |
| Festlegung (Kristallisierung) | <p>Der Punkt, an dem eine erfolgsabhängige Gebühr an den Sub-Investment-Manager zahlbar wird. Die Festlegung erfolgt entweder (i) am Ende des Berechnungszeitraums, (ii) bei Beendigung der Bestellung des Sub-Investment-Managers oder (iii) an einem Handelstag, an dem ein Anteilinhaber den gesamten oder einen Teil seines Anteilsbestands zurückgibt oder umtauscht.</p>   |
| Outperformance                | <p>Die überdurchschnittlich positive Entwicklung des Nettoinventarwerts je Anteil über der Performance der Benchmark im Berechnungszeitraum.</p>   |

**FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023****5. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)****Erfolgsabhängige Gebühren (Fortsetzung)**

An den Manager und einen Sub-Investment-Manager gezahlte erfolgsabhängige Gebühr (Fortsetzung)

**Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)**Benchmarkindizes

| Klassen                  | Index   |
|--------------------------|---|
| USD-Klassen              | ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return, USD)         |
| Abgesicherte Klassen EUR | ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return - EUR Hedged) |
| Abgesicherte Klassen GBP | ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return - GBP Hedged) |
| Abgesicherte Klassen CHF | ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return - CHF Hedged) |
| Abgesicherte Klassen JPY | ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return - JPY Hedged) |

Die Benchmark ist ein weit verbreiteter Richtwert für kurzfristige Zinssätze, der einen Anhaltspunkt für die Durchschnittskurse liefert, zu denen Banken für bestimmte Zeiträume in bestimmten Währungen ungesicherte Interbankkredite aufnehmen können.

Für Klassen, die in anderen als die oben genannten Währungen denominated sind, wird der ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return, USD) die Benchmark sein. Der Index ist gegenüber der jeweiligen Klassenwährung abgesichert.

Methode

Für jeden Berechnungszeitraum wird bzgl. jeder ausgegebenen Klasse eine erfolgsabhängige Gebühr für eine Outperformance fällig, d. h. die überdurchschnittlich positive Wertentwicklung des Nettoinventarwerts je Anteil (nach Abzug aller Kosten vor dem Abzug einer aufgelaufenen erfolgsabhängigen Gebühr, sofern dies im besten Interesse des Anteilinhabers liegt) gegenüber der Wertentwicklung der für die jeweilige Klasse geltenden Benchmark während des Berechnungszeitraums. Die erfolgsabhängige Gebühr wird an jedem Handelstag berechnet und entspricht bis zu 20 % der für diese spezielle Klasse im selben Zeitraum geltenden Outperformance.

Für den Fall, dass die Performance einer Klasse über einen Berechnungszeitraum geringer ist als die der Benchmark, fällt in Bezug auf diese Klasse keine erfolgsabhängige Gebühr an, bis eine solche kumulative Underperformance gegenüber ihrer Benchmark hereingeholt wurde.

Im Fall, dass die Klasse eine Outperformance in einem Berechnungszeitraum erzielt hat, wird eine erfolgsabhängige Gebühr in Bezug auf diese Klasse zahlbar. Nach der Zahlung wird die Benchmark angepasst; dieser Prozess gewährleistet, dass der Nettoinventarwert je Anteil und die Benchmark zu Beginn des Berechnungszeitraums von derselben Stelle ausgehen. Folglich entspricht der anfängliche Benchmarkwert für den nächsten Berechnungszeitraum dem Nettoinventarwert in Bezug auf die Klasse, für die die erfolgsabhängige Gebühr gezahlt wurde, d. h. wenn der Nettoinventarwert am Ende eines Berechnungszeitraums, in dem eine erfolgsabhängige Gebühr gezahlt wurde, 110 betragen würde, würde der Benchmarkwert zu Beginn des folgenden Berechnungszeitraums ebenfalls 110 betragen.

Anteilinhaber werden darauf hingewiesen, dass im Falle einer zahlbaren erfolgsabhängigen Gebühr auf die Outperformance gegenüber der Benchmark ihnen auch dann eine erfolgsabhängige Gebühr in Rechnung gestellt wird, wenn der Nettoinventarwert je Anteil zurückgegangen ist, allerdings in einem geringeren Ausmaß als die Benchmark.

Anteilinhaber werden darauf hingewiesen, dass die erfolgsabhängige Gebühr auf Anteilklassenebene und nicht auf Ebene des individuellen Anteilinhabers berechnet wird und ihnen daher unter Umständen eine erfolgsabhängige Gebühr in Rechnung gestellt wird, selbst wenn der Nettoinventarwert ihrer Anteile gleich geblieben oder zurückgegangen ist, zum Beispiel, wenn Anteilinhaber Anteile zu einem Zeitpunkt kaufen oder verkaufen, bei dem es sich nicht um den Beginn oder das Ende des Berechnungszeitraums handelt.

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 5. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

## Erfolgsabhängige Gebühren (Fortsetzung)

An den Manager und einen Sub-Investment-Manager gezahlte erfolgsabhängige Gebühr (Fortsetzung)

## Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

## Methode (Fortsetzung)

Die erfolgsabhängige Gebühr wird täglich zu jedem Bewertungszeitpunkt ermittelt und läuft zu diesem auf. Die erfolgsabhängige Gebühr wird auf den nicht für eine Verwässerungsgebühr angepassten Nettoinventarwert je Anteil berechnet, d. h. bevor eine Swing-Pricing-Anpassung erfolgte (weitere Informationen in Bezug auf „Swing Pricing“ sind im Abschnitt „Ermittlung des Nettoinventarwerts – Bewertungsanpassungen und Swing Pricing“ des Verkaufsprospekts enthalten).

Die erfolgsabhängige Gebühr wird gewöhnlich rückwirkend innerhalb von 30 Geschäftstagen nach dem 31. Dezember jeden Jahres an den Sub-Investment-Manager gezahlt. Für den Fall der Feststellung einer erfolgsabhängigen Gebühr während eines Berechnungszeitraums wird die aufgelaufene erfolgsabhängige Gebühr für solche Beträge innerhalb von 30 Geschäftstagen nach Ende des Kalenderquartals zahlbar, in dem die Feststellung erfolgte.

Festgestellte erfolgsabhängige Gebühren verbleiben im Portfolio, bis sie an den Sub-Investment-Manager gezahlt werden, und partizipieren nicht an darauffolgenden Gewinnen oder Verlusten des Portfolios. Festgestellte erfolgsabhängige Gebühren werden nicht zur Bedienung von Rücknahmeanträgen oder zur Zahlung von Gebühren und Aufwendungen des Portfolios oder des Fonds (außer den an den Sub-Investment-Manager zahlbaren Gebühren) herangezogen oder zu Verfügung gestellt.

Die Verwahrstelle prüft die Berechnung der erfolgsabhängigen Gebühr und stellt sicher, dass sie nicht manipuliert werden kann.

Erfolgsabhängige Gebühren fallen auf realisierte und nicht realisierte Kapitalerträge (zur Klarstellung: einschließlich Anlageerträgen) unter Berücksichtigung der realisierten und nicht realisierten Verluste zum Ende des Berechnungszeitraums an. Daher können erfolgsabhängige Gebühren auf nicht realisierte Gewinne gezahlt werden, die in der Folge niemals realisiert werden.

Der Sub-Investment-Manager hat im Berichtszeitraum keine erfolgsabhängigen Gebühren erhalten. Bis zum 31. Dezember 2022 hatten die vom Sub-Investment-Manager ernannten Berater („nicht verbundene Unterberater“) Anspruch auf eine erfolgsabhängige Gebühr. Die von nicht verbundenen Unterberatern erhaltenen erfolgsabhängigen Gebühren in dem sechsmonatigen Berichtszeiträumen zum 30. Juni 2022 werden nachstehend aufgeführt.

|                                | <b>30. Juni 2022</b> |
|--------------------------------|----------------------|
|                                | <b>US\$</b>          |
| Altiq LLP                      | 14.728.825           |
| BH-DG Systematic Trading LLP   | 11.891.839           |
| Crabel Capital Management LLC  | 4.182.659            |
| P/E Global LLC                 | 11.068.187           |
| Portman Square Capital         | 6.217.820            |
| Sandbar Asset Management LLP   | 121.822              |
| Soloda Investment Advisors LLP | 8.251.688            |

**FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023****5. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)****Erfolgsabhängige Gebühren (Fortsetzung)**

An den Manager und einen Sub-Investment-Manager gezahlte erfolgsabhängige Gebühr (Fortsetzung)

**Uncorrelated Trading\***

Der Sub-Investment-Manager hat unter Umständen Anspruch auf eine erfolgsabhängige Gebühr, die aus dem Portfoliovermögen und wie genauer unten beschrieben zahlbar ist. Alle Anteilkassen im Portfolio sind PF-Klassen.

Definitionen

|                               |  |
|-------------------------------|--|
| Benchmark                     | ICE BofA 1- Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index in der entsprechenden Klassenwährung.<br>Die Benchmark ist ein weit verbreiteter Richtwert für kurzfristige Zinssätze, der einen Anhaltspunkt für die Durchschnittskurse liefert, zu denen Banken für bestimmte Zeiträume in bestimmten Währungen ungesicherte Interbankenkredite aufnehmen können.   |
| Berechnungszeitraum           | Der Berechnungszeitraum geht normalerweise jährlich vom 1. Januar bis zum 31. Dezember, mit Ausnahme, dass: <ul style="list-style-type: none"> <li>• im Fall der Erstaussgabe von Anteilen in jeder Klasse der erste Berechnungszeitraum vom Ausgabedatum bis zum 31. Dezember des folgenden Jahres geht;</li> <li>• im Fall der Auflösung einer Klasse der Berechnungszeitraum am Datum der Auflösung endet; und</li> <li>• im Fall der Auflösung des Vertrags des Sub-Investment-Managers während eines Jahres, der Berechnungszeitraum am Datum der Auflösung endet.</li> </ul> |
| Festlegung (Kristallisierung) | Der Punkt, an dem eine erfolgsabhängige Gebühr an den Sub-Investment-Manager zahlbar wird. Die Festlegung erfolgt entweder (i) am Ende des Berechnungszeitraums, (ii) bei Beendigung der Bestellung des Sub-Investment-Managers oder (iii) an einem Handelstag, an dem ein Anteilinhaber den gesamten oder einen Teil seines Anteilsbestands zurückgibt oder umtauscht.  |
| Outperformance                | Die überdurchschnittlich positive Entwicklung des Nettoinventarwerts je Anteil über der Performance der Benchmark im Berechnungszeitraum.  |

Methode

Für jeden Berechnungszeitraum wird bzgl. jeder ausgegebenen Klasse eine erfolgsabhängige Gebühr für eine Outperformance fällig, d. h. die überdurchschnittlich positive Wertentwicklung des Nettoinventarwerts je Anteil (nach Abzug aller Kosten vor dem Abzug einer aufgelaufenen erfolgsabhängigen Gebühr, sofern dies im besten Interesse des Anteilinhabers liegt) gegenüber der Wertentwicklung der für die jeweilige Klasse geltenden Benchmark während des Berechnungszeitraums. Die erfolgsabhängige Gebühr wird an jedem Handelstag berechnet und entspricht bis zu 20 % der für diese spezielle Klasse im selben Zeitraum geltenden Outperformance.

Für den Fall, dass die Performance einer Klasse über einen Berechnungszeitraum geringer ist als die der Benchmark, fällt in Bezug auf diese Klasse keine erfolgsabhängige Gebühr an, bis eine solche kumulative Underperformance gegenüber ihrer Benchmark hereingeholt wurde.

Im Fall, dass die Klasse eine Outperformance in einem Berechnungszeitraum erzielt hat, wird eine erfolgsabhängige Gebühr in Bezug auf diese Klasse zahlbar. Nach der Zahlung wird die Benchmark angepasst, dieser Prozess gewährleistet, dass der Nettoinventarwert je Anteil und die Benchmark zu Beginn des Berechnungszeitraums von derselben Stelle ausgehen. Folglich entspricht der anfängliche Benchmarkwert für den nächsten Berechnungszeitraum dem Nettoinventarwert in Bezug auf die Klasse, für die die erfolgsabhängige Gebühr gezahlt wurde, d. h. wenn der Nettoinventarwert am Ende eines Berechnungszeitraums, in dem eine erfolgsabhängige Gebühr gezahlt wurde, 110 betragen würde, würde der Benchmarkwert zu Beginn des folgenden Berechnungszeitraums ebenfalls 110 betragen.

Anteilinhaber werden darauf hingewiesen, dass im Falle einer zahlbaren erfolgsabhängigen Gebühr auf die Outperformance gegenüber der Benchmark ihnen auch dann eine erfolgsabhängige Gebühr in Rechnung gestellt wird, wenn der Nettoinventarwert je Anteil zurückgegangen ist, allerdings in einem geringeren Ausmaß als die Benchmark.

**FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023****5. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)****Erfolgsabhängige Gebühren (Fortsetzung)**

*An den Manager und einen Sub-Investment-Manager gezahlte erfolgsabhängige Gebühr (Fortsetzung)*

**Uncorrelated Trading\* (Fortsetzung)**Methode (Fortsetzung)

Anteilinhaber werden darauf hingewiesen, dass die erfolgsabhängige Gebühr auf Anteilklassenebene und nicht auf Ebene des individuellen Anteilinhabers berechnet wird und ihnen daher unter Umständen eine erfolgsabhängige Gebühr in Rechnung gestellt wird, selbst wenn der Nettoinventarwert ihrer Anteile gleich geblieben oder zurückgegangen ist, zum Beispiel, wenn Anteilinhaber Anteile zu einem Zeitpunkt kaufen oder verkaufen, bei dem es sich nicht um den Beginn oder das Ende des Berechnungszeitraums handelt.

Die erfolgsabhängige Gebühr wird täglich zu jedem Bewertungszeitpunkt ermittelt und läuft zu diesem auf. Die erfolgsabhängige Gebühr wird auf den nicht für eine Verwässerungsgebühr angepassten Nettoinventarwert je Anteil berechnet, d. h. bevor eine Swing-Pricing-Anpassung erfolgte (weitere Informationen in Bezug auf „Swing Pricing“ sind im Abschnitt „Ermittlung des Nettoinventarwerts – Bewertungsanpassungen und Swing Pricing“ des Verkaufsprospekts enthalten).

Die erfolgsabhängige Gebühr wird gewöhnlich rückwirkend innerhalb von 30 Geschäftstagen nach dem 31. Dezember jeden Jahres an den Sub-Investment-Manager gezahlt. Für den Fall der Feststellung einer erfolgsabhängigen Gebühr während eines Berechnungszeitraums wird die aufgelaufene erfolgsabhängige Gebühr für solche Beträge innerhalb von 30 Geschäftstagen nach Ende des Kalenderquartals zahlbar, in dem die Feststellung erfolgte.

Festgestellte erfolgsabhängige Gebühren verbleiben im Portfolio, bis sie an den Sub-Investment-Manager gezahlt werden, und partizipieren nicht an darauffolgenden Gewinnen oder Verlusten des Portfolios. Festgestellte erfolgsabhängige Gebühren werden nicht zur Bedienung von Rücknahmeanträgen oder zur Zahlung von Gebühren und Aufwendungen des Portfolios oder des Fonds (außer den an den Sub-Investment-Manager zahlbaren Gebühren) herangezogen oder zu Verfügung gestellt.

Die Verwahrstelle prüft die Berechnung der erfolgsabhängigen Gebühr und stellt sicher, dass sie nicht manipuliert werden kann.

Erfolgsabhängige Gebühren fallen auf realisierte und nicht realisierte Kapitalerträge (zur Klarstellung: einschließlich Anlageerträgen) unter Berücksichtigung der realisierten und nicht realisierten Verluste zum Ende des Berechnungszeitraums an. Daher können erfolgsabhängige Gebühren auf nicht realisierte Gewinne gezahlt werden, die in der Folge niemals realisiert werden.

Für die Berichtszeiträume zum 30. Juni 2023 und 30. Juni 2022 wurden vom Portfolio keine erfolgsabhängigen Gebühren an den Sub-Investment-Manager gezahlt.

\* Das Portfolio wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst.

**Gebühren der Verwahrstelle**

Die Gesellschaft bezahlt der Verwahrstelle eine Gebühr für Treuhanddienstleistungen für jedes Portfolio die maximal 0,02 % pro Jahr des NIW des jeweiligen Portfolios beträgt und monatlich anfällt und monatlich rückwirkend zahlbar ist. Die Verwahrstelle hat auch Anspruch auf Erstattung von dem Fonds aus dem Portfoliosvermögen von Verwahrgebühren, Transaktionsgebühren und angemessenen Auslagen („Depotbankgebühren“), die zugunsten des Portfolios entstehen, einschließlich der Gebühren (die normale kommerzielle Sätze nicht übersteigen werden) und angemessener Auslagen von Unter-Depotbanken, die von der Verwahrstelle beauftragt werden.

**FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023****6. HONORARE UND AUFWENDUNGEN DER DIREKTOREN**

Die Direktoren haben als Vergütung für ihre Dienste Anspruch auf ein Honorar, dessen Höhe von Zeit zu Zeit von den Direktoren festgelegt wird, wobei der an einen Direktor jährlich in Bezug auf den Fonds zu zahlende Betrag der Vergütung 75.000 EUR (oder 85.000 EUR im Falle eines Vorsitzenden des Fonds) oder einen anderen Betrag, den die Direktoren jeweils ggf. festlegen, nicht überschreiten wird. Die Direktoren sowie diese ggf. vertretende Direktoren haben Anspruch auf die Erstattung sämtlicher angemessener Reise-, Hotel- und anderer Kosten, die ihnen bei der Teilnahme an Sitzungen der Direktoren oder der Anteilinhaber oder anderen Versammlungen im Zusammenhang mit dem Geschäftsbetrieb des Fonds entstehen. Sämtliche auf die Honorare der Direktoren gezahlten Lohnsteuern sind in den Gesamtkosten enthalten. Keiner der Direktoren hat einen Dienstvertrag mit dem Fonds abgeschlossen, derartige Verträge sind auch nicht vorgesehen, und kein Direktor ist in der Unternehmensleitung des Fonds tätig. Die Direktoren, die zugleich Mitarbeiter von Neuberger Berman Europe Limited sind, erhalten für ihre Dienstleistungen als Direktoren der Gesellschaft kein Honorar.

Die Gesamtbezüge der Direktoren (einschließlich Spesen) für den Sechsmonatszeitraum zum 30. Juni 2023 betragen insgesamt 125.151 US\$ (30. Juni 2022: 134.547 USD), von denen 60.894 USD am Ende des Berichtszeitraums noch ausstanden (31. Dezember 2022: 60.237 US\$).

Zum 30. Juni 2023 waren Michelle Green und Alex Duncan Direktoren und ebenfalls bei der Neuberger Berman Europe Limited („NBEL“), dem Sub-Investment-Manager und der Vertriebsstelle des Fonds, angestellt. Bis zum 15. Februar 2023 war Frau Michelle Green zudem eine Direktorin der Neuberger Berman Asset Management Ireland Limited („NBAMIL“), dem Manager des Fonds. Michelle Green und Alex Duncan haben sich freiwillig bereit erklärt auf ihren Anspruch auf eine Vergütung in Hinblick auf ihre Pflichten als Direktoren für den Sechsmonatszeitraum bis 30. Juni 2023 zu verzichten (30. Juni 2022: ebenso).

Die Honorare der Direktoren werden vor Abzug der Einkommensteuer ausgewiesen. Von den Direktoren wurden keine Sachleistungen bezogen.

**7. SONSTIGE GEBÜHREN UND KOSTEN**

Die Transaktionskosten sind die beim Kauf, bei der Emission oder beim Verkauf von finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten anfallenden Kosten. Zu den Transaktionskosten gehören Gebühren und Provisionen für Makler und Händler, die an Aufsichtsbehörden und Börsen zahlbaren Gebühren und bei der Übertragung fällig werdenden Steuern und Abgaben. Die Transaktionskosten erstrecken sich nicht auf Auf- oder Abschläge auf Fremdkapitalanlagen, Finanzierungskosten oder interne Verwaltungs- bzw. Haltekosten. Diese Kosten werden verbucht, sobald sie anfallen und für die Zwecke der Finanzberichterstattung in der Gewinn- und Verlustrechnung als Aufwand erfasst.

Der Fonds und die Portfolios zahlen auch bestimmte sonstige Kosten, Gebühren, Honorare und Aufwendungen, die im Rahmen ihres Betriebs entstehen. Diese können insbesondere Gebühren und Kosten enthalten, die im Zusammenhang mit Bank- und Maklerdienstleistungen beim Kauf und Verkauf von Wertpapieren der Portfolios entstehen, Steuern, Versicherungen, die Kosten und Aufwendungen für die Buchführung und die Abfassung, den Druck, die Veröffentlichung und Verteilung der Verkaufsprospekte, Nachträge, Jahres- und Halbjahresberichte und sonstiger Dokumente und Informationen (in den jeweils notwendigen Sprachen) für bestehende oder potenzielle Anteilinhaber (einschließlich der Kosten für die Entwicklung und Verbesserung von Software und elektronischen Übertragungstechniken zur Verteilung dieser Dokumente oder Informationen), die Kosten für die Veröffentlichung von Preis- und Renditeinformationen in den relevanten Medien, die Kosten und Aufwendungen für das Einholen von Genehmigungen oder Registrierungen der Gesellschaft oder von Anteilen bei den Aufsichtsbehörden verschiedener Rechtsordnungen, einschließlich etwaiger von der Central Bank of Ireland erhobener Abgaben, die Kosten für die Notierung und Aufrechterhaltung der Notierung von Anteilen an einer Börse, Marketing- und Werbekosten, die Kosten für die Einberufung und Abhaltung der Versammlungen der Direktoren und der Anteilinhaber, die Kosten für die Ausübung der Stimmrechte im Zusammenhang mit der Anlage der Gesellschaft im besten Interesse der Anteilinhaber und die Honorare und Aufwendungen für Rechts-, Rechnungsprüfungs- und andere Beratungsleistungen, sämtliche Kosten, die durch die Auflösung oder Liquidierung der Gesellschaft entstehen, sowie alle weiteren Kosten und Aufwendungen (einmalige und außerordentliche Kosten und Aufwendungen eingeschlossen), die von Zeit zu Zeit entstehen und von den Direktoren als notwendig oder angemessen für den fortdauernden Geschäftsbetrieb der Gesellschaft oder eines Portfolios genehmigt wurden. Im Zusammenhang mit der Registrierung des Fonds oder der Anteile zum Verkauf in bestimmten Rechtsordnungen zahlt der Fonds die Gebühren und Kosten von Zahl- und Informationsstellen und/oder Korrespondenzbanken. Diese Zahlungen erfolgen zu marktüblichen Sätzen.

Der Manager begleicht alle Kosten für von ihm bezogenes Research direkt, ungeachtet der Bezugsquelle. Sub-Investment-Manager mit Sitz außerhalb der EU, die bezogenes Research nicht in die EU weiterleiten, können dem betreffenden Portfolio durch Bereitstellung eines jährlichen Research-Budgets für jedes Portfolio Research-Kosten in Rechnung stellen.

Für die Zwecke des Halbjahresabschlusses werden Gründungsaufwendungen in der Gewinn- und Verlustrechnung als Aufwand erfasst. Für die Berechnung des NIW pro Anteil Aktie für Handelszwecke der Anteilinhaber werden Gründungsaufwendungen über die ersten zwei Jahre der Laufzeit des Portfolios abgeschrieben.

FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

8. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN

Gemäß FRS 102 „Transaktionen mit nahe stehenden Parteien“ gelten Parteien als nahe stehend, wenn eine Partei die Möglichkeit hat, die Kontrolle über die andere Partei auszuüben oder bei finanziellen oder betrieblichen Entscheidungen entscheidenden Einfluss auf die andere Partei auszuüben.

Michelle Green und Alex Duncan sind Direktoren des Fonds und sind auch bei der NBEL, dem Sub-Investment-Manager und der Vertriebsstelle des Fonds, angestellt. Bis zum 15. Februar 2023 war Frau Michelle Green auch Direktorin von NBAMIL, der Manager der Gesellschaft. Die von NBEL und NBAMIL in den Sechsmonatszeiträumen zum 30. Juni 2023 und zum 30. Juni 2022 erhältlichen Gebühren sind in der nachstehenden Tabelle aufgeführt. Nähere Angaben zu den in den zum 30. Juni 2023 und 30. Juni 2022 gezahlten Honoraren der Direktoren finden sich in Anmerkung 6.

| Managementgebühren, Gebühren der Verwaltungsstelle und erfolgsabhängige Gebühren*          | 30. Juni 2023 | 30. Juni 2022 |
|--|---------------|---------------|
|  | US\$          | US\$          |
| Von NBAMIL erhaltene Managementgebühren und Gebühren der Verwaltungsstelle, ohne Verzichte | 115.480.410   | 121.502.990   |
| Beratungsgebühren und Kostenverzichte  | (1.670.750)   | (1.510.886)   |
| Ausstehende Managementgebühren   | 15.860.154    | 17.618.159    |
| Von NBAMIL erhaltene erfolgsabhängige Gebühren   | 211.938       | -             |
| Ausstehende erfolgsabhängige Gebühren  | 211.938       | -             |

\*Weitere Informationen zu den Managementgebühren und erfolgsabhängigen Gebühren finden sich in Anmerkung 5.

Zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022 hielten folgende Portfolios andere, von mit dem Manager verbundenen Unternehmen verwaltete Portfolios:

| Portfolio                                | Bestand*                            | Verwaltet von | 30. Juni 2023 |            | 31. Dezember 2022 |            |
|--|-------------------------------------|---------------|---------------|------------|-------------------|------------|
|  |                                     |               | Anteile       | Wert       | Anteile           | Wert       |
| Corporate Hybrid Bond                    | Global Investment Grade Credit      | NBAMIL        | 1.300.000     | 10.426.214 | 1.300.000         | 10.317.170 |
| Emerging Market Debt - Hard Currency     | Ultra Short Term Euro Bond          | NBAMIL        | 150.000       | 16.618.500 | 150.000           | 16.110.000 |
| Emerging Market Debt - Local Currency    | China Bond                          | NBAMIL        | 1.595.000     | 15.886.200 | 1.595.000         | 15.136.550 |
| Emerging Market Debt Blend               | China Bond                          | NBAMIL        | 1.409.964     | 14.043.241 | 1.409.964         | 13.380.558 |
| Global Flexible Credit Income            | NB Global Monthly Income Fund Ltd** | NBIA***       | 171.898       | 163.907    | 394.721           | 338.564    |
| Global Opportunistic Bond                | Global Investment Grade Credit      | NBAMIL        | -             | -          | 200.000           | 1.694.000  |
| Global Opportunistic Bond                | NB Global Monthly Income Fund Ltd** | NBIA***       | 54.437        | 51.906     | 125.000           | 107.216    |
| High Yield Bond                          | NB Global Monthly Income Fund Ltd** | NBIA***       | 9.288.723     | 8.856.913  | 21.329.208        | 18.294.706 |
| Multi-Asset Income                       | China Bond                          | NBAMIL        | -             | -          | 40.890            | 388.047    |
| Multi-Asset Income                       | Commodities                         | NBAMIL        | -             | -          | 16.300            | 184.515    |
| Short Duration Emerging Market Debt      | Ultra Short Term Euro Bond          | NBAMIL        | 655.000       | 72.567.450 | 655.000           | 70.347.000 |
| Short Duration High Yield SDG Engagement | NB Global Monthly Income Fund Ltd** | NBIA***       | 619.956       | 591.136    | 1.423.570         | 1.221.039  |
| Strategic Income                         | China Bond                          | NBAMIL        | 1.208.113     | 11.634.127 | 1.208.113         | 11.815.344 |
| Strategic Income                         | Euro Bond Absolute Return           | NBAMIL        | 945.691       | 10.572.830 | 945.691           | 10.270.208 |
| Strategic Income                         | European High Yield Bond            | NBAMIL        | 486.855       | 5.822.785  | 486.855           | 5.477.118  |
| Strategic Income                         | Global Flexible Credit Income       | NBAMIL        | 459.982       | 5.133.394  | 459.982           | 4.921.803  |
| Strategic Income                         | Global High Yield SDG Engagement    | NBAMIL        | 654.438       | 8.363.721  | 654.438           | 8.062.679  |
| Strategic Income                         | Global Investment Grade Credit      | NBAMIL        | 2.000.000     | 17.500.000 | 2.000.000         | 16.940.000 |
| Strategic Income                         | NB Global Monthly Income Fund Ltd** | NBIA***       | 375.051       | 357.616    | 861.209           | 738.685    |

\*Zum 30. Juni 2023 (ggf. 31. Dezember 2022) betrug die effektive Managementgebühr nach Ermäßigung(en) für jede der oben genannten Bestände in jedem Portfolio 0,00 %.

\*\* Die Managementgebühr für den NB Global Monthly Income Fund Ltd beträgt 0,75 %.

\*\*\* Neuberger Berman Investment Advisers LLC.

**FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023****8. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)**

Der Manager gewährte den vorstehend genannten Portfolios im Zusammenhang mit ihren Anlagen einen Rabatt, so dass ihre effektiven Managementgebührensätze für die Anlagen 0,00 % betragen (31. Dezember 2022: gleich). Der von jedem Portfolio gewährte Gebührenverzicht wird unter „Verzicht auf Beratungsgebühren“ in den Gewinn- und Verlustrechnungen ausgewiesen.

Zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022 wurden die Überkreuzinvestitionen zwischen den Portfolios der Gesellschaft vom konsolidierten Abschluss ausgeschlossen.

*Verbundene Personen*

In Übereinstimmung mit der OGAW-Vorschrift 48(1) der Zentralbank muss eine Transaktion, die vom Investment-Manager, der Verwahrstelle, dem Anlageberater und/oder einem mit diesen Rechtsträgern verbundenem Unternehmen oder einer verbundenen Firmengruppe („verbundene Personen“) mit dem Fonds durchgeführt wird, zu normalen Marktbedingungen ausgehandelt werden. Diese Transaktionen müssen im besten Interesse der Anteilhaber des Fonds sein.

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

Den Direktoren sind mit Ausnahme der in diesem Halbjahresabschluss angegebenen keine Transaktionen mit nahe stehenden Parteien im Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 bekannt (31. Dezember 2022: ebenso).



FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

8. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

Zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022 hatten die folgenden Anteilinhaber, die als nahe stehende Parteien galten, folgende Anlagen im Fonds getätigt.

| Portfolio                  | Anteilkategorie                                       | Anteilinhaber                        | 30. Juni 2023<br>Anzahl der Anteile | 31. Dezember 2022<br>Anzahl der Anteile |
|----------------------------|---|--------------------------------------|-------------------------------------|---|
| 5G Connectivity            | Thesaurierende Klasse EUR I                           | Neuberger Berman Asia Holdings LLC   | -                                   | 1.871                                   |
| 5G Connectivity            | Thesaurierende Klasse EUR I5                          | Neuberger Berman Employee            | 1.965                               | 1.965                                   |
| 5G Connectivity            | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.326                               | 2.326                                   |
| 5G Connectivity            | Thesaurierende Klasse USD I                           | Neuberger Berman Employee            | -                                   | 500                                     |
| 5G Connectivity            | Ausschüttende Klasse USD I                            | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                                   | 552                                     |
| 5G Connectivity            | Thesaurierende Klasse USD I3                          | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.000                               | 1.000                                   |
| 5G Connectivity            | Thesaurierende Klasse USD I5                          | Neuberger Berman Employee            | 9.953                               | 9.953                                   |
| 5G Connectivity            | Thesaurierende Klasse USD Z                           | Neuberger Berman Employee            | 112.195                             | 112.195                                 |
| Asian Debt - Hard Currency | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)                | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.046                               | 1.046                                   |
| Asian Debt - Hard Currency | Thesaurierende Klasse USD A                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                                   | 1.000                                   |
| Asian Debt - Hard Currency | Thesaurierende Klasse USD I                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                                   | 1.000                                   |
| Asian Debt - Hard Currency | Ausschüttende Klasse USD I                            | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                                   | 1.162.791                               |
| Asian Debt - Hard Currency | Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich)               | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.000                               | 1.000                                   |
| Asian Debt - Hard Currency | Thesaurierende Klasse USD I4                          | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.000                               | 1.000                                   |
| Asian Debt - Hard Currency | Ausschüttende Klasse USD X (Monatlich)                | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.000                               | 1.000                                   |
| Asian Debt - Hard Currency | Thesaurierende Klasse USD X                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.193                               | 2.193                                   |
| Asian Debt - Hard Currency | Thesaurierende Klasse USD Z                           | Neuberger Berman Asia Holdings LLC   | 3.887.269                           | -                                       |
| Asian Debt - Hard Currency | Thesaurierende Klasse USD Z                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.004.281                           | -                                       |
| Asian Debt - Hard Currency | Thesaurierende Klasse USD Z                           | Neuberger Berman Group LLC           | 848.201                             | 848.201                                 |
| China A-Share Equity       | Thesaurierende Klasse CNY I                           | Neuberger Berman Asia Holdings LLC   | 688                                 | 688                                     |
| China A-Share Equity       | Thesaurierende Klasse CNY I                           | Neuberger Berman Employee            | 774                                 | 774                                     |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 8. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

| Portfolio                | Anteilkategorie                                       | Anteilinhaber                             | 30. Juni 2023      | 31. Dezember 2022  |
|--------------------------|---|---|--------------------|--------------------|
|                          |   |   | Anzahl der Anteile | Anzahl der Anteile |
| China A-Share Equity     | Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Asia Holdings LLC        | 1.000              | 1.000              |
| China A-Share Equity     | Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Employee                 | 1.934              | 1.934              |
| China A-Share Equity     | Ausschüttende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)  | Neuberger Berman Asia Holdings LLC        | 250.091            | 250.091            |
| China Bond               | Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)                | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 1.993              | 1.993              |
| China Bond               | Ausschüttende Klasse CNY I                            | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 2.347              | 2.347              |
| China Bond               | Thesaurierende Klasse CNY Z                           | Neuberger Berman Employee                 | 1.218              | 1.218              |
| China Bond               | Thesaurierende Klasse CNY Z                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | 614                | 614                |
| China Bond               | Thesaurierende Klasse GBP I2                          | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 2.176              | 2.176              |
| China Bond               | Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | 1.003              | 1.003              |
| China Bond               | Thesaurierende Klasse USD Z                           | Emerging Market Debt - Local Currency     | 1.595.000          | 1.595.000          |
| China Bond               | Thesaurierende Klasse USD Z                           | Emerging Market Debt Blend                | 1.409.964          | 1.409.964          |
| China Bond               | Thesaurierende Klasse USD Z                           | Multi-Asset Income                        | -                  | 40.890             |
| China Bond               | Thesaurierende Klasse USD Z                           | Neuberger Berman Employee                 | 40.000             | 40.000             |
| China Bond               | Thesaurierende Klasse USD Z (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Employee                 | 196                | 7.283              |
| China Bond               | Thesaurierende Klasse USD Z (nicht währungsgesichert) | Strategic Income                          | 1.208.113          | 1.208.113          |
| China Equity             | Thesaurierende Klasse EUR Z                           | Neuberger Berman Employee                 | 891                | 891                |
| China Equity             | Thesaurierende Klasse USD Z                           | Neuberger Berman Employee                 | 16.177             | 16.177             |
| CLO Income               | Thesaurierende Klasse EUR A                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 2.824              | 2.824              |
| CLO Income               | Thesaurierende Klasse USD A                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 3.144              | 3.144              |
| CLO Income               | Thesaurierende Klasse USD Z                           | Neuberger Berman Employee                 | 43.436             | 42.619             |
| Commodities <sup>1</sup> | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 806                | 806                |
| Commodities <sup>1</sup> | Thesaurierende Klasse GBP I5                          | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | -                  | 2.290              |
| Commodities <sup>1</sup> | Thesaurierende Klasse USD I                           | Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd | 1.431              | 1.431              |

FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

8. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

| Portfolio                             | Anteilkategorie                        | Anteilinhaber                        | 30. Juni 2023      | 31. Dezember 2022  |
|---------------------------------------|--|--------------------------------------|--------------------|--------------------|
|                                       |  |                                      | Anzahl der Anteile | Anzahl der Anteile |
| Commodities <sup>1</sup>              | Thesaurierende Klasse USD Z            | Multi-Asset Income                   | -                  | 16.300             |
| Commodities <sup>1</sup>              | Thesaurierende Klasse USD Z            | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | -                  | 1.000              |
| Commodities <sup>1</sup>              | Thesaurierende Klasse USD Z            | Neuberger Berman Employee            | 14.369             | 9.284              |
| Corporate Hybrid Bond                 | Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.390              | 1.390              |
| Corporate Hybrid Bond                 | Thesaurierende Klasse EUR I            | Neuberger Berman Employee            | 15.690             | 9.000              |
| Corporate Hybrid Bond                 | Ausschüttende Klasse EUR I2            | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | -                  | 2.462              |
| Corporate Hybrid Bond                 | Thesaurierende Klasse GBP I            | Neuberger Berman Employee            | 973                | 973                |
| Corporate Hybrid Bond                 | Ausschüttende Klasse USD A             | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 3.000              | 3.000              |
| Corporate Hybrid Bond                 | Ausschüttende Klasse USD I             | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 3.000              | 3.000              |
| Corporate Hybrid Bond                 | Ausschüttende Klasse USD I2            | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.128              | 1.128              |
| Corporate Hybrid Bond                 | Thesaurierende Klasse USD Z            | Neuberger Berman Employee            | 33.729             | 33.729             |
| Emerging Market Debt - Hard Currency  | Thesaurierende Klasse CHF I2           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.911              | 2.911              |
| Emerging Market Debt - Hard Currency  | Thesaurierende Klasse CHF P            | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.118              | 1.118              |
| Emerging Market Debt - Hard Currency  | Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                  | 1.008              |
| Emerging Market Debt - Hard Currency  | Thesaurierende Klasse EUR P            | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                  | 946                |
| Emerging Market Debt - Hard Currency  | Thesaurierende Klasse EUR Z            | Neuberger Berman Employee            | 47.903             | 36.062             |
| Emerging Market Debt - Hard Currency  | Thesaurierende Klasse GBP P            | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                  | 978                |
| Emerging Market Debt - Hard Currency  | Ausschüttende Klasse USD A             | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.000              | 1.000              |
| Emerging Market Debt - Hard Currency  | Ausschüttende Klasse USD I2            | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                  | 1.000              |
| Emerging Market Debt - Hard Currency  | Thesaurierende Klasse USD Z            | Neuberger Berman Employee            | 10.002             | 9.752              |
| Emerging Market Debt - Local Currency | Thesaurierende Klasse AUD B            | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 824                | 824                |
| Emerging Market Debt - Local Currency | Thesaurierende Klasse AUD C2           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 925                | -                  |
| Emerging Market Debt - Local Currency | Thesaurierende Klasse AUD E            | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.494              | 1.494              |
| Emerging Market Debt - Local Currency | Thesaurierende Klasse AUD T            | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.472              | 1.472              |
| Emerging Market Debt - Local Currency | Thesaurierende Klasse EUR I            | Neuberger Berman Employee            | 14.328             | 14.328             |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 8. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

| Portfolio   | Anteilkategorie                                       | Anteilinhaber   | 30. Juni 2023      | 31. Dezember 2022  |
|---|---|---|--------------------|--------------------|
|   |   |   | Anzahl der Anteile | Anzahl der Anteile |
| Emerging Market Debt - Local Currency                   | Thesaurierende Klasse GBP I                           | Neuberger Berman Employee   | 7.903              | 7.903              |
| Emerging Market Debt - Local Currency                   | Thesaurierende Klasse GBP I                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC                                    | 1.011              | 1.011              |
| Emerging Market Debt - Local Currency                   | Thesaurierende Klasse SEK A                           | Neuberger Berman Employee   | 11.535             | 11.535             |
| Emerging Market Debt - Local Currency                   | Thesaurierende Klasse USD B                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC                                    | 1.000              | 1.000              |
| Emerging Market Debt - Local Currency                   | Thesaurierende Klasse USD E                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC                                    | 1.000              | 1.000              |
| Emerging Market Debt - Local Currency                   | Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)                | Bond-Plus Income & Growth Multi-Asset Class Securities Investment Trust | 5.221.523          | 5.097.097          |
| Emerging Market Debt - Local Currency                   | Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)                | Global Strategic Income   | 192.560            | 192.560            |
| Emerging Market Debt - Local Currency                   | Thesaurierende Klasse USD I5                          | Neuberger Berman Europe Holdings LLC                                    | 1.579              | -                  |
| Emerging Market Debt - Local Currency                   | Thesaurierende Klasse USD T                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC                                    | 950                | 950                |
| Emerging Market Debt - Local Currency                   | Thesaurierende Klasse ZAR C2                          | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                    | 1.596              | -                  |
| Emerging Market Debt - Local Currency                   | Thesaurierende Klasse ZAR E                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC                                    | 855                | 855                |
| Emerging Market Debt - Local Currency                   | Thesaurierende Klasse ZAR T                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC                                    | 1.683              | 1.683              |
| Emerging Market Debt Blend                              | Ausschüttende Klasse EUR I3                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC                                    | 3.000              | 3.000              |
| Emerging Market Debt Blend                              | Thesaurierende Klasse EUR Z                           | Neuberger Berman Employee   | 8.737              | 9.487              |
| Emerging Market Debt Blend                              | Ausschüttende Klasse GBP I                            | Neuberger Berman Europe Holdings LLC                                    | -                  | 746                |
| Emerging Market Debt Blend                              | Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)  | Neuberger Berman Europe Holdings LLC                                    | 746                | 746                |
| Emerging Market Debt Blend                              | Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                    | 772                | 772                |
| Emerging Market Debt Blend                              | Thesaurierende Klasse NOK U                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                    | 2.286              | 2.286              |
| Emerging Market Debt Blend                              | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)                | Neuberger Berman Europe Holdings LLC                                    | 699                | 699                |
| Emerging Market Debt Blend                              | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)                | Neuberger Berman Europe Holdings LLC                                    | 1.025              | 1.025              |
| Emerging Market Debt Blend                              | Ausschüttende Klasse USD I                            | Neuberger Berman Europe Holdings LLC                                    | 9                  | 9                  |
| Emerging Market Debt Blend                              | Thesaurierende Klasse USD Z                           | Neuberger Berman Employee   | 9.460              | 9.460              |
| Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend | Thesaurierende Klasse NOK I                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC                                    | 808                | 808                |
| Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend | Thesaurierende Klasse USD Z                           | Neuberger Berman Employee   | 81                 | 81                 |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 8. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

| Portfolio   | Anteilkategorie                                      | Anteilinhaber                        | 30. Juni 2023      | 31. Dezember 2022  |
|---|--|--------------------------------------|--------------------|--------------------|
|   |  |                                      | Anzahl der Anteile | Anzahl der Anteile |
| Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend | Thesaurierende Klasse USD Z                          | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 250.358            | 250.358            |
| Emerging Markets Equity                                 | Thesaurierende Klasse AUD B                          | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.356              | 1.356              |
| Emerging Markets Equity                                 | Thesaurierende Klasse AUD C2                         | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.575              | -                  |
| Emerging Markets Equity                                 | Thesaurierende Klasse AUD E                          | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.356              | 1.356              |
| Emerging Markets Equity                                 | Thesaurierende Klasse AUD T                          | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 2.662              | 2.662              |
| Emerging Markets Equity                                 | Ausschüttende Klasse CAD I (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 8.283              | 8.283              |
| Emerging Markets Equity                                 | Thesaurierende Klasse EUR M                          | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 901                | 901                |
| Emerging Markets Equity                                 | Thesaurierende Klasse EUR Z                          | Neuberger Berman Employee            | 22.279             | 22.279             |
| Emerging Markets Equity                                 | Thesaurierende Klasse GBP Z                          | Neuberger Berman Employee            | 800                | 800                |
| Emerging Markets Equity                                 | Thesaurierende Klasse USD T                          | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 670                | 670                |
| Emerging Markets Equity                                 | Thesaurierende Klasse USD Z                          | Neuberger Berman Employee            | 24.884             | 24.884             |
| Emerging Markets Equity                                 | Thesaurierende Klasse ZAR B                          | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.410              | 1.410              |
| Emerging Markets Equity                                 | Thesaurierende Klasse ZAR E                          | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.410              | 1.410              |
| Emerging Markets Equity                                 | Thesaurierende Klasse ZAR T                          | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 2.765              | 2.765              |
| Emerging Markets Select Equity                          | Thesaurierende Klasse USD I                          | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 814                | 814                |
| Euro Bond Absolute Return                               | Thesaurierende Klasse EUR I                          | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 28.155             | 28.155             |
| Euro Bond Absolute Return                               | Ausschüttende Klasse EUR I                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 930                | 930                |
| Euro Bond Absolute Return                               | Thesaurierende Klasse USD Z                          | Neuberger Berman Asia Holdings LLC   | 247.390            | 247.390            |
| Euro Bond Absolute Return                               | Thesaurierende Klasse USD Z                          | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.146.064          | 1.146.064          |
| Euro Bond Absolute Return                               | Thesaurierende Klasse USD Z                          | Strategic Income                     | 945.691            | 945.691            |
| Euro Opportunistic Bond                                 | Thesaurierende Klasse EUR I                          | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 3.000              | 3.000              |
| Euro Opportunistic Bond                                 | Ausschüttende Klasse EUR I                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 978.926            | 978.926            |
| European High Yield Bond                                | Thesaurierende Klasse EUR I                          | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.947              | 1.947              |
| European High Yield Bond                                | Thesaurierende Klasse EUR X                          | Neuberger Berman Employee            | 13.224             | 4.413              |
| European High Yield Bond                                | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)               | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                  | 1.630              |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 8. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

| Portfolio                   | Anteilkategorie   | Anteilinhaber                             | 30. Juni 2023      | 31. Dezember 2022  |
|-----------------------------|---|---|--------------------|--------------------|
|                             |   |   | Anzahl der Anteile | Anzahl der Anteile |
| European High Yield Bond    | Thesaurierende Klasse USD X                                     | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | 3.639              | 3.639              |
| European High Yield Bond    | Thesaurierende Klasse USD Z                                     | Neuberger Berman Asia Holdings LLC        | 472.326            | 472.326            |
| European High Yield Bond    | Thesaurierende Klasse USD Z                                     | Neuberger Berman Employee                 | 386                | 386                |
| European High Yield Bond    | Thesaurierende Klasse USD Z                                     | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | 827.807            | 827.807            |
| European High Yield Bond    | Thesaurierende Klasse USD Z                                     | Strategic Income                          | 486.855            | 486.855            |
| European Sustainable Equity | Ausschüttende Klasse EUR A                                      | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 2.627              | 2.627              |
| European Sustainable Equity | Thesaurierende Klasse EUR I                                     | Neuberger Berman Asia Holdings LLC        | 825                | 825                |
| European Sustainable Equity | Ausschüttende Klasse EUR I                                      | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 1.027              | 1.027              |
| European Sustainable Equity | Ausschüttende Klasse EUR I3                                     | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 2.593              | 2.593              |
| European Sustainable Equity | Thesaurierende Klasse EUR M                                     | Neuberger Berman Asia Holdings LLC        | 1.649              | 1.649              |
| European Sustainable Equity | Thesaurierende Klasse EUR Z                                     | Neuberger Berman Asia Holdings LLC        | 408.530            | 408.530            |
| European Sustainable Equity | Thesaurierende Klasse EUR Z                                     | Neuberger Berman Employee                 | 32.029             | 32.029             |
| European Sustainable Equity | Thesaurierende Klasse EUR Z                                     | Neuberger Berman Group LLC                | 4.772.441          | 3.124.536          |
| European Sustainable Equity | Thesaurierende Klasse USD A (nicht währungsgesichert)           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 1.000              | 1.000              |
| European Sustainable Equity | Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 1.000              | 1.000              |
| European Sustainable Equity | Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)           | Neuberger Berman Group LLC                | -                  | 1.970.793          |
| European Sustainable Equity | Thesaurierende Klasse USD M (nicht währungsgesichert)           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 1.000              | 1.000              |
| Event Driven <sup>1</sup>   | Ausschüttende Klasse GBP I5                                     | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 2.584              | 2.584              |
| Event Driven <sup>1</sup>   | Thesaurierende Klasse GBP P                                     | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 2.584              | 2.584              |
| Event Driven <sup>1</sup>   | Thesaurierende Klasse USD I                                     | Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd | -                  | 1.000.000          |
| Event Driven <sup>1</sup>   | Thesaurierende Klasse USD I                                     | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 1.000              | 1.000              |
| Global Bond                 | Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)                          | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 3.937              | 3.937              |
| Global Bond                 | Thesaurierende Klasse USD I Benchmark Währungsgesicherte Klasse | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 3.000              | 3.000              |
| Global Bond                 | Thesaurierende Klasse USD I                                     | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | 888                | 888                |
| Global Bond                 | Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)                          | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 3.000              | 3.000              |

FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

8. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

| Portfolio                        | Anteilkategorie                                       | Anteilinhaber                        | 30. Juni 2023      | 31. Dezember 2022  |
|----------------------------------|---|--------------------------------------|--------------------|--------------------|
|                                  |   |                                      | Anzahl der Anteile | Anzahl der Anteile |
| Global Bond                      | Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)                | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 4.481              | 4.481              |
| Global Equity Megatrends         | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                  | 1.009              |
| Global Equity Megatrends         | Thesaurierende Klasse USD C 1                         | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                  | 1.000              |
| Global Equity Megatrends         | Thesaurierende Klasse USD I                           | Neuberger Berman Employee            | 8.678              | 8.678              |
| Global Equity Megatrends         | Thesaurierende Klasse USD I                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                  | 1.000              |
| Global Equity Megatrends         | Thesaurierende Klasse USD M                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                  | 1.000              |
| Global Equity Megatrends         | Thesaurierende Klasse USD Z                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.000              | 1.000              |
| Global Flexible Credit Income    | Thesaurierende Klasse EUR M                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.359              | 2.359              |
| Global Flexible Credit Income    | Thesaurierende Klasse USD I                           | Neuberger Berman Asia Holdings LLC   | -                  | 3.000              |
| Global Flexible Credit Income    | Ausschüttende Klasse USD I                            | Neuberger Berman Asia Holdings LLC   | 7.763              | 7.763              |
| Global Flexible Credit Income    | Thesaurierende Klasse USD Z                           | Neuberger Berman Employee            | 27.065             | 22.231             |
| Global Flexible Credit Income    | Thesaurierende Klasse USD Z                           | Strategic Income                     | 459.982            | 459.982            |
| Global High Yield SDG Engagement | Ausschüttende Klasse AUD I                            | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 4.223              | 4.223              |
| Global High Yield SDG Engagement | Thesaurierende Klasse CHF I4                          | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 2.931              | 2.931              |
| Global High Yield SDG Engagement | Ausschüttende Klasse CHF I4                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 2.931              | 2.931              |
| Global High Yield SDG Engagement | Thesaurierende Klasse CHF X                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 2.931              | 2.931              |
| Global High Yield SDG Engagement | Thesaurierende Klasse EUR I4                          | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 2.846              | 2.846              |
| Global High Yield SDG Engagement | Ausschüttende Klasse EUR I4                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 2.846              | 2.846              |
| Global High Yield SDG Engagement | Thesaurierende Klasse EUR X                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 2.846              | 2.846              |
| Global High Yield SDG Engagement | Thesaurierende Klasse EUR Z (PF)                      | Neuberger Berman Employee            | 4.634              | -                  |
| Global High Yield SDG Engagement | Thesaurierende Klasse EUR Z (PF)                      | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 2.539              | 2.539              |
| Global High Yield SDG Engagement | Thesaurierende Klasse GBP I4                          | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 2.398              | 2.398              |
| Global High Yield SDG Engagement | Thesaurierende Klasse GBP X                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 2.398              | 2.398              |
| Global High Yield SDG Engagement | Thesaurierende Klasse USD A                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.796              | 1.796              |
| Global High Yield SDG Engagement | Thesaurierende Klasse USD I                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 816                | 816                |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 8. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

| Portfolio                            | Anteilkategorie                                       | Anteilinhaber                        | 30. Juni 2023      | 31. Dezember 2022  |
|--------------------------------------|---|--------------------------------------|--------------------|--------------------|
|                                      |   |                                      | Anzahl der Anteile | Anzahl der Anteile |
| Global High Yield SDG Engagement     | Thesaurierende Klasse USD I4                          | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.000              | 1.000              |
| Global High Yield SDG Engagement     | Ausschüttende Klasse USD M                            | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.208              | 1.208              |
| Global High Yield SDG Engagement     | Thesaurierende Klasse USD X                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.000              | 1.000              |
| Global High Yield SDG Engagement     | Thesaurierende Klasse USD X                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.013              | 1.013              |
| Global High Yield SDG Engagement     | Thesaurierende Klasse USD Z                           | Neuberger Berman Employee            | 2.226              | 2.226              |
| Global High Yield SDG Engagement     | Thesaurierende Klasse USD Z                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 789                | 789                |
| Global High Yield SDG Engagement     | Thesaurierende Klasse USD Z                           | Strategic Income                     | 654.438            | 654.438            |
| Global High Yield Sustainable Action | Thesaurierende Klasse USD I                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                  | 1.000              |
| Global High Yield Sustainable Action | Ausschüttende Klasse USD I                            | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                  | 1.458.132          |
| Global High Yield Sustainable Action | Thesaurierende Klasse USD X                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | -                  | 1.000              |
| Global Investment Grade Credit       | Thesaurierende Klasse USD I                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.000              | 1.000              |
| Global Investment Grade Credit       | Thesaurierende Klasse USD X                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.000              | 1.000              |
| Global Investment Grade Credit       | Thesaurierende Klasse USD Z                           | Corporate Hybrid Bond                | 1.300.000          | 1.300.000          |
| Global Investment Grade Credit       | Thesaurierende Klasse USD Z                           | Global Opportunistic Bond            | -                  | 200.000            |
| Global Investment Grade Credit       | Thesaurierende Klasse USD Z                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.498.000          | 1.498.000          |
| Global Investment Grade Credit       | Thesaurierende Klasse USD Z                           | Strategic Income                     | 2.000.000          | 2.000.000          |
| Global Opportunistic Bond            | Thesaurierende Klasse EUR I                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.530              | -                  |
| Global Opportunistic Bond            | Thesaurierende Klasse GBP P                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.295              | 2.295              |
| Global Opportunistic Bond            | Thesaurierende Klasse USD A                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.175              | 1.175              |
| Global Opportunistic Bond            | Thesaurierende Klasse USD I                           | Neuberger Berman Group LLC           | 669                | 669                |
| Global Opportunistic Bond            | Ausschüttende Klasse USD I                            | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.083              | 1.083              |
| Global Real Estate Securities        | Thesaurierende Klasse EUR M                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.000              | 1.000              |
| Global Real Estate Securities        | Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Employee            | 18.444             | 9.210              |
| Global Real Estate Securities        | Thesaurierende Klasse GBP Z                           | Neuberger Berman Employee            | 500                | 500                |
| Global Real Estate Securities        | Ausschüttende Klasse USD I5                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 3.315              | 3.315              |



FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

8. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

| Portfolio                     | Anteilkategorie  | Anteilinhaber   | 30. Juni 2023      | 31. Dezember 2022  |
|-------------------------------|--|---|--------------------|--------------------|
|                               |  |   | Anzahl der Anteile | Anzahl der Anteile |
| Global Real Estate Securities | Thesaurierende Klasse USD Z                            | Neuberger Berman Employee   | 9.811              | 9.811              |
| Global Sustainable Equity     | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)  | Neuberger Berman Asia Holdings LLC                                      | 1.649              | 1.649              |
| Global Sustainable Equity     | Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert)  | Neuberger Berman Employee   | 121.070            | 122.222            |
| Global Sustainable Equity     | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)  | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                    | -                  | 722                |
| Global Sustainable Equity     | Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                    | 722                | 722                |
| Global Sustainable Equity     | Thesaurierende Klasse USD A                            | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                    | 1.000              | 1.000              |
| Global Sustainable Equity     | Thesaurierende Klasse USD I                            | Neuberger Berman Asia Holdings LLC                                      | -                  | 1.000              |
| Global Sustainable Equity     | Thesaurierende Klasse USD I                            | Neuberger Berman Employee   | 9.518              | 9.518              |
| Global Sustainable Equity     | Ausschüttende Klasse USD I                             | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                    | 1.131              | 1.131              |
| Global Sustainable Equity     | Thesaurierende Klasse USD M                            | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                    | -                  | 1.000              |
| Global Sustainable Equity     | Thesaurierende Klasse USD Z                            | Neuberger Berman Asia Holdings LLC                                      | 528.063            | 528.063            |
| Global Sustainable Equity     | Thesaurierende Klasse USD Z                            | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                    | 1.000              | 1.000              |
| Global Sustainable Equity     | Thesaurierende Klasse USD Z                            | Neuberger Berman Employee   | 160                | 160                |
| Global Sustainable Equity     | Thesaurierende Klasse USD Z                            | Neuberger Berman Group LLC  | 2.481.151          | 2.481.151          |
| High Yield Bond               | Ausschüttende Klasse AUD T (Wöchentlich)               | Neuberger Berman Europe Holdings LLC                                    | 1.675              | 1.675              |
| High Yield Bond               | Thesaurierende Klasse EUR Z                            | Neuberger Berman Employee   | 15.211             | 15.211             |
| High Yield Bond               | Thesaurierende Klasse GBP Z                            | Neuberger Berman Employee   | 4.961              | 6.162              |
| High Yield Bond               | Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)                 | Bond-Plus Income & Growth Multi-Asset Class Securities Investment Trust | 4.036.814          | 5.674.132          |
| High Yield Bond               | Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)                 | Global Strategic Income   | 483.669            | 483.669            |
| High Yield Bond               | Thesaurierende Klasse USD P                            | Neuberger Berman Europe Holdings LLC                                    | 1.208              | 1.208              |
| High Yield Bond               | Thesaurierende Klasse USD Z                            | Neuberger Berman Employee   | 12.514             | 28.793             |
| High Yield Bond               | Thesaurierende Klasse ZAR T                            | Neuberger Berman Europe Holdings LLC                                    | 1.308              | 1.308              |
| InnovAsia 5G                  | Thesaurierende Klasse CHF I4                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC                                    | 2.747              | 2.747              |
| InnovAsia 5G                  | Thesaurierende Klasse EUR A                            | Neuberger Berman Europe Holdings LLC                                    | 2.539              | 2.539              |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 8. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

| Portfolio               | Anteilkategorie                                       | Anteilinhaber                        | 30. Juni 2023      | 31. Dezember 2022  |
|-------------------------|---|--------------------------------------|--------------------|--------------------|
|                         |   |                                      | Anzahl der Anteile | Anzahl der Anteile |
| InnovAsia 5G            | Thesaurierende Klasse EUR I4                          | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 2.539              | 2.539              |
| InnovAsia 5G            | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.584              | 2.584              |
| InnovAsia 5G            | Thesaurierende Klasse EUR X                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 2.539              | 2.539              |
| InnovAsia 5G            | Thesaurierende Klasse SGD A                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 2.031              | 2.031              |
| InnovAsia 5G            | Thesaurierende Klasse SGD I4                          | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 2.031              | 2.031              |
| InnovAsia 5G            | Thesaurierende Klasse SGD X                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 2.031              | 2.031              |
| InnovAsia 5G            | Thesaurierende Klasse USD A                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.000              | 1.000              |
| InnovAsia 5G            | Thesaurierende Klasse USD I                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 476.000            | 476.000            |
| InnovAsia 5G            | Thesaurierende Klasse USD I4                          | Neuberger Berman Employee            | 2.037              | 2.037              |
| InnovAsia 5G            | Thesaurierende Klasse USD I4                          | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.000              | 1.000              |
| InnovAsia 5G            | Thesaurierende Klasse USD M                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.000              | 1.000              |
| InnovAsia 5G            | Thesaurierende Klasse USD X                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.000              | 1.000              |
| Japan Equity Engagement | Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.242              | 2.242              |
| Japan Equity Engagement | Thesaurierende Klasse JPY I                           | Neuberger Berman Asia Holdings LLC   | -                  | 3.000              |
| Japan Equity Engagement | Thesaurierende Klasse JPY I                           | Neuberger Berman Employee            | 3.576              | 3.576              |
| Japan Equity Engagement | Ausschüttende Klasse JPY I                            | Neuberger Berman Asia Holdings LLC   | -                  | 497.000            |
| Japan Equity Engagement | Thesaurierende Klasse JPY I5                          | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | -                  | 318                |
| Japan Equity Engagement | Thesaurierende Klasse JPY Z                           | Neuberger Berman Asia Holdings LLC   | 778.814            | -                  |
| Japan Equity Engagement | Thesaurierende Klasse JPY Z                           | Neuberger Berman Employee            | 147.815            | 140.482            |
| Japan Equity Engagement | Thesaurierende Klasse JPY Z                           | Neuberger Berman Group LLC           | 4.692.912          | 4.692.912          |
| Macro Opportunities FX  | Thesaurierende Klasse EUR I                           | Neuberger Berman Asia Holdings LLC   | 1.000              | 1.000              |
| Macro Opportunities FX  | Thesaurierende Klasse EUR I                           | Neuberger Berman Employee            | 23.771             | 23.771             |
| Macro Opportunities FX  | Thesaurierende Klasse GBP Z                           | Neuberger Berman Employee            | 16.762             | 16.762             |
| Macro Opportunities FX  | Thesaurierende Klasse SEK I                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.830              | 2.830              |
| Macro Opportunities FX  | Thesaurierende Klasse USD I                           | Neuberger Berman Asia Holdings LLC   | 1.081              | 1.081              |

FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

8. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

| Portfolio                                  | Anteilkategorie  | Anteilinhaber                             | 30. Juni 2023      | 31. Dezember 2022  |
|--|--|---|--------------------|--------------------|
|  |  |   | Anzahl der Anteile | Anzahl der Anteile |
| Macro Opportunities FX                     | Thesaurierende Klasse USD Z                            | Neuberger Berman Employee                 | 7.959              | 7.959              |
| Multi-Asset Income                         | Ausschüttende Klasse GBP P                             | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 2.332              | 2.332              |
| Multi-Asset Income                         | Thesaurierende Klasse USD I                            | Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd | 847                | 847                |
| Multi-Asset Income                         | Ausschüttende Klasse USD I                             | Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd | 2.917              | 2.917              |
| Next Generation Mobility                   | Thesaurierende Klasse EUR A                            | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | 1.000              | 1.000              |
| Next Generation Mobility                   | Thesaurierende Klasse EUR I                            | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 2.459              | 2.459              |
| Next Generation Mobility                   | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)  | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | -                  | 2.632              |
| Next Generation Mobility                   | Thesaurierende Klasse USD C 1                          | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 10                 | 1.000              |
| Next Generation Mobility                   | Thesaurierende Klasse USD I                            | Neuberger Berman Asia Holdings LLC        | -                  | 3.000              |
| Next Generation Mobility                   | Thesaurierende Klasse USD I                            | Neuberger Berman Employee                 | 738                | 738                |
| Next Generation Mobility                   | Ausschüttende Klasse USD I                             | Neuberger Berman Asia Holdings LLC        | 730                | 730                |
| Next Generation Mobility                   | Thesaurierende Klasse USD X                            | Neuberger Berman Asia Holdings LLC        | 3.000              | 3.000              |
| Next Generation Mobility                   | Thesaurierende Klasse USD X                            | Neuberger Berman Employee                 | 588                | 588                |
| Next Generation Space Economy <sup>1</sup> | Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | 94.928             | 94.928             |
| Next Generation Space Economy <sup>1</sup> | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)  | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | 94.928             | 94.928             |
| Next Generation Space Economy <sup>1</sup> | Thesaurierende Klasse USD I                            | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | 300.000            | 300.000            |
| Short Duration Emerging Market Debt        | Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich)                 | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | 1.365              | 1.365              |
| Short Duration Emerging Market Debt        | Ausschüttende Klasse GBP I                             | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | -                  | 814                |
| Short Duration Emerging Market Debt        | Thesaurierende Klasse GBP P                            | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | -                  | 2.487              |
| Short Duration Emerging Market Debt        | Thesaurierende Klasse SEK A                            | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | 2.374              | 2.374              |
| Short Duration Emerging Market Debt        | Thesaurierende Klasse USD Z                            | Neuberger Berman Employee                 | 28.808             | 28.808             |
| Short Duration High Yield SDG Engagement   | Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)                 | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 23.546             | 23.546             |
| Short Duration High Yield SDG Engagement   | Thesaurierende Klasse USD I4                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 1.000              | -                  |
| Short Duration High Yield SDG Engagement   | Thesaurierende Klasse USD Z                            | Neuberger Berman Asia Holdings LLC        | 7.984              | -                  |
| Short Duration High Yield SDG Engagement   | Thesaurierende Klasse USD Z                            | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 14.872             | 839                |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 8. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

| Portfolio   | Anteilkategorie  | Anteilinhaber                        | 30. Juni 2023      | 31. Dezember 2022  |
|---|--|--------------------------------------|--------------------|--------------------|
|   |  |                                      | Anzahl der Anteile | Anzahl der Anteile |
| Short Duration High Yield SDG Engagement                      | Thesaurierende Klasse USD Z                            | Neuberger Berman Employee            | 42.360             | 32.263             |
| Short Duration High Yield SDG Engagement                      | Thesaurierende Klasse USD Z                            | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 29.666             | 6.782              |
| Short Duration High Yield SDG Engagement                      | Thesaurierende Klasse USD Z                            | Neuberger Berman Group LLC           | 5.823              | -                  |
| Strategic Income  | Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)                 | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.137              | -                  |
| Strategic Income  | Thesaurierende Klasse EUR A                            | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.861              | 2.861              |
| Strategic Income  | Thesaurierende Klasse EUR I                            | Neuberger Berman Employee            | 29.388             | 7.239              |
| Strategic Income  | Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich)                 | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                  | 834                |
| Strategic Income  | Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)                 | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 11.473             | 11.473             |
| Strategic Income  | Ausschüttende Klasse JPY I                             | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 5.300              | -                  |
| Strategic Income  | Thesaurierende Klasse SGD A                            | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 682                | 682                |
| Strategic Income  | Ausschüttende Klasse USD A                             | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                  | 1.093              |
| Strategic Income  | Thesaurierende Klasse USD Z                            | Neuberger Berman Employee            | 25.582             | 24.029             |
| Sustainable Asia High Yield                                   | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)                 | Neuberger Berman Group LLC           | 1.000              | 1.000              |
| Sustainable Asia High Yield                                   | Thesaurierende Klasse USD A                            | Neuberger Berman Group LLC           | 1.000              | 1.000              |
| Sustainable Asia High Yield                                   | Thesaurierende Klasse USD I                            | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.225              | 1.225              |
| Sustainable Asia High Yield                                   | Thesaurierende Klasse USD Z                            | Neuberger Berman Employee            | 13.395             | 13.395             |
| Sustainable Asia High Yield                                   | Thesaurierende Klasse USD Z                            | Neuberger Berman Group LLC           | 2.395.262          | 2.395.262          |
| Sustainable Emerging Market Corporate Debt                    | Thesaurierende Klasse GBP I                            | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 787                | 787                |
| Sustainable Emerging Market Corporate Debt                    | Thesaurierende Klasse SEK A                            | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 2.409              | 2.409              |
| Sustainable Emerging Market Corporate Debt                    | Thesaurierende Klasse USD M                            | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                  | 1.040              |
| Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency <sup>1</sup> | Thesaurierende Klasse USD I                            | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.000              | 1.000              |
| Systematic Global Sustainable Value                           | Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 927                | 927                |
| Systematic Global Sustainable Value                           | Thesaurierende Klasse USD A                            | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                  | 886                |
| Systematic Global Sustainable Value                           | Thesaurierende Klasse USD I                            | Neuberger Berman Group LLC           | -                  | 613                |
| Systematic Global Sustainable Value                           | Thesaurierende Klasse USD Z                            | Neuberger Berman Employee            | 3.166              | 3.166              |

FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

8. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

| Portfolio                   | Anteilkategorie                                       | Anteilinhaber                        | 30. Juni 2023      | 31. Dezember 2022  |
|-----------------------------|---|--------------------------------------|--------------------|--------------------|
|                             |   |                                      | Anzahl der Anteile | Anzahl der Anteile |
| Tactical Macro <sup>2</sup> | Thesaurierende Klasse USD I                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.000              | -                  |
| Tactical Macro <sup>2</sup> | Thesaurierende Klasse USD I5                          | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.000              | -                  |
| Tactical Macro <sup>2</sup> | Thesaurierende Klasse USD Z                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 500.000            | -                  |
| Ultra Short Term Euro Bond  | Thesaurierende Klasse CHF U                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 294                | 294                |
| Ultra Short Term Euro Bond  | Thesaurierende Klasse EUR A                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | -                  | 247                |
| Ultra Short Term Euro Bond  | Thesaurierende Klasse EUR I                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                  | 122                |
| Ultra Short Term Euro Bond  | Ausschüttende Klasse EUR I                            | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 119                | 119                |
| Ultra Short Term Euro Bond  | Thesaurierende Klasse EUR M                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 252                | 252                |
| Ultra Short Term Euro Bond  | Thesaurierende Klasse EUR U                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 79                 | 79                 |
| Ultra Short Term Euro Bond  | Thesaurierende Klasse EUR Z                           | Neuberger Berman Employee            | 19.252             | 22.356             |
| Ultra Short Term Euro Bond  | Thesaurierende Klasse USD Z                           | Emerging Market Debt - Hard Currency | 150.000            | 150.000            |
| Ultra Short Term Euro Bond  | Thesaurierende Klasse USD Z                           | Short Duration Emerging Market Debt  | 655.000            | 655.000            |
| Uncorrelated Strategies     | Thesaurierende Klasse EUR P                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.931              | 2.931              |
| Uncorrelated Strategies     | Ausschüttende Klasse GBP I2                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 858                | 858                |
| Uncorrelated Strategies     | Thesaurierende Klasse GBP Z                           | Neuberger Berman Employee            | 21.992             | 21.992             |
| Uncorrelated Strategies     | Thesaurierende Klasse USD Z                           | Neuberger Berman Employee            | 24.926             | 16.007             |
| US Equity                   | Thesaurierende Klasse USD I                           | Neuberger Berman Employee            | 415                | 415                |
| US Equity                   | Thesaurierende Klasse USD I                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                  | 997                |
| US Equity                   | Ausschüttende Klasse USD I                            | Neuberger Berman Group LLC           | 229.104            | 229.104            |
| US Equity                   | Thesaurierende Klasse USD M                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.000              | 1.000              |
| US Equity Index PutWrite    | Thesaurierende Klasse EUR I                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 2.132              | 2.132              |
| US Equity Index PutWrite    | Ausschüttende Klasse EUR I3                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.655              | 2.655              |
| US Equity Index PutWrite    | Thesaurierende Klasse EUR I4                          | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.111              | 1.111              |
| US Equity Index PutWrite    | Thesaurierende Klasse EUR M                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.143              | 1.143              |
| US Equity Index PutWrite    | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                  | 941                |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 8. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

| Portfolio                | Anteilkategorie                                       | Anteilinhaber                        | 30. Juni 2023      | 31. Dezember 2022  |
|--------------------------|---|--------------------------------------|--------------------|--------------------|
|                          |   |                                      | Anzahl der Anteile | Anzahl der Anteile |
| US Equity Index PutWrite | Thesaurierende Klasse GBP I3                          | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | -                  | 2.120              |
| US Equity Index PutWrite | Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 785                | -                  |
| US Equity Index PutWrite | Ausschüttende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)  | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | -                  | 2.187              |
| US Equity Index PutWrite | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)                | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 809                | 809                |
| US Equity Index PutWrite | Thesaurierende Klasse USD I                           | Neuberger Berman Group LLC           | -                  | 759                |
| US Equity Index PutWrite | Ausschüttende Klasse USD I3                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.000              | 1.000              |
| US Equity Index PutWrite | Thesaurierende Klasse USD M                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                  | 1.134              |
| US Equity Index PutWrite | Thesaurierende Klasse USD Z                           | Neuberger Berman Employee            | 102.917            | 117.446            |
| US Large Cap Value       | Thesaurierende Klasse EUR A                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 3.066              | 3.066              |
| US Large Cap Value       | Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Group LLC           | 947                | 947                |
| US Large Cap Value       | Thesaurierende Klasse EUR I                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | -                  | 2.688              |
| US Large Cap Value       | Thesaurierende Klasse GBP I                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.528              | 2.528              |
| US Large Cap Value       | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 843                | 843                |
| US Large Cap Value       | Ausschüttende Klasse GBP I                            | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.528              | 2.528              |
| US Large Cap Value       | Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)  | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 843                | 843                |
| US Large Cap Value       | Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Group LLC           | 797                | 797                |
| US Large Cap Value       | Ausschüttende Klasse GBP P                            | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.678              | 2.678              |
| US Large Cap Value       | Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Group LLC           | -                  | 797                |
| US Large Cap Value       | Ausschüttende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)  | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 858                | 858                |
| US Large Cap Value       | Thesaurierende Klasse USD I                           | Neuberger Berman Employee            | -                  | 8.044              |
| US Large Cap Value       | Thesaurierende Klasse USD I                           | Neuberger Berman Group LLC           | -                  | 4.524              |
| US Large Cap Value       | Thesaurierende Klasse USD Z                           | Neuberger Berman Employee            | 20.291             | 1.016              |
| US Long Short Equity     | Thesaurierende Klasse EUR I3                          | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | -                  | 2.771              |
| US Long Short Equity     | Ausschüttende Klasse GBP I3                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.302              | 2.302              |
| US Long Short Equity     | Thesaurierende Klasse USD I3                          | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.000              | 1.000              |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 8. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

| Portfolio                  | Anteilkategorie                                       | Anteilinhaber                        | 30. Juni 2023      | 31. Dezember 2022  |
|----------------------------|---|--------------------------------------|--------------------|--------------------|
|                            |   |                                      | Anzahl der Anteile | Anzahl der Anteile |
| US Long Short Equity       | Thesaurierende Klasse USD M                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.115              | 1.115              |
| US Long Short Equity       | Thesaurierende Klasse USD Z                           | Neuberger Berman Employee            | 13.363             | 13.363             |
| US Multi Cap Opportunities | Thesaurierende Klasse AUD T                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 516                | 516                |
| US Multi Cap Opportunities | Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.065              | 1.065              |
| US Multi Cap Opportunities | Thesaurierende Klasse USD I2                          | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.000              | -                  |
| US Multi Cap Opportunities | Thesaurierende Klasse USD Z                           | Neuberger Berman Employee            | 12.942             | 12.942             |
| US Multi Cap Opportunities | Ausschüttende Klasse USD1 I                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 268                | 268                |
| US Real Estate Securities  | Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich)                | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.418              | 1.418              |
| US Real Estate Securities  | Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)                | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.586              | 1.586              |
| US Real Estate Securities  | Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)                | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.424              | 1.424              |
| US Real Estate Securities  | Thesaurierende Klasse AUD T                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.140              | 1.140              |
| US Real Estate Securities  | Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)                | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 943                | 943                |
| US Real Estate Securities  | Ausschüttende Klasse USD I                            | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                  | 1.008              |
| US Real Estate Securities  | Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)                | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 985                | 985                |
| US Real Estate Securities  | Thesaurierende Klasse USD Z                           | Neuberger Berman Employee            | 15.008             | 15.008             |
| US Real Estate Securities  | Thesaurierende Klasse ZAR C2                          | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.921              | 2.921              |
| US Real Estate Securities  | Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)                | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.790              | 1.790              |
| US Real Estate Securities  | Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)                | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.208              | 1.208              |
| US Small Cap               | Thesaurierende Klasse AUD B                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 727                | 727                |
| US Small Cap               | Thesaurierende Klasse AUD C2                          | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.010              | 1.010              |
| US Small Cap               | Thesaurierende Klasse AUD E                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 756                | 756                |
| US Small Cap               | Thesaurierende Klasse AUD T                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.329              | 1.329              |
| US Small Cap               | Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.531              | 2.531              |
| US Small Cap               | Thesaurierende Klasse EUR Z                           | Neuberger Berman Employee            | 19.268             | 18.894             |
| US Small Cap               | Thesaurierende Klasse USD C2                          | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 153                | -                  |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 8. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

| Portfolio                    | Anteilkategorie             | Anteilinhaber                        | 30. Juni 2023      | 31. Dezember 2022  |
|------------------------------|-----------------------------|--------------------------------------|--------------------|--------------------|
|                              |                             |                                      | Anzahl der Anteile | Anzahl der Anteile |
| US Small Cap                 | Thesaurierende Klasse USD Z | Neuberger Berman Employee            | 10.663             | 10.663             |
| US Small Cap                 | Thesaurierende Klasse ZAR E | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 745                | 745                |
| US Small Cap                 | Thesaurierende Klasse ZAR T | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.812              | 1.812              |
| US Small Cap Intrinsic Value | Thesaurierende Klasse USD A | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                  | 1.000              |
| US Small Cap Intrinsic Value | Thesaurierende Klasse USD I | Neuberger Berman Employee            | 958                | 958                |

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

<sup>2</sup> Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtszeitraum aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.



FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT

Bei den angegebenen Beträgen zum Nettoinventarwert und Nettoinventarwert je Anteil handelt es sich um Werte für den Handel mit Anteilhabern.

5G Connectivity

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse AUD A NIW | Thesaurierende Klasse AUD A NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse CNY A NIW | Thesaurierende Klasse CNY A NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR A NIW | Thesaurierende Klasse EUR A NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------|---|---------------------------------|---|---------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 19.894.809 AUD                  | 9,61 AUD                                  | 2.843.687 CNY                   | 68,37 CNY                                 | 45.205.789 EUR                  | 10,01 EUR                                 |
| 31. Dezember 2022    | 17.057.259 AUD                  | 7,98 AUD                                  | 2.370.930 CNY                   | 57,01 CNY                                 | 43.082.992 EUR                  | 8,32 EUR                                  |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I NIW | Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil |
|----------------------|---|---|---------------------------------|---|---|---|
| 30. Juni 2023        | 58.256.501 EUR  | 11,13 EUR   | 39.910.384 EUR                  | 9,33 EUR                                  | 46.899.455 EUR  | 10,79 EUR   |
| 31. Dezember 2022    | 54.125.094 EUR  | 9,34 EUR  | 39.268.790 EUR                  | 7,73 EUR                                  | 43.589.698 EUR  | 9,01 EUR  |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse EUR I5 NIW | Thesaurierende Klasse EUR I5 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP A NIW | Thesaurierende Klasse GBP A NIW je Anteil |
|----------------------|----------------------------------|--|---|---|---------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 16.573 EUR                       | 8,43 EUR                                   | 53.327.300 EUR  | 10,85 EUR   | 11.059.739 GBP                  | 10,24 GBP                                 |
| 31. Dezember 2022    | 1.352.834 EUR                    | 6,97 EUR                                   | 44.772.549 EUR  | 9,14 EUR  | 10.322.335 GBP                  | 8,45 GBP                                  |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## 5G Connectivity (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse<br>GBP I (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP I (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>HKD A<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>HKD A<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>SGD A<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>SGD A<br>NIW je Anteil |
|----------------------|--|--|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 293.982 GBP  | 9,05 GBP   | 41.770.393 HKD                        | 10,65 HKD                                       | 41.985.893 SGD                        | 20,90 SGD                                       |
| 31. Dezember 2022    | 535.353 GBP  | 7,81 GBP   | 47.629.183 HKD                        | 8,80 HKD  | 39.375.609 SGD                        | 17,27 SGD                                       |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse<br>USD A<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD A<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD E*<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD E*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD I<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD I<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------------|---|--|--|---------------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 449.829.534 USD                       | 11,11 USD                                       | 113.971 USD                            | 10,57 USD  | 128.720.850 USD                       | 11,98 USD                                       |
| 31. Dezember 2022    | 421.532.776 USD                       | 9,12 USD  | –                                      | –  | 144.216.650 USD                       | 9,79 USD  |

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse<br>USD I<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>USD I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD I2<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD I2<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD I3<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD I3<br>NIW je Anteil |
|----------------------|--------------------------------------|--|--|--|--|--|
| 30. Juni 2023        | 20.328.706 USD                       | 11,98 USD                                      | 7.630.795 USD                          | 7,66 USD   | 74.104.995 USD                         | 8,15 USD   |
| 31. Dezember 2022    | 18.941.211 USD                       | 9,79 USD                                       | 6.231.632 USD                          | 6,26 USD   | 64.460.647 USD                         | 6,65 USD   |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse<br>USD I5<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD I5<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD M<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD M<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD Z<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD Z<br>NIW je Anteil |
|----------------------|--|--|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 13.862.813 USD                         | 11,13 USD  | 25.219.821 USD                        | 9,76 USD  | 860.685 USD                           | 7,67 USD  |
| 31. Dezember 2022    | 11.306.667 USD                         | 9,07 USD   | 23.507.641 USD                        | 8,04 USD  | 700.508 USD                           | 6,24 USD  |

FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

5G Connectivity (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse ZAR A*<br>NIW | Thesaurierende Klasse ZAR A*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse ZAR E*<br>NIW | Thesaurierende Klasse ZAR E*<br>NIW je Anteil |
|----------------------|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 906.066 ZAR                         | 108,98 ZAR                                    | 558.812 ZAR                         | 110,13 ZAR                                    |

Asian Debt – Hard Currency

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD A<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD A<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD C1<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD C1<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---|---|------------------------------------|--|-------------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 274.198 USD                                   | 7,82 USD  | 1.211.525 USD                      | 11,31 USD                                    | 143.733 USD                         | 8,89 USD                                      |
| 31. Dezember 2022    | 274.934 USD                                   | 7,83 USD  | 1.309.918 USD                      | 10,99 USD                                    | 168.834 USD                         | 8,68 USD                                      |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD I<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD I<br>NIW | Ausschüttende Klasse USD I<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich)*<br>NIW | Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich)*<br>NIW je Anteil |
|----------------------|------------------------------------|--|-----------------------------------|---|---|---|
| 30. Juni 2023        | 343.984 USD                        | 11,84 USD                                    | 73.621 USD                        | 8,93 USD                                    | 10.148 USD                                      | 10,15 USD   |
| 31. Dezember 2022    | 344.730 USD                        | 11,47 USD                                    | 10.492.727 USD                    | 8,96 USD                                    | 10.118 USD                                      | 10,12 USD   |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD I4*<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I4*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD M<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD M<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD X (Monatlich)*<br>NIW | Ausschüttende Klasse USD X (Monatlich)*<br>NIW je Anteil |
|----------------------|--------------------------------------|--|------------------------------------|--|--|--|
| 30. Juni 2023        | 10.572 USD                           | 10,57 USD                                      | 399.337 USD                        | 9,09 USD                                     | 10.091 USD                                     | 10,09 USD  |
| 31. Dezember 2022    | 10.229 USD                           | 10,23 USD                                      | 490.875 USD                        | 8,86 USD                                     | 10.098 USD                                     | 10,10 USD  |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Asian Debt – Hard Currency (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD X<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD X<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD Z*<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD Z*<br>NIW je Anteil |
|----------------------|------------------------------------|--|-------------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 19.289 USD                         | 8,79 USD                                     | 59.475.375 USD                      | 10,36 USD                                     |
| 31. Dezember 2022    | 18.734 USD                         | 8,54 USD                                     | 8.490.714 USD                       | 10,01 USD                                     |

## China A-Share Equity

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse CNY I<br>NIW | Thesaurierende Klasse CNY I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)<br>NIW | Ausschüttende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)<br>NIW je Anteil |
|----------------------|------------------------------------|--|--|--|---|---|
| 30. Juni 2023        | 128.742 CNY                        | 88,09 CNY                                    | 24.892 USD   | 8,48 USD   | 2.118.766 USD   | 8,47 USD  |
| 31. Dezember 2022    | 133.897 CNY                        | 91,62 CNY                                    | 27.220 USD   | 9,28 USD   | 2.319.140 USD   | 9,27 USD  |

## China Bond

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse CNY I*<br>NIW | Ausschüttende Klasse CNY I*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse CNY Z<br>NIW | Thesaurierende Klasse CNY Z<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---|---|------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 155.880 CNY                                   | 78,23 CNY   | 214.580 CNY                        | 91,43 CNY                                    | 217.736 CNY                        | 118,88 CNY                                   |
| 31. Dezember 2022    | 156.137 CNY                                   | 78,36 CNY   | 209.325 CNY                        | 89,19 CNY                                    | 210.297 CNY                        | 114,82 CNY                                   |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse GBP I2<br>NIW | Thesaurierende Klasse GBP I2<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) (nicht währungsgesichert)<br>NIW | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) (nicht währungsgesichert)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)<br>NIW je Anteil |
|----------------------|-------------------------------------|---|---|---|--|--|
| 30. Juni 2023        | 20.390 GBP                          | 9,37 GBP                                      | 781.870 SGD   | 14,07 SGD   | 3.065.424 USD  | 10,04 USD  |
| 31. Dezember 2022    | 19.572 GBP                          | 9,00 GBP                                      | 1.003.087 SGD   | 14,69 SGD   | 5.761.473 USD  | 10,22 USD  |

FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

China Bond (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD Z NIW | Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD Z (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse USD Z (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------|---|---|---|
| 30. Juni 2023        | 48.932.636 USD                  | 9,96 USD                                  | 11.632.739 USD  | 9,63 USD  |
| 31. Dezember 2022    | 47.003.040 USD                  | 9,49 USD                                  | 11.882.617 USD  | 9,78 USD  |

China Equity

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse CHF I NIW | Thesaurierende Klasse CHF I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR A NIW | Thesaurierende Klasse EUR A NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I NIW | Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------|---|---------------------------------|---|---------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 314.492 CHF                     | 10,81 CHF                                 | 1.282.400 EUR                   | 19,06 EUR                                 | 1.091.817 EUR                   | 20,76 EUR                                 |
| 31. Dezember 2022    | 355.994 CHF                     | 12,23 CHF                                 | 1.489.033 EUR                   | 21,49 EUR                                 | 1.254.577 EUR                   | 23,33 EUR                                 |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse EUR Z NIW | Thesaurierende Klasse EUR Z NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse GBP A NIW | Ausschüttende Klasse GBP A NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse SGD A NIW | Thesaurierende Klasse SGD A NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------|---|--------------------------------|--|---------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 14.374 EUR                      | 16,13 EUR                                 | 12.122 GBP                     | 9,53 GBP                                 | 1.823.654 SGD                   | 26,95 SGD                                 |
| 31. Dezember 2022    | 16.058 EUR                      | 18,02 EUR                                 | 13.559 GBP                     | 10,70 GBP                                | 2.180.349 SGD                   | 30,18 SGD                                 |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD A NIW | Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD A NIW | Ausschüttende Klasse USD A NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I NIW | Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------|---|--------------------------------|--|---------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 22.750.827 USD                  | 23,09 USD                                 | 701.449 USD                    | 14,15 USD                                | 211.818.775 USD                 | 25,24 USD                                 |
| 31. Dezember 2022    | 28.844.956 USD                  | 25,67 USD                                 | 786.778 USD                    | 15,80 USD                                | 240.949.106 USD                 | 27,95 USD                                 |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## China Equity (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD I2<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I2<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD M<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD M<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD U<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD U<br>NIW je Anteil |
|----------------------|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 11.693.176 USD                      | 15,62 USD                                     | 18.072 USD                         | 13,32 USD                                    | 23.419.083 USD                     | 16,16 USD                                    |
| 31. Dezember 2022    | 15.248.435 USD                      | 17,28 USD                                     | 20.188 USD                         | 14,88 USD                                    | 26.266.970 USD                     | 17,93 USD                                    |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD Z<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD Z<br>NIW je Anteil |
|----------------------|------------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 276.543 USD                        | 17,10 USD                                    |
| 31. Dezember 2022    | 304.598 USD                        | 18,83 USD                                    |

## CLO Income

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse EUR A*<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR A*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR I<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse EUR I2<br>NIW | Ausschüttende Klasse EUR I2<br>NIW je Anteil |
|----------------------|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 29.123 EUR                          | 10,31 EUR                                     | 17.588.573 EUR                     | 10,95 EUR                                    | 11.791.949 EUR                     | 8,05 EUR                                     |
| 31. Dezember 2022    | 62.426 EUR                          | 9,67 EUR                                      | 11.405.488 EUR                     | 10,23 EUR                                    | 12.590.646 EUR                     | 7,90 EUR                                     |

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse GBP I2<br>NIW | Ausschüttende Klasse GBP I2<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP Z<br>NIW | Thesaurierende Klasse GBP Z<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse SEK I<br>NIW | Thesaurierende Klasse SEK I<br>NIW je Anteil |
|----------------------|------------------------------------|--|------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 15.447.641 GBP                     | 8,32 GBP                                     | 57.000 GBP                         | 11,74 GBP                                    | 29.740.381 SEK                     | 111,55 SEK                                   |
| 31. Dezember 2022    | 22.140.124 GBP                     | 8,17 GBP                                     | 52.625 GBP                         | 10,84 GBP                                    | 29.102.703 SEK                     | 104,04 SEK                                   |

FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

CLO Income (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD A*<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD A*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD I2<br>NIW | Ausschüttende Klasse USD I2<br>NIW je Anteil |
|----------------------|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 56.612 USD                          | 10,60 USD                                     | 20.671.773 USD                     | 12,12 USD                                    | 27.496.298 USD                     | 9,37 USD                                     |
| 31. Dezember 2022    | 62.292 USD                          | 9,83 USD                                      | 14.305.878 USD                     | 11,19 USD                                    | 30.076.757 USD                     | 9,09 USD                                     |

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse USD I5<br>NIW | Ausschüttende Klasse USD I5<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD Z<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD Z<br>NIW je Anteil |
|----------------------|------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 41.395.689 USD                     | 8,91 USD                                     | 544.596 USD                        | 12,54 USD                                    |
| 31. Dezember 2022    | 37.889.294 USD                     | 8,65 USD                                     | 491.530 USD                        | 11,53 USD                                    |

Commodities<sup>1</sup>

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)*<br>NIW | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP I5*<br>NIW | Thesaurierende Klasse GBP I5*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD A*<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD A*<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---|---|--------------------------------------|--|-------------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 6.180.608 GBP   | 9,15 GBP  | 26.676.405 GBP                       | 8,69 GBP                                       | 2.787.165 USD                       | 8,97 USD                                      |
| 31. Dezember 2022    | 8.401 GBP   | 10,43 GBP   | 16.248.150 GBP                       | 9,42 GBP                                       | 2.916.591 USD                       | 9,71 USD                                      |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD I*<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I5*<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I5*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD M*<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD M*<br>NIW je Anteil |
|----------------------|-------------------------------------|---|--------------------------------------|--|-------------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 1.783.963 USD                       | 10,39 USD                                     | 58.652.246 USD                       | 9,08 USD                                       | 391.504 USD                         | 8,21 USD                                      |
| 31. Dezember 2022    | 247.698 USD                         | 11,20 USD                                     | 59.937.610 USD                       | 9,78 USD                                       | 432.835 USD                         | 8,91 USD                                      |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Commodities<sup>1</sup> (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z*<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z*<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---|---|
| 30. Juni 2023        | 2.342.718 USD                             | 10,53 USD   |
| 31. Dezember 2022    | 2.656.009 USD                             | 11,32 USD   |

## Corporate Hybrid Bond

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende<br>Klasse<br>AUD A<br>(Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende<br>Klasse<br>AUD A<br>(Monatlich)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF P<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF P<br>NIW je Anteil | Ausschüttende<br>Klasse<br>CHF P<br>NIW | Ausschüttende<br>Klasse<br>CHF P<br>NIW je Anteil |
|----------------------|--|--|--|--|---|---|
| 30. Juni 2023        | 4.770.219 AUD  | 7,80 AUD   | 4.764.396 CHF                            | 9,76 CHF   | 1.541.941 CHF                           | 8,74 CHF  |
| 31. Dezember 2022    | 4.816.413 AUD  | 7,88 AUD   | 22.917.824 CHF                           | 9,64 CHF   | 1.547.416 CHF                           | 8,79 CHF  |

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR A<br>(Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR A<br>(Monatlich)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I<br>NIW je Anteil |
|----------------------|--|--|--|--|--|--|
| 30. Juni 2023        | 38.820.055 EUR   | 7,85 EUR   | 138.483.402 EUR                          | 10,53 EUR  | 710.722.705 EUR                          | 11,28 EUR  |
| 31. Dezember 2022    | 38.403.169 EUR   | 7,91 EUR   | 124.371.360 EUR                          | 10,36 EUR  | 655.035.193 EUR                          | 11,06 EUR  |

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I<br>NIW | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I2<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I2<br>NIW je Anteil | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I2<br>NIW | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I2<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---|---|---|---|--|--|
| 30. Juni 2023        | 152.797.555 EUR                         | 9,01 EUR  | 183.456.525 EUR                           | 10,41 EUR   | 150.592.395 EUR                          | 8,21 EUR   |
| 31. Dezember 2022    | 92.907.803 EUR                          | 8,98 EUR  | 191.477.785 EUR                           | 10,20 EUR   | 177.916.143 EUR                          | 8,19 EUR   |



FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse EUR I3<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR I3<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I5<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR I5<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR M<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR M<br>NIW je Anteil |
|----------------------|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 5.752.024 EUR                       | 10,52 EUR                                     | 106.151.919 EUR                     | 11,54 EUR                                     | 11.040.708 EUR                     | 11,03 EUR                                    |
| 31. Dezember 2022    | 7.208.715 EUR                       | 10,30 EUR                                     | 184.534.266 EUR                     | 11,30 EUR                                     | 11.578.693 EUR                     | 10,88 EUR                                    |

  

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse EUR M<br>NIW | Ausschüttende Klasse EUR M<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR P<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR P<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse EUR P<br>NIW | Ausschüttende Klasse EUR P<br>NIW je Anteil |
|----------------------|-----------------------------------|---|------------------------------------|--|-----------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 3.206.454 EUR                     | 7,56 EUR                                    | 24.384.716 EUR                     | 10,04 EUR                                    | 3.825.671 EUR                     | 9,04 EUR                                    |
| 31. Dezember 2022    | 3.553.082 EUR                     | 7,61 EUR                                    | 37.115.535 EUR                     | 9,84 EUR                                     | 4.537.698 EUR                     | 9,02 EUR                                    |

  

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse GBP I<br>NIW | Thesaurierende Klasse GBP I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP I2<br>NIW | Thesaurierende Klasse GBP I2<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse GBP I2<br>NIW | Ausschüttende Klasse GBP I2<br>NIW je Anteil |
|----------------------|------------------------------------|--|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 2.784.867 GBP                      | 10,83 GBP                                    | 2.544.278 GBP                       | 10,67 GBP                                     | 51.923 GBP                         | 9,18 GBP                                     |
| 31. Dezember 2022    | 5.461.763 GBP                      | 10,54 GBP                                    | 10.032.613 GBP                      | 10,38 GBP                                     | 406.601 GBP                        | 9,09 GBP                                     |

  

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse GBP P<br>NIW | Thesaurierende Klasse GBP P<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse GBP P<br>NIW | Ausschüttende Klasse GBP P<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)<br>NIW je Anteil |
|----------------------|------------------------------------|--|-----------------------------------|---|---|---|
| 30. Juni 2023        | 2.868.959 GBP                      | 9,74 GBP                                     | 6.765.280 GBP                     | 8,87 GBP                                    | 1.601.884 SGD                                 | 15,96 SGD   |
| 31. Dezember 2022    | 6.021.069 GBP                      | 9,48 GBP                                     | 7.470.246 GBP                     | 8,78 GBP                                    | 1.412.307 SGD                                 | 16,07 SGD   |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD A NIW | Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD A NIW  | Ausschüttende Klasse USD A NIW je Anteil  |
|----------------------|--|--|---------------------------------|---|---------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 51.328.330 USD                             | 8,22 USD   | 47.029.965 USD                  | 11,50 USD                                 | 67.688 USD                      | 8,56 USD                                  |
| 31. Dezember 2022    | 55.263.711 USD                             | 8,26 USD   | 49.003.214 USD                  | 11,18 USD                                 | 66.746 USD                      | 8,44 USD                                  |
| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD C1 NIW           | Thesaurierende Klasse USD C1 NIW je Anteil           | Thesaurierende Klasse USD I NIW | Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD I NIW  | Ausschüttende Klasse USD I NIW je Anteil  |
| 30. Juni 2023        | 5.243.660 USD                              | 9,89 USD   | 43.731.220 USD                  | 12,74 USD                                 | 1.060.126 USD                   | 8,57 USD                                  |
| 31. Dezember 2022    | 5.909.890 USD                              | 9,66 USD   | 54.193.798 USD                  | 12,35 USD                                 | 1.406.325 USD                   | 8,45 USD                                  |
| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD I2 NIW           | Thesaurierende Klasse USD I2 NIW je Anteil           | Ausschüttende Klasse USD I2 NIW | Ausschüttende Klasse USD I2 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD M NIW | Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil |
| 30. Juni 2023        | 6.925.945 USD                              | 11,90 USD  | 4.900.480 USD                   | 9,81 USD                                  | 7.713.980 USD                   | 10,12 USD                                 |
| 31. Dezember 2022    | 6.709.367 USD                              | 11,52 USD  | 5.086.148 USD                   | 9,68 USD                                  | 8.149.257 USD                   | 9,86 USD                                  |
| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse USD M NIW             | Ausschüttende Klasse USD M NIW je Anteil             | Thesaurierende Klasse USD P NIW | Thesaurierende Klasse USD P NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD Z NIW | Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil |
| 30. Juni 2023        | 2.264.051 USD                              | 8,26 USD   | 8.439.922 USD                   | 11,35 USD                                 | 413.271 USD                     | 12,25 USD                                 |
| 31. Dezember 2022    | 2.213.713 USD                              | 8,23 USD   | 15.462.358 USD                  | 11,00 USD                                 | 399.396 USD                     | 11,84 USD                                 |

FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Hard Currency

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse AUD I NIW | Ausschüttende Klasse AUD I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse CAD I3 (nicht währungsgesichert)* NIW | Thesaurierende Klasse CAD I3 (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil |
|----------------------|--|--|--------------------------------|--|---|---|
| 30. Juni 2023        | 2.403.568 AUD                              | 6,88 AUD   | 47.843.311 AUD                 | 7,94 AUD                                 | 48.738.184 CAD  | 11,33 CAD   |
| 31. Dezember 2022    | 2.134.881 AUD                              | 6,88 AUD   | 21.672.088 AUD                 | 7,81 AUD                                 | 47.479.252 CAD  | 11,04 CAD   |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse CHF I2 NIW | Thesaurierende Klasse CHF I2 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse CHF P NIW | Thesaurierende Klasse CHF P NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) NIW je Anteil |
|----------------------|----------------------------------|--|---------------------------------|---|--|--|
| 30. Juni 2023        | 134.947.888 CHF                  | 7,96 CHF                                   | 24.280.871 CHF                  | 8,01 CHF                                  | 7.220.378 EUR                              | 6,17 EUR   |
| 31. Dezember 2022    | 161.496.077 CHF                  | 7,73 CHF                                   | 21.658.399 CHF                  | 7,79 CHF                                  | 7.363.041 EUR                              | 6,20 EUR   |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse EUR A NIW | Thesaurierende Klasse EUR A NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I NIW | Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------|---|---------------------------------|---|---|---|
| 30. Juni 2023        | 43.465.908 EUR                  | 9,85 EUR                                  | 107.736.902 EUR                 | 10,69 EUR                                 | 17.889.030 EUR  | 9,06 EUR  |
| 31. Dezember 2022    | 32.580.202 EUR                  | 9,53 EUR                                  | 118.505.956 EUR                 | 10,31 EUR                                 | 17.296.623 EUR  | 8,82 EUR  |

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse EUR I NIW | Ausschüttende Klasse EUR I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW | Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse EUR I2 NIW | Ausschüttende Klasse EUR I2 NIW je Anteil |
|----------------------|--------------------------------|--|----------------------------------|--|---------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 168.380.936 EUR                | 6,57 EUR                                 | 34.883.752 EUR                   | 8,17 EUR                                   | 33.356.960 EUR                  | 7,04 EUR                                  |
| 31. Dezember 2022    | 178.942.116 EUR                | 6,49 EUR                                 | 61.386.430 EUR                   | 7,87 EUR                                   | 32.976.153 EUR                  | 6,96 EUR                                  |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse EUR I3<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR I3<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I4<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR I4<br>NIW je Anteil |
|----------------------|-------------------------------------|---|---|---|-------------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 136.590.749 EUR                     | 9,17 EUR                                      | 9 EUR   | 8,97 EUR  | 101.650.012 EUR                     | 10,36 EUR                                     |
| 31. Dezember 2022    | 101.186.993 EUR                     | 8,83 EUR                                      | 29.023.972 EUR  | 8,76 EUR  | 106.621.915 EUR                     | 9,97 EUR                                      |

  

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)*<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR M<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR M<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse EUR M<br>NIW | Ausschüttende Klasse EUR M<br>NIW je Anteil |
|----------------------|--|--|------------------------------------|--|-----------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 83.699.991 EUR   | 10,30 EUR  | 576.118 EUR                        | 9,21 EUR                                     | 136.688 EUR                       | 6,16 EUR                                    |
| 31. Dezember 2022    | 68.627.475 EUR   | 10,00 EUR  | 625.349 EUR                        | 8,95 EUR                                     | 136.677 EUR                       | 6,16 EUR                                    |

  

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse EUR P<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR P<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR Z<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR Z<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP I<br>NIW | Thesaurierende Klasse GBP I<br>NIW je Anteil |
|----------------------|------------------------------------|--|------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 9.992.900 EUR                      | 8,28 EUR                                     | 412.376 EUR                        | 8,61 EUR                                     | 18.195.480 GBP                     | 9,97 GBP                                     |
| 31. Dezember 2022    | 9.665.588 EUR                      | 7,98 EUR                                     | 298.344 EUR                        | 8,27 EUR                                     | 16.360.366 GBP                     | 9,55 GBP                                     |

  

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse GBP I<br>NIW | Ausschüttende Klasse GBP I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP I2<br>NIW | Thesaurierende Klasse GBP I2<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse GBP I2<br>NIW | Ausschüttende Klasse GBP I2<br>NIW je Anteil |
|----------------------|-----------------------------------|---|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 2.092.468 GBP                     | 7,04 GBP                                    | 38.194.038 GBP                      | 8,76 GBP                                      | 10.198.938 GBP                     | 7,31 GBP                                     |
| 31. Dezember 2022    | 1.864.069 GBP                     | 6,91 GBP                                    | 31.637.924 GBP                      | 8,39 GBP                                      | 11.800.925 GBP                     | 7,18 GBP                                     |

FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse GBP P<br>NIW | Thesaurierende Klasse GBP P<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse HKD A<br>(Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse HKD A<br>(Monatlich)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse JPY I<br>NIW | Thesaurierende Klasse JPY I<br>NIW je Anteil |
|----------------------|------------------------------------|--|--|--|------------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 8.560.557 GBP                      | 8,94 GBP                                     | 1.269.835 HKD                                    | 7,40 HKD   | 1.667.127.429 JPY                  | 833,56 JPY                                   |
| 31. Dezember 2022    | 7.543.092 GBP                      | 8,56 GBP                                     | 1.259.413 HKD                                    | 7,38 HKD   | 1.632.621.347 JPY                  | 816,31 JPY                                   |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse SEK A<br>NIW | Thesaurierende Klasse SEK A<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse SEK I2<br>NIW | Thesaurierende Klasse SEK I2<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse SGD A<br>(Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse SGD A<br>(Monatlich)<br>NIW je Anteil |
|----------------------|------------------------------------|--|-------------------------------------|---|--|--|
| 30. Juni 2023        | 1.388.685.328 SEK                  | 94,98 SEK                                    | 255.338.128 SEK                     | 80,57 SEK                                     | 17.684.279 SGD                                   | 13,95 SGD  |
| 31. Dezember 2022    | 1.276.699.611 SEK                  | 91,78 SEK                                    | 135.368.249 SEK                     | 77,53 SEK                                     | 16.860.018 SGD                                   | 13,92 SGD  |

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse USD A<br>(Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse USD A<br>(Monatlich)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD A<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD A<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD A<br>NIW | Ausschüttende Klasse USD A<br>NIW je Anteil |
|----------------------|--|--|------------------------------------|--|-----------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 136.718.591 USD                                  | 6,95 USD   | 108.123.137 USD                    | 11,78 USD                                    | 301.672 USD                       | 7,92 USD                                    |
| 31. Dezember 2022    | 144.691.919 USD                                  | 6,89 USD   | 112.403.688 USD                    | 11,26 USD                                    | 42.552 USD                        | 7,74 USD                                    |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD C1<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD C1<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD I<br>NIW | Ausschüttende Klasse USD I<br>NIW je Anteil |
|----------------------|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|-----------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 9.600.953 USD                       | 8,80 USD                                      | 534.326.099 USD                    | 12,64 USD                                    | 70.479.040 USD                    | 7,88 USD                                    |
| 31. Dezember 2022    | 10.176.824 USD                      | 8,45 USD                                      | 583.066.950 USD                    | 12,04 USD                                    | 80.694.053 USD                    | 7,70 USD                                    |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD I2<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I2<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD I2<br>NIW | Ausschüttende Klasse USD I2<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD I3<br>NIW | Ausschüttende Klasse USD I3<br>NIW je Anteil |
|----------------------|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 28.992.727 USD                      | 10,98 USD                                     | 7.550.295 USD                      | 7,64 USD                                     | 83.304.903 USD                     | 7,78 USD                                     |
| 31. Dezember 2022    | 33.738.168 USD                      | 10,45 USD                                     | 13.108.552 USD                     | 7,47 USD                                     | 81.371.873 USD                     | 7,60 USD                                     |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD M<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD M<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD M<br>NIW | Ausschüttende Klasse USD M<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD P<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD P<br>NIW je Anteil |
|----------------------|------------------------------------|--|-----------------------------------|---|------------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 15.992.721 USD                     | 8,88 USD                                     | 3.274.828 USD                     | 6,47 USD                                    | 60.223.604 USD                     | 9,40 USD                                     |
| 31. Dezember 2022    | 16.134.339 USD                     | 8,52 USD                                     | 3.112.446 USD                     | 6,39 USD                                    | 17.590.354 USD                     | 8,95 USD                                     |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD X<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD X<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD Z<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD Z<br>NIW je Anteil |
|----------------------|------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 103.398.087 USD                    | 8,57 USD                                     | 105.621 USD                        | 10,56 USD                                    |
| 31. Dezember 2022    | 98.360.925 USD                     | 8,15 USD                                     | 97.737 USD                         | 10,02 USD                                    |

## Emerging Market Debt - Local Currency

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse AUD B<br>NIW | Thesaurierende Klasse AUD B<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich)<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---|---|------------------------------------|--|--|--|
| 30. Juni 2023        | 2.638.486 AUD                                 | 3,59 AUD  | 244.119 AUD                        | 8,14 AUD                                     | 15.951 AUD                                     | 3,59 AUD   |
| 31. Dezember 2022    | 3.579.112 AUD                                 | 3,54 AUD  | 279.747 AUD                        | 7,62 AUD                                     | 67.549 AUD                                     | 3,53 AUD   |

FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse AUD C2<br>NIW | Thesaurierende Klasse AUD C2<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse AUD E<br>NIW | Thesaurierende Klasse AUD E<br>NIW je Anteil |
|----------------------|-------------------------------------|---|---|---|------------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 7.520 AUD                           | 8,13 AUD                                      | 284.134 AUD                                   | 3,60 AUD  | 60.445 AUD                         | 8,13 AUD                                     |
| 31. Dezember 2022    | 7.870 AUD                           | 7,61 AUD                                      | 399.839 AUD                                   | 3,54 AUD  | 43.406 AUD                         | 7,61 AUD                                     |

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse AUD T<br>NIW | Thesaurierende Klasse AUD T<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR A<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR A<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---|---|------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 27.842.587 AUD                                | 3,90 AUD  | 2.158.938 AUD                      | 8,81 AUD                                     | 3.866.750 EUR                      | 6,98 EUR                                     |
| 31. Dezember 2022    | 27.559.985 AUD                                | 3,81 AUD  | 2.188.886 AUD                      | 8,21 AUD                                     | 2.710.862 EUR                      | 6,52 EUR                                     |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse EUR I<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungsgesichert)<br>NIW je Anteil |
|----------------------|------------------------------------|--|--|--|---|---|
| 30. Juni 2023        | 21.968.159 EUR                     | 7,51 EUR                                     | 162.491.490 EUR  | 9,83 EUR   | 14.968.872 EUR  | 11,59 EUR   |
| 31. Dezember 2022    | 12.677.170 EUR                     | 6,99 EUR                                     | 153.261.974 EUR  | 9,22 EUR   | 13.077.476 EUR  | 10,86 EUR   |

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)<br>NIW | Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR Y (nicht währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR Y (nicht währungsgesichert)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP I<br>NIW | Thesaurierende Klasse GBP I<br>NIW je Anteil |
|----------------------|--|--|--|--|------------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 19.338.958 EUR   | 7,51 EUR   | 86.965.428 EUR   | 9,85 EUR   | 77.392 GBP                         | 8,28 GBP                                     |
| 31. Dezember 2022    | 18.536.988 EUR   | 7,20 EUR   | 79.014.824 EUR   | 9,22 EUR   | 71.487 GBP                         | 7,65 GBP                                     |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse<br>GBP I4 (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP I4 (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>GBP I4 (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>GBP I4 (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>GBP Y (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP Y (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---|---|--|--|--|--|
| 30. Juni 2023        | 52.707.738 GBP  | 9,98 GBP  | 42.403.109 GBP   | 7,27 GBP   | 37.864.559 GBP   | 9,52 GBP   |
| 31. Dezember 2022    | 55.720.554 GBP  | 9,67 GBP  | 34.761.741 GBP   | 7,20 GBP   | 51.131.054 GBP   | 9,22 GBP   |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse<br>SEK A<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>SEK A<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>SGD A<br>(Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>SGD A<br>(Monatlich)<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>USD A<br>(Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>USD A<br>(Monatlich)<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------------|---|---|---|---|---|
| 30. Juni 2023        | 6.926.251 SEK                         | 86,22 SEK                                       | 937.768 SGD   | 11,07 SGD   | 3.819.859 USD                                       | 4,95 USD  |
| 31. Dezember 2022    | 8.262.545 SEK                         | 80,46 SEK                                       | 431.283 SGD   | 10,66 SGD   | 2.763.181 USD                                       | 4,73 USD  |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse<br>USD A<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD A<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>USD B<br>(Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>USD B<br>(Monatlich)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD B<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD B<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------------|---|---|---|---------------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 14.097.289 USD                        | 8,44 USD  | 11.155.943 USD                                      | 4,07 USD  | 623.097 USD                           | 8,61 USD  |
| 31. Dezember 2022    | 13.383.059 USD                        | 7,78 USD  | 11.674.878 USD                                      | 3,97 USD  | 507.723 USD                           | 7,99 USD  |

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse<br>USD C2<br>(Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>USD C2<br>(Monatlich)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD C2<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD C2<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>USD E<br>(Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>USD E<br>(Monatlich)<br>NIW je Anteil |
|----------------------|--|--|--|--|---|---|
| 30. Juni 2023        | 86.479 USD   | 4,07 USD   | 1.818 USD                              | 8,62 USD   | 1.607.850 USD                                       | 4,07 USD  |
| 31. Dezember 2022    | 523.171 USD  | 3,97 USD   | 22.894 USD                             | 7,99 USD   | 3.285.216 USD                                       | 3,97 USD  |



FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD E<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD E<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD I<br>(Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse USD I<br>(Monatlich)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I<br>NIW je Anteil |
|----------------------|------------------------------------|--|--|--|------------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 254.465 USD                        | 8,62 USD                                     | 42.728.291 USD                                   | 7,89 USD   | 201.728.954 USD                    | 9,11 USD                                     |
| 31. Dezember 2022    | 313.230 USD                        | 7,99 USD                                     | 39.776.506 USD                                   | 7,52 USD   | 373.741.103 USD                    | 8,36 USD                                     |

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse USD I<br>NIW | Ausschüttende Klasse USD I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I2<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I2<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I5<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I5<br>NIW je Anteil |
|----------------------|-----------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 1.161.612 USD                     | 7,40 USD                                    | 68.618.612 USD                      | 8,85 USD                                      | 15.394 USD                          | 9,73 USD                                      |
| 31. Dezember 2022    | 537.178 USD                       | 6,94 USD                                    | 54.407.790 USD                      | 8,12 USD                                      | 18 USD                              | 9,08 USD                                      |

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse USD T<br>(Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse USD T<br>(Monatlich)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD T<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD T<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD X<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD X<br>NIW je Anteil |
|----------------------|--|--|------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 52.350.281 USD                                   | 4,49 USD   | 4.096.929 USD                      | 9,33 USD                                     | 143.365.872 USD                    | 9,03 USD                                     |
| 31. Dezember 2022    | 48.894.990 USD                                   | 4,35 USD   | 4.066.572 USD                      | 8,61 USD                                     | 141.579.673 USD                    | 8,27 USD                                     |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD Y<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD Y<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse ZAR B<br>(Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse ZAR B<br>(Monatlich)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse ZAR B<br>NIW | Thesaurierende Klasse ZAR B<br>NIW je Anteil |
|----------------------|------------------------------------|--|--|--|------------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 150.289.736 USD                    | 8,77 USD                                     | 71.759.620 ZAR                                   | 37,30 ZAR  | 5.434.167 ZAR                      | 117,77 ZAR                                   |
| 31. Dezember 2022    | 154.229.779 USD                    | 8,03 USD                                     | 123.706.182 ZAR                                  | 36,58 ZAR  | 6.630.951 ZAR                      | 107,97 ZAR                                   |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse ZAR C2 NIW | Thesaurierende Klasse ZAR C2 NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich) NIW je Anteil |
|----------------------|---|---|----------------------------------|--|--|--|
| 30. Juni 2023        | 1.081.303 ZAR                               | 37,29 ZAR   | 184.953 ZAR                      | 115,90 ZAR                                 | 11.688.646 ZAR                             | 37,30 ZAR  |
| 31. Dezember 2022    | 2.919.213 ZAR                               | 36,57 ZAR   | 99.096 ZAR                       | 107,97 ZAR                                 | 20.692.248 ZAR                             | 36,58 ZAR  |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse ZAR E NIW | Thesaurierende Klasse ZAR E NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse ZAR T NIW | Thesaurierende Klasse ZAR T NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 2.099.597 ZAR                   | 117,78 ZAR                                | 583.207.267 ZAR                            | 40,45 ZAR  | 46.658.064 ZAR                  | 127,70 ZAR                                |
| 31. Dezember 2022    | 790.752 ZAR                     | 107,98 ZAR                                | 549.054.261 ZAR                            | 39,47 ZAR  | 40.857.889 ZAR                  | 116,49 ZAR                                |

## Emerging Market Debt Blend

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse AUD I3 NIW | Ausschüttende Klasse AUD I3 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR A NIW | Thesaurierende Klasse EUR A NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I NIW | Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------|---|---------------------------------|---|---------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 8.460.936 AUD                   | 7,82 AUD                                  | 10.305.845 EUR                  | 10,03 EUR                                 | 228.766.224 EUR                 | 10,33 EUR                                 |
| 31. Dezember 2022    | 8.275.300 AUD                   | 7,49 AUD                                  | 10.503.424 EUR                  | 9,66 EUR                                  | 206.919.548 EUR                 | 9,92 EUR                                  |

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse EUR I NIW | Ausschüttende Klasse EUR I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW | Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse EUR I2 NIW | Ausschüttende Klasse EUR I2 NIW je Anteil |
|----------------------|--------------------------------|--|----------------------------------|--|---------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 24.663.127 EUR                 | 7,07 EUR                                 | 16.444.875 EUR                   | 10,62 EUR                                  | 9.057.999 EUR                   | 6,89 EUR                                  |
| 31. Dezember 2022    | 24.719.131 EUR                 | 6,93 EUR                                 | 19.433.459 EUR                   | 10,19 EUR                                  | 9.667.380 EUR                   | 6,74 EUR                                  |

FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse EUR I3<br>NIW | Ausschüttende Klasse EUR I3<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I5<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR I5<br>NIW je Anteil |
|----------------------|------------------------------------|--|---|---|-------------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 15.334.010 EUR                     | 7,66 EUR                                     | 1.812.107 EUR   | 10,19 EUR   | 20.901.132 EUR                      | 11,23 EUR                                     |
| 31. Dezember 2022    | 22.443 EUR                         | 7,48 EUR                                     | 579.587 EUR   | 9,81 EUR  | 21.116.810 EUR                      | 10,76 EUR                                     |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse EUR M<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR M<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse EUR M<br>NIW | Ausschüttende Klasse EUR M<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR Z<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR Z<br>NIW je Anteil |
|----------------------|------------------------------------|--|-----------------------------------|---|------------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 516.483 EUR                        | 9,65 EUR                                     | 401.553 EUR                       | 6,01 EUR                                    | 97.366 EUR                         | 11,14 EUR                                    |
| 31. Dezember 2022    | 497.438 EUR                        | 9,32 EUR                                     | 241.149 EUR                       | 6,05 EUR                                    | 101.072 EUR                        | 10,65 EUR                                    |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse GBP I<br>NIW | Thesaurierende Klasse GBP I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse GBP I<br>NIW | Ausschüttende Klasse GBP I<br>NIW je Anteil |
|----------------------|------------------------------------|--|--|--|-----------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 345.882 GBP                        | 10,96 GBP                                    | 5.355 GBP  | 9,97 GBP   | 11.164.883 GBP                    | 7,81 GBP                                    |
| 31. Dezember 2022    | 350.186 GBP                        | 10,65 GBP                                    | 5.345 GBP  | 9,93 GBP   | 11.265.349 GBP                    | 7,75 GBP                                    |

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)<br>NIW | Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP P<br>NIW | Thesaurierende Klasse GBP P<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---|---|------------------------------------|--|--|--|
| 30. Juni 2023        | 660.800 GBP   | 8,24 GBP  | 4.236.191 GBP                      | 9,60 GBP                                     | 961.316 GBP  | 9,89 GBP   |
| 31. Dezember 2022    | 560.698 GBP   | 8,39 GBP  | 6.745.122 GBP                      | 9,33 GBP                                     | 962.313 GBP  | 9,85 GBP   |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse<br>GBP Z<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP Z<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>NOK U<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>NOK U<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>SEK A<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>SEK A<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 201.156 GBP                           | 11,91 GBP                                       | 250.511 NOK                           | 109,60 NOK                                      | 27.343.254 SEK                        | 110,88 SEK                                      |
| 31. Dezember 2022    | 194.796 GBP                           | 11,54 GBP                                       | 228.017 NOK                           | 99,75 NOK                                       | 27.339.928 SEK                        | 103,59 SEK                                      |

  

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse<br>SGD A<br>(Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>SGD A<br>(Monatlich)<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>USD A<br>(Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>USD A<br>(Monatlich)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD A<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD A<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---|---|---|---|---------------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 4.149.951 SGD                                       | 12,65 SGD   | 354.598 USD   | 6,42 USD  | 6.946.473 USD                         | 11,08 USD                                       |
| 31. Dezember 2022    | 4.038.162 SGD                                       | 12,31 SGD   | 342.321 USD   | 6,26 USD  | 10.292.897 USD                        | 10,49 USD                                       |

  

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse<br>USD C1<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD C1<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD I<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD I<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>USD I<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>USD I<br>NIW je Anteil |
|----------------------|--|--|---------------------------------------|---|--------------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 813.763 USD                            | 8,65 USD   | 17.900.965 USD                        | 10,45 USD                                       | 433.301 USD                          | 7,98 USD                                       |
| 31. Dezember 2022    | 1.059.311 USD                          | 8,23 USD   | 27.687.499 USD                        | 9,85 USD  | 417.314 USD                          | 7,69 USD                                       |

  

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse<br>USD I2<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>USD I2<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD I3<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD I3<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD M<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD M<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------------|---|--|--|---------------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 40.288.714 USD                        | 7,32 USD  | 32.005.607 USD                         | 9,54 USD   | 776.636 USD                           | 8,73 USD  |
| 31. Dezember 2022    | 38.999.171 USD                        | 7,05 USD  | 41.113.489 USD                         | 8,98 USD   | 737.778 USD                           | 8,29 USD  |

FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse<br>USD M<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>USD M<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD Z<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD Z<br>NIW je Anteil |
|----------------------|--------------------------------------|--|---------------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 625.278 USD                          | 6,01 USD                                       | 117.820 USD                           | 12,46 USD                                       |
| 31. Dezember 2022    | 486.413 USD                          | 5,94 USD                                       | 110.712 USD                           | 11,70 USD                                       |

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse<br>AUD I2<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>AUD I2<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>NOK I<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>NOK I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD I<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD I<br>NIW je Anteil |
|----------------------|--|--|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 23.095.586 AUD                         | 9,12 AUD   | 387.480.180 NOK                       | 110,59 NOK                                      | 39.932 USD                            | 10,85 USD                                       |
| 31. Dezember 2022    | 21.961.420 AUD                         | 8,67 AUD   | 297.517.124 NOK                       | 103,11 NOK                                      | 38.055 USD                            | 10,34 USD                                       |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse<br>USD I2<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD I2<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD Z<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD Z<br>NIW je Anteil |
|----------------------|--|--|---------------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 4.249.377 USD                          | 9,04 USD   | 6.498.757 USD                         | 10,88 USD                                       |
| 31. Dezember 2022    | 4.047.197 USD                          | 8,61 USD   | 5.087.444 USD                         | 10,33 USD                                       |

Emerging Markets Equity

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse<br>AUD B<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>AUD B<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>AUD C2<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>AUD C2<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>AUD E<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>AUD E<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------------|---|--|--|---------------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 396.219 AUD                           | 9,38 AUD  | 14.769 AUD                             | 9,38 AUD   | 47.636 AUD                            | 9,37 AUD  |
| 31. Dezember 2022    | 389.876 AUD                           | 9,13 AUD  | 11.442 AUD                             | 9,13 AUD   | 125.310 AUD                           | 9,12 AUD  |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Emerging Markets Equity (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse AUD T | Thesaurierende Klasse AUD T | Ausschüttende Klasse CAD I (nicht währungsgesichert) | Ausschüttende Klasse CAD I (nicht währungsgesichert) | Ausschüttende Klasse CAD I2 | Ausschüttende Klasse CAD I2 |
|----------------------|-----------------------------|-----------------------------|--|--|-----------------------------|-----------------------------|
|                      | NIW                         | NIW je Anteil               | NIW  | NIW je Anteil  | NIW                         | NIW je Anteil               |
| 30. Juni 2023        | 1.770.672 AUD               | 10,01 AUD                   | 65.347 CAD   | 7,89 CAD   | 11.642.822 CAD              | 7,80 CAD                    |
| 31. Dezember 2022    | 1.741.416 AUD               | 9,69 AUD                    | 65.215 CAD   | 7,87 CAD   | 11.406.458 CAD              | 7,64 CAD                    |

  

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse EUR I | Thesaurierende Klasse EUR I | Thesaurierende Klasse EUR M | Thesaurierende Klasse EUR M | Thesaurierende Klasse EUR Z | Thesaurierende Klasse EUR Z |
|----------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
|                      | NIW                         | NIW je Anteil               | NIW                         | NIW je Anteil               | NIW                         | NIW je Anteil               |
| 30. Juni 2023        | 951.989 EUR                 | 8,91 EUR                    | 440.173 EUR                 | 10,13 EUR                   | 170.077 EUR                 | 7,63 EUR                    |
| 31. Dezember 2022    | 1.362.334 EUR               | 8,60 EUR                    | 429.393 EUR                 | 9,87 EUR                    | 163.271 EUR                 | 7,33 EUR                    |

  

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse GBP I | Thesaurierende Klasse GBP I | Thesaurierende Klasse GBP Z | Thesaurierende Klasse GBP Z | Thesaurierende Klasse USD A | Thesaurierende Klasse USD A |
|----------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
|                      | NIW                         | NIW je Anteil               | NIW                         | NIW je Anteil               | NIW                         | NIW je Anteil               |
| 30. Juni 2023        | 397.666 GBP                 | 10,20 GBP                   | 84.199 GBP                  | 12,31 GBP                   | 5.204.240 USD               | 9,87 USD                    |
| 31. Dezember 2022    | 381.404 GBP                 | 9,77 GBP                    | 80.198 GBP                  | 11,72 GBP                   | 4.825.592 USD               | 9,44 USD                    |

  

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD B | Thesaurierende Klasse USD B | Thesaurierende Klasse USD C2 | Thesaurierende Klasse USD C2 | Thesaurierende Klasse USD E | Thesaurierende Klasse USD E |
|----------------------|-----------------------------|-----------------------------|------------------------------|------------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
|                      | NIW                         | NIW je Anteil               | NIW                          | NIW je Anteil                | NIW                         | NIW je Anteil               |
| 30. Juni 2023        | 1.298.991 USD               | 10,35 USD                   | 3.456 USD                    | 10,33 USD                    | 1.439.261 USD               | 10,34 USD                   |
| 31. Dezember 2022    | 1.423.437 USD               | 9,96 USD                    | 119.565 USD                  | 9,95 USD                     | 265.455 USD                 | 9,94 USD                    |

FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Markets Equity (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD I NIW | Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD M NIW | Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD T NIW | Thesaurierende Klasse USD T NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------|---|---------------------------------|---|---------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 73.388.384 USD                  | 11,19 USD                                 | 335.687 USD                     | 11,02 USD                                 | 4.069.138 USD                   | 11,06 USD                                 |
| 31. Dezember 2022    | 155.175.902 USD                 | 10,66 USD                                 | 398.316 USD                     | 10,60 USD                                 | 6.120.100 USD                   | 10,57 USD                                 |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD Z NIW | Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse ZAR B NIW | Thesaurierende Klasse ZAR B NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse ZAR C2 NIW | Thesaurierende Klasse ZAR C2 NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------|---|---------------------------------|---|----------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 17.491.558 USD                  | 11,55 USD                                 | 9.816.377 ZAR                   | 127,42 ZAR                                | 72.177 ZAR                       | 127,40 ZAR                                 |
| 31. Dezember 2022    | 11.172.939 USD                  | 10,94 USD                                 | 6.247.098 ZAR                   | 121,51 ZAR                                | 1.133.518 ZAR                    | 121,50 ZAR                                 |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse ZAR E NIW | Thesaurierende Klasse ZAR E NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse ZAR T NIW | Thesaurierende Klasse ZAR T NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------|---|---------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 3.467.714 ZAR                   | 127,41 ZAR                                | 25.642.087 ZAR                  | 136,29 ZAR                                |
| 31. Dezember 2022    | 3.953.205 ZAR                   | 121,51 ZAR                                | 24.141.495 ZAR                  | 129,33 ZAR                                |

Emerging Markets Select Equity

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I NIW | Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil |
|----------------------|---|---|---|---|---------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 2.478.405 EUR   | 8,74 EUR  | 1.426.999.832 JPY   | 1.252,20 JPY  | 84.116.776 USD                  | 9,08 USD                                  |
| 31. Dezember 2022    | 2.008.452 EUR   | 8,70 EUR  | 1.269.919.529 JPY   | 1.112,95 JPY  | 81.907.316 USD                  | 8,84 USD                                  |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Emerging Markets Select Equity (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I5<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I5<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---|---|
| 30. Juni 2023        | 70.261 USD                                | 8,78 USD  |
| 31. Dezember 2022    | 68.263 USD                                | 8,53 USD  |

## Euro Bond Absolute Return

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I<br>NIW je Anteil | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I<br>NIW | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I5<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I5<br>NIW je Anteil |
|----------------------|--|--|---|---|---|---|
| 30. Juni 2023        | 2.285.663 EUR                            | 10,68 EUR  | 9.403 EUR                               | 10,11 EUR   | 18.133.111 EUR                            | 10,73 EUR   |
| 31. Dezember 2022    | 2.262.829 EUR                            | 10,52 EUR  | 13.827.199 EUR                          | 10,04 EUR   | 18.661.626 EUR                            | 10,55 EUR   |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z<br>NIW je Anteil |
|----------------------|--|--|
| 30. Juni 2023        | 30.272.229 USD                           | 11,18 USD  |
| 31. Dezember 2022    | 14.615.873 USD                           | 10,86 USD  |

## Euro Opportunistic Bond

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I<br>NIW je Anteil | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I<br>NIW | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I<br>NIW je Anteil |
|----------------------|--|--|---|---|
| 30. Juni 2023        | 182.249 EUR                              | 10,28 EUR  | 9.416.567 EUR                           | 9,62 EUR  |
| 31. Dezember 2022    | 78.692 EUR                               | 9,96 EUR   | 9.215.906 EUR                           | 9,41 EUR  |



FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

European High Yield Bond

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse CHF I*<br>NIW | Thesaurierende Klasse CHF I*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR M<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR M<br>NIW je Anteil |
|----------------------|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 983.092 CHF                         | 10,04 CHF                                     | 11.206.076 EUR                     | 12,93 EUR                                    | 803.856 EUR                        | 11,78 EUR                                    |
| 31. Dezember 2022    | –                                   | –   | 875.869 EUR                        | 12,34 EUR                                    | 524.711 EUR                        | 11,31 EUR                                    |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse EUR X<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR X<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR Y*<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR Y*<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse EUR Y*<br>NIW | Ausschüttende Klasse EUR Y*<br>NIW je Anteil |
|----------------------|------------------------------------|--|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 10.417.827 EUR                     | 11,36 EUR                                    | 28.533.208 EUR                      | 10,40 EUR                                     | 2.740.990 EUR                      | 10,01 EUR                                    |
| 31. Dezember 2022    | 5.239.330 EUR                      | 10,82 EUR                                    | –                                   | –   | –                                  | –  |

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD X<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD X<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---|---|------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 351.402 USD                                   | 8,81 USD  | 208.971 USD                        | 15,08 USD                                    | 534.974 USD                        | 12,69 USD                                    |
| 31. Dezember 2022    | 343.199 USD                                   | 8,63 USD  | 14.858.536 USD                     | 14,23 USD                                    | 2.659.377 USD                      | 11,95 USD                                    |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD Z<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD Z<br>NIW je Anteil |
|----------------------|------------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 25.842.507 USD                     | 11,96 USD                                    |
| 31. Dezember 2022    | 9.687.331 USD                      | 11,25 USD                                    |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## European Sustainable Equity

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse<br>EUR A*<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>EUR A*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>EUR I<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>EUR I<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>EUR I<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>EUR I<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|--------------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 23.580 EUR                            | 8,98 EUR  | 33.068 EUR                            | 10,37 EUR                                       | 10.558 EUR                           | 10,28 EUR                                      |
| 31. Dezember 2022    | 20.816 EUR                            | 7,93 EUR  | 29.063 EUR                            | 9,11 EUR  | 3.727.608 EUR                        | 9,09 EUR                                       |

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse<br>EUR I3<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>EUR I3<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>EUR I5<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>EUR I5<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>EUR M<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>EUR M<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------------|---|--|--|---------------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 114.462.029 EUR                       | 8,80 EUR  | 1.997.836 EUR                          | 9,07 EUR   | 42.060 EUR                            | 9,96 EUR  |
| 31. Dezember 2022    | 126.435.303 EUR                       | 7,79 EUR  | 1.690.128 EUR                          | 7,96 EUR   | 21.161 EUR                            | 8,83 EUR  |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse<br>EUR Z<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>EUR Z<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD A (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD A (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD I (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD I (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------------|---|--|--|--|--|
| 30. Juni 2023        | 54.329.499 EUR                        | 10,41 EUR                                       | 9.297 USD  | 9,30 USD   | 9.485 USD  | 9,48 USD   |
| 31. Dezember 2022    | 28.841.630 EUR                        | 9,12 EUR  | 8.028 USD  | 8,03 USD   | 16.077.887 USD   | 8,15 USD   |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse<br>USD M (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD M (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW je Anteil |
|----------------------|--|--|
| 30. Juni 2023        | 9.129 USD  | 9,13 USD   |
| 31. Dezember 2022    | 7.914 USD  | 7,91 USD   |

FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Event Driven<sup>1</sup>

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse EUR I*<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR I*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP I5*<br>NIW | Thesaurierende Klasse GBP I5*<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse GBP I5*<br>NIW | Ausschüttende Klasse GBP I5*<br>NIW je Anteil |
|----------------------|-------------------------------------|---|--------------------------------------|--|-------------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 380.849 EUR                         | 10,00 EUR                                     | 44.376.508 GBP                       | 10,12 GBP                                      | 12.163.368 GBP                      | 10,11 GBP                                     |
| 31. Dezember 2022    | –                                   | –   | 23.956.881 GBP                       | 10,11 GBP                                      | 26.138 GBP                          | 10,11 GBP                                     |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse GBP P*<br>NIW | Thesaurierende Klasse GBP P*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I*<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I5*<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I5*<br>NIW je Anteil |
|----------------------|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|--------------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 26.099 GBP                          | 10,10 GBP                                     | 10.143 USD                          | 10,14 USD                                     | 13.707.928 USD                       | 10,16 USD                                      |
| 31. Dezember 2022    | 26.104 GBP                          | 10,10 GBP                                     | 10.126.565 USD                      | 10,12 USD                                     | 2.455.025 USD                        | 10,13 USD                                      |

Global Bond

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD C1<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD C1<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I Benchmark Währungsgesicherte Klasse*<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I Benchmark Währungsgesicherte Klasse*<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---|---|-------------------------------------|---|---|---|
| 30. Juni 2023        | 29.073 AUD                                    | 7,38 AUD  | 418.975 USD                         | 8,65 USD                                      | 31.431 USD  | 10,48 USD   |
| 31. Dezember 2022    | 29.300 AUD                                    | 7,44 AUD  | 414.949 USD                         | 8,57 USD                                      | 30.527 USD  | 10,18 USD   |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD I<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD M<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD M<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)<br>NIW je Anteil |
|----------------------|------------------------------------|--|------------------------------------|--|---|---|
| 30. Juni 2023        | 4.186.581 USD                      | 9,78 USD                                     | 580.616 USD                        | 9,12 USD                                     | 23.024 USD                                    | 7,67 USD  |
| 31. Dezember 2022    | 1.427.481 USD                      | 9,63 USD                                     | 255.883 USD                        | 9,00 USD                                     | 23.014 USD                                    | 7,67 USD  |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Global Bond (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z<br>NIW je Anteil | Ausschüttende<br>Klasse<br>ZAR T<br>(Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende<br>Klasse<br>ZAR T<br>(Monatlich)<br>NIW je Anteil |
|----------------------|--|--|--|--|
| 30. Juni 2023        | 130.951.477 USD                          | 10,27 USD  | 336.549 ZAR  | 75,11 ZAR  |
| 31. Dezember 2022    | 132.650.317 USD                          | 10,10 USD  | 338.271 ZAR  | 75,50 ZAR  |

## Global Diversified Income FMP – 2024

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A<br>NIW je Anteil | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR A<br>NIW | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR A<br>NIW je Anteil | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I<br>NIW | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I<br>NIW je Anteil |
|----------------------|--|--|---|---|---|---|
| 30. Juni 2023        | 1.196.726 EUR                            | 9,79 EUR   | 222.396 EUR                             | 8,90 EUR  | 878.834 EUR                             | 8,79 EUR  |
| 31. Dezember 2022    | 1.182.222 EUR                            | 9,67 EUR   | 223.454 EUR                             | 8,94 EUR  | 882.969 EUR                             | 8,83 EUR  |

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP I<br>NIW | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP I<br>NIW je Anteil | Ausschüttende<br>Klasse<br>HKD A<br>NIW | Ausschüttende<br>Klasse<br>HKD A<br>NIW je Anteil | Ausschüttende<br>Klasse<br>SGD A<br>NIW | Ausschüttende<br>Klasse<br>SGD A<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---|---|---|---|---|---|
| 30. Juni 2023        | 1.883.760 GBP                           | 9,19 GBP  | 6.810.918 HKD                           | 9,08 HKD  | 4.380.907 SGD                           | 18,43 SGD   |
| 31. Dezember 2022    | 1.968.485 GBP                           | 9,16 GBP  | 6.811.671 HKD                           | 9,08 HKD  | 4.834.873 SGD                           | 18,40 SGD   |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A<br>NIW je Anteil | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD A<br>NIW | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD A<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>NIW je Anteil |
|----------------------|--|--|---|---|--|--|
| 30. Juni 2023        | 30.138.241 USD                           | 10,25 USD  | 41.316.777 USD                          | 9,28 USD  | 2.630.250 USD                            | 10,37 USD  |
| 31. Dezember 2022    | 29.538.472 USD                           | 10,01 USD  | 42.245.620 USD                          | 9,23 USD  | 2.564.036 USD                            | 10,11 USD  |

FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Global Diversified Income FMP – 2024 (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse USD I<br>NIW | Ausschüttende Klasse USD I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD X<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD X<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD X<br>NIW | Ausschüttende Klasse USD X<br>NIW je Anteil |
|----------------------|-----------------------------------|---|------------------------------------|--|-----------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 2.081.833 USD                     | 9,29 USD                                    | 21.803.700 USD                     | 10,36 USD                                    | 53.726.826 USD                    | 9,29 USD                                    |
| 31. Dezember 2022    | 2.069.152 USD                     | 9,23 USD                                    | 21.260.082 USD                     | 10,10 USD                                    | 53.399.383 USD                    | 9,24 USD                                    |

Global Equity Megatrends

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD A<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD A<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD C1<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD C1<br>NIW je Anteil |
|----------------------|--|--|------------------------------------|--|-------------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 6.462.560 EUR  | 15,35 EUR  | 33.889.164 USD                     | 14,31 USD                                    | 3.915.966 USD                       | 13,60 USD                                     |
| 31. Dezember 2022    | 5.374.723 EUR  | 13,68 EUR  | 33.770.046 USD                     | 12,43 USD                                    | 3.586.666 USD                       | 11,87 USD                                     |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD I<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD M<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD M<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD Z*<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD Z*<br>NIW je Anteil |
|----------------------|------------------------------------|--|------------------------------------|--|-------------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 23.376.590 USD                     | 15,05 USD                                    | 22.242.969 USD                     | 13,65 USD                                    | 12.239.087 USD                      | 10,18 USD                                     |
| 31. Dezember 2022    | 9.729.597 USD                      | 13,01 USD                                    | 17.646.556 USD                     | 11,90 USD                                    | 8.879.110 USD                       | 8,77 USD                                      |

Global Flexible Credit Income

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse CAD I5<br>NIW | Thesaurierende Klasse CAD I5<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR M<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR M<br>NIW je Anteil |
|----------------------|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 13.546.828 CAD                      | 9,70 CAD                                      | 3.957.182 EUR                      | 9,95 EUR                                     | 433.715 EUR                        | 9,44 EUR                                     |
| 31. Dezember 2022    | 14.013.104 CAD                      | 9,34 CAD                                      | 3.643.959 EUR                      | 9,69 EUR                                     | 390.568 EUR                        | 9,25 EUR                                     |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Global Flexible Credit Income (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse<br>GBP I5<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP I5<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD A<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD A<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD I<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD I<br>NIW je Anteil |
|----------------------|--|--|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 138.880.893 GBP                        | 10,87 GBP  | 8.509.261 USD                         | 10,09 USD                                       | 132.897.036 USD                       | 10,95 USD                                       |
| 31. Dezember 2022    | 196.137.415 GBP                        | 10,49 GBP  | 9.127.970 USD                         | 9,74 USD  | 123.697.450 USD                       | 10,54 USD                                       |

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse<br>USD I<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>USD I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD M<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD M<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD Z<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD Z<br>NIW je Anteil |
|----------------------|--------------------------------------|--|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 337.090 USD                          | 9,63 USD                                       | 5.543.827 USD                         | 9,87 USD  | 5.465.307 USD                         | 11,16 USD                                       |
| 31. Dezember 2022    | 333.308 USD                          | 9,53 USD                                       | 5.552.804 USD                         | 9,56 USD  | 5.191.915 USD                         | 10,70 USD                                       |

## Global High Yield SDG Engagement

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse<br>AUD I*<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>AUD I*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>CHF I4*<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>CHF I4*<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>CHF I4*<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>CHF I4*<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------------|---|---|---|--|--|
| 30. Juni 2023        | 39.503 AUD                            | 9,36 AUD  | 76.633.689 CHF                          | 9,67 CHF  | 4.925.349 CHF                          | 9,20 CHF   |
| 31. Dezember 2022    | 39.517 AUD                            | 9,36 AUD  | 34.903.208 CHF                          | 9,53 CHF  | 2.109.781 CHF                          | 9,32 CHF   |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse<br>CHF X*<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>CHF X*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>EUR I4*<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>EUR I4*<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>EUR I4*<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>EUR I4*<br>NIW je Anteil |
|----------------------|--|--|---|---|--|--|
| 30. Juni 2023        | 28.117 CHF                             | 9,59 CHF   | 67.305.155 EUR                          | 9,73 EUR  | 1.066.864 EUR                          | 9,26 EUR   |
| 31. Dezember 2022    | 27.818 CHF                             | 9,49 CHF   | 34.350.965 EUR                          | 9,51 EUR  | 894.723 EUR                            | 9,30 EUR   |

FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Global High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse EUR X*<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR X*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR Z (PF)<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR Z (PF)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP I4*<br>NIW | Thesaurierende Klasse GBP I4*<br>NIW je Anteil |
|----------------------|-------------------------------------|---|---|---|--------------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 27.448 EUR                          | 9,65 EUR                                      | 22.602.026 EUR                          | 10,94 EUR   | 17.884.580 GBP                       | 9,93 GBP                                       |
| 31. Dezember 2022    | 26.930 EUR                          | 9,46 EUR                                      | 21.835.394 EUR                          | 10,68 EUR   | 8.029.261 GBP                        | 9,63 GBP                                       |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse GBP X*<br>NIW | Thesaurierende Klasse GBP X*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD A<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD A<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I<br>NIW je Anteil |
|----------------------|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 23.625 GBP                          | 9,85 GBP                                      | 584.377 USD                        | 11,64 USD                                    | 4.930.027 USD                      | 12,27 USD                                    |
| 31. Dezember 2022    | 23.001 GBP                          | 9,59 GBP                                      | 600.599 USD                        | 11,29 USD                                    | 82.906 USD                         | 11,86 USD                                    |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD I4*<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I4*<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD M<br>NIW | Ausschüttende Klasse USD M<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD X<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD X<br>NIW je Anteil |
|----------------------|--------------------------------------|--|-----------------------------------|---|------------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 332.353.775 USD                      | 10,04 USD                                      | 1.217.153 USD                     | 7,70 USD                                    | 19.788 USD                         | 9,83 USD                                     |
| 31. Dezember 2022    | 93.240.963 USD                       | 9,70 USD                                       | 1.212.483 USD                     | 7,72 USD                                    | 19.180 USD                         | 9,53 USD                                     |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD Z<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD Z<br>NIW je Anteil |
|----------------------|------------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 8.403.639 USD                      | 12,78 USD                                    |
| 31. Dezember 2022    | 8.101.529 USD                      | 12,32 USD                                    |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Global High Yield Sustainable Action\*\*

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse<br>USD I*<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD I*<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>USD I*<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>USD I*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD X*<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD X*<br>NIW je Anteil |
|----------------------|--|--|---------------------------------------|---|--|--|
| 30. Juni 2023        | –                                      | –  | –                                     | –   | –                                      | –  |
| 31. Dezember 2022    | 9.396 USD                              | 9,40 USD   | 12.286.350 USD                        | 8,43 USD  | 9.281 USD                              | 9,28 USD   |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse<br>USD Y*<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD Y*<br>NIW je Anteil |
|----------------------|--|--|
| 30. Juni 2023        | –                                      | –  |
| 31. Dezember 2022    | 2.739.164 USD                          | 9,13 USD   |

\*\* Das Portfolio wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst.

## Global Investment Grade Credit

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse<br>USD I<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD X<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD X<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD Z<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD Z<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 1.709.631 USD                         | 8,70 USD  | 37.834.239 USD                        | 8,73 USD  | 41.961.859 USD                        | 8,75 USD  |
| 31. Dezember 2022    | 1.224.588 USD                         | 8,44 USD  | 42.337.788 USD                        | 8,46 USD  | 42.354.407 USD                        | 8,47 USD  |



FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Global Opportunistic Bond

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse EUR I NIW | Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP P NIW | Thesaurierende Klasse GBP P NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD A NIW | Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------|---|---------------------------------|---|---------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 14.363 EUR                      | 9,39 EUR                                  | 21.699 GBP                      | 9,46 GBP                                  | 484.719 USD                     | 10,42 USD                                 |
| 31. Dezember 2022    | 8.432.665 EUR                   | 8,72 EUR                                  | 21.356 GBP                      | 9,31 GBP                                  | 481.764 USD                     | 10,22 USD                                 |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD I NIW | Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD I NIW | Ausschüttende Klasse USD I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I2 NIW | Thesaurierende Klasse USD I2 NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------|---|--------------------------------|--|----------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 4.313.611 USD                   | 11,13 USD                                 | 11.947.712 USD                 | 9,55 USD                                 | 23.664.457 USD                   | 10,53 USD                                  |
| 31. Dezember 2022    | 4.135.327 USD                   | 10,91 USD                                 | 8.952.587 USD                  | 9,50 USD                                 | 24.678.158 USD                   | 10,32 USD                                  |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD Z NIW | Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 27.296.838 USD                  | 10,27 USD                                 |
| 31. Dezember 2022    | 28.817.657 USD                  | 10,04 USD                                 |

Global Real Estate Securities

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse EUR I5 NIW | Ausschüttende Klasse EUR I5 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR M NIW | Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------|---|---------------------------------|---|---|---|
| 30. Juni 2023        | 8.978.060 EUR                   | 7,54 EUR                                  | 885.820 EUR                     | 9,68 EUR                                  | 204.045 EUR   | 11,06 EUR   |
| 31. Dezember 2022    | 9.028.171 EUR                   | 7,69 EUR                                  | 1.021.424 EUR                   | 9,87 EUR                                  | 103.583 EUR   | 11,25 EUR   |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Global Real Estate Securities (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse<br>GBP Z<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP Z<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD A<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD A<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD CI<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD CI<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|--|--|
| 30. Juni 2023        | 83.084 GBP                            | 11,37 GBP                                       | 3.361.649 USD                         | 9,81 USD  | 127.452 USD                            | 8,71 USD   |
| 31. Dezember 2022    | 83.075 GBP                            | 11,37 GBP                                       | 4.298.698 USD                         | 9,83 USD  | 128.352 USD                            | 8,77 USD   |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse<br>USD I<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD I<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>USD I5<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>USD I5<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD M<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD M<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 13.552.074 USD                        | 12,57 USD                                       | 2.366.573 USD                         | 8,76 USD  | 667.536 USD                           | 8,93 USD  |
| 31. Dezember 2022    | 16.657.145 USD                        | 12,55 USD                                       | 2.824.490 USD                         | 8,82 USD  | 672.248 USD                           | 8,99 USD  |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse<br>USD Z<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD Z<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 2.242.111 USD                         | 12,88 USD                                       |
| 31. Dezember 2022    | 3.549.409 USD                         | 12,81 USD                                       |

## Global Sustainable Equity

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse<br>EUR I5 (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>EUR I5 (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>EUR M (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>EUR M (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>EUR Z (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>EUR Z (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---|---|--|--|--|--|
| 30. Juni 2023        | 84.804.126 EUR  | 11,41 EUR   | 71.826 EUR   | 10,88 EUR  | 1.361.141 EUR  | 11,02 EUR  |
| 31. Dezember 2022    | 79.067.463 EUR  | 10,10 EUR   | 59.173 EUR   | 9,73 EUR   | 1.214.656 EUR  | 9,75 EUR   |

FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Global Sustainable Equity (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse<br>GBP I (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP I (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>GBP I5 (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP I5 (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD A<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD A<br>NIW je Anteil |
|----------------------|--|--|---|---|---------------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 890.479 GBP  | 10,74 GBP  | 4.100.007 GBP   | 10,81 GBP   | 756.701 USD                           | 8,35 USD  |
| 31. Dezember 2022    | 526.524 GBP  | 9,85 GBP   | 4.009.524 GBP   | 9,90 GBP  | 523.329 USD                           | 7,28 USD  |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse<br>USD I<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD I<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>USD I<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>USD I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD M<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD M<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------------|---|--------------------------------------|--|---------------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 12.550.540 USD                        | 10,18 USD                                       | 11.530 USD                           | 10,19 USD                                      | 392.532 USD                           | 9,76 USD  |
| 31. Dezember 2022    | 10.623.061 USD                        | 8,83 USD  | 4.393.504 USD                        | 8,84 USD                                       | 361.394 USD                           | 8,54 USD  |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse<br>USD Z*<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD Z*<br>NIW je Anteil |
|----------------------|--|--|
| 30. Juni 2023        | 36.128.046 USD                         | 9,62 USD   |
| 31. Dezember 2022    | 24.466.171 USD                         | 8,32 USD   |

High Yield Bond

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse<br>AUD A<br>(Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>AUD A<br>(Monatlich)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>AUD A<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>AUD A<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>AUD B<br>(Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>AUD B<br>(Monatlich)<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---|---|---------------------------------------|---|---|---|
| 30. Juni 2023        | 18.586.550 AUD                                      | 6,39 AUD  | 3.015.630 AUD                         | 14,17 AUD                                       | 12.217.186 AUD                                      | 4,88 AUD  |
| 31. Dezember 2022    | 18.826.339 AUD                                      | 6,43 AUD  | 3.345.436 AUD                         | 13,78 AUD                                       | 14.918.035 AUD                                      | 4,95 AUD  |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## High Yield Bond (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse AUD B<br>NIW | Thesaurierende Klasse AUD B<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich)<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)<br>NIW je Anteil |
|----------------------|------------------------------------|--|--|--|---|---|
| 30. Juni 2023        | 917.736 AUD                        | 8,89 AUD                                     | 106.535 AUD                                    | 4,90 AUD   | 790.838 AUD                                   | 4,93 AUD  |
| 31. Dezember 2022    | 907.067 AUD                        | 8,71 AUD                                     | 422.009 AUD                                    | 4,96 AUD   | 961.233 AUD                                   | 5,00 AUD  |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse AUD E<br>NIW | Thesaurierende Klasse AUD E<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse AUD I<br>NIW | Ausschüttende Klasse AUD I<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)<br>NIW je Anteil |
|----------------------|------------------------------------|--|-----------------------------------|---|---|---|
| 30. Juni 2023        | 316.679 AUD                        | 10,02 AUD                                    | 19.549.545 AUD                    | 9,17 AUD                                    | 75.187.277 AUD                                | 5,66 AUD  |
| 31. Dezember 2022    | 394.034 AUD                        | 9,82 AUD                                     | 24.632.173 AUD                    | 9,15 AUD                                    | 77.779.276 AUD                                | 5,71 AUD  |

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse AUD T (Wöchentlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse AUD T (Wöchentlich)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse AUD T<br>NIW | Thesaurierende Klasse AUD T<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich)<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---|---|------------------------------------|--|---|---|
| 30. Juni 2023        | 750.079 AUD                                     | 5,47 AUD  | 2.007.303 AUD                      | 12,13 AUD                                    | 5.834.398 CAD                                 | 6,60 CAD  |
| 31. Dezember 2022    | 790.496 AUD                                     | 5,52 AUD  | 2.009.139 AUD                      | 11,83 AUD                                    | 6.486.618 CAD                                 | 6,61 CAD  |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse CHF A<br>NIW | Thesaurierende Klasse CHF A<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse CHF I<br>NIW | Thesaurierende Klasse CHF I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse CHF I2<br>NIW | Thesaurierende Klasse CHF I2<br>NIW je Anteil |
|----------------------|------------------------------------|--|------------------------------------|--|-------------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 3.212.827 CHF                      | 11,66 CHF                                    | 215.706 CHF                        | 12,46 CHF                                    | 2.132.796 CHF                       | 10,68 CHF                                     |
| 31. Dezember 2022    | 3.669.718 CHF                      | 11,47 CHF                                    | 5.277.144 CHF                      | 12,22 CHF                                    | 1.843.440 CHF                       | 10,47 CHF                                     |

FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich) NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse CNY I (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse CNY I (Monatlich) NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) NIW je Anteil |
|----------------------|--|--|--|--|--|--|
| 30. Juni 2023        | 13.229.716 CNY                             | 72,24 CNY  | 205.380 CNY                                | 76,55 CNY  | 6.017.774 EUR                              | 5,97 EUR   |
| 31. Dezember 2022    | 14.058.980 CNY                             | 73,25 CNY  | 207.631 CNY                                | 77,39 CNY  | 6.420.394 EUR                              | 6,03 EUR   |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse EUR A NIW | Thesaurierende Klasse EUR A NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse EUR A NIW | Ausschüttende Klasse EUR A NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I NIW | Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------|---|--------------------------------|--|---------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 24.599.198 EUR                  | 18,87 EUR                                 | 2.861.730 EUR                  | 7,00 EUR                                 | 18.310.961 EUR                  | 16,76 EUR                                 |
| 31. Dezember 2022    | 20.497.963 EUR                  | 18,42 EUR                                 | 2.934.472 EUR                  | 7,01 EUR                                 | 21.263.684 EUR                  | 16,30 EUR                                 |

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse EUR I NIW | Ausschüttende Klasse EUR I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW | Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse EUR I2 NIW | Ausschüttende Klasse EUR I2 NIW je Anteil |
|----------------------|--------------------------------|--|----------------------------------|--|---------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 4.742.595 EUR                  | 6,74 EUR                                 | 22.635.978 EUR                   | 11,77 EUR                                  | 57.805.842 EUR                  | 6,65 EUR                                  |
| 31. Dezember 2022    | 5.068.640 EUR                  | 6,74 EUR                                 | 21.766.293 EUR                   | 11,44 EUR                                  | 37.930.088 EUR                  | 6,65 EUR                                  |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse EUR M NIW | Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR Z NIW | Thesaurierende Klasse EUR Z NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich) NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------|---|---------------------------------|---|--|--|
| 30. Juni 2023        | 41.425 EUR                      | 10,58 EUR                                 | 170.363 EUR                     | 11,20 EUR                                 | 2.613.536 GBP                              | 6,19 GBP   |
| 31. Dezember 2022    | 40.548 EUR                      | 10,36 EUR                                 | 165.274 EUR                     | 10,87 EUR                                 | 2.614.675 GBP                              | 6,20 GBP   |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## High Yield Bond (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse<br>GBP A<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP A<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>GBP A<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>GBP A<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>GBP I<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP I<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------------|---|--------------------------------------|--|---------------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 1.325.077 GBP                         | 13,33 GBP                                       | 1.092.506 GBP                        | 7,64 GBP                                       | 5.418.821 GBP                         | 16,18 GBP                                       |
| 31. Dezember 2022    | 1.624.325 GBP                         | 12,91 GBP                                       | 1.085.076 GBP                        | 7,59 GBP                                       | 5.660.368 GBP                         | 15,62 GBP                                       |

  

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse<br>GBP I<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>GBP I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>GBP I2<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP I2<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>GBP I2<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>GBP I2<br>NIW je Anteil |
|----------------------|--------------------------------------|--|--|--|---------------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 4.109.175 GBP                        | 8,26 GBP                                       | 1.169.138 GBP                          | 12,95 GBP  | 178.156.566 GBP                       | 7,31 GBP  |
| 31. Dezember 2022    | 7.234.066 GBP                        | 8,21 GBP                                       | 581.131 GBP                            | 12,49 GBP  | 123.006.920 GBP                       | 7,27 GBP  |

  

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse<br>GBP Z<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP Z<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>HKD A<br>(Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>HKD A<br>(Monatlich)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>SEK A<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>SEK A<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------------|---|---|---|---------------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 144.037 GBP                           | 12,52 GBP                                       | 36.978.102 HKD                                      | 6,49 HKD  | 100.438.455 SEK                       | 128,85 SEK                                      |
| 31. Dezember 2022    | 153.131 GBP                           | 12,06 GBP                                       | 38.478.810 HKD                                      | 6,53 HKD  | 78.792.625 SEK                        | 125,59 SEK                                      |

  

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse<br>SGD A<br>(Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>SGD A<br>(Monatlich)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>SGD A<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>SGD A<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>USD A<br>(Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>USD A<br>(Monatlich)<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---|---|---------------------------------------|---|---|---|
| 30. Juni 2023        | 21.173.655 SGD                                      | 13,60 SGD   | 2.789.159 SGD                         | 27,42 SGD                                       | 78.984.210 USD                                      | 6,94 USD  |
| 31. Dezember 2022    | 22.367.741 SGD                                      | 13,65 SGD   | 2.875.654 SGD                         | 26,58 SGD                                       | 93.381.210 USD                                      | 6,93 USD  |

FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse USD A (Wöchentlich) NIW | Ausschüttende Klasse USD A (Wöchentlich) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD A NIW | Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD A NIW | Ausschüttende Klasse USD A NIW je Anteil |
|----------------------|--|--|---------------------------------|---|--------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 2.762.783 USD                                | 6,66 USD   | 137.721.103 USD                 | 16,93 USD                                 | 19.795.079 USD                 | 8,28 USD                                 |
| 31. Dezember 2022    | 2.844.055 USD                                | 6,65 USD   | 137.066.692 USD                 | 16,32 USD                                 | 20.742.314 USD                 | 8,20 USD                                 |

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD B NIW | Thesaurierende Klasse USD B NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD C NIW | Thesaurierende Klasse USD C NIW je Anteil |
|----------------------|--|--|---------------------------------|---|---------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 105.500.661 USD                            | 5,35 USD   | 11.963.374 USD                  | 11,19 USD                                 | 924.820 USD                     | 12,48 USD                                 |
| 31. Dezember 2022    | 111.013.457 USD                            | 5,38 USD   | 12.754.653 USD                  | 10,88 USD                                 | 894.416 USD                     | 12,07 USD                                 |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD C1 NIW | Thesaurierende Klasse USD C1 NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD C1 NIW | Ausschüttende Klasse USD C1 NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich) NIW je Anteil |
|----------------------|----------------------------------|--|---------------------------------|---|---|---|
| 30. Juni 2023        | 2.463.169 USD                    | 10,17 USD                                  | 621.225 USD                     | 8,37 USD                                  | 1.137.782 USD                               | 5,34 USD  |
| 31. Dezember 2022    | 2.598.086 USD                    | 9,85 USD                                   | 612.205 USD                     | 8,29 USD                                  | 3.605.063 USD                               | 5,38 USD  |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD C2 NIW | Thesaurierende Klasse USD C2 NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD E NIW | Thesaurierende Klasse USD E NIW je Anteil |
|----------------------|----------------------------------|--|--|--|---------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 56.058 USD                       | 11,20 USD                                  | 11.156.553 USD                             | 5,43 USD   | 2.196.380 USD                   | 10,09 USD                                 |
| 31. Dezember 2022    | 2.346.023 USD                    | 10,89 USD                                  | 11.744.149 USD                             | 5,46 USD   | 2.696.286 USD                   | 9,81 USD                                  |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## High Yield Bond (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I NIW | Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD I NIW | Ausschüttende Klasse USD I NIW je Anteil |
|----------------------|--|--|---------------------------------|---|--------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 40.340.132 USD                             | 7,24 USD   | 310.665.559 USD                 | 25,72 USD                                 | 15.080.536 USD                 | 9,58 USD                                 |
| 31. Dezember 2022    | 56.976.570 USD                             | 7,20 USD   | 420.046.688 USD                 | 24,73 USD                                 | 19.820.534 USD                 | 9,48 USD                                 |

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse USD I2 (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse USD I2 (Monatlich) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I2 NIW | Thesaurierende Klasse USD I2 NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD I2 NIW | Ausschüttende Klasse USD I2 NIW je Anteil |
|----------------------|---|---|----------------------------------|--|---------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 53.402.476 USD                              | 8,13 USD  | 233.445.506 USD                  | 14,08 USD                                  | 219.665.290 USD                 | 7,99 USD                                  |
| 31. Dezember 2022    | 53.570.112 USD                              | 8,09 USD  | 265.106.976 USD                  | 13,53 USD                                  | 156.239.569 USD                 | 7,91 USD                                  |

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD M NIW | Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD M NIW | Ausschüttende Klasse USD M NIW je Anteil |
|----------------------|---|---|---------------------------------|---|--------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 126.025.741 USD                             | 9,02 USD  | 588.905 USD                     | 12,53 USD                                 | 331.897 USD                    | 7,79 USD                                 |
| 31. Dezember 2022    | 124.143.845 USD                             | 8,88 USD  | 553.297 USD                     | 12,12 USD                                 | 164.387 USD                    | 7,79 USD                                 |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD P NIW | Thesaurierende Klasse USD P NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD T (Wöchentlich) NIW | Ausschüttende Klasse USD T (Wöchentlich) NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------|---|--|--|--|--|
| 30. Juni 2023        | 2.448.023 USD                   | 11,10 USD                                 | 133.701.403 USD                            | 5,94 USD   | 1.799.879 USD                                | 5,98 USD   |
| 31. Dezember 2022    | 4.400.603 USD                   | 10,67 USD                                 | 138.874.267 USD                            | 5,95 USD   | 1.835.534 USD                                | 5,99 USD   |



FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD T<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD T<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD U<br>(Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse USD U<br>(Monatlich)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD U<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD U<br>NIW je Anteil |
|----------------------|------------------------------------|--|--|--|------------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 10.505.821 USD                     | 12,43 USD                                    | 732.650 USD                                      | 6,79 USD   | 8.033.199 USD                      | 13,73 USD                                    |
| 31. Dezember 2022    | 7.598.079 USD                      | 12,02 USD                                    | 742.761 USD                                      | 6,77 USD   | 11.371.297 USD                     | 13,22 USD                                    |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD Z<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD Z<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse ZAR B<br>(Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse ZAR B<br>(Monatlich)<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse ZAR C2<br>(Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse ZAR C2<br>(Monatlich)<br>NIW je Anteil |
|----------------------|------------------------------------|--|--|--|---|---|
| 30. Juni 2023        | 50.836.390 USD                     | 13,19 USD                                    | 345.769.934 ZAR                                  | 53,12 ZAR  | 3.143.009 ZAR                                     | 53,06 ZAR   |
| 31. Dezember 2022    | 64.829.210 USD                     | 12,65 USD                                    | 372.548.933 ZAR                                  | 53,76 ZAR  | 7.199.304 ZAR                                     | 53,71 ZAR   |

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse ZAR E<br>(Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse ZAR E<br>(Monatlich)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse ZAR E<br>NIW | Thesaurierende Klasse ZAR E<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse ZAR T<br>(Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse ZAR T<br>(Monatlich)<br>NIW je Anteil |
|----------------------|--|--|------------------------------------|--|--|--|
| 30. Juni 2023        | 77.173.801 ZAR                                   | 52,52 ZAR  | 7.144.414 ZAR                      | 155,09 ZAR                                   | 1.600.475.728 ZAR                                | 59,06 ZAR  |
| 31. Dezember 2022    | 71.672.740 ZAR                                   | 53,15 ZAR  | 9.921.353 ZAR                      | 148,94 ZAR                                   | 1.678.189.332 ZAR                                | 59,48 ZAR  |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse ZAR T<br>NIW | Thesaurierende Klasse ZAR T<br>NIW je Anteil |
|----------------------|------------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 18.983.484 ZAR                     | 143,91 ZAR                                   |
| 31. Dezember 2022    | 15.485.308 ZAR                     | 137,52 ZAR                                   |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## InnovAsia 5G

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse CHF I4<br>NIW | Thesaurierende Klasse CHF I4<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR A<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR A<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I4<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR I4<br>NIW je Anteil |
|----------------------|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|-------------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 540.885 CHF                         | 7,58 CHF                                      | 335.746 EUR                        | 7,51 EUR                                     | 883.115 EUR                         | 7,69 EUR                                      |
| 31. Dezember 2022    | 469.743 CHF                         | 6,39 CHF                                      | 282.274 EUR                        | 6,32 EUR                                     | 810.342 EUR                         | 6,42 EUR                                      |

  

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR X<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR X<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse SGD A<br>NIW | Thesaurierende Klasse SGD A<br>NIW je Anteil |
|----------------------|--|--|------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 34.282 EUR   | 8,90 EUR   | 3.740.157 EUR                      | 7,54 EUR                                     | 31.516 SGD                         | 15,52 SGD                                    |
| 31. Dezember 2022    | 29.209 EUR   | 7,58 EUR   | 3.134.258 EUR                      | 6,33 EUR                                     | 26.331 SGD                         | 12,97 SGD                                    |

  

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse SGD I4<br>NIW | Thesaurierende Klasse SGD I4<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse SGD X<br>NIW | Thesaurierende Klasse SGD X<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD A<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD A<br>NIW je Anteil |
|----------------------|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 989.317 SGD                         | 15,89 SGD                                     | 292.125 SGD                        | 15,60 SGD                                    | 1.859.831 USD                      | 7,89 USD                                     |
| 31. Dezember 2022    | 696.450 SGD                         | 13,20 SGD                                     | 343.196 SGD                        | 13,02 SGD                                    | 125.519 USD                        | 6,55 USD                                     |

  

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD I<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I4<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I4<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD M<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD M<br>NIW je Anteil |
|----------------------|------------------------------------|--|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 6.086.274 USD                      | 8,03 USD                                     | 4041.583 USD                        | 8,08 USD                                      | 7.517 USD                          | 7,52 USD                                     |
| 31. Dezember 2022    | 3.159.260 USD                      | 6,64 USD                                     | 3.888.909 USD                       | 6,67 USD                                      | 6.265 USD                          | 6,26 USD                                     |

FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

InnovAsia 5G (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD X NIW | Thesaurierende Klasse USD X NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 1.987.092 USD                   | 7,94 USD                                  |
| 31. Dezember 2022    | 1.765.309 USD                   | 6,58 USD                                  |

Japan Equity Engagement Fund

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse EUR I5* NIW | Ausschüttende Klasse EUR I5* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP I5 NIW | Thesaurierende Klasse GBP I5 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil |
|----------------------|----------------------------------|--|----------------------------------|--|---|---|
| 30. Juni 2023        | 67.199.604 EUR                   | 10,91 EUR                                  | 452.748 GBP                      | 9,59 GBP                                   | 65.923 GBP  | 7,86 GBP  |
| 31. Dezember 2022    | 60.111.478 EUR                   | 9,46 EUR                                   | 321.237 GBP                      | 8,13 GBP                                   | 17.700 GBP  | 7,89 GBP  |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse JPY I NIW | Thesaurierende Klasse JPY I NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse JPY I NIW | Ausschüttende Klasse JPY I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse JPY I5 NIW | Thesaurierende Klasse JPY I5 NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------|---|--------------------------------|--|----------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 90.451.538 JPY                  | 1.670,03 JPY                              | 22.577.522 JPY                 | 1.657,30 JPY                             | 7.290.858.954 JPY                | 10.826,46 JPY                              |
| 31. Dezember 2022    | 503.411.392 JPY                 | 1.450,08 JPY                              | 735.824.128 JPY                | 1.450,06 JPY                             | 6.320.326.223 JPY                | 9.380,86 JPY                               |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse JPY Z NIW | Thesaurierende Klasse JPY Z NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 6.002.149.078 JPY               | 1.066,82 JPY                              |
| 31. Dezember 2022    | 4.464.613.674 JPY               | 922,43 JPY                                |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Macro Opportunities FX

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP Z<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP Z<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>SEK I<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>SEK I<br>NIW je Anteil |
|----------------------|--|--|--|--|--|--|
| 30. Juni 2023        | 1.283.522 EUR                            | 9,31 EUR   | 165.897 GBP                              | 9,90 GBP   | 284.892.737 SEK                          | 94,57 SEK  |
| 31. Dezember 2022    | 1.066.163 EUR                            | 9,23 EUR   | 162.743 GBP                              | 9,71 GBP   | 263.295.231 SEK                          | 93,64 SEK  |

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende<br>Klasse<br>SEK I<br>NIW | Ausschüttende<br>Klasse<br>SEK I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---|---|--|--|--|--|
| 30. Juni 2023        | 72.881 SEK                              | 97,78 SEK   | 10.646 USD                               | 9,85 USD   | 4.618.371 USD                            | 10,06 USD  |
| 31. Dezember 2022    | 72.218 SEK                              | 96,89 SEK   | 10.440 USD                               | 9,66 USD   | 6.993.860 USD                            | 9,84 USD   |

## Multi-Asset Income

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP P<br>NIW | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP P<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD C1<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD C1<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---|---|--|--|---|---|
| 30. Juni 2023        | 18.969 GBP                              | 8,14 GBP  | 4.330.286 USD                            | 10,56 USD  | 1.579.085 USD                             | 10,06 USD   |
| 31. Dezember 2022    | 19.140 GBP                              | 8,21 GBP  | 6.738.767 USD                            | 10,32 USD  | 2.328.953 USD                             | 9,89 USD  |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>NIW je Anteil | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I<br>NIW | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M<br>NIW je Anteil |
|----------------------|--|--|---|---|--|--|
| 30. Juni 2023        | 674.104 USD                              | 11,90 USD  | 107.127 USD                             | 8,67 USD  | 1.339.817 USD                            | 10,23 USD  |
| 31. Dezember 2022    | 685.261 USD                              | 11,59 USD  | 107.660 USD                             | 8,72 USD  | 1.477.940 USD                            | 10,04 USD  |

FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Next Generation Mobility

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse EUR A<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR A<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)<br>NIW je Anteil |
|----------------------|------------------------------------|--|------------------------------------|--|--|--|
| 30. Juni 2023        | 120.196 EUR                        | 14,07 EUR                                    | 327.792 EUR                        | 9,98 EUR                                     | 43.707.190 EUR   | 16,19 EUR  |
| 31. Dezember 2022    | 132.041 EUR                        | 11,62 EUR                                    | 269.618 EUR                        | 8,21 EUR                                     | 36.872.226 EUR   | 13,43 EUR  |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD A<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD A<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD C1<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD C1<br>NIW je Anteil |
|----------------------|--|--|------------------------------------|--|-------------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 35.484.809 EUR   | 18,79 EUR  | 30.133.630 USD                     | 16,07 USD                                    | 1.510.527 USD                       | 17,28 USD                                     |
| 31. Dezember 2022    | 30.152.894 EUR   | 15,72 EUR  | 26.824.764 USD                     | 13,10 USD                                    | 1.947.673 USD                       | 14,16 USD                                     |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD I<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD I<br>NIW | Ausschüttende Klasse USD I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD M<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD M<br>NIW je Anteil |
|----------------------|------------------------------------|--|-----------------------------------|---|------------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 6.296.905 USD                      | 16,32 USD                                    | 6.378.903 USD                     | 16,31 USD                                   | 7.938.553 USD                      | 17,42 USD                                    |
| 31. Dezember 2022    | 4.906.268 USD                      | 13,25 USD                                    | 5.581.715 USD                     | 13,24 USD                                   | 7.055.187 USD                      | 14,25 USD                                    |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD X<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD X<br>NIW je Anteil |
|----------------------|------------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 31.728.106 USD                     | 19,00 USD                                    |
| 31. Dezember 2022    | 29.578.839 USD                     | 15,48 USD                                    |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Next Generation Space Economy<sup>1</sup>

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse<br>EUR I3 (nicht<br>währungsgesichert)*<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>EUR I3 (nicht<br>währungsgesichert)*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>EUR M (nicht<br>währungsgesichert)*<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>EUR M (nicht<br>währungsgesichert)*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD I*<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD I*<br>NIW je Anteil |
|----------------------|--|--|---|---|--|--|
| 30. Juni 2023        | 7.098.421 EUR  | 10,96 EUR  | 2.334.081 EUR   | 10,72 EUR   | 3.391.797 USD                          | 11,31 USD  |
| 31. Dezember 2022    | 4.206.616 EUR  | 9,51 EUR   | 1.061.485 EUR   | 9,39 EUR  | 2.882.343 USD                          | 9,61 USD   |

## Short Duration Emerging Market Debt

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse<br>AUD A<br>(Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>AUD A<br>(Monatlich)<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>CAD A<br>(Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>CAD A<br>(Monatlich)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>CHF A<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>CHF A<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---|---|---|---|---------------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 1.542.459 AUD                                       | 7,79 AUD  | 4.476.660 CAD                                       | 8,13 CAD  | 3.614.049 CHF                         | 9,26 CHF  |
| 31. Dezember 2022    | 2.610.697 AUD                                       | 7,91 AUD  | 4.375.456 CAD                                       | 8,21 CAD  | 4.483.337 CHF                         | 9,23 CHF  |

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse<br>CHF A<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>CHF A<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>CHF I<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>CHF I<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>CHF I<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>CHF I<br>NIW je Anteil |
|----------------------|--------------------------------------|--|---------------------------------------|---|--------------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 773.127 CHF                          | 6,72 CHF                                       | 6.242.203 CHF                         | 9,69 CHF  | 1.123.469 CHF                        | 6,74 CHF                                       |
| 31. Dezember 2022    | 824.695 CHF                          | 6,80 CHF                                       | 12.634.709 CHF                        | 9,64 CHF  | 1.149.563 CHF                        | 6,82 CHF                                       |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse<br>CHF I2<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>CHF I2<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>CHF I2<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>CHF I2<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>CHF I5<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>CHF I5<br>NIW je Anteil |
|----------------------|--|--|---------------------------------------|---|--|--|
| 30. Juni 2023        | 14.188.068 CHF                         | 9,89 CHF   | 5.215.586 CHF                         | 7,39 CHF  | 1.508.971 CHF                          | 10,09 CHF  |
| 31. Dezember 2022    | 19.647.200 CHF                         | 9,84 CHF   | 12.395.410 CHF                        | 7,49 CHF  | 1.515.754 CHF                          | 10,02 CHF  |

FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse CHF P NIW | Thesaurierende Klasse CHF P NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR A NIW | Thesaurierende Klasse EUR A NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse EUR A NIW | Ausschüttende Klasse EUR A NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------|---|---------------------------------|---|--------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 21.379.102 CHF                  | 9,37 CHF                                  | 114.307.309 EUR                 | 9,66 EUR                                  | 15.965.761 EUR                 | 7,01 EUR                                 |
| 31. Dezember 2022    | 27.905.942 CHF                  | 9,32 CHF                                  | 117.630.713 EUR                 | 9,55 EUR                                  | 16.574.105 EUR                 | 7,04 EUR                                 |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse EUR I NIW | Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse EUR I NIW | Ausschüttende Klasse EUR I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW | Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------|---|--------------------------------|--|----------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 677.367.746 EUR                 | 10,11 EUR                                 | 151.895.747 EUR                | 7,02 EUR                                 | 222.688.779 EUR                  | 10,20 EUR                                  |
| 31. Dezember 2022    | 712.003.973 EUR                 | 9,98 EUR                                  | 163.594.524 EUR                | 7,05 EUR                                 | 214.675.538 EUR                  | 10,06 EUR                                  |

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse EUR I2 NIW | Ausschüttende Klasse EUR I2 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I5 NIW | Thesaurierende Klasse EUR I5 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR M NIW | Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------|---|----------------------------------|--|---------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 58.581.948 EUR                  | 7,59 EUR                                  | 6.727.079 EUR                    | 10,58 EUR                                  | 2.324.735 EUR                   | 9,40 EUR                                  |
| 31. Dezember 2022    | 59.488.811 EUR                  | 7,63 EUR                                  | 6.256.930 EUR                    | 10,43 EUR                                  | 2.699.887 EUR                   | 9,33 EUR                                  |

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse EUR M NIW | Ausschüttende Klasse EUR M NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR P NIW | Thesaurierende Klasse EUR P NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR U NIW | Thesaurierende Klasse EUR U NIW je Anteil |
|----------------------|--------------------------------|--|---------------------------------|---|---------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 1.624.755 EUR                  | 6,70 EUR                                 | 56.442.713 EUR                  | 9,69 EUR                                  | 4.881.541 EUR                   | 9,60 EUR                                  |
| 31. Dezember 2022    | 1.109.542 EUR                  | 6,79 EUR                                 | 108.476.284 EUR                 | 9,56 EUR                                  | 3.889.492 EUR                   | 9,49 EUR                                  |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse<br>EUR X<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>EUR X<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>GBP A<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP A<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>GBP I<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP I<br>NIW je Anteil |
|----------------------|--------------------------------------|--|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 49.090.925 EUR                       | 8,77 EUR                                       | 1.222.584 GBP                         | 10,18 GBP                                       | 2.624.378 GBP                         | 10,51 GBP                                       |
| 31. Dezember 2022    | 49.291.318 EUR                       | 8,80 EUR                                       | 1.784.594 GBP                         | 10,00 GBP                                       | 4.696.255 GBP                         | 10,30 GBP                                       |

  

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse<br>GBP I<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>GBP I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>GBP I2<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP I2<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>GBP I2<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>GBP I2<br>NIW je Anteil |
|----------------------|--------------------------------------|--|--|--|---------------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 2.697.913 GBP                        | 8,32 GBP                                       | 1.342.767 GBP                          | 10,50 GBP  | 507.360.919 GBP                       | 8,17 GBP  |
| 31. Dezember 2022    | 3.745.024 GBP                        | 8,30 GBP                                       | 2.008.405 GBP                          | 10,29 GBP  | 504.532.899 GBP                       | 8,15 GBP  |

  

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse<br>GBP I5<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>GBP I5<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>GBP P<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP P<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>JPY I<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>JPY I<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 140.692.917 GBP                       | 7,68 GBP  | 1.718.432 GBP                         | 9,86 GBP  | 78.533.997.403 JPY                    | 1.021,46 JPY                                    |
| 31. Dezember 2022    | 130.424.601 GBP                       | 7,66 GBP  | 1.656.455 GBP                         | 9,67 GBP  | 90.490.215.829 JPY                    | 1.024,16 JPY                                    |

  

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse<br>JPY I<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>JPY I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>SEK A<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>SEK A<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>SGD A<br>(Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>SGD A<br>(Monatlich)<br>NIW je Anteil |
|----------------------|--------------------------------------|--|---------------------------------------|---|---|---|
| 30. Juni 2023        | 3.830.322.344 JPY                    | 705,88 JPY                                     | 13.152.522 SEK                        | 94,38 SEK                                       | 53.934.657 SGD                                      | 15,91 SGD   |
| 31. Dezember 2022    | 3.875.746.192 JPY                    | 719,95 JPY                                     | 15.573.259 SEK                        | 93,27 SEK                                       | 40.192.701 SGD                                      | 16,13 SGD   |



FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD A NIW | Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD A NIW | Ausschüttende Klasse USD A NIW je Anteil |
|----------------------|--|--|---------------------------------|---|--------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 25.839.454 USD                             | 8,13 USD   | 377.746.208 USD                 | 11,55 USD                                 | 111.302.807 USD                | 8,17 USD                                 |
| 31. Dezember 2022    | 23.230.997 USD                             | 8,19 USD   | 412.842.165 USD                 | 11,29 USD                                 | 119.519.572 USD                | 8,11 USD                                 |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD C1 NIW | Thesaurierende Klasse USD C1 NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD C1 NIW | Ausschüttende Klasse USD C1 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I NIW | Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil |
|----------------------|----------------------------------|--|---------------------------------|---|---------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 35.209.105 USD                   | 9,89 USD                                   | 3.655.136 USD                   | 8,63 USD                                  | 716.036.250 USD                 | 12,08 USD                                 |
| 31. Dezember 2022    | 37.919.286 USD                   | 9,72 USD                                   | 3.929.202 USD                   | 8,57 USD                                  | 741.407.065 USD                 | 11,79 USD                                 |

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse USD I NIW | Ausschüttende Klasse USD I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I2 NIW | Thesaurierende Klasse USD I2 NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD I2 NIW | Ausschüttende Klasse USD I2 NIW je Anteil |
|----------------------|--------------------------------|--|----------------------------------|--|---------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 77.493.055 USD                 | 8,68 USD                                 | 50.192.014 USD                   | 11,87 USD                                  | 99.916.175 USD                  | 8,67 USD                                  |
| 31. Dezember 2022    | 81.356.489 USD                 | 8,62 USD                                 | 159.773.031 USD                  | 11,58 USD                                  | 88.468.242 USD                  | 8,61 USD                                  |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD I5 NIW | Thesaurierende Klasse USD I5 NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD I5 NIW | Ausschüttende Klasse USD I5 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD M NIW | Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil |
|----------------------|----------------------------------|--|---------------------------------|---|---------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 5.499.224 USD                    | 12,29 USD                                  | 19.341.638 USD                  | 8,31 USD                                  | 40.061.530 USD                  | 10,13 USD                                 |
| 31. Dezember 2022    | 5.538.850 USD                    | 11,98 USD                                  | 21.165.474 USD                  | 8,25 USD                                  | 42.163.321 USD                  | 9,94 USD                                  |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse<br>USD M<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>USD M<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD P<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD P<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD Z<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD Z<br>NIW je Anteil |
|----------------------|--------------------------------------|--|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 7.611.497 USD                        | 7,83 USD                                       | 179.939.531 USD                       | 11,71 USD                                       | 20.952.338 USD                        | 12,51 USD                                       |
| 31. Dezember 2022    | 9.583.244 USD                        | 7,84 USD                                       | 188.567.221 USD                       | 11,42 USD                                       | 14.055.349 USD                        | 12,18 USD                                       |

## Short Duration High Yield SDG Engagement

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse<br>AUD A<br>(Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>AUD A<br>(Monatlich)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>CHF A<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>CHF A<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>CHF I<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>CHF I<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---|---|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 1.191.560 AUD                                       | 7,04 AUD  | 585.038 CHF                           | 10,93 CHF                                       | 231.573 CHF                           | 11,88 CHF                                       |
| 31. Dezember 2022    | 1.192.743 AUD                                       | 7,08 AUD  | 790.227 CHF                           | 10,75 CHF                                       | 227.034 CHF                           | 11,64 CHF                                       |

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse<br>CNY A<br>(Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>CNY A<br>(Monatlich)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>EUR A<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>EUR A<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>EUR A<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>EUR A<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---|---|---------------------------------------|---|--------------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 2.121.700 CNY                                       | 83,15 CNY   | 10.604.541 EUR                        | 11,58 EUR                                       | 2.460.181 EUR                        | 6,78 EUR                                       |
| 31. Dezember 2022    | 2.048.761 CNY                                       | 84,25 CNY   | 11.761.196 EUR                        | 11,29 EUR                                       | 2.515.236 EUR                        | 6,76 EUR                                       |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse<br>EUR I<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>EUR I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>EUR I2<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>EUR I2<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>EUR M<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>EUR M<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------------|---|--|--|---------------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 51.664.499 EUR                        | 12,37 EUR                                       | 33.705.058 EUR                         | 11,47 EUR  | 935.458 EUR                           | 10,24 EUR                                       |
| 31. Dezember 2022    | 39.889.511 EUR                        | 12,03 EUR                                       | 5.785.967 EUR                          | 11,15 EUR  | 922.543 EUR                           | 10,01 EUR                                       |

FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Short Duration High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse<br>EUR M<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>EUR M<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>GBP I<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP I<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>GBP I<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>GBP I<br>NIW je Anteil |
|----------------------|--------------------------------------|--|---------------------------------------|---|--------------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 581.274 EUR                          | 6,79 EUR                                       | 387.338 GBP                           | 13,66 GBP                                       | 28.875.609 GBP                       | 7,61 GBP                                       |
| 31. Dezember 2022    | 630.438 EUR                          | 6,83 EUR                                       | 15.610.824 GBP                        | 13,18 GBP                                       | 2.403.578 GBP                        | 7,53 GBP                                       |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse<br>GBP I2<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP I2<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>GBP I2<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>GBP I2<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>HKD A<br>(Monatlich)*<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>HKD A<br>(Monatlich)*<br>NIW je Anteil |
|----------------------|--|--|---------------------------------------|---|--|--|
| 30. Juni 2023        | 1.249.583 GBP                          | 12,69 GBP  | 1.118.095 GBP                         | 7,42 GBP  | 1.113.911 HKD  | 9,93 HKD   |
| 31. Dezember 2022    | 1.217.801 GBP                          | 12,24 GBP  | 1.385.249 GBP                         | 7,34 GBP  | 2.368.192 HKD  | 9,97 HKD   |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse<br>JPY I<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>JPY I<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>JPY I*<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>JPY I*<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>SGD A<br>(Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>SGD A<br>(Monatlich)<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|---|---|
| 30. Juni 2023        | 17.343.643.709 JPY                    | 1.221,47 JPY                                    | 1.507.092.252 JPY                     | 1.004,73 JPY                                    | 2.675.914 SGD                                       | 14,81 SGD   |
| 31. Dezember 2022    | 17.584.604.152 JPY                    | 1.205,68 JPY                                    | 1.522.033.806 JPY                     | 1.014,69 JPY                                    | 2.179.241 SGD                                       | 14,86 SGD   |

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse<br>USD A<br>(Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>USD A<br>(Monatlich)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD A<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD A<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>USD A<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>USD A<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---|---|---------------------------------------|---|--------------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 3.155.994 USD                                       | 7,58 USD  | 35.199.181 USD                        | 13,61 USD                                       | 9.467.081 USD                        | 8,02 USD                                       |
| 31. Dezember 2022    | 3.099.464 USD                                       | 7,57 USD  | 35.220.346 USD                        | 13,11 USD                                       | 9.519.536 USD                        | 7,91 USD                                       |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Short Duration High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD C1 NIW | Thesaurierende Klasse USD C1 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I NIW | Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD I NIW | Ausschüttende Klasse USD I NIW je Anteil |
|----------------------|----------------------------------|--|---------------------------------|---|--------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 3.517.161 USD                    | 10,59 USD                                  | 130.356.871 USD                 | 14,57 USD                                 | 180.121.044 USD                | 8,20 USD                                 |
| 31. Dezember 2022    | 3.953.039 USD                    | 10,26 USD                                  | 121.367.229 USD                 | 14,00 USD                                 | 2.566.217 USD                  | 8,09 USD                                 |

  

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD I2 NIW | Thesaurierende Klasse USD I2 NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD I2 NIW | Ausschüttende Klasse USD I2 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I4* NIW | Thesaurierende Klasse USD I4* NIW je Anteil |
|----------------------|----------------------------------|--|---------------------------------|---|-----------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 30.777.196 USD                   | 13,65 USD                                  | 281.094 USD                     | 8,01 USD                                  | 2.833.409 USD                     | 10,08 USD                                   |
| 31. Dezember 2022    | 94.032.462 USD                   | 13,11 USD                                  | 1.874.619 USD                   | 7,90 USD                                  | –                                 | –   |

  

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD I5* NIW | Thesaurierende Klasse USD I5* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD M NIW | Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD M NIW | Ausschüttende Klasse USD M NIW je Anteil |
|----------------------|-----------------------------------|---|---------------------------------|---|--------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 26.319.745 USD                    | 10,47 USD                                   | 4.165.370 USD                   | 10,91 USD                                 | 2.164.552 USD                  | 8,04 USD                                 |
| 31. Dezember 2022    | 25.249.794 USD                    | 10,04 USD                                   | 8.383.843 USD                   | 10,55 USD                                 | 3.564.599 USD                  | 8,00 USD                                 |

  

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD Z NIW | Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 5.901.695 USD                   | 13,19 USD                                 |
| 31. Dezember 2022    | 9.845.241 USD                   | 12,64 USD                                 |

FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Strategic Income

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse AUD Z (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse AUD Z (Monatlich) NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)* NIW | Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)* NIW je Anteil |
|----------------------|--|--|--|--|---|---|
| 30. Juni 2023        | 35.919.882 AUD                             | 8,03 AUD   | 97.237.615 AUD                             | 8,72 AUD   | 213.728 CNY                                 | 100,03 CNY  |
| 31. Dezember 2022    | 3.816.128 AUD                              | 8,10 AUD   | 74.440.920 AUD                             | 8,74 AUD   | –   | –   |

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR A* NIW | Thesaurierende Klasse EUR A* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I NIW | Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil |
|----------------------|--|--|----------------------------------|--|---------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 22.669.913 EUR                             | 7,47 EUR   | 160.187 EUR                      | 10,26 EUR                                  | 8.322.898 EUR                   | 10,93 EUR                                 |
| 31. Dezember 2022    | 6.586.578 EUR                              | 7,56 EUR   | 54.250 EUR                       | 10,05 EUR                                  | 7.002.752 EUR                   | 10,68 EUR                                 |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse EUR M NIW | Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich) NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------|---|--|--|--|--|
| 30. Juni 2023        | 1.030.458 EUR                   | 10,03 EUR                                 | 17.231.501 GBP                             | 7,92 GBP   | 390.708.230 HKD                            | 8,27 HKD   |
| 31. Dezember 2022    | 1.332.181 EUR                   | 9,85 EUR                                  | 1.790.460 GBP                              | 7,95 GBP   | 11.395.657 HKD                             | 8,31 HKD   |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse JPY I NIW | Thesaurierende Klasse JPY I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse JPY I CG NIW | Ausschüttende Klasse JPY I CG NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------|---|---|---|-----------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 12.135.734.591 JPY              | 1.072,80 JPY                              | 4.412.916.809 JPY   | 1.880,24 JPY  | 3.699.349.750 JPY                 | 881,56 JPY                                  |
| 31. Dezember 2022    | 12.532.729.742 JPY              | 1.065,57 JPY                              | 3.890.984.078 JPY   | 1.656,82 JPY  | 5.903.832.844 JPY                 | 875,62 JPY                                  |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Strategic Income (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse JPY I<br>NIW | Ausschüttende Klasse JPY I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse JPY Z*<br>NIW | Thesaurierende Klasse JPY Z*<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse SGD A<br>(Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse SGD A<br>(Monatlich)<br>NIW je Anteil |
|----------------------|-----------------------------------|---|-------------------------------------|---|--|--|
| 30. Juni 2023        | 4.226.618 JPY                     | 797,50 JPY                                  | 5.505.723.722 JPY                   | 923,92 JPY                                    | 28.042.297 SGD                                   | 15,82 SGD  |
| 31. Dezember 2022    | 7.335.571.257 JPY                 | 803,30 JPY                                  | 10.051.163.176 JPY                  | 915,43 JPY                                    | 22.557.538 SGD                                   | 15,90 SGD  |

  

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse SGD A<br>NIW | Thesaurierende Klasse SGD A<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse SGD I<br>(Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse SGD I<br>(Monatlich)<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD A<br>(Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse USD A<br>(Monatlich)<br>NIW je Anteil |
|----------------------|------------------------------------|--|--|--|--|--|
| 30. Juni 2023        | 6.002.749 SGD                      | 20,92 SGD                                    | 12.515.179 SGD                                   | 17,64 SGD  | 123.915.762 USD                                  | 8,12 USD   |
| 31. Dezember 2022    | 4.409.893 SGD                      | 20,36 SGD                                    | 11.455.558 SGD                                   | 17,69 SGD  | 39.825.935 USD                                   | 8,11 USD   |

  

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD A<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD A<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD A<br>NIW | Ausschüttende Klasse USD A<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD C1<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD C1<br>NIW je Anteil |
|----------------------|------------------------------------|--|-----------------------------------|---|-------------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 368.553.770 USD                    | 11,75 USD                                    | 20.345.564 USD                    | 9,58 USD                                    | 40.972.070 USD                      | 10,27 USD                                     |
| 31. Dezember 2022    | 302.568.244 USD                    | 11,37 USD                                    | 15.250.191 USD                    | 9,39 USD                                    | 43.957.466 USD                      | 9,99 USD                                      |

  

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD I<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD I<br>NIW | Ausschüttende Klasse USD I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD M<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD M<br>NIW je Anteil |
|----------------------|------------------------------------|--|-----------------------------------|---|------------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 331.568.530 USD                    | 12,72 USD                                    | 36.372.461 USD                    | 9,62 USD                                    | 90.389.083 USD                     | 11,70 USD                                    |
| 31. Dezember 2022    | 369.131.042 USD                    | 12,27 USD                                    | 25.395.713 USD                    | 9,43 USD                                    | 70.446.108 USD                     | 11,36 USD                                    |

FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Strategic Income (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse<br>USD M<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>USD M<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD Z<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD Z<br>NIW je Anteil |
|----------------------|--------------------------------------|--|---------------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 8.641.506 USD                        | 8,38 USD                                       | 43.359.236 USD                        | 12,86 USD                                       |
| 31. Dezember 2022    | 8.239.009 USD                        | 8,30 USD                                       | 42.846.054 USD                        | 12,39 USD                                       |

Sustainable Asia High Yield

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse<br>EUR X*<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>EUR X*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>GBP X*<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP X*<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>USD A<br>(Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>USD A<br>(Monatlich)<br>NIW je Anteil |
|----------------------|--|--|--|--|---|---|
| 30. Juni 2023        | 417.167 EUR                            | 8,48 EUR   | 37.332 GBP                             | 9,34 GBP   | 13.316 USD  | 7,34 USD  |
| 31. Dezember 2022    | 3.659.153 EUR                          | 8,51 EUR   | 208.349 GBP                            | 9,31 GBP   | 7.630 USD   | 7,63 USD  |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse<br>USD A<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD A<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD I<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD Z*<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD Z*<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|--|--|
| 30. Juni 2023        | 8.314 USD                             | 8,31 USD  | 10.286 USD                            | 8,39 USD  | 21.155.702 USD                         | 8,78 USD   |
| 31. Dezember 2022    | 8.284 USD                             | 8,28 USD  | 10.219 USD                            | 8,34 USD  | 20.955.845 USD                         | 8,70 USD   |

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse<br>USD Z*<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>USD Z*<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 6.672.268 USD                         | 9,25 USD  |
| 31. Dezember 2022    | 6.793.345 USD                         | 9,42 USD  |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Sustainable Emerging Market Corporate Debt

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse CHF I NIW | Thesaurierende Klasse CHF I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse CHF I4* NIW          | Thesaurierende Klasse CHF I4* NIW je Anteil          | Thesaurierende Klasse EUR A NIW | Thesaurierende Klasse EUR A NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 11.734.121 CHF                  | 11,04 CHF                                 | –  | –  | 555.499 EUR                     | 10,05 EUR                                 |
| 31. Dezember 2022    | 11.340.526 CHF                  | 10,96 CHF                                 | 4.061.234 CHF                              | 8,89 CHF   | 630.955 EUR                     | 9,94 EUR                                  |
| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse EUR I NIW | Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I3 NIW           | Thesaurierende Klasse EUR I3 NIW je Anteil           | Thesaurierende Klasse EUR M NIW | Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil |
| 30. Juni 2023        | 533.306 EUR                     | 11,60 EUR                                 | 206.482 EUR                                | 9,92 EUR   | 529.186 EUR                     | 9,58 EUR                                  |
| 31. Dezember 2022    | 525.213 EUR                     | 11,42 EUR                                 | 236.709 EUR                                | 9,75 EUR   | 533.388 EUR                     | 9,51 EUR                                  |
| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse EUR M NIW  | Ausschüttende Klasse EUR M NIW je Anteil  | Thesaurierende Klasse EUR X NIW            | Thesaurierende Klasse EUR X NIW je Anteil            | Thesaurierende Klasse GBP I NIW | Thesaurierende Klasse GBP I NIW je Anteil |
| 30. Juni 2023        | 430.899 EUR                     | 6,54 EUR                                  | 42.887.408 EUR                             | 10,54 EUR  | 9.938 GBP                       | 12,63 GBP                                 |
| 31. Dezember 2022    | 383.031 EUR                     | 6,66 EUR                                  | 42.148.804 EUR                             | 10,36 EUR  | 26.641 GBP                      | 12,35 GBP                                 |
| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse SEK A NIW | Thesaurierende Klasse SEK A NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD A NIW | Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil |
| 30. Juni 2023        | 2.790.633 SEK                   | 88,63 SEK                                 | 704.749 USD                                | 7,30 USD   | 5.790.094 USD                   | 12,53 USD                                 |
| 31. Dezember 2022    | 2.904.877 SEK                   | 87,48 SEK                                 | 625.857 USD                                | 7,32 USD   | 6.344.534 USD                   | 12,24 USD                                 |



FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Sustainable Emerging Market Corporate Debt (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD C1<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD C1<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD I<br>NIW | Ausschüttende Klasse USD I<br>NIW je Anteil |
|----------------------|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|-----------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 641.673 USD                         | 9,50 USD                                      | 21.414.136 USD                     | 13,56 USD                                    | 2.481.592 USD                     | 8,83 USD                                    |
| 31. Dezember 2022    | 648.535 USD                         | 9,32 USD                                      | 20.881.275 USD                     | 13,20 USD                                    | 2.641.379 USD                     | 8,77 USD                                    |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD I2<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I2<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I5<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I5<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD M<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD M<br>NIW je Anteil |
|----------------------|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 797.388 USD                         | 12,27 USD                                     | 228.995 USD                         | 12,68 USD                                     | 1.336.792 USD                      | 9,56 USD                                     |
| 31. Dezember 2022    | 775.368 USD                         | 11,93 USD                                     | 338.193 USD                         | 12,32 USD                                     | 752.825 USD                        | 9,38 USD                                     |

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse USD M<br>NIW | Ausschüttende Klasse USD M<br>NIW je Anteil |
|----------------------|-----------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 680.830 USD                       | 7,14 USD                                    |
| 31. Dezember 2022    | 657.453 USD                       | 7,19 USD                                    |

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency<sup>1</sup>

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse EUR I3*<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR I3*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I4*<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR I4*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I5*<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR I5*<br>NIW je Anteil |
|----------------------|--------------------------------------|--|--------------------------------------|--|--------------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 30.898.568 EUR                       | 11,23 EUR                                      | 159.959.726 EUR                      | 10,18 EUR                                      | –                                    | –  |
| 31. Dezember 2022    | 23.246.658 EUR                       | 10,79 EUR                                      | –                                    | –  | 2.500.773 EUR                        | 10,01 EUR                                      |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency<sup>1</sup> (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse EUR X*<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR X*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I*<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I5*<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I5*<br>NIW je Anteil |
|----------------------|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|--------------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 60.960.971 EUR                      | 8,71 EUR                                      | 8.992 USD                           | 8,99 USD                                      | 65.544.190 USD                       | 9,02 USD                                       |
| 31. Dezember 2022    | 64.417.647 EUR                      | 8,36 EUR                                      | 8.540 USD                           | 8,54 USD                                      | 62.156.033 USD                       | 8,55 USD                                       |

## Systematic Global Sustainable Value

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse EUR M<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR M<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)*<br>NIW | Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD A<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD A<br>NIW je Anteil |
|----------------------|------------------------------------|--|--|--|------------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 505.422 EUR                        | 14,87 EUR                                    | 9.563 GBP  | 10,32 GBP  | 1.634.445 USD                      | 17,08 USD                                    |
| 31. Dezember 2022    | 483.610 EUR                        | 14,02 EUR                                    | 9.338 GBP  | 10,08 GBP  | 2.093.493 USD                      | 15,83 USD                                    |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD I<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I3*<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I3*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD Z<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD Z<br>NIW je Anteil |
|----------------------|------------------------------------|--|--------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 3.004.312 USD                      | 18,06 USD                                    | 27.717.572 USD                       | 10,24 USD                                      | 13.222.850 USD                     | 19,67 USD                                    |
| 31. Dezember 2022    | 2.989.730 USD                      | 16,71 USD                                    | 23.813.624 USD                       | 9,47 USD                                       | 19.288.532 USD                     | 18,15 USD                                    |

Tactical Macro<sup>2</sup>

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD I*<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I5*<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I5*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD Z*<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD Z*<br>NIW je Anteil |
|----------------------|-------------------------------------|---|--------------------------------------|--|-------------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 10.000 USD                          | 10,00 USD                                     | 10.000 USD                           | 10,00 USD                                      | 10.000 USD                          | 10,00 USD                                     |

FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Ultra Short Term Euro Bond

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse CHF P* NIW | Thesaurierende Klasse CHF P* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse CHF U NIW | Thesaurierende Klasse CHF U NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR A NIW | Thesaurierende Klasse EUR A NIW je Anteil |
|----------------------|----------------------------------|--|---------------------------------|---|---------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 778.219 CHF                      | 98,51 CHF                                  | 6.070.331 CHF                   | 97,88 CHF                                 | 8.797.177 EUR                   | 95,80 EUR                                 |
| 31. Dezember 2022    | 770.086 CHF                      | 97,48 CHF                                  | 6.454.030 CHF                   | 96,91 CHF                                 | 5.076.654 EUR                   | 94,09 EUR                                 |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse EUR I NIW | Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse EUR I NIW | Ausschüttende Klasse EUR I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW | Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------|---|--------------------------------|--|----------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 543.507.082 EUR                 | 101,11 EUR                                | 1.448.190 EUR                  | 96,36 EUR                                | 80.425.093 EUR                   | 99,92 EUR                                  |
| 31. Dezember 2022    | 504.982.352 EUR                 | 99,21 EUR                                 | 1.514.355 EUR                  | 95,44 EUR                                | 49.163.695 EUR                   | 98,02 EUR                                  |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse EUR I5 NIW | Thesaurierende Klasse EUR I5 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR M NIW | Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR U NIW | Thesaurierende Klasse EUR U NIW je Anteil |
|----------------------|----------------------------------|--|---------------------------------|---|---------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 170.041.922 EUR                  | 101,52 EUR                                 | 956.107 EUR                     | 94,63 EUR                                 | 4.226.151 EUR                   | 99,33 EUR                                 |
| 31. Dezember 2022    | 163.327.491 EUR                  | 99,56 EUR                                  | 75.202 EUR                      | 93,22 EUR                                 | 3.981.734 EUR                   | 97,51 EUR                                 |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse EUR Z NIW | Thesaurierende Klasse EUR Z NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I NIW | Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD Z NIW | Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------|---|---------------------------------|---|---------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 1.967.246 EUR                   | 102,18 EUR                                | 5.996.564 USD                   | 99,27 USD                                 | 89.184.162 USD                  | 110,79 USD                                |
| 31. Dezember 2022    | 2.239.437 EUR                   | 100,17 EUR                                | 2.354.804 USD                   | 96,33 USD                                 | 86.457.213 USD                  | 107,40 USD                                |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Uncorrelated Strategies

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF I<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF I5<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF I5<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A<br>NIW je Anteil |
|----------------------|--|--|---|---|--|--|
| 30. Juni 2023        | 2.800.977 CHF                            | 9,37 CHF   | 1.433.248 CHF                             | 9,74 CHF  | 17.016.795 EUR                           | 9,16 EUR   |
| 31. Dezember 2022    | 3.430.851 CHF                            | 10,34 CHF  | 1.500.147 CHF                             | 10,74 CHF   | 32.208.149 EUR                           | 10,07 EUR  |

  

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I2<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I2<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I5<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I5<br>NIW je Anteil |
|----------------------|--|--|---|---|---|---|
| 30. Juni 2023        | 26.965.653 EUR                           | 9,59 EUR   | 10.976.832 EUR                            | 9,91 EUR  | 2.583.880 EUR                             | 10,07 EUR   |
| 31. Dezember 2022    | 157.192.927 EUR                          | 10,51 EUR  | 15.201.022 EUR                            | 10,85 EUR   | 6.769.918 EUR                             | 11,01 EUR   |

  

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR P*<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR P*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I<br>NIW je Anteil |
|----------------------|--|--|---|---|--|--|
| 30. Juni 2023        | 1.159.285 EUR                            | 8,91 EUR   | 394.829 EUR                               | 9,01 EUR  | 25.701.047 GBP                           | 10,60 GBP  |
| 31. Dezember 2022    | 1.654.675 EUR                            | 9,83 EUR   | 28.465.642 EUR                            | 9,85 EUR  | 77.383.312 GBP                           | 11,52 GBP  |

  

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I2<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I2<br>NIW je Anteil | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP I2*<br>NIW | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP I2*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I5<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I5<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---|---|---|---|---|---|
| 30. Juni 2023        | 836.317.812 GBP                           | 10,64 GBP   | 186.991 GBP                               | 9,18 GBP  | 94.944.181 GBP                            | 10,83 GBP   |
| 31. Dezember 2022    | 876.636.906 GBP                           | 11,56 GBP   | 76.067 GBP                                | 9,96 GBP  | 244.341.482 GBP                           | 11,74 GBP   |

FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse<br>GBP P<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP P<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>GBP Z<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP Z<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>JPY I*<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>JPY I*<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|--|--|
| 30. Juni 2023        | 440.660.013 GBP                       | 10,27 GBP                                       | 463.082 GBP                           | 11,10 GBP                                       | 3.895.195.662 JPY                      | 926,06 JPY                                       |
| 31. Dezember 2022    | 733.833.769 GBP                       | 11,16 GBP                                       | 501.313 GBP                           | 12,02 GBP                                       | 4.336.598.065 JPY                      | 1.029,89 JPY                                     |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse<br>SGD A*<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>SGD A*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD A<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD A<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD C1<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD C1<br>NIW je Anteil |
|----------------------|--|--|---------------------------------------|---|--|--|
| 30. Juni 2023        | 39.111 SGD                             | 19,73 SGD  | 52.745.713 USD                        | 10,15 USD                                       | 5.788.259 USD                          | 9,67 USD   |
| 31. Dezember 2022    | 201.328 SGD                            | 20,11 SGD  | 76.331.807 USD                        | 11,03 USD                                       | 7.019.785 USD                          | 10,57 USD  |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse<br>USD I<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD I2<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD I2<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD I5<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD I5<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------------|---|--|--|--|--|
| 30. Juni 2023        | 244.046.550 USD                       | 11,05 USD                                       | 55.488.718 USD                         | 11,10 USD  | 13.389.406 USD                         | 11,31 USD  |
| 31. Dezember 2022    | 253.706.005 USD                       | 11,97 USD                                       | 59.598.401 USD                         | 12,01 USD  | 23.473.722 USD                         | 12,22 USD  |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse<br>USD M<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD M<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD P<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD P<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD Z<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD Z<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 9.411.758 USD                         | 9,98 USD  | 13.935.205 USD                        | 10,76 USD                                       | 11.631.089 USD                        | 11,41 USD                                       |
| 31. Dezember 2022    | 14.132.913 USD                        | 10,89 USD                                       | 54.279.664 USD                        | 11,66 USD                                       | 27.792.127 USD                        | 12,32 USD                                       |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Uncorrelated Trading<sup>1\*\*</sup>

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR X*<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR X*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD X*<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD X*<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---|---|---|---|
| 30. Juni 2023        | –   | –   | –   | –   |
| 31. Dezember 2022    | 649.030.110 EUR                           | 9,83 EUR  | 18.184.485 USD                            | 10,00 USD   |

\*\* Das Portfolio wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst.

## US Equity

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende<br>Klasse<br>JPY I3*<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>JPY I3*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>NIW je Anteil |
|----------------------|--|--|--|--|--|--|
| 30. Juni 2023        | 3.283.871.669 JPY                          | 984,21 JPY   | 3.298.147 USD                            | 16,94 USD  | 4.237.523 USD                            | 25,13 USD  |
| 31. Dezember 2022    | 2.722.761.830 JPY                          | 816,04 JPY   | 3.127.165 USD                            | 13,76 USD  | 3.063.327 USD                            | 20,34 USD  |

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I<br>NIW | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M*<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M*<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---|---|---|---|
| 30. Juni 2023        | 5.714.477 USD                           | 24,94 USD   | 2.260.010 USD                             | 9,49 USD  |
| 31. Dezember 2022    | 4.623.317 USD                           | 20,18 USD   | 7.737 USD                                 | 7,74 USD  |

FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Equity Index PutWrite

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse EUR I<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR I<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse EUR I3<br>NIW | Ausschüttende Klasse EUR I3<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I4<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR I4<br>NIW je Anteil |
|----------------------|------------------------------------|--|------------------------------------|--|-------------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 439.354 EUR                        | 12,78 EUR                                    | 5.294.972 EUR                      | 9,66 EUR                                     | 717.445 EUR                         | 12,75 EUR                                     |
| 31. Dezember 2022    | 519.574 EUR                        | 11,69 EUR                                    | 4.848.784 EUR                      | 8,83 EUR                                     | 769.301 EUR                         | 11,65 EUR                                     |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse EUR M<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR M<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP I3<br>NIW | Thesaurierende Klasse GBP I3<br>NIW je Anteil |
|----------------------|------------------------------------|--|--|--|-------------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 299.036 EUR                        | 11,68 EUR                                    | 17.759.204 GBP   | 14,21 GBP  | 104.343.014 GBP                     | 12,13 GBP                                     |
| 31. Dezember 2022    | 295.878 EUR                        | 10,76 EUR                                    | 32.974.906 GBP   | 13,58 GBP  | 72.609.172 GBP                      | 11,58 GBP                                     |

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse GBP I3<br>NIW | Ausschüttende Klasse GBP I3<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert)*<br>NIW | Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert)*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)<br>NIW je Anteil |
|----------------------|------------------------------------|--|---|---|---|---|
| 30. Juni 2023        | 223.461.474 GBP                    | 10,36 GBP                                    | 7.916 GBP   | 10,08 GBP   | 56.509.407 GBP  | 14,72 GBP   |
| 31. Dezember 2022    | 199.939.675 GBP                    | 9,40 GBP                                     | –   | –   | 131.866.462 GBP   | 14,05 GBP   |

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)<br>NIW | Ausschüttende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD A<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD A<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---|---|---|---|------------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 3.994.122 GBP   | 10,32 GBP   | 231.532 SGD                                   | 20,27 SGD   | 9.027.564 USD                      | 14,40 USD                                    |
| 31. Dezember 2022    | 4.612.426 GBP   | 10,06 GBP   | 182.949 SGD                                   | 18,85 SGD   | 12.416.490 USD                     | 13,06 USD                                    |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## US Equity Index PutWrite (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I NIW | Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD I3 NIW | Ausschüttende Klasse USD I3 NIW je Anteil |
|----------------------|--|--|---------------------------------|---|---------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 15.375.908 USD                             | 11,44 USD  | 58.527.040 USD                  | 15,16 USD                                 | 20.636.717 USD                  | 10,06 USD                                 |
| 31. Dezember 2022    | 11.585.856 USD                             | 10,55 USD  | 55.168.614 USD                  | 13,71 USD                                 | 18.562.430 USD                  | 9,09 USD                                  |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD I4 NIW | Thesaurierende Klasse USD I4 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD M NIW | Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD Z NIW | Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil |
|----------------------|----------------------------------|--|---------------------------------|---|---------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 4.910.629 USD                    | 14,72 USD                                  | 959.278 USD                     | 13,53 USD                                 | 46.528.689 USD                  | 15,39 USD                                 |
| 31. Dezember 2022    | 5.127.891 USD                    | 13,29 USD                                  | 1.208.956 USD                   | 12,32 USD                                 | 37.615.063 USD                  | 13,87 USD                                 |

## US Large Cap Value

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse EUR A* NIW | Thesaurierende Klasse EUR A* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)* NIW | Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I* NIW | Thesaurierende Klasse EUR I* NIW je Anteil |
|----------------------|----------------------------------|--|--|--|----------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 621.566 EUR                      | 10,49 EUR                                  | 395.168 EUR  | 10,20 EUR  | 24.545.248 EUR                   | 8,91 EUR                                   |
| 31. Dezember 2022    | 151.717 EUR                      | 10,87 EUR                                  | 421.987 EUR  | 10,68 EUR  | 13.504.321 EUR                   | 9,20 EUR                                   |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)* NIW | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)* NIW | Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)* NIW | Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil |
|----------------------|--|--|--|--|---|---|
| 30. Juni 2023        | 133.597.712 EUR  | 9,04 EUR   | 13.371.856 EUR   | 9,43 EUR   | 112.632.314 EUR   | 10,02 EUR   |
| 31. Dezember 2022    | 37.390.049 EUR   | 9,42 EUR   | 14.242.602 EUR   | 9,91 EUR   | 117.300.158 EUR   | 10,42 EUR   |



FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Large Cap Value (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse GBP I*<br>NIW | Thesaurierende Klasse GBP I*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)*<br>NIW | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)*<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse GBP I*<br>NIW | Ausschüttende Klasse GBP I*<br>NIW je Anteil |
|----------------------|-------------------------------------|---|---|---|------------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 24.083 GBP                          | 9,53 GBP                                      | 414.874 GBP   | 8,97 GBP  | 179.158 GBP                        | 9,52 GBP                                     |
| 31. Dezember 2022    | 24.659 GBP                          | 9,76 GBP                                      | 8.138 GBP   | 9,66 GBP  | 24.659 GBP                         | 9,76 GBP                                     |

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)*<br>NIW | Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)*<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)*<br>NIW | Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)*<br>NIW | Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)*<br>NIW je Anteil |
|----------------------|--|--|---|---|---|---|
| 30. Juni 2023        | 5.256.171 GBP  | 8,95 GBP   | 721.378.020 GBP   | 10,05 GBP   | 1.139.434 GBP   | 9,54 GBP  |
| 31. Dezember 2022    | 8.138 GBP  | 9,66 GBP   | 767.350.829 GBP   | 10,92 GBP   | 1.047.402 GBP   | 10,28 GBP   |

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse GBP P*<br>NIW | Ausschüttende Klasse GBP P*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)*<br>NIW | Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)*<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)*<br>NIW | Ausschüttende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)*<br>NIW je Anteil |
|----------------------|------------------------------------|--|---|---|--|--|
| 30. Juni 2023        | 27.734 GBP                         | 10,36 GBP                                    | 92.216.303 GBP  | 9,73 GBP  | 129.758 GBP  | 9,52 GBP   |
| 31. Dezember 2022    | 28.455 GBP                         | 10,63 GBP                                    | 79.855.605 GBP  | 10,48 GBP   | 57.641 GBP   | 10,29 GBP  |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD A*<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD A*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD I4*<br>NIW | Ausschüttende Klasse USD I4*<br>NIW je Anteil |
|----------------------|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|-------------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 68.953.079 USD                      | 9,29 USD                                      | 357.419.927 USD                    | 10,08 USD                                    | 51.892.598 USD                      | 9,37 USD                                      |
| 31. Dezember 2022    | 64.127.333 USD                      | 9,50 USD                                      | 370.024.843 USD                    | 10,28 USD                                    | 55.448.399 USD                      | 9,63 USD                                      |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## US Large Cap Value (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD I5* NIW | Thesaurierende Klasse USD I5* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD M* NIW | Thesaurierende Klasse USD M* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD Z* NIW | Thesaurierende Klasse USD Z* NIW je Anteil |
|----------------------|-----------------------------------|---|----------------------------------|--|----------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 45.533 USD                        | 9,49 USD                                    | 29.247.223 USD                   | 9,09 USD                                   | 3.731.262 USD                    | 9,94 USD                                   |
| 31. Dezember 2022    | 51.156 USD                        | 9,65 USD                                    | 47.864.951 USD                   | 9,35 USD                                   | 13.571.781 USD                   | 10,10 USD                                  |

## US Long Short Equity

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse EUR A NIW | Thesaurierende Klasse EUR A NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I NIW | Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I3 NIW | Thesaurierende Klasse EUR I3 NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------|---|---------------------------------|---|----------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 376.050 EUR                     | 10,95 EUR                                 | 37.483.260 EUR                  | 11,87 EUR                                 | 35.894.681 EUR                   | 11,17 EUR                                  |
| 31. Dezember 2022    | 607.101 EUR                     | 10,40 EUR                                 | 36.739.571 EUR                  | 11,22 EUR                                 | 36.252.558 EUR                   | 10,54 EUR                                  |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse EUR M NIW | Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse GBP I3 NIW | Ausschüttende Klasse GBP I3 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse SGD A1 NIW | Thesaurierende Klasse SGD A1 NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------|---|---------------------------------|---|----------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 2.967.746 EUR                   | 10,70 EUR                                 | 812.871 GBP                     | 10,74 GBP                                 | 251.606 SGD                      | 25,61 SGD                                  |
| 31. Dezember 2022    | 3.231.098 EUR                   | 10,21 EUR                                 | 553.045 GBP                     | 10,08 GBP                                 | 306.753 SGD                      | 24,13 SGD                                  |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD A (PF) NIW | Thesaurierende Klasse USD A (PF) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD A NIW | Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD A1 NIW | Thesaurierende Klasse USD A1 NIW je Anteil |
|----------------------|--------------------------------------|--|---------------------------------|---|----------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 1.875.541 USD                        | 12,51 USD                                      | 15.639.764 USD                  | 12,63 USD                                 | 14.667.458 USD                   | 13,47 USD                                  |
| 31. Dezember 2022    | 2.738.736 USD                        | 11,72 USD                                      | 15.008.727 USD                  | 11,86 USD                                 | 13.820.694 USD                   | 12,63 USD                                  |

FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Long Short Equity (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse<br>USD I (PF)<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>USD I (PF)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD I<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD I3<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD I3<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---|---|---------------------------------------|---|--|--|
| 30. Juni 2023        | 34.475.021 USD                            | 13,19 USD   | 47.473.706 USD                        | 14,43 USD                                       | 14.350.463 USD                         | 11,78 USD  |
| 31. Dezember 2022    | 32.577.472 USD                            | 12,33 USD   | 49.565.162 USD                        | 13,49 USD                                       | 13.048.932 USD                         | 10,99 USD  |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse<br>USD M<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD M<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD U<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD U<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD Z<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD Z<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 783.147 USD                           | 11,65 USD                                       | 6.419.041 USD                         | 13,23 USD                                       | 3.227.303 USD                         | 16,05 USD                                       |
| 31. Dezember 2022    | 1.229.714 USD                         | 10,98 USD                                       | 6.626.973 USD                         | 12,39 USD                                       | 3.984.842 USD                         | 14,90 USD                                       |

US Multi Cap Opportunities

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse<br>AUD E<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>AUD E<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>AUD T<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>AUD T<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>EUR I3<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>EUR I3<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|--|--|
| 30. Juni 2023        | 1.585.259 AUD                         | 17,80 AUD                                       | 2.010.253 AUD                         | 16,79 AUD                                       | 2.106.250 EUR                          | 25,03 EUR  |
| 31. Dezember 2022    | 1.517.141 AUD                         | 16,18 AUD                                       | 1.676.142 AUD                         | 15,19 AUD                                       | 1.895.752 EUR                          | 22,53 EUR  |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse<br>EUR M<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>EUR M<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>EUR1 A<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>EUR1 A<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>EUR1 I<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>EUR1 I<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------------|---|--|--|--|--|
| 30. Juni 2023        | 548.962 EUR                           | 17,48 EUR                                       | 1.907.566 EUR                          | 27,70 EUR  | 4.773.917 EUR                          | 30,34 EUR  |
| 31. Dezember 2022    | 493.074 EUR                           | 15,91 EUR                                       | 1.953.365 EUR                          | 25,08 EUR  | 3.440.135 EUR                          | 27,36 EUR  |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse             | Ausschüttende Klasse             | Thesaurierende Klasse | Thesaurierende Klasse | Thesaurierende Klasse | Thesaurierende Klasse |
|----------------------|----------------------------------|----------------------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
|                      | GBP I3 (nicht währungsgesichert) | GBP I3 (nicht währungsgesichert) | SGD A                 | SGD A                 | USD B                 | USD B                 |
|                      | NIW                              | NIW je Anteil                    | NIW                   | NIW je Anteil         | NIW                   | NIW je Anteil         |
| 30. Juni 2023        | 18.520 GBP                       | 17,39 GBP                        | 27.092.945 SGD        | 46,97 SGD             | 12.902.604 USD        | 19,80 USD             |
| 31. Dezember 2022    | 17.444 GBP                       | 16,38 GBP                        | 24.554.266 SGD        | 42,26 SGD             | 14.429.013 USD        | 17,80 USD             |

  

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse | Thesaurierende Klasse | Thesaurierende Klasse | Thesaurierende Klasse | Thesaurierende Klasse | Thesaurierende Klasse |
|----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
|                      | USD C1                | USD C1                | USD C2                | USD C2                | USD E                 | USD E                 |
|                      | NIW                   | NIW je Anteil         | NIW                   | NIW je Anteil         | NIW                   | NIW je Anteil         |
| 30. Juni 2023        | 1.908.929 USD         | 15,16 USD             | 549.730 USD           | 19,80 USD             | 13.328.464 USD        | 18,63 USD             |
| 31. Dezember 2022    | 1.855.172 USD         | 13,62 USD             | 775.262 USD           | 17,80 USD             | 12.157.572 USD        | 16,75 USD             |

  

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse | Thesaurierende Klasse | Thesaurierende Klasse | Thesaurierende Klasse | Ausschüttende Klasse | Ausschüttende Klasse |
|----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|----------------------|----------------------|
|                      | USD I2*               | USD I2*               | USD I3                | USD I3                | USD I3               | USD I3               |
|                      | NIW                   | NIW je Anteil         | NIW                   | NIW je Anteil         | NIW                  | NIW je Anteil        |
| 30. Juni 2023        | 10.642 USD            | 10,64 USD             | 19.380.961 USD        | 29,40 USD             | 5.666.665 USD        | 26,31 USD            |
| 31. Dezember 2022    | –                     | –                     | 23.096.196 USD        | 26,14 USD             | 5.049.971 USD        | 23,44 USD            |

  

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse | Thesaurierende Klasse | Thesaurierende Klasse | Thesaurierende Klasse | Thesaurierende Klasse | Thesaurierende Klasse |
|----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
|                      | USD M                 | USD M                 | USD T                 | USD T                 | USD U                 | USD U                 |
|                      | NIW                   | NIW je Anteil         | NIW                   | NIW je Anteil         | NIW                   | NIW je Anteil         |
| 30. Juni 2023        | 8.684.952 USD         | 21,09 USD             | 21.189.190 USD        | 21,80 USD             | 55.408.588 USD        | 30,06 USD             |
| 31. Dezember 2022    | 8.827.718 USD         | 18,95 USD             | 18.665.561 USD        | 19,51 USD             | 55.179.479 USD        | 26,82 USD             |

FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD Z NIW | Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD1 A NIW | Thesaurierende Klasse USD1 A NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD1 I NIW | Thesaurierende Klasse USD1 I NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------|---|----------------------------------|--|----------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 321.918 USD                     | 24,88 USD                                 | 65.136.386 USD                   | 32,69 USD                                  | 162.241.330 USD                  | 36,74 USD                                  |
| 31. Dezember 2022    | 285.453 USD                     | 22,06 USD                                 | 68.130.989 USD                   | 29,24 USD                                  | 188.629.207 USD                  | 32,71 USD                                  |

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse USD1 I NIW | Ausschüttende Klasse USD1 I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse ZAR B NIW | Thesaurierende Klasse ZAR B NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse ZAR C2 NIW | Thesaurierende Klasse ZAR C2 NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------|---|---------------------------------|---|----------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 5.354.439 USD                   | 35,45 USD                                 | 40.088.201 ZAR                  | 290,87 ZAR                                | 954.825 ZAR                      | 289,19 ZAR                                 |
| 31. Dezember 2022    | 5.497.999 USD                   | 31,57 USD                                 | 44.251.345 ZAR                  | 258,68 ZAR                                | 714.961 ZAR                      | 257,19 ZAR                                 |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse ZAR E NIW | Thesaurierende Klasse ZAR E NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse ZAR T NIW | Thesaurierende Klasse ZAR T NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------|---|---------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 77.992.552 ZAR                  | 267,86 ZAR                                | 68.127.189 ZAR                  | 319,98 ZAR                                |
| 31. Dezember 2022    | 58.876.819 ZAR                  | 238,22 ZAR                                | 62.283.522 ZAR                  | 283,17 ZAR                                |

US Real Estate Securities

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse AUD B NIW | Thesaurierende Klasse AUD B NIW je Anteil |
|----------------------|--|--|--|--|---------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 3.200.308 AUD                              | 8,04 AUD   | 2.894.727 AUD                              | 7,40 AUD   | 1.256.545 AUD                   | 11,25 AUD                                 |
| 31. Dezember 2022    | 5.496.298 AUD                              | 8,13 AUD   | 3.710.929 AUD                              | 7,53 AUD   | 1.551.669 AUD                   | 11,22 AUD                                 |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## US Real Estate Securities (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich) NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse AUD E NIW | Thesaurierende Klasse AUD E NIW je Anteil |
|----------------------|---|---|--|--|---------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 5.838 AUD                                   | 7,41 AUD  | 1.774.375 AUD                              | 7,39 AUD   | 696.612 AUD                     | 12,17 AUD                                 |
| 31. Dezember 2022    | 13.633 AUD                                  | 7,54 AUD  | 1.845.753 AUD                              | 7,52 AUD   | 1.473.276 AUD                   | 12,14 AUD                                 |

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse AUD T NIW | Thesaurierende Klasse AUD T NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse CHF A NIW | Thesaurierende Klasse CHF A NIW je Anteil |
|----------------------|--|--|---------------------------------|---|---------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 4.010.236 AUD                              | 8,63 AUD   | 5.222.655 AUD                   | 14,47 AUD                                 | 1.426.589 CHF                   | 13,32 CHF                                 |
| 31. Dezember 2022    | 4.048.009 AUD                              | 8,74 AUD   | 5.292.429 AUD                   | 14,37 AUD                                 | 1.863.576 CHF                   | 13,32 CHF                                 |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse EUR A NIW | Thesaurierende Klasse EUR A NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I NIW | Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR M NIW | Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------|---|---------------------------------|---|---------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 828.583 EUR                     | 8,04 EUR                                  | 9.617.491 EUR                   | 17,84 EUR                                 | 539.729 EUR                     | 10,81 EUR                                 |
| 31. Dezember 2022    | 1.065.458 EUR                   | 7,98 EUR                                  | 9.711.898 EUR                   | 17,63 EUR                                 | 525.424 EUR                     | 10,78 EUR                                 |

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse SGD A NIW | Thesaurierende Klasse SGD A NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW je Anteil |
|----------------------|--|--|---------------------------------|---|--|--|
| 30. Juni 2023        | 50.167.699 HKD                             | 8,76 HKD   | 545.919 SGD                     | 28,39 SGD                                 | 30.318.420 USD                             | 10,15 USD  |
| 31. Dezember 2022    | 63.131.693 HKD                             | 8,82 HKD   | 798.510 SGD                     | 27,99 SGD                                 | 34.765.827 USD                             | 10,15 USD  |

FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD A<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD A<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD A<br>NIW | Ausschüttende Klasse USD A<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich)<br>NIW je Anteil |
|----------------------|------------------------------------|--|-----------------------------------|---|---|---|
| 30. Juni 2023        | 197.727.468 USD                    | 22,37 USD                                    | 13.201.225 USD                    | 16,05 USD                                   | 19.869.786 USD                                | 8,40 USD  |
| 31. Dezember 2022    | 219.433.044 USD                    | 21,92 USD                                    | 14.624.460 USD                    | 15,81 USD                                   | 21.360.783 USD                                | 8,45 USD  |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD B<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD B<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD C1<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD C1<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich)<br>NIW je Anteil |
|----------------------|------------------------------------|--|-------------------------------------|---|--|--|
| 30. Juni 2023        | 12.555.091 USD                     | 13,67 USD                                    | 12.565.397 USD                      | 11,42 USD                                     | 161.457 USD                                    | 8,50 USD   |
| 31. Dezember 2022    | 17.275.041 USD                     | 13,48 USD                                    | 13.832.889 USD                      | 11,25 USD                                     | 285.279 USD                                    | 8,56 USD   |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD C2<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD C2<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD E<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD E<br>NIW je Anteil |
|----------------------|-------------------------------------|---|---|---|------------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 209.544 USD                         | 13,66 USD                                     | 8.728.699 USD                                 | 8,40 USD  | 9.351.842 USD                      | 12,96 USD                                    |
| 31. Dezember 2022    | 345.981 USD                         | 13,47 USD                                     | 9.804.365 USD                                 | 8,45 USD  | 11.862.421 USD                     | 12,79 USD                                    |

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD I<br>NIW | Ausschüttende Klasse USD I<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---|---|------------------------------------|--|-----------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 202.905 USD                                   | 8,72 USD  | 109.824.167 USD                    | 25,35 USD                                    | 8.207.421 USD                     | 14,73 USD                                   |
| 31. Dezember 2022    | 202.117 USD                                   | 8,69 USD  | 136.972.776 USD                    | 24,75 USD                                    | 8.086.151 USD                     | 14,51 USD                                   |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## US Real Estate Securities (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD I2<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I2<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD M<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD M<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)<br>NIW je Anteil |
|----------------------|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|---|---|
| 30. Juni 2023        | 16.404.494 USD                      | 18,65 USD                                     | 41.293.124 USD                     | 13,32 USD                                    | 11.017.058 USD                                | 9,71 USD  |
| 31. Dezember 2022    | 16.291.811 USD                      | 18,19 USD                                     | 47.619.174 USD                     | 13,12 USD                                    | 12.964.064 USD                                | 9,72 USD  |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD T<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD T<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD Z<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD Z<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich)<br>NIW je Anteil |
|----------------------|------------------------------------|--|------------------------------------|--|---|---|
| 30. Juni 2023        | 16.477.171 USD                     | 15,07 USD                                    | 1.187.103 USD                      | 14,77 USD                                    | 86.995.106 ZAR                                | 77,04 ZAR   |
| 31. Dezember 2022    | 17.827.622 USD                     | 14,79 USD                                    | 2.792.788 USD                      | 14,36 USD                                    | 95.145.043 ZAR                                | 78,11 ZAR   |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse ZAR B<br>NIW | Thesaurierende Klasse ZAR B<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse ZAR C2<br>NIW | Thesaurierende Klasse ZAR C2<br>NIW je Anteil |
|----------------------|------------------------------------|--|--|--|-------------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 25.111.800 ZAR                     | 166,44 ZAR                                   | 1.091.980 ZAR                                  | 76,17 ZAR  | 860.316 ZAR                         | 164,36 ZAR                                    |
| 31. Dezember 2022    | 32.016.598 ZAR                     | 162,51 ZAR                                   | 2.020.359 ZAR                                  | 77,23 ZAR  | 955.698 ZAR                         | 160,47 ZAR                                    |

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse ZAR E<br>NIW | Thesaurierende Klasse ZAR E<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---|---|------------------------------------|--|---|---|
| 30. Juni 2023        | 46.359.016 ZAR                                | 77,05 ZAR   | 18.795.016 ZAR                     | 186,21 ZAR                                   | 99.478.559 ZAR                                | 119,15 ZAR  |
| 31. Dezember 2022    | 50.137.837 ZAR                                | 78,12 ZAR   | 28.025.473 ZAR                     | 181,81 ZAR                                   | 103.488.803 ZAR                               | 120,20 ZAR  |



FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse ZAR T NIW | Thesaurierende Klasse ZAR T NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 46.847.790 ZAR                  | 229,95 ZAR                                |
| 31. Dezember 2022    | 47.847.359 ZAR                  | 223,40 ZAR                                |

US Small Cap

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse AUD B NIW | Thesaurierende Klasse AUD B NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse AUD C2 NIW | Thesaurierende Klasse AUD C2 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse AUD E NIW | Thesaurierende Klasse AUD E NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------|---|----------------------------------|--|---------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 1.515.625 AUD                   | 11,92 AUD                                 | 11.745 AUD                       | 11,63 AUD                                  | 1.591.535 AUD                   | 16,67 AUD                                 |
| 31. Dezember 2022    | 1.174.595 AUD                   | 10,86 AUD                                 | 17.906 AUD                       | 10,59 AUD                                  | 1.486.516 AUD                   | 15,20 AUD                                 |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse AUD T NIW | Thesaurierende Klasse AUD T NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR A NIW | Thesaurierende Klasse EUR A NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------|---|---------------------------------|---|---|---|
| 30. Juni 2023        | 1.628.669 AUD                   | 15,48 AUD                                 | 1.470.480 EUR                   | 16,84 EUR                                 | 401.727 EUR   | 13,78 EUR   |
| 31. Dezember 2022    | 1.570.235 AUD                   | 14,04 AUD                                 | 2.265.778 EUR                   | 15,29 EUR                                 | 368.888 EUR   | 12,63 EUR   |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse EUR I NIW | Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------|---|---|---|--|--|
| 30. Juni 2023        | 4.546.103 EUR                   | 20,00 EUR                                 | 3.763.456 EUR   | 17,93 EUR   | 24.642.953 EUR   | 16,73 EUR  |
| 31. Dezember 2022    | 3.429.996 EUR                   | 18,08 EUR                                 | 3.457.660 EUR   | 16,36 EUR   | 22.369.014 EUR   | 15,26 EUR  |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## US Small Cap (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse<br>EUR I4 (nicht<br>währungsgesichert)*<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>EUR I4 (nicht<br>währungsgesichert)*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>EUR M<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>EUR M<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>EUR Z<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>EUR Z<br>NIW je Anteil |
|----------------------|--|--|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 49.056.948 EUR   | 10,82 EUR  | 213.162 EUR                           | 16,98 EUR                                       | 366.062 EUR                           | 19,00 EUR                                       |
| 31. Dezember 2022    | 38.159.092 EUR   | 9,86 EUR   | 213.152 EUR                           | 15,49 EUR                                       | 323.177 EUR                           | 17,10 EUR                                       |

| Berichtszeitraum zum | Ausschüttende Klasse<br>JPY I (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>JPY I (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD A<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD A<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>USD A<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>USD A<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---|---|---------------------------------------|---|--------------------------------------|--|
| 30. Juni 2023        | 5.298.967.222 JPY   | 5,91 JPY  | 102.566.310 USD                       | 27,22 USD                                       | 11.148.563 USD                       | 17,57 USD                                      |
| 31. Dezember 2022    | 4.342.939.609 JPY   | 4,82 JPY  | 96.318.017 USD                        | 24,40 USD                                       | 10.366.064 USD                       | 15,75 USD                                      |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse<br>USD B<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD B<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD C2<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD C2<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD E<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD E<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------------|---|--|--|---------------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 9.217.059 USD                         | 20,08 USD                                       | 3.072 USD                              | 20,10 USD  | 4.637.392 USD                         | 17,71 USD                                       |
| 31. Dezember 2022    | 7.251.318 USD                         | 18,10 USD                                       | 61.322 USD                             | 18,12 USD  | 2.587.858 USD                         | 15,96 USD                                       |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse<br>USD I<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD I<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>USD I<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>USD I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD I3<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD I3<br>NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------------|---|--------------------------------------|--|--|--|
| 30. Juni 2023        | 219.798.267 USD                       | 30,27 USD                                       | 22.552.410 USD                       | 22,03 USD                                      | 111.946.046 USD                        | 15.180,00 USD                                    |
| 31. Dezember 2022    | 225.900.152 USD                       | 27,02 USD                                       | 21.992.051 USD                       | 19,66 USD                                      | 101.463.016 USD                        | 13.534,58 USD                                    |

FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Small Cap (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse USD M NIW | Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD T NIW | Thesaurierende Klasse USD T NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD Z NIW | Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------|---|---------------------------------|---|---------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 3.759.670 USD                   | 20,23 USD                                 | 7.604.734 USD                   | 22,18 USD                                 | 2.246.155 USD                   | 20,60 USD                                 |
| 31. Dezember 2022    | 3.240.409 USD                   | 18,23 USD                                 | 7.242.861 USD                   | 19,89 USD                                 | 2.213.208 USD                   | 18,32 USD                                 |

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse ZAR E NIW | Thesaurierende Klasse ZAR E NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse ZAR T NIW | Thesaurierende Klasse ZAR T NIW je Anteil |
|----------------------|---------------------------------|---|---------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 12.621.160 ZAR                  | 253,80 ZAR                                | 16.749.503 ZAR                  | 212,89 ZAR                                |
| 31. Dezember 2022    | 18.435.416 ZAR                  | 226,59 ZAR                                | 18.202.064 ZAR                  | 189,12 ZAR                                |

US Small Cap Intrinsic Value

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP I2 (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse GBP I2 (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD A NIW | Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil |
|----------------------|---|---|--|--|---------------------------------|---|
| 30. Juni 2023        | 60.492.446 GBP  | 10,35 GBP   | 14.829.592 GBP   | 9,61 GBP   | 8.153.158 USD                   | 20,73 USD                                 |
| 31. Dezember 2022    | 42.248.255 GBP  | 10,04 GBP   | 13.137.811 GBP   | 9,31 GBP   | 8.698.122 USD                   | 19,11 USD                                 |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 9. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## US Small Cap Intrinsic Value (Fortsetzung)

| Berichtszeitraum zum | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I2*<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I2*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M<br>NIW je Anteil |
|----------------------|--|--|--|--|--|--|
| 30. Juni 2023        | 111.956.656 USD                          | 18,30 USD  | 64.201.571 USD                             | 9,21 USD   | 389.512 USD                              | 17,14 USD  |
| 31. Dezember 2022    | 85.094.541 USD                           | 16,80 USD  | 32.935.389 USD                             | 8,44 USD   | 500.654 USD                              | 15,88 USD  |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtszeitraum aufgelegt und/oder geschlossen.

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtszeitraum aufgelegt.

<sup>2</sup> Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtszeitraum aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

Bei den angegebenen Beträgen zum Nettoinventarwert und Nettoinventarwert je Anteil handelt es sich um Werte für den Handel mit Anteilhabern.

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 10. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN

**Beizulegender Zeitwert von Anlagen**

FRS 102 Section 11.27 zum „Zeitwert: Offenlegung“ erfordert die Offenlegung in Bezug auf die Zeitwerthierarchie, in der Zeitwertbewertungen für Aktiva und Passiva kategorisiert sind. Die Offenlegungen basieren auf einer Zeitwerthierarchie mit drei Stufen für die Eingangswerte, die zur Bewertung des Zeitwerts in Bewertungstechniken verwendet werden.

Der Fonds legt der Bewertung nach dem beizulegenden Zeitwert eine Zeitwerthierarchie zu Grunde, die die Bedeutung der zur Bewertung herangezogenen Parameter berücksichtigt. Die drei Stufen der Zeitwerthierarchie gemäß FRS 102 werden nachstehend beschrieben:

Stufe 1 – Unangepasste, auf aktiven Märkten notierte Preise, die zum Bewertungszeitpunkt für identische, unbeschränkte Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten verfügbar sind.

Stufe 2 – Bewertungsparameter, die für den Vermögenswert oder die Verbindlichkeit entweder direkt (d. h. als Preise) oder indirekt (d. h. abgeleitet aus Preisen) beobachtbar sind und die nicht der Stufe 1 angehören.

Stufe 3 – Bewertungsparameter für den Vermögenswert oder die Verbindlichkeit, die nicht auf beobachtbaren Marktdaten basieren (d. h. nicht beobachtbare Parameter). Nicht beobachtbare Preisparameter werden bei Anlagen und in Situationen herangezogen, bei denen keine oder nur eine geringe Marktaktivität für das Instrument vorhanden ist. Die zur Ermittlung des beizulegenden Zeitwerts herangezogenen Parameter erfordern ein hohes Maß an Verwaltung, Beurteilung und Schätzung. Da für diese Wertpapiere keine beobachtbaren Preise verfügbar sind, hätten die Portfolios gegebenenfalls Bewertungstechniken angewandt, um dem beizulegenden Zeitwert zu ermitteln.

Die Stufe in der Zeitwerthierarchie, der die Zeitwertbewertung in ihrer Gesamtheit zugeordnet wird, wird anhand des niedrigsten Bewertungsparameters festgelegt, der für die Zeitwertbewertung in ihrer Gesamtheit maßgeblich ist. Zu diesem Zweck wird die Maßgeblichkeit eines Parameters anhand der Zeitwertbewertung in ihrer Gesamtheit beurteilt. Werden zum Beispiel bei einer Zeitwertbewertung beobachtbare Parameter angewandt, die aufgrund von nicht beobachtbaren Parametern eine maßgebliche Anpassung erfordern, so ist diese Bewertung der Stufe 3 zuzuordnen.

Die Beurteilung der Maßgeblichkeit eines bestimmten Parameters für die Zeitwertbewertung in ihrer Gesamtheit erfordert Urteilsvermögen und die Abwägung von Faktoren, die für den Vermögenswert oder die Verbindlichkeit spezifisch sind.

Die Entscheidung, was als „beobachtbar“ gilt, erfordert Urteilsvermögen und wird vom Bewertungsausschuss des Managers berücksichtigt.

Der Wert der Anlagen der Portfolios in Aktien, börsengehandelten Indexfonds, Optionsscheinen und ge- und verkauften börsengehandelten Optionen, für die Marktnotierungen leicht zugänglich sind, wird in der Regel durch die Einholung von Bewertungen von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern auf der Grundlage des letzten an einer Hauptbörse oder einem Hauptmarkt für dieses Wertpapier notierten Verkaufspreises ermittelt (Parameter der Stufe 1). An der NASDAQ gehandelte Wertpapiere werden normalerweise mit dem offiziellen NASDAQ-Schlusskurs („NOCP“) bewertet, der von der NASDAQ an jedem Geschäftstag bereitgestellt wird. Der NOCP ist der zuletzt gemeldete Kurs um 16:00:02 Uhr, Eastern Time, außer wenn dieser Kurs außerhalb der „internen“ Geld- und Briefkursspanne (d. h. der Geld- und Briefkurse, die sich die Händler gegenseitig beim Handel für ihre eigenen Konten nennen) liegt. In diesem Fall passt die NASDAQ den Kurs so an, dass er dem internen Geld- oder Briefkurs entspricht, je nachdem, welcher näher liegt. Aufgrund von Verzögerungen bei der Meldung von Transaktionen basiert der NOCP möglicherweise nicht auf dem Preis des letzten Geschäfts vor dem Marktschluss. Wenn es an einem bestimmten Tag keinen Verkauf eines Wertpapiers gibt, können die unabhängigen Pricing-Service-Anbieter das Wertpapier auf der Grundlage von Marktnotierungen bewerten.

Der Wert von Participatory Notes wird ermittelt, indem Bewertungen von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern eingeholt werden, die auf der zugrunde liegenden Aktien und dem anwendbaren Wechselkurs basieren (Inputfaktoren der Stufe 1).

Der Wert der Anlagen des Portfolios in Schuldtiteln wird in erster Linie durch die Einholung von Bewertungen unabhängiger Pricing-Service-Anbietern auf der Grundlage leicht zugänglicher Mittelkurse bestimmt. Falls keine solchen verfügbar sind, werden Methoden genutzt, die verschiedene Überlegungen auf der Grundlage des Wertpapiertyps beinhalten (allgemein Inputfaktoren der Stufe 2). Wenn mehr als eine Marktnotierung für ein Wertpapier verfügbar ist, wird das Wertpapier auf Stufe 2 eingestuft. Neben der Berücksichtigung von Renditen oder Kursen von Wertpapieren vergleichbarer Qualität, des Kupons, der Laufzeit und des Typs, von Hinweisen auf Werte von Händlern und der allgemeinen Marktbedingungen werden im Folgenden weitere Parameter der Stufe 2 und damit verbundene Bewertungstechniken beschrieben, die von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern zur Bewertung bestimmter Arten, von den Portfolios gehaltenen Schuldtiteln verwendet werden:

**Unternehmensanleihen.** Zu den Parametern, die für die Bewertung von Unternehmensanleihen verwendet werden, gehören im Allgemeinen relevante Kreditinformationen, beobachtete Marktbewegungen, sektorrelevante Nachrichten, die Renditekurve der US-Staatsanleihen oder die relevante Benchmark-Renditekurve sowie andere Marktinformationen, zu denen die Renditekurve der Benchmark, gemeldete Transaktionen, Broker-Dealer-Quotierungen, Emittentenspreads, vergleichbare Wertpapiere und Referenzdaten, wie z. B. verfügbar Veröffentlichtungen im Bereich der Marktforschung („andere Marktinformationen“).

**Wandelanleihen.** Die zur Bewertung von Wandelanleihen (einschließlich CoCos) herangezogenen Parameter beinhalten gewöhnlich Daten zu den zugrunde liegenden Aktien, Wandelprämien, Kurse börsennotierter Anleihen und Vorzugsaktien und andere Marktinformationen. Darunter können gegebenenfalls Benchmarkkurven, Transaktionsausführungsdaten und Sensitivitätsanalysen sein.

**US-Staatsanleihen.** Die zur Bewertung von US-Staatsanleihen herangezogenen Parameter beinhalten gewöhnlich Notierungen verschiedener Inter-Dealer-Broker und andere Marktinformationen.

**FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023****10. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)****Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)**

*Quasistaatliche US-Wertpapiere.* Die zur Bewertung quasistaatlicher US-Wertpapiere herangezogenen Parameter beinhalten gewöhnlich das Einholen von Benchmark-Notierungen und andere Marktinformationen.

*Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS) und hypothekarisch besicherte Wertpapiere (MBS).* Zu den Parametern, die für die Bewertung von forderungsbesicherten Wertpapieren und hypothekarisch besicherten Wertpapieren verwendet werden, gehören im Allgemeinen Modelle, die eine Reihe von Faktoren berücksichtigen, darunter: vorzeitige Rückzahlungen, Cashflows, Spreadanpassungen und andere Marktinformationen.

*Besicherte Schuldtitel (Collateralized Loan Obligations, CLOs):* Der Wert besicherter Schuldtitel wird vorrangig durch Cashflow-Daten, relevante Daten zur Preisgestaltung von Darlehen und Marktfarben (Informationen, die für ein Unternehmen, eine Branche oder einen Markt spezifischer sind als öffentliche Informationen) sowie durch das Research von Marktteilnehmern und Trading Desks bestimmt (Inputfaktoren der Stufe 2 oder 3).

*Hochzinstitel.* Zu den Parametern, die für die Bewertung von Hochzinstiteln verwendet werden, gehören im Allgemeinen eine Reihe von emittentenbezogenen Beobachtungen von Aktien- und Credit-Default-Swap-Kurven sowie sonstige Marktinformationen.

Schwellenländeranleihen und ausländische Staatsanleihen. Zu den Parametern, die für die Bewertung von Schuldtiteln aus Schwellenländern und ausländischen Staatspapieren verwendet werden, gehören im Allgemeinen Händlernetzwerke, Anleihemarktaktivitäten, diskontierte Cashflow-Modelle und andere relevante Informationen wie Kreditspreads, Benchmarkkurven und andere Marktinformationen.

Der Wert von Laufzeitkrediten wird in erster Linie durch Bewertungen von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern auf der Grundlage von Broker-Quotierungen ermittelt (im Allgemeinen Inputfaktoren der Stufe 2 oder 3, je nach Anzahl der verfügbaren Quotierungen).

Der Wert von Futures-Kontrakten wird ermittelt, indem Bewertungen von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern zum Abrechnungskurs bei Börsenschluss eingeholt werden (Inputfaktoren der Stufe 1).

Der Wert von Devisenterminkontrakten wird bestimmt, indem Bewertungen von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern eingeholt werden, die auf tatsächlich gehandelten Währungskursen in den Netzwerken dieser unabhängigen Dienste sowie auf anderen gehandelten und notierten Währungskursen basieren, die den Pricing-Service-Anbietern von führenden Marktteilnehmern zur Verfügung gestellt werden (Inputfaktoren der Stufe 2).

Der Wert von Credit Default Swaps wird ermittelt, indem Bewertungen von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern eingeholt werden. Dabei kommt ein Modell zum Einsatz, das eine Reihe von Faktoren berücksichtigt, darunter möglicherweise Ausfallwahrscheinlichkeiten, Kreditkurven, Wiedereinbringungsquoten und Cashflows (Inputfaktoren der Stufe 2 oder 3).

Der Wert von Inflationswaps wird in erster Linie durch die Einholung von Bewertungen unabhängiger Pricing-Service-Anbieter unter Bezugnahme auf die zugrunde liegenden Inflationsraten einschließlich der prognostizierten erwarteten Inflationsrate und der jeweiligen Interbank Offered Forward Rate für den Tagessatz ermittelt. Der Barwert wird anhand der erwarteten Cashflows auf Basis der Swap-Parameter sowie unter Bezugnahme auf die zugrunde liegende Inflationserwartungskurve und den Referenzsatz berechnet (Inputfaktoren der Stufe 2).

Der Wert von Zinsswaps wird in erster Linie durch die Einholung von Bewertungen unabhängiger Pricing-Service-Anbieter auf der Grundlage von Referenzen zu den zugrunde liegenden Sätzen einschließlich des lokalen OIS (Overnight Index Swap) und des jeweiligen IBOR (Interbank Offered Forward) für den Tagessatz ermittelt. Der Barwert wird anhand der erwarteten Cashflows auf Basis der Swap-Parameter sowie unter Bezugnahme auf die zugrunde liegende Zinskurve und den Referenzzinssatz berechnet (Inputfaktoren der Stufe 2).

Der Wert von Total Return Swaps wird bestimmt, indem Bewertungen von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern unter Verwendung des zugrunde liegenden Vermögenswerts und des angegebenen Zinssatzes der Benchmark eingeholt werden (Inputfaktoren der Stufe 2).

Der Wert von Cross-Currency-Swaps wird durch die Einholung von Bewertungen unabhängiger Pricing-Service-Anbieter anhand des Barwerts der erwarteten Cashflows auf Basis der Swap-Parameter sowie unter Bezugnahme auf die zugrunde liegende Zinskurve und den Referenzzinssatz berechnet (Inputfaktoren der Stufe 2).

Der Wert von Volatility-Swaps wird in erster Linie durch die Einholung von Bewertungen von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern ermittelt und basiert auf einem vorab festgestellten Volatilitätsniveau gegenüber der tatsächlichen, über einen gewissen Zeitraum realisierten Volatilität auf Grundlage von Daten des Referenzwerts (Inputfaktoren der Stufe 2 oder 3).

Der Wert von Variance-Swaps wird in erster Linie durch die Einholung von Bewertungen von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern ermittelt und basiert auf der in der Vergangenheit realisierten und der voraussichtlichen künftigen Varianz (oder fairen Varianz) des Referenzwerts (Inputfaktoren der Stufe 2 oder 3).

Der Wert von Correlation-Swaps wird in erster Linie durch die Einholung von Bewertungen von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern ermittelt und basiert auf der Differenzen zwischen der realisierten Korrelation und einem festen Korrelationswert (Inputfaktoren der Stufe 2 oder 3).

**FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023****10. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)****Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)**

Der Wert von Differenzkontrakten („CFD“) wird in erster Linie durch die Einholung von Bewertungen unabhängiger Pricing-Service-Anbieter ermittelt, die auf der Bezugnahme auf den zugrunde liegenden Vermögenswert sowie den angegebenen Referenzzinssatz beruhen (Inputfaktoren der Stufe 2 oder 3).

Der Wert von Swaptions wird ermittelt, indem Bewertungen von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern oder von Gegenparteien zum Abrechnungskurs bei Börsenschluss eingeholt werden (Inputfaktoren der Stufe 2).

Optionskontrakte, die im Freiverkehr gehandelt werden, werden generell auf der Grundlage von Notierungen bewertet, die von Broker-Dealern gestellt werden, oder von Preisen, die von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern bereitgestellt werden, welche eine Reihe von Methoden einsetzen, unter anderem simulierte Preismodelle und/oder Kurvenanpassung (Bootstrapping), was die Ermittlung des Barwerts der Kontrakte erleichtert. Die Preismodelle ziehen Parameter heran, die auf aktiv notierten Märkten beobachtet werden, wie Angaben zum Emittenten, Indizes, Spreads, Zinssätze, Renditekurven, Volatilitätsoberflächen und Wechselkurse (Inputfaktoren der Stufe 2).

Einlagenzertifikate werden zu fortgeschriebenen Anschaffungskosten bewertet (Inputfaktoren der Stufe 2).

Umgekehrte Pensionsgeschäfte werden von Pricing-Service-Anbietern zum Nennwert bewertet (Inputfaktoren der Stufe 2).

Der Manager hat einen Bewertungsausschuss ernannt, der für alle maßgeblichen Wertpapierarten unabhängige Pricing-Service-Anbieter prüft.

Anlagen in nicht börsengehandelte Investmentgesellschaften werden anhand des täglich berechneten Nettoinventarwerts („NIW“) pro Anteil des jeweiligen Fonds bewertet (Inputfaktoren der Stufe 2).

Wenn keine Bewertung von einem unabhängigen Pricing-Service-Anbieter verfügbar ist oder wenn der Manager Grund zu der Annahme hat, dass die erhaltene Bewertung nicht dem Betrag entspricht, den ein Portfolio bei einem aktuellen Verkauf in einer ordnungsgemäßen Transaktion vernünftigerweise erwarten könnte, versucht der Manager, Quotierungen von Brokern oder Händlern einzuholen (sie werden im Allgemeinen je nach der Anzahl der verfügbaren Angebote als Inputfaktoren der Stufe 2 oder der Stufe 3 erachtet). Wenn solche Quotierungen nicht verfügbar sind, wird das Wertpapier anhand von Methoden bewertet, welche die Direktoren in dem guten Glauben genehmigt haben, dass die resultierende Bewertung den beizulegenden Zeitwert des Wertpapiers widerspiegelt.

Parameter und Annahmen, die bei der Bestimmung des beizulegenden Zeitwerts eines Wertpapiers auf der Grundlage von Inputfaktoren der Stufe 2 oder 3 berücksichtigt werden, gehören unter anderem die Art des Wertpapiers, die Anschaffungskosten des Wertpapiers, das Vorhandensein vertraglicher Beschränkungen für die Veräußerung des Wertpapiers, der Preis und der Umfang des öffentlichen Handels mit ähnlichen Wertpapieren des Emittenten oder vergleichbarer Unternehmen; Notierungen oder bewertete Preise von Broker-Dealern und/oder Pricing-Service-Anbietern; Informationen, die vom Emittenten und/oder von Analysten eingeholt wurden; eine Analyse der Abschlüsse des Unternehmens oder des Emittenten; eine Bewertung der Parameter, die den Emittenten beeinflussen, und des Marktes/der Märkte, auf dem/denen das Wertpapier gekauft und verkauft wird.

Der Wert der Anlagen der Portfolios in ausländischen Wertpapieren wird in der Regel mit denselben Bewertungsmethoden und Parametern wie bei anderen Portfolioanlagen und wie oben beschrieben bestimmt. Die in Landeswährung ausgedrückten Preise ausländischer Wertpapiere werden normalerweise von der Landeswährung in US-Dollar umgerechnet. Dabei werden die Wechselkurse um 16:00 Uhr Eastern Time an Tagen verwendet, an denen die New York Stock Exchange („NYSE“) für den Geschäftsverkehr geöffnet ist. Die Direktoren haben die Inanspruchnahme der Interactive Data Pricing & Reference Data LLC („ICE“) genehmigt, um bei der Ermittlung des beizulegenden Zeitwerts ausländischer Dividendenpapiere mitzuwirken, wenn Änderungen im Wert eines bestimmten Index andeuten, dass die Schlusskurse an den ausländischen Börsen ggf. nicht länger repräsentativ für den Preis sind, den ein Portfolio für diese Wertpapiere oder an Tagen erwarten könnte, wenn ausländische Märkte geschlossen und US-Märkte offen sind. In jedem dieser Fälle liefert ICE mittels einer statistischen Analyse historischer Korrelationen mehrerer Faktoren angepasste Kurse für bestimmte ausländische Dividendenpapiere (Inputfaktoren der Stufe 2). Die Direktoren haben zudem die Verwendung von ICE genehmigt, um die Preise ausländischer Schuldtiteln zu dem Zeitpunkt zu bewerten, zu dem der Anteilspreis eines Portfolios berechnet wird. ICE verwendet Benchmark-Spread- und Renditekurven und wertet die verfügbaren Marktaktivitäten vom lokalen Börsenschluss bis zu dem Zeitpunkt aus, zu dem der Anteilspreis eines Portfolios berechnet wird (Inputfaktoren der Stufe 2), um so bei der Ermittlung der Preise bestimmter ausländischer Schuldtitel zu helfen.

Sowohl bei ausländischen Aktien als auch bei ausländischen Schuldtiteln haben die Direktoren Mangels genauer Informationen über die Marktwerte dieser ausländischen Wertpapiere zu dem Zeitpunkt, wenn der Anteilspreis eines Portfolios berechnet wird anhand verfügbarer Daten entschieden, dass auf diese Art und Weise angepasste oder geschätzte Preise wahrscheinlich eher den Preisen entsprechen, die ein Portfolio bei einem aktuellen Verkauf erzielen könnte, als die Preise derjenigen Wertpapiere, die bei Börsenschluss der ausländischen Märkte ermittelt werden, auf denen die Wertpapiere vorwiegend gehandelt werden.

Preise zum beizulegenden Zeitwert sind notwendigerweise Schätzungen. Es gibt keine Gewähr, dass ein solcher Preis dem tatsächlichen Preis, zu dem das Wertpapier als nächstes notiert oder gehandelt wird, entspricht oder diesem nahe kommt.

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 10. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Die nachstehenden Tabellen zeigen Finanzanlagen nach den Stufen in der Zeitwerthierarchie:

## 5G Connectivity

## Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 30. Juni 2023

|   | Stufe 1<br>US\$    | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$    |
|---|--------------------|--------------------|-----------------|----------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                    |                    |                 |                      |
| Aktien  | 778.986.582        | 246.555.140        | –               | 1.025.541.722        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –                  | 821.482            | –               | 821.482              |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>778.986.582</b> | <b>247.376.622</b> | <b>–</b>        | <b>1.026.363.204</b> |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                    |                    |                 |                      |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –                  | (1.994.291)        | –               | (1.994.291)          |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>–</b>           | <b>(1.994.291)</b> | <b>–</b>        | <b>(1.994.291)</b>   |

## Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

|   | Stufe 1<br>US\$    | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|--------------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                    |                    |                 |                    |
| Aktien  | 884.202.753        | 68.691.966         | –               | 952.894.719        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –                  | 12.141.765         | –               | 12.141.765         |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>884.202.753</b> | <b>80.833.731</b>  | <b>–</b>        | <b>965.036.484</b> |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                    |                    |                 |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –                  | (3.280.059)        | –               | (3.280.059)        |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>–</b>           | <b>(3.280.059)</b> | <b>–</b>        | <b>(3.280.059)</b> |

## Absolute Return Multi Strategy\*

## Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 30. Juni 2023

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|--|-----------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b> |                 |                 |                 |                   |
| Aktien   | –               | –               | 6.311           | 6.311             |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                            | <b>–</b>        | <b>–</b>        | <b>6.311</b>    | <b>6.311</b>      |

## Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|--|-----------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b> |                 |                 |                 |                   |
| Aktien   | –               | –               | 6.766           | 6.766             |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                            | <b>–</b>        | <b>–</b>        | <b>6.766</b>    | <b>6.766</b>      |

\* Das Portfolio wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.



## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 10. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Asian Debt - Hard Currency

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 30. Juni 2023

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$   | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-----------------|-------------------|-----------------|-------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                 |                   |                 |                   |
| Unternehmensanleihen  | –               | 44.782.255        | –               | 44.782.255        |
| Staatsanleihen  | –               | 11.458.267        | –               | 11.458.267        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –               | 37.649            | –               | 37.649            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten              | 83.790          | –                 | –               | 83.790            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten              | –               | 268               | –               | 268               |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>83.790</b>   | <b>56.278.439</b> | <b>–</b>        | <b>56.362.229</b> |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                 |                   |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –               | (40.209)          | –               | (40.209)          |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten             | (18.509)        | –                 | –               | (18.509)          |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>(18.509)</b> | <b>(40.209)</b>   | <b>–</b>        | <b>(58.718)</b>   |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$   | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-----------------|-------------------|-----------------|-------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                 |                   |                 |                   |
| Unternehmensanleihen  | –               | 18.090.069        | –               | 18.090.069        |
| Staatsanleihen  | –               | 2.090.986         | –               | 2.090.986         |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –               | 34.382            | –               | 34.382            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten              | 47.079          | –                 | –               | 47.079            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>47.079</b>   | <b>20.215.437</b> | <b>–</b>        | <b>20.262.516</b> |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                 |                   |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –               | (84.733)          | –               | (84.733)          |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten             | (3.440)         | –                 | –               | (3.440)           |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>(3.440)</b>  | <b>(84.733)</b>   | <b>–</b>        | <b>(88.173)</b>   |

## China A-Share Equity

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 30. Juni 2023

|  | Stufe 1<br>CNY    | Stufe 2<br>CNY | Stufe 3<br>CNY | Insgesamt<br>CNY  |
|--|-------------------|----------------|----------------|-------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b> |                   |                |                |                   |
| Aktien   | 14.850.230        | –              | –              | 14.850.230        |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                            | <b>14.850.230</b> | <b>–</b>       | <b>–</b>       | <b>14.850.230</b> |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 10. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## China A-Share Equity (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten  
Zum 31. Dezember 2022

|  | Stufe 1<br>CNY | Stufe 2<br>CNY | Stufe 3<br>CNY | Insgesamt<br>CNY |
|--|----------------|----------------|----------------|------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b> |                |                |                |                  |
| Aktien   | 15.264.413     | 53.280         | –              | 15.317.693       |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                            | 15.264.413     | 53.280         | –              | 15.317.693       |

## China Bond

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten  
Zum 30. Juni 2023

|   | Stufe 1<br>CNY | Stufe 2<br>CNY | Stufe 3<br>CNY | Insgesamt<br>CNY |
|---|----------------|----------------|----------------|------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                |                |                |                  |
| Einlagenzertifikate   | –              | 63.788.535     | –              | 63.788.535       |
| Unternehmensanleihen  | –              | 334.570.186    | –              | 334.570.186      |
| Staatsanleihen  | –              | 50.350.005     | –              | 50.350.005       |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –              | 8.564.889      | –              | 8.564.889        |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | –              | 457.273.615    | –              | 457.273.615      |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                |                |                |                  |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten             | (1.452.118)    | –              | –              | (1.452.118)      |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –              | (9.682.245)    | –              | (9.682.245)      |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | (1.452.118)    | (9.682.245)    | –              | (11.134.363)     |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten  
Zum 31. Dezember 2022

|   | Stufe 1<br>CNY | Stufe 2<br>CNY | Stufe 3<br>CNY | Insgesamt<br>CNY |
|---|----------------|----------------|----------------|------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                |                |                |                  |
| Unternehmensanleihen  | –              | 272.165.839    | –              | 272.165.839      |
| Einlagenzertifikate   | –              | 92.924.345     | –              | 92.924.345       |
| Staatsanleihen  | –              | 60.073.670     | –              | 60.073.670       |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –              | 3.921.557      | –              | 3.921.557        |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | –              | 429.085.411    | –              | 429.085.411      |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                |                |                |                  |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –              | (2.701.843)    | –              | (2.701.843)      |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten             | (37.837)       | –              | –              | (37.837)         |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | (37.837)       | (2.701.843)    | –              | (2.739.680)      |

FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

10. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

China Equity

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 30. Juni 2023

|   | Stufe 1<br>US\$   | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|-------------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                   |                    |                 |                    |
| Aktien  | 12.353.752        | 253.433.372        | –               | 265.787.124        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –                 | 161.282            | –               | 161.282            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>12.353.752</b> | <b>253.594.654</b> | <b>–</b>        | <b>265.948.406</b> |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                   |                    |                 |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –                 | (209.102)          | –               | (209.102)          |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>–</b>          | <b>(209.102)</b>   | <b>–</b>        | <b>(209.102)</b>   |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

|   | Stufe 1<br>US\$    | Stufe 2<br>US\$  | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|--------------------|------------------|-----------------|--------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                    |                  |                 |                    |
| Aktien  | 306.849.688        | –                | –               | 306.849.688        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –                  | 1.099.861        | –               | 1.099.861          |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>306.849.688</b> | <b>1.099.861</b> | <b>–</b>        | <b>307.949.549</b> |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                    |                  |                 |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –                  | (817.712)        | –               | (817.712)          |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>–</b>           | <b>(817.712)</b> | <b>–</b>        | <b>(817.712)</b>   |

CLO Income

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 30. Juni 2023

|   | Stufe 1<br>US\$   | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|-------------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                   |                    |                 |                    |
| Schatzwechsel   | –                 | 5.493.929          | –               | 5.493.929          |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)               | –                 | 118.774.919        | –               | 118.774.919        |
| Investmentfonds   | 11.657.356        | –                  | –               | 11.657.356         |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –                 | 622.095            | –               | 622.095            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten    | –                 | 12.305             | –               | 12.305             |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>11.657.356</b> | <b>124.903.248</b> | <b>–</b>        | <b>136.560.604</b> |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                   |                    |                 |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –                 | (404.630)          | –               | (404.630)          |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>–</b>          | <b>(404.630)</b>   | <b>–</b>        | <b>(404.630)</b>   |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 10. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## CLO Income (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                 |                 |                 |                   |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)               | –               | 112.870.953     | –               | 112.870.953       |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –               | 3.267.421       | –               | 3.267.421         |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | –               | 116.138.374     | –               | 116.138.374       |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                 |                 |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –               | (989.846)       | –               | (989.846)         |
| Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten   | –               | (334.323)       | –               | (334.323)         |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | –               | (1.324.169)     | –               | (1.324.169)       |

Commodities<sup>1</sup>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 30. Juni 2023

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                 |                 |                 |                   |
| Schatzwechsel   | –               | 28.923.051      | –               | 28.923.051        |
| Agency Bonds  | –               | 12.050.260      | –               | 12.050.260        |
| Unternehmensanleihen  | –               | 42.979.774      | –               | 42.979.774        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –               | 709.086         | –               | 709.086           |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | –               | 84.662.171      | –               | 84.662.171        |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                 |                 |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –               | (111.800)       | –               | (111.800)         |
| Nicht realisierter Verlust aus Return--Swap-Kontrakten        | –               | 0               | –               | 0                 |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | –               | (111.800)       | –               | (111.800)         |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 10. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

 Commodities<sup>1</sup> (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                 |                 |                 |                   |
| Agency Bonds  | –               | 10.530.836      | –               | 10.530.836        |
| Unternehmensanleihen  | –               | 26.223.262      | –               | 26.223.262        |
| Schatzwechsel   | –               | 39.453.874      | –               | 39.453.874        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –               | 1.519.496       | –               | 1.519.496         |
| Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten    | –               | 0               | –               | 0                 |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | –               | 77.727.468      | –               | 77.727.468        |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                 |                 |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –               | (333.046)       | –               | (333.046)         |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | –               | (333.046)       | –               | (333.046)         |

## Corporate Hybrid Bond

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 30. Juni 2023

|   | Stufe 1<br>EUR | Stufe 2<br>EUR | Stufe 3<br>EUR | Insgesamt<br>EUR |
|---|----------------|----------------|----------------|------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                |                |                |                  |
| Unternehmensanleihen  | –              | 1.588.389.053  | –              | 1.588.389.053    |
| Investmentfonds   | –              | 10.426.215     | –              | 10.426.215       |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –              | 3.227.790      | –              | 3.227.790        |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | –              | 1.602.043.058  | –              | 1.602.043.058    |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                |                |                |                  |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –              | (14.688.097)   | –              | (14.688.097)     |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | –              | (14.688.097)   | –              | (14.688.097)     |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

|   | Stufe 1<br>EUR | Stufe 2<br>EUR | Stufe 3<br>EUR | Insgesamt<br>EUR |
|---|----------------|----------------|----------------|------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                |                |                |                  |
| Unternehmensanleihen  | –              | 1.638.001.345  | –              | 1.638.001.345    |
| Investmentfonds   | –              | 10.317.170     | –              | 10.317.170       |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –              | 36.511.573     | –              | 36.511.573       |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | –              | 1.684.830.088  | –              | 1.684.830.088    |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                |                |                |                  |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                                  | –              | (37.445.575)   | –              | (37.445.575)     |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –              | (20.223.334)   | –              | (20.223.334)     |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | –              | (57.668.909)   | –              | (57.668.909)     |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 10. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Emerging Market Debt - Hard Currency

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 30. Juni 2023

|   | Stufe 1<br>US\$    | Stufe 2<br>US\$      | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$    |
|---|--------------------|----------------------|-----------------|----------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                    |                      |                 |                      |
| Unternehmensanleihen  | –                  | 736.230.920          | –               | 736.230.920          |
| Staatsanleihen  | –                  | 1.633.773.145        | –               | 1.633.773.145        |
| Investmentfonds   | –                  | 16.618.500           | –               | 16.618.500           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –                  | 11.183.221           | –               | 11.183.221           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten              | 4.194.591          | –                    | –               | 4.194.591            |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten     | –                  | 1.247.088            | –               | 1.247.088            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>4.194.591</b>   | <b>2.399.052.874</b> | <b>–</b>        | <b>2.403.247.465</b> |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                    |                      |                 |                      |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –                  | (11.465.388)         | –               | (11.465.388)         |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten             | (8.287.454)        | –                    | –               | (8.287.454)          |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>(8.287.454)</b> | <b>(11.465.388)</b>  | <b>–</b>        | <b>(19.752.842)</b>  |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

|   | Stufe 1<br>US\$    | Stufe 2<br>US\$      | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$    |
|---|--------------------|----------------------|-----------------|----------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                    |                      |                 |                      |
| Unternehmensanleihen  | –                  | 784.977.470          | –               | 784.977.470          |
| Staatsanleihen  | –                  | 1.508.020.941        | –               | 1.508.020.941        |
| Investmentfonds   | –                  | 16.110.000           | –               | 16.110.000           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –                  | 12.379.899           | –               | 12.379.899           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten              | 23.148.647         | –                    | –               | 23.148.647           |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten     | –                  | 1.909.636            | –               | 1.909.636            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>23.148.647</b>  | <b>2.323.397.946</b> | <b>–</b>        | <b>2.346.546.593</b> |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                    |                      |                 |                      |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –                  | (10.560.096)         | –               | (10.560.096)         |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten             | (1.308.787)        | –                    | –               | (1.308.787)          |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>(1.308.787)</b> | <b>(10.560.096)</b>  | <b>–</b>        | <b>(11.868.883)</b>  |

FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

10. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Emerging Market Debt - Local Currency

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 30. Juni 2023

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|--|-----------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b> |                 |                 |                 |                   |
| Schatzwechsel  | –               | 13.105.824      | –               | 13.105.824        |
| Unternehmensanleihen                                       | –               | 32.124.973      | –               | 32.124.973        |
| Staatsanleihen   | –               | 1.140.233.323   | –               | 1.140.233.323     |
| Investmentfonds  | –               | 15.886.200      | –               | 15.886.200        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten      | –               | 15.082.218      | –               | 15.082.218        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten           | –               | 10.141.528      | –               | 10.141.528        |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                            | –               | 1.226.574.066   | –               | 1.226.574.066     |

**Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten**

|  |           |              |   |              |
|--|-----------|--------------|---|--------------|
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –         | (9.570.816)  | – | (9.570.816)  |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten      | (354.346) | –            | – | (354.346)    |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten      | –         | (18.306.180) | – | (18.306.180) |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | (354.346) | (27.876.996) | – | (28.231.342) |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|--|-----------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b> |                 |                 |                 |                   |
| Einlagenzertifikat   | –               | 18.492.177      | –               | 18.492.177        |
| Unternehmensanleihen                                       | –               | 22.468.723      | –               | 22.468.723        |
| Staatsanleihen   | –               | 1.280.353.016   | –               | 1.280.353.016     |
| Investmentfonds  | –               | 15.136.550      | –               | 15.136.550        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten      | –               | 14.987.459      | –               | 14.987.459        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten           | –               | 8.845.584       | –               | 8.845.584         |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                            | –               | 1.360.283.509   | –               | 1.360.283.509     |

**Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten**

|  |           |              |   |              |
|--|-----------|--------------|---|--------------|
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –         | (9.665.447)  | – | (9.665.447)  |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten      | (676.393) | –            | – | (676.393)    |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten      | –         | (47.106.454) | – | (47.106.454) |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | (676.393) | (56.771.901) | – | (57.448.294) |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 10. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Emerging Market Debt Blend

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 30. Juni 2023

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|--|-----------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b> |                 |                    |                 |                    |
| Schatzwechsel  | –               | 2.057.221          | –               | 2.057.221          |
| Unternehmensanleihen                                       | –               | 141.038.882        | –               | 141.038.882        |
| Staatsanleihen   | –               | 302.822.935        | –               | 302.822.935        |
| Investmentfonds  | –               | 14.043.241         | –               | 14.043.241         |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten      | –               | 4.486.762          | –               | 4.486.762          |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten           | 267.698         | –                  | –               | 267.698            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten           | –               | 2.668.378          | –               | 2.668.378          |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten  | –               | 1.130.242          | –               | 1.130.242          |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                            | <b>267.698</b>  | <b>468.247.661</b> | <b>–</b>        | <b>468.515.359</b> |

**Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten**

|  |                  |                    |          |                    |
|--|------------------|--------------------|----------|--------------------|
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –                | (1.608.336)        | –        | (1.608.336)        |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten      | (804.269)        | –                  | –        | (804.269)          |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten      | –                | (6.058.801)        | –        | (6.058.801)        |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>(804.269)</b> | <b>(7.667.137)</b> | <b>–</b> | <b>(8.471.406)</b> |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

|  | Stufe 1<br>US\$  | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|--|------------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b> |                  |                    |                 |                    |
| Unternehmensanleihen                                       | –                | 149.902.253        | –               | 149.902.253        |
| Staatsanleihen   | –                | 288.112.593        | –               | 288.112.593        |
| Investmentfonds  | –                | 13.380.558         | –               | 13.380.558         |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten      | –                | 4.031.358          | –               | 4.031.358          |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten           | 1.175.800        | –                  | –               | 1.175.800          |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten  | –                | 1.658.685          | –               | 1.658.685          |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten           | –                | 4.841.085          | –               | 4.841.085          |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                            | <b>1.175.800</b> | <b>461.926.532</b> | <b>–</b>        | <b>463.102.332</b> |

**Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten**

|  |                  |                     |          |                     |
|--|------------------|---------------------|----------|---------------------|
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –                | (2.058.976)         | –        | (2.058.976)         |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten      | (159.705)        | –                   | –        | (159.705)           |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten      | –                | (11.561.405)        | –        | (11.561.405)        |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>(159.705)</b> | <b>(13.620.381)</b> | <b>–</b> | <b>(13.780.086)</b> |



FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

10. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 30. Juni 2023

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$   | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|--|-----------------|-------------------|-----------------|-------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b> |                 |                   |                 |                   |
| Schatzwechsel  | –               | 134.530           | –               | 134.530           |
| Unternehmensanleihen                                       | –               | 8.112.874         | –               | 8.112.874         |
| Staatsanleihen   | –               | 49.700.225        | –               | 49.700.225        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten      | –               | 278.530           | –               | 278.530           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten           | 190.200         | –                 | –               | 190.200           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten           | –               | 24.567            | –               | 24.567            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                            | <b>190.200</b>  | <b>58.250.726</b> | <b>–</b>        | <b>58.440.926</b> |

**Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten**

|  |                  |                  |          |                  |
|--|------------------|------------------|----------|------------------|
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –                | (485.938)        | –        | (485.938)        |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten      | (191.437)        | –                | –        | (191.437)        |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten      | –                | (52.717)         | –        | (52.717)         |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>(191.437)</b> | <b>(538.655)</b> | <b>–</b> | <b>(730.092)</b> |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$   | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|--|-----------------|-------------------|-----------------|-------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b> |                 |                   |                 |                   |
| Unternehmensanleihen                                       | –               | 7.512.041         | –               | 7.512.041         |
| Staatsanleihen   | –               | 42.285.874        | –               | 42.285.874        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten      | –               | 446.879           | –               | 446.879           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten           | 610.127         | –                 | –               | 610.127           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten           | –               | 43.385            | –               | 43.385            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                            | <b>610.127</b>  | <b>50.288.179</b> | <b>–</b>        | <b>50.898.306</b> |

**Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten**

|  |                 |                  |          |                  |
|--|-----------------|------------------|----------|------------------|
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –               | (340.697)        | –        | (340.697)        |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten      | (65.989)        | –                | –        | (65.989)         |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten      | –               | (135.722)        | –        | (135.722)        |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>(65.989)</b> | <b>(476.419)</b> | <b>–</b> | <b>(542.408)</b> |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 10. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Emerging Markets Equity

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 30. Juni 2023

|   | Stufe 1<br>US\$   | Stufe 2<br>US\$   | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|-------------------|-------------------|-----------------|--------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                   |                   |                 |                    |
| Aktien  | 34.971.609        | 79.087.526        | –               | 114.059.135        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –                 | 328.720           | –               | 328.720            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>34.971.609</b> | <b>79.416.246</b> | <b>–</b>        | <b>114.387.855</b> |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                   |                   |                 |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –                 | (291.952)         | –               | (291.952)          |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>–</b>          | <b>(291.952)</b>  | <b>–</b>        | <b>(291.952)</b>   |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

|   | Stufe 1<br>US\$    | Stufe 2<br>US\$   | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|--------------------|-------------------|-----------------|--------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                    |                   |                 |                    |
| Aktien  | 139.636.822        | 49.097.184        | –               | 188.734.006        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –                  | 1.053.813         | –               | 1.053.813          |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>139.636.822</b> | <b>50.150.997</b> | <b>–</b>        | <b>189.787.819</b> |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                    |                   |                 |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –                  | (666.859)         | –               | (666.859)          |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>–</b>           | <b>(666.859)</b>  | <b>–</b>        | <b>(666.859)</b>   |

## Emerging Markets Select Equity

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 30. Juni 2023

|  | Stufe 1<br>US\$   | Stufe 2<br>US\$   | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|--|-------------------|-------------------|-----------------|-------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b> |                   |                   |                 |                   |
| Aktien   | 22.424.530        | 70.673.300        | –               | 93.097.830        |
| Immobilienaktiengesellschaften                             | 52.882            | –                 | –               | 52.882            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                            | <b>22.477.412</b> | <b>70.673.300</b> | <b>–</b>        | <b>93.150.712</b> |

FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

10. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Emerging Markets Select Equity (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten  
Zum 31. Dezember 2022

|  | Stufe 1<br>US\$   | Stufe 2<br>US\$   | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|--|-------------------|-------------------|-----------------|-------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b> |                   |                   |                 |                   |
| Aktien   | 67.247.423        | 23.179.556        | –               | 90.426.979        |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                            | <b>67.247.423</b> | <b>23.179.556</b> | <b>–</b>        | <b>90.426.979</b> |

Euro Bond Absolute Return

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten  
Zum 30. Juni 2023

|  | Stufe 1<br>EUR | Stufe 2<br>EUR    | Stufe 3<br>EUR | Insgesamt<br>EUR  |
|--|----------------|-------------------|----------------|-------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b> |                |                   |                |                   |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)            | –              | 467.091           | –              | 467.091           |
| Unternehmensanleihen                                       | –              | 24.403.993        | –              | 24.403.993        |
| Staatsanleihen   | –              | 21.742.817        | –              | 21.742.817        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten      | –              | 183.318           | –              | 183.318           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten           | 20.730         | –                 | –              | 20.730            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Inflation-Swap-Kontrakten    | –              | 17.672            | –              | 17.672            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten           | –              | 6.380             | –              | 6.380             |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                            | <b>20.730</b>  | <b>46.821.271</b> | <b>–</b>       | <b>46.842.001</b> |

**Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten**

|   |                 |                  |          |                  |
|---|-----------------|------------------|----------|------------------|
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten    | –               | (49.016)         | –        | (49.016)         |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten         | (96.603)        | –                | –        | (96.603)         |
| Nicht realisierter Verlust aus Inflation-Swap-Kontrakten  | –               | (18.503)         | –        | (18.503)         |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten         | –               | (89.456)         | –        | (89.456)         |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten | –               | (99.353)         | –        | (99.353)         |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                       | <b>(96.603)</b> | <b>(256.328)</b> | <b>–</b> | <b>(352.931)</b> |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 10. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Euro Bond Absolute Return (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

|   | Stufe 1<br>EUR   | Stufe 2<br>EUR     | Stufe 3<br>EUR | Insgesamt<br>EUR   |
|---|------------------|--------------------|----------------|--------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                  |                    |                |                    |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)               | –                | 2.319.216          | –              | 2.319.216          |
| Unternehmensanleihen  | –                | 23.938.251         | –              | 23.938.251         |
| Staatsanleihen  | –                | 19.650.553         | –              | 19.650.553         |
| Nicht realisierter Gewinn aus Inflation-Swap-Kontrakten       | –                | 61.989             | –              | 61.989             |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –                | 39.745             | –              | 39.745             |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten              | 1.497.736        | –                  | –              | 1.497.736          |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten              | –                | 12.884             | –              | 12.884             |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>1.497.736</b> | <b>46.022.638</b>  | <b>–</b>       | <b>47.520.374</b>  |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                  |                    |                |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Inflation-Swap-Kontrakten      | –                | (67.569)           | –              | (67.569)           |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –                | (1.032.074)        | –              | (1.032.074)        |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten             | (103.516)        | –                  | –              | (103.516)          |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten     | –                | (32.637)           | –              | (32.637)           |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten             | –                | (43.820)           | –              | (43.820)           |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>(103.516)</b> | <b>(1.176.100)</b> | <b>–</b>       | <b>(1.279.616)</b> |

## Euro Opportunistic Bond

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 30. Juni 2023

|   | Stufe 1<br>EUR  | Stufe 2<br>EUR   | Stufe 3<br>EUR | Insgesamt<br>EUR |
|---|-----------------|------------------|----------------|------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                 |                  |                |                  |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)               | –               | 50.110           | –              | 50.110           |
| Unternehmensanleihen  | –               | 4.361.061        | –              | 4.361.061        |
| Staatsanleihen  | –               | 4.694.045        | –              | 4.694.045        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten              | 5.768           | –                | –              | 5.768            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten              | –               | 1.308            | –              | 1.308            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>5.768</b>    | <b>9.106.524</b> | <b>–</b>       | <b>9.112.292</b> |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                 |                  |                |                  |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten             | (17.677)        | –                | –              | (17.677)         |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten             | –               | (23.616)         | –              | (23.616)         |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten     | –               | (19.870)         | –              | (19.870)         |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>(17.677)</b> | <b>(43.486)</b>  | <b>–</b>       | <b>(61.163)</b>  |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 10. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Euro Opportunistic Bond (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

|   | Stufe 1<br>EUR  | Stufe 2<br>EUR   | Stufe 3<br>EUR | Insgesamt<br>EUR |
|---|-----------------|------------------|----------------|------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                 |                  |                |                  |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)               | –               | 462.816          | –              | 462.816          |
| Unternehmensanleihen  | –               | 4.079.176        | –              | 4.079.176        |
| Staatsanleihen  | –               | 4.005.023        | –              | 4.005.023        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Inflation-Swap-Kontrakten       | –               | 93               | –              | 93               |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten              | 41.432          | –                | –              | 41.432           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten              | –               | 1.858            | –              | 1.858            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>41.432</b>   | <b>8.548.966</b> | <b>–</b>       | <b>8.590.398</b> |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                 |                  |                |                  |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten             | (82.010)        | –                | –              | (82.010)         |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten     | –               | (6.528)          | –              | (6.528)          |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten             | –               | (23.909)         | –              | (23.909)         |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>(82.010)</b> | <b>(30.437)</b>  | <b>–</b>       | <b>(112.447)</b> |

## European High Yield Bond

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 30. Juni 2023

|   | Stufe 1<br>EUR | Stufe 2<br>EUR    | Stufe 3<br>EUR | Insgesamt<br>EUR  |
|---|----------------|-------------------|----------------|-------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                |                   |                |                   |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)               | –              | 1.102.256         | –              | 1.102.256         |
| Unternehmensanleihen  | –              | 75.446.879        | –              | 75.446.879        |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen                          | –              | 211.293           | –              | 211.293           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –              | 246.403           | –              | 246.403           |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>–</b>       | <b>77.006.831</b> | <b>–</b>       | <b>77.006.831</b> |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                |                   |                |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –              | (276.536)         | –              | (276.536)         |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>–</b>       | <b>(276.536)</b>  | <b>–</b>       | <b>(276.536)</b>  |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 10. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## European High Yield Bond (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten  
Zum 31. Dezember 2022

|   | Stufe 1<br>EUR | Stufe 2<br>EUR | Stufe 3<br>EUR | Insgesamt<br>EUR |
|---|----------------|----------------|----------------|------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                |                |                |                  |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)               | –              | 215.121        | –              | 215.121          |
| Unternehmensanleihen  | –              | 32.065.000     | –              | 32.065.000       |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen                          | –              | 202.519        | –              | 202.519          |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –              | 1.258.544      | –              | 1.258.544        |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | –              | 33.741.184     | –              | 33.741.184       |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                |                |                |                  |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –              | (3.113.019)    | –              | (3.113.019)      |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | –              | (3.113.019)    | –              | (3.113.019)      |

## European Sustainable Equity

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten  
Zum 30. Juni 2023

|  | Stufe 1<br>EUR | Stufe 2<br>EUR | Stufe 3<br>EUR | Insgesamt<br>EUR |
|--|----------------|----------------|----------------|------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b> |                |                |                |                  |
| Aktien   | 169.803.221    | –              | –              | 169.803.221      |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                            | 169.803.221    | –              | –              | 169.803.221      |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten  
Zum 31. Dezember 2022

|  | Stufe 1<br>EUR | Stufe 2<br>EUR | Stufe 3<br>EUR | Insgesamt<br>EUR |
|--|----------------|----------------|----------------|------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b> |                |                |                |                  |
| Aktien   | 40.367.498     | 134.021.329    | –              | 174.388.827      |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                            | 40.367.498     | 134.021.329    | –              | 174.388.827      |

FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

10. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Event Driven<sup>1</sup>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 30. Juni 2023

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                 |                 |                 |                   |
| Schatzwechsel   | –               | 74.931.702      | –               | 74.931.702        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –               | 1.413.895       | –               | 1.413.895         |
| Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten    | –               | 428.434         | –               | 428.434           |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | –               | 76.774.031      | –               | 76.774.031        |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                 |                 |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –               | (61.574)        | –               | (61.574)          |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | –               | (61.574)        | –               | (61.574)          |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                 |                 |                 |                   |
| Schatzwechsel   | –               | 33.823.354      | –               | 33.823.354        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –               | 918.069         | –               | 918.069           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten    | –               | 18.364          | –               | 18.364            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | –               | 34.759.787      | –               | 34.759.787        |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                 |                 |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –               | (18.616)        | –               | (18.616)          |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | –               | (18.616)        | –               | (18.616)          |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 10. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Global Bond

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 30. Juni 2023

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|--|-----------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b> |                 |                    |                 |                    |
| Agency Bonds   | –               | 2.217.915          | –               | 2.217.915          |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)            | –               | 9.534.175          | –               | 9.534.175          |
| Unternehmensanleihen                                       | –               | 37.840.750         | –               | 37.840.750         |
| Staatsanleihen   | –               | 55.109.127         | –               | 55.109.127         |
| Mortgage-Backed Securities                                 | –               | 25.715.608         | –               | 25.715.608         |
| Kommunalanleihen   | –               | 1.641.442          | –               | 1.641.442          |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten      | –               | 1.095.225          | –               | 1.095.225          |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten           | 133.687         | –                  | –               | 133.687            |
| Gekaufte Optionskontrakte                                  | 4.000           | –                  | –               | 4.000              |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten           | –               | 148.915            | –               | 148.915            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                            | <b>137.687</b>  | <b>133.303.157</b> | <b>–</b>        | <b>133.440.844</b> |

**Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten**

|  |                  |                    |          |                    |
|--|------------------|--------------------|----------|--------------------|
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –                | (3.093.454)        | –        | (3.093.454)        |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten      | (214.659)        | –                  | –        | (214.659)          |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>(214.659)</b> | <b>(3.093.454)</b> | <b>–</b> | <b>(3.308.113)</b> |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

|   | Stufe 1<br>US\$  | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|------------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                  |                    |                 |                    |
| Agency Bonds  | –                | 2.423.190          | –               | 2.423.190          |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)               | –                | 8.861.707          | –               | 8.861.707          |
| Unternehmensanleihen  | –                | 44.359.194         | –               | 44.359.194         |
| Staatsanleihen  | –                | 53.670.009         | –               | 53.670.009         |
| Mortgage-Backed Securities                                    | –                | 19.062.981         | –               | 19.062.981         |
| Kommunalanleihen  | –                | 1.706.806          | –               | 1.706.806          |
| Schatzwechsel   | –                | 791.814            | –               | 791.814            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –                | 2.638.428          | –               | 2.638.428          |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten              | 270.257          | –                  | –               | 270.257            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten              | –                | 1.233              | –               | 1.233              |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>270.257</b>   | <b>133.515.362</b> | <b>–</b>        | <b>133.785.619</b> |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                  |                    |                 |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –                | (1.908.377)        | –               | (1.908.377)        |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten             | (191.230)        | –                  | –               | (191.230)          |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten     | –                | (13.185)           | –               | (13.185)           |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>(191.230)</b> | <b>(1.921.562)</b> | <b>–</b>        | <b>(2.112.792)</b> |



FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

10. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Global Diversified Income FMP – 2024

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 30. Juni 2023

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                 |                 |                 |                   |
| Unternehmensanleihen  | –               | 148.892.129     | –               | 148.892.129       |
| Staatsanleihen  | –               | 1.664.293       | –               | 1.664.293         |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –               | 48.375          | –               | 48.375            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | –               | 150.604.797     | –               | 150.604.797       |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                 |                 |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –               | (108.675)       | –               | (108.675)         |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | –               | (108.675)       | –               | (108.675)         |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                 |                 |                 |                   |
| Unternehmensanleihen  | –               | 150.336.737     | –               | 150.336.737       |
| Staatsanleihen  | –               | 3.931.136       | –               | 3.931.136         |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –               | 523.987         | –               | 523.987           |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | –               | 154.791.860     | –               | 154.791.860       |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                 |                 |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –               | (417)           | –               | (417)             |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | –               | (417)           | –               | (417)             |

Global Equity Megatrends

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 30. Juni 2023

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|--|-----------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b> |                 |                 |                 |                   |
| Aktien   | 99.819.818      | –               | –               | 99.819.818        |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                            | 99.819.818      | –               | –               | 99.819.818        |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 10. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Global Equity Megatrends (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten  
Zum 31. Dezember 2022

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|--|-----------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b> |                 |                 |                 |                   |
| Aktien   | 75.013.478      | 4.451.857       | –               | 79.465.335        |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                            | 75.013.478      | 4.451.857       | –               | 79.465.335        |

## Global Flexible Credit Income

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten  
Zum 30. Juni 2023

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                 |                 |                 |                   |
| Aktien  | –               | –               | 5.744.028       | 5.744.028         |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)               | –               | 14.907.673      | –               | 14.907.673        |
| Unternehmensanleihen  | –               | 279.028.236     | –               | 279.028.236       |
| Staatsanleihen  | –               | 22.388.147      | –               | 22.388.147        |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen                          | –               | 13.544.713      | –               | 13.544.713        |
| Investmentfonds   | 163.907         | –               | –               | 163.907           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –               | 4.407.908       | –               | 4.407.908         |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten              | 1.706.318       | –               | –               | 1.706.318         |
| Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten    | –               | 27.731          | –               | 27.731            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | 1.870.225       | 334.304.408     | 5.744.028       | 341.918.661       |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                 |                 |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –               | (821.687)       | –               | (821.687)         |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten             | (3.030.181)     | –               | –               | (3.030.181)       |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | (3.030.181)     | (821.687)       | –               | (3.851.868)       |

FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

10. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Global Flexible Credit Income (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

|   | Stufe 1<br>US\$  | Stufe 2<br>US\$     | Stufe 3<br>US\$  | Insgesamt<br>US\$   |
|---|------------------|---------------------|------------------|---------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                  |                     |                  |                     |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)               | –                | 24.079.041          | –                | 24.079.041          |
| Unternehmensanleihen  | –                | 316.164.124         | –                | 316.164.124         |
| Aktien  | –                | –                   | 5.247.334        | 5.247.334           |
| Staatsanleihen  | –                | 9.817.787           | –                | 9.817.787           |
| Investmentfonds   | 338.564          | –                   | –                | 338.564             |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –                | 29.033.515          | –                | 29.033.515          |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten              | 468.202          | –                   | –                | 468.202             |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>806.766</b>   | <b>379.094.467</b>  | <b>5.247.334</b> | <b>385.148.567</b>  |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                  |                     |                  |                     |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –                | (10.857.921)        | –                | (10.857.921)        |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten             | (515.955)        | –                   | –                | (515.955)           |
| Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten   | –                | (632.100)           | –                | (632.100)           |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>(515.955)</b> | <b>(11.490.021)</b> | <b>–</b>         | <b>(12.005.976)</b> |

Global High Yield SDG Engagement

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 30. Juni 2023

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|-----------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                 |                    |                 |                    |
| Unternehmensanleihen  | –               | 531.160.752        | –               | 531.160.752        |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen                          | –               | 1.179.329          | –               | 1.179.329          |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –               | 1.917.361          | –               | 1.917.361          |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>–</b>        | <b>534.257.442</b> | <b>–</b>        | <b>534.257.442</b> |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                 |                    |                 |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –               | (1.546.329)        | –               | (1.546.329)        |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>–</b>        | <b>(1.546.329)</b> | <b>–</b>        | <b>(1.546.329)</b> |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 10. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Global High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten  
Zum 31. Dezember 2022

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                 |                 |                 |                   |
| Unternehmensanleihen  | –               | 273.005.334     | –               | 273.005.334       |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen                          | –               | 687.601         | 325.875         | 1.013.476         |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –               | 12.873.530      | –               | 12.873.530        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten    | –               | 13.411          | –               | 13.411            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | –               | 286.579.876     | 325.875         | 286.905.751       |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                 |                 |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –               | (9.426.254)     | –               | (9.426.254)       |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | –               | (9.426.254)     | –               | (9.426.254)       |

## Global High Yield Sustainable Action\*

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten  
Zum 30. Juni 2023

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                 |                 |                 |                   |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –               | 43.352          | –               | 43.352            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | –               | 43.352          | –               | 43.352            |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                 |                 |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –               | (27.682)        | –               | (27.682)          |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | –               | (27.682)        | –               | (27.682)          |

\* Das Portfolio wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst.

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten  
Zum 31. Dezember 2022

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                 |                 |                 |                   |
| Unternehmensanleihen  | –               | 14.443.671      | –               | 14.443.671        |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen                          | –               | 95.881          | –               | 95.881            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –               | 7.620           | –               | 7.620             |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | –               | 14.547.172      | –               | 14.547.172        |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                 |                 |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –               | (358.029)       | –               | (358.029)         |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | –               | (358.029)       | –               | (358.029)         |

\* Das Portfolio wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst.

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 10. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Global Investment Grade Credit

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 30. Juni 2023

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                 |                 |                 |                   |
| Unternehmensanleihen  | –               | 77.831.690      | –               | 77.831.690        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –               | 162.295         | –               | 162.295           |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | –               | 77.993.985      | –               | 77.993.985        |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                 |                 |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –               | (120.622)       | –               | (120.622)         |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | –               | (120.622)       | –               | (120.622)         |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                 |                 |                 |                   |
| Unternehmensanleihen  | –               | 80.767.363      | –               | 80.767.363        |
| Staatsanleihen  | –               | 2.758.010       | –               | 2.758.010         |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –               | 16.124          | –               | 16.124            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | –               | 83.541.497      | –               | 83.541.497        |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                 |                 |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –               | (1.642.819)     | –               | (1.642.819)       |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | –               | (1.642.819)     | –               | (1.642.819)       |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 10. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Global Opportunistic Bond

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 30. Juni 2023

|   | Stufe 1<br>US\$  | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|------------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                  |                    |                 |                    |
| Agency Bonds  | –                | 316.208            | –               | 316.208            |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)               | –                | 2.087.988          | –               | 2.087.988          |
| Unternehmensanleihen  | –                | 26.826.482         | –               | 26.826.482         |
| Staatsanleihen  | –                | 21.824.491         | –               | 21.824.491         |
| Mortgage-Backed Securities                                    | –                | 14.954.772         | –               | 14.954.772         |
| Investmentfonds   | 51.906           | –                  | –               | 51.906             |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –                | 1.648.082          | –               | 1.648.082          |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten              | 147.322          | –                  | –               | 147.322            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten              | –                | 26.113             | –               | 26.113             |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten     | –                | 283.005            | –               | 283.005            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>199.228</b>   | <b>67.967.141</b>  | <b>–</b>        | <b>68.166.369</b>  |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                  |                    |                 |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –                | (1.560.899)        | –               | (1.560.899)        |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten             | (344.327)        | –                  | –               | (344.327)          |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten     | –                | (497.900)          | –               | (497.900)          |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten             | –                | (4.693)            | –               | (4.693)            |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>(344.327)</b> | <b>(2.063.492)</b> | <b>–</b>        | <b>(2.407.819)</b> |

FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

10. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Global Opportunistic Bond (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

|   | Stufe 1<br>US\$  | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|------------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                  |                    |                 |                    |
| Agency Bonds  | –                | 307.820            | –               | 307.820            |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)               | –                | 4.290.102          | –               | 4.290.102          |
| Unternehmensanleihen  | –                | 35.431.699         | –               | 35.431.699         |
| Staatsanleihen  | –                | 24.711.043         | –               | 24.711.043         |
| Investmentfonds   | 107.216          | 1.694.000          | –               | 1.801.216          |
| Mortgage-Backed Securities                                    | –                | 10.458.233         | –               | 10.458.233         |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –                | 2.069.747          | –               | 2.069.747          |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten              | 568.616          | –                  | –               | 568.616            |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten     | –                | 455.060            | –               | 455.060            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten              | –                | 17.416             | –               | 17.416             |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>675.832</b>   | <b>79.435.120</b>  | <b>–</b>        | <b>80.110.952</b>  |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                  |                    |                 |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –                | (4.857.533)        | –               | (4.857.533)        |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten             | (607.164)        | –                  | –               | (607.164)          |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten     | –                | (64.729)           | –               | (64.729)           |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten             | –                | (141)              | –               | (141)              |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>(607.164)</b> | <b>(4.922.403)</b> | <b>–</b>        | <b>(5.529.567)</b> |

Global Real Estate Securities

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 30. Juni 2023

|   | Stufe 1<br>US\$   | Stufe 2<br>US\$  | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-------------------|------------------|-----------------|-------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                   |                  |                 |                   |
| Aktien  | 1.482.965         | 3.965.162        | –               | 5.448.127         |
| Immobilienaktiengesellschaften                                | 23.291.646        | 3.792.207        | –               | 27.083.853        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –                 | 20.230           | –               | 20.230            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>24.774.611</b> | <b>7.777.599</b> | <b>–</b>        | <b>32.552.210</b> |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                   |                  |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –                 | (81.118)         | –               | (81.118)          |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>–</b>          | <b>(81.118)</b>  | <b>–</b>        | <b>(81.118)</b>   |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 10. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Global Real Estate Securities (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

|   | Stufe 1<br>US\$   | Stufe 2<br>US\$  | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-------------------|------------------|-----------------|-------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                   |                  |                 |                   |
| Aktien  | 5.878.530         | 967.525          | –               | 6.846.055         |
| Immobilienaktiengesellschaften                                | 26.313.894        | 4.046.904        | –               | 30.360.798        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –                 | 866.015          | –               | 866.015           |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>32.192.424</b> | <b>5.880.444</b> | <b>–</b>        | <b>38.072.868</b> |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                   |                  |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –                 | (147.763)        | –               | (147.763)         |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>–</b>          | <b>(147.763)</b> | <b>–</b>        | <b>(147.763)</b>  |

## Global Sustainable Equity

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 30. Juni 2023

|  | Stufe 1<br>US\$    | Stufe 2<br>US\$  | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|--|--------------------|------------------|-----------------|--------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b> |                    |                  |                 |                    |
| Aktien   | 147.170.318        | 1.761.988        | –               | 148.932.306        |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                            | <b>147.170.318</b> | <b>1.761.988</b> | <b>–</b>        | <b>148.932.306</b> |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

|  | Stufe 1<br>US\$   | Stufe 2<br>US\$   | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|--|-------------------|-------------------|-----------------|--------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b> |                   |                   |                 |                    |
| Aktien   | 96.654.246        | 33.870.236        | –               | 130.524.482        |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                            | <b>96.654.246</b> | <b>33.870.236</b> | <b>–</b>        | <b>130.524.482</b> |



FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

10. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

High Yield Bond

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 30. Juni 2023

|   | Stufe 1<br>US\$  | Stufe 2<br>US\$      | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$    |
|---|------------------|----------------------|-----------------|----------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                  |                      |                 |                      |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)               | –                | 39.349.509           | –               | 39.349.509           |
| Unternehmensanleihen  | –                | 1.954.989.023        | –               | 1.954.989.023        |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen                          | –                | 110.068.113          | –               | 110.068.113          |
| Investmentfonds   | 8.856.913        | –                    | –               | 8.856.913            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –                | 9.305.841            | –               | 9.305.841            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>8.856.913</b> | <b>2.113.712.486</b> | <b>–</b>        | <b>2.122.569.399</b> |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                  |                      |                 |                      |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –                | (13.405.321)         | –               | (13.405.321)         |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>–</b>         | <b>(13.405.321)</b>  | <b>–</b>        | <b>(13.405.321)</b>  |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

|   | Stufe 1<br>US\$   | Stufe 2<br>US\$      | Stufe 3<br>US\$  | Insgesamt<br>US\$    |
|---|-------------------|----------------------|------------------|----------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                   |                      |                  |                      |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)               | –                 | 21.830.306           | –                | 21.830.306           |
| Unternehmensanleihen  | –                 | 1.982.553.426        | –                | 1.982.553.426        |
| Investmentfonds   | 18.294.706        | –                    | –                | 18.294.706           |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen                          | –                 | 85.843.814           | 5.791.687        | 91.635.501           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –                 | 55.707.544           | –                | 55.707.544           |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>18.294.706</b> | <b>2.145.935.090</b> | <b>5.791.687</b> | <b>2.170.021.483</b> |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                   |                      |                  |                      |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –                 | (25.192.706)         | –                | (25.192.706)         |
| Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten   | –                 | (404.963)            | –                | (404.963)            |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>–</b>          | <b>(25.597.669)</b>  | <b>–</b>         | <b>(25.597.669)</b>  |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 10. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## InnovAsia 5G

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 30. Juni 2023

|   | Stufe 1<br>US\$   | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-------------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                   |                 |                 |                   |
| Aktien  | 20.341.162        | –               | –               | 20.341.162        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –                 | 19.032          | –               | 19.032            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>20.341.162</b> | <b>19.032</b>   | <b>–</b>        | <b>20.360.194</b> |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                   |                 |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –                 | (71.701)        | –               | (71.701)          |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>–</b>          | <b>(71.701)</b> | <b>–</b>        | <b>(71.701)</b>   |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

|   | Stufe 1<br>US\$   | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-------------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                   |                 |                 |                   |
| Aktien  | 13.493.208        | 379.300         | –               | 13.872.508        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –                 | 453.339         | –               | 453.339           |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>13.493.208</b> | <b>832.639</b>  | <b>–</b>        | <b>14.325.847</b> |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                   |                 |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –                 | (78.732)        | –               | (78.732)          |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>–</b>          | <b>(78.732)</b> | <b>–</b>        | <b>(78.732)</b>   |

## Japan Equity Engagement

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 30. Juni 2023

|   | Stufe 1<br>JPY        | Stufe 2<br>JPY       | Stufe 3<br>JPY | Insgesamt<br>JPY      |
|---|-----------------------|----------------------|----------------|-----------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                       |                      |                |                       |
| Aktien  | 22.277.775.500        | –                    | –              | 22.277.775.500        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –                     | 1.125.039.603        | –              | 1.125.039.603         |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>22.277.775.500</b> | <b>1.125.039.603</b> | <b>–</b>       | <b>23.402.815.103</b> |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                       |                      |                |                       |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –                     | (87.510.379)         | –              | (87.510.379)          |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>–</b>              | <b>(87.510.379)</b>  | <b>–</b>       | <b>(87.510.379)</b>   |

FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

10. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Japan Equity Engagement (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

|   | Stufe 1<br>JPY        | Stufe 2<br>JPY       | Stufe 3<br>JPY | Insgesamt<br>JPY      |
|---|-----------------------|----------------------|----------------|-----------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                       |                      |                |                       |
| Aktien  | 20.207.455.300        | –                    | –              | 20.207.455.300        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –                     | 44.531.344           | –              | 44.531.344            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>20.207.455.300</b> | <b>44.531.344</b>    | <b>–</b>       | <b>20.251.986.644</b> |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                       |                      |                |                       |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –                     | (141.215.249)        | –              | (141.215.249)         |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>–</b>              | <b>(141.215.249)</b> | <b>–</b>       | <b>(141.215.249)</b>  |

Macro Opportunities FX

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 30. Juni 2023

|   | Stufe 1<br>EUR | Stufe 2<br>EUR     | Stufe 3<br>EUR | Insgesamt<br>EUR   |
|---|----------------|--------------------|----------------|--------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                |                    |                |                    |
| Schatzwechsel   | –              | 6.291.574          | –              | 6.291.574          |
| Unternehmensanleihen  | –              | 24.544.223         | –              | 24.544.223         |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –              | 3.275.979          | –              | 3.275.979          |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>–</b>       | <b>34.111.776</b>  | <b>–</b>       | <b>34.111.776</b>  |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                |                    |                |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –              | (4.247.855)        | –              | (4.247.855)        |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>–</b>       | <b>(4.247.855)</b> | <b>–</b>       | <b>(4.247.855)</b> |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

|   | Stufe 1<br>EUR | Stufe 2<br>EUR     | Stufe 3<br>EUR | Insgesamt<br>EUR   |
|---|----------------|--------------------|----------------|--------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                |                    |                |                    |
| Unternehmensanleihen  | –              | 24.967.521         | –              | 24.967.521         |
| Staatsanleihen  | –              | 2.778.639          | –              | 2.778.639          |
| Schatzwechsel   | –              | 4.389.983          | –              | 4.389.983          |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –              | 3.617.207          | –              | 3.617.207          |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>–</b>       | <b>35.753.350</b>  | <b>–</b>       | <b>35.753.350</b>  |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                |                    |                |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –              | (4.428.576)        | –              | (4.428.576)        |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>–</b>       | <b>(4.428.576)</b> | <b>–</b>       | <b>(4.428.576)</b> |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 10. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Multi-Asset Income

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 30. Juni 2023

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$  | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-----------------|------------------|-----------------|-------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                 |                  |                 |                   |
| Aktien  | 248.994         | –                | –               | 248.994           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –               | 116.411          | –               | 116.411           |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>248.994</b>  | <b>116.411</b>   | <b>–</b>        | <b>365.405</b>    |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                 |                  |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –               | (110.257)        | –               | (110.257)         |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>–</b>        | <b>(110.257)</b> | <b>–</b>        | <b>(110.257)</b>  |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

|   | Stufe 1<br>US\$  | Stufe 2<br>US\$  | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|------------------|------------------|-----------------|-------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                  |                  |                 |                   |
| Agency Bonds  | –                | 7.644            | –               | 7.644             |
| Unternehmensanleihen  | –                | 4.880.908        | –               | 4.880.908         |
| Aktien  | 2.520.628        | 327.820          | –               | 2.848.448         |
| Staatsanleihen  | –                | 311.601          | –               | 311.601           |
| Investmentfonds   | 29.623           | 572.562          | –               | 602.185           |
| Gekaufte Optionskontrakte                                     | 4.207            | –                | –               | 4.207             |
| Immobilienaktiengesellschaften                                | 364.808          | –                | –               | 364.808           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –                | 160.435          | –               | 160.435           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten              | 51.032           | –                | –               | 51.032            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>2.970.298</b> | <b>6.260.970</b> | <b>–</b>        | <b>9.231.268</b>  |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                  |                  |                 |                   |
| Verkaufte Optionskontrakte                                    | (59.717)         | –                | –               | (59.717)          |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –                | (584.335)        | –               | (584.335)         |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten             | (2.994)          | –                | –               | (2.994)           |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>(62.711)</b>  | <b>(584.335)</b> | <b>–</b>        | <b>(647.046)</b>  |

FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

10. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Next Generation Mobility

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 30. Juni 2023

|   | Stufe 1<br>US\$    | Stufe 2<br>US\$  | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|--------------------|------------------|-----------------|--------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                    |                  |                 |                    |
| Aktien  | 147.810.644        | 9.929.155        | –               | 157.739.799        |
| Immobilienaktiengesellschaften                                | 1.656.241          | –                | –               | 1.656.241          |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –                  | 1.543            | –               | 1.543              |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>149.466.885</b> | <b>9.930.698</b> | <b>–</b>        | <b>159.397.583</b> |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                    |                  |                 |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –                  | (4.261)          | –               | (4.261)            |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>–</b>           | <b>(4.261)</b>   | <b>–</b>        | <b>(4.261)</b>     |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

|   | Stufe 1<br>US\$    | Stufe 2<br>US\$  | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|--------------------|------------------|-----------------|--------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                    |                  |                 |                    |
| Aktien  | 129.334.927        | 7.542.858        | –               | 136.877.785        |
| Immobilienaktiengesellschaften                                | 1.522.531          | –                | –               | 1.522.531          |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –                  | 294.328          | –               | 294.328            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>130.857.458</b> | <b>7.837.186</b> | <b>–</b>        | <b>138.694.644</b> |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                    |                  |                 |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –                  | (213.661)        | –               | (213.661)          |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>–</b>           | <b>(213.661)</b> | <b>–</b>        | <b>(213.661)</b>   |

Next Generation Space Economy<sup>1</sup>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 30. Juni 2023

|  | Stufe 1<br>US\$   | Stufe 2<br>US\$  | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|--|-------------------|------------------|-----------------|-------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b> |                   |                  |                 |                   |
| Aktien   | 11.288.920        | 1.996.146        | 13.488          | 13.298.554        |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                            | <b>11.288.920</b> | <b>1.996.146</b> | <b>13.488</b>   | <b>13.298.554</b> |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 10. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Next Generation Space Economy<sup>1</sup> (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|--|-----------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b> |                 |                 |                 |                   |
| Aktien   | 6.156.111       | 1.825.563       | –               | 7.981.674         |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                            | 6.156.111       | 1.825.563       | –               | 7.981.674         |

## Short Duration Emerging Market Debt

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 30. Juni 2023

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|--|-----------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b> |                 |                 |                 |                   |
| Schatzwechsel  | –               | 149.927.648     | –               | 149.927.648       |
| Unternehmensanleihen                                       | –               | 3.140.210.790   | 500.000         | 3.140.710.790     |
| Staatsanleihen   | –               | 1.326.789.239   | –               | 1.326.789.239     |
| Investmentfonds  | –               | 72.567.450      | –               | 72.567.450        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten      | –               | 31.984.722      | –               | 31.984.722        |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                            | –               | 4.721.479.849   | 500.000         | 4.721.979.849     |

**Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten**

|  |   |              |   |              |
|--|---|--------------|---|--------------|
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                           | – | (752.400)    | – | (752.400)    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (31.766.279) | – | (31.766.279) |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | – | (32.518.679) | – | (32.518.679) |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|--|-----------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b> |                 |                 |                 |                   |
| Unternehmensanleihen                                       | –               | 3.527.185.607   | 500.000         | 3.527.685.607     |
| Staatsanleihen   | –               | 1.205.827.702   | –               | 1.205.827.702     |
| Investmentfonds  | –               | 70.347.000      | –               | 70.347.000        |
| Schatzwechsel  | –               | 51.075.667      | –               | 51.075.667        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten      | –               | 46.700.064      | –               | 46.700.064        |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                            | –               | 4.901.136.040   | 500.000         | 4.901.636.040     |

**Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten**

|  |   |              |   |              |
|--|---|--------------|---|--------------|
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                           | – | (1.843.240)  | – | (1.843.240)  |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (23.986.773) | – | (23.986.773) |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | – | (25.830.013) | – | (25.830.013) |

FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

10. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Short Duration High Yield SDG Engagement

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 30. Juni 2023

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                 |                 |                 |                   |
| Unternehmensanleihen  | –               | 658.803.630     | –               | 658.803.630       |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen                          | –               | 41.150.626      | –               | 41.150.626        |
| Investmentfonds   | 591.136         | –               | –               | 591.136           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –               | 1.415.296       | –               | 1.415.296         |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | 591.136         | 701.369.552     | –               | 701.960.688       |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                 |                 |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –               | (16.944.350)    | –               | (16.944.350)      |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | –               | (16.944.350)    | –               | (16.944.350)      |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                 |                 |                 |                   |
| Unternehmensanleihen  | –               | 477.638.711     | –               | 477.638.711       |
| Investmentfonds   | 1.221.039       | –               | –               | 1.221.039         |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen                          | –               | 23.578.927      | –               | 23.578.927        |
| Schatzwechsel   | –               | 10.810.063      | –               | 10.810.063        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –               | 23.012.144      | –               | 23.012.144        |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | 1.221.039       | 535.039.845     | –               | 536.260.884       |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                 |                 |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –               | (5.286.451)     | –               | (5.286.451)       |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | –               | (5.286.451)     | –               | (5.286.451)       |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 10. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Strategic Income

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 30. Juni 2023

|   | Stufe 1<br>US\$    | Stufe 2<br>US\$      | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$    |
|---|--------------------|----------------------|-----------------|----------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                    |                      |                 |                      |
| Aktien  | –                  | 27.776               | –               | 27.776               |
| Schatzwechsel   | –                  | 52.240.976           | –               | 52.240.976           |
| Agency Bonds  | –                  | 791.771              | –               | 791.771              |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)               | –                  | 134.247.605          | –               | 134.247.605          |
| Unternehmensanleihen  | –                  | 503.902.134          | –               | 503.902.134          |
| Staatsanleihen  | –                  | 258.627.687          | –               | 258.627.687          |
| Mortgage-Backed Securities                                    | –                  | 589.853.152          | –               | 589.853.152          |
| Kommunalanleihen  | –                  | 12.773.846           | –               | 12.773.846           |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen                          | –                  | 395.563              | –               | 395.563              |
| Investmentfonds   | 357.616            | 59.026.856           | –               | 59.384.472           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –                  | 4.275.407            | –               | 4.275.407            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten              | 449.625            | –                    | –               | 449.625              |
| Gekaufte Optionskontrakte                                     | 5.750              | –                    | –               | 5.750                |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten              | –                  | 685.495              | –               | 685.495              |
| Nicht realisierter Gewinn aus Inflation-Swap-Kontrakten       | –                  | 31.002               | –               | 31.002               |
| Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten    | –                  | 499.398              | –               | 499.398              |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>812.991</b>     | <b>1.617.378.668</b> | <b>–</b>        | <b>1.618.191.659</b> |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                    |                      |                 |                      |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –                  | (27.047.783)         | –               | (27.047.783)         |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten             | (3.646.362)        | –                    | –               | (3.646.362)          |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten     | –                  | (86.715)             | –               | (86.715)             |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten             | –                  | (1.190.643)          | –               | (1.190.643)          |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>(3.646.362)</b> | <b>(28.325.141)</b>  | <b>–</b>        | <b>(31.971.503)</b>  |



FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

10. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Strategic Income (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

|   | Stufe 1<br>US\$    | Stufe 2<br>US\$      | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$    |
|---|--------------------|----------------------|-----------------|----------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                    |                      |                 |                      |
| Agency Bonds  | –                  | 772.053              | –               | 772.053              |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)               | –                  | 105.467.359          | –               | 105.467.359          |
| Unternehmensanleihen  | –                  | 637.567.177          | –               | 637.567.177          |
| Staatsanleihen  | –                  | 243.357.365          | –               | 243.357.365          |
| Investmentfonds   | 738.685            | 57.487.152           | –               | 58.225.837           |
| Mortgage-Backed Securities                                    | –                  | 346.893.475          | –               | 346.893.475          |
| Kommunalanleihen  | –                  | 20.744.098           | –               | 20.744.098           |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen                          | –                  | 453.664              | 126.140         | 579.804              |
| Schatzwechsel   | –                  | 8.017.122            | –               | 8.017.122            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –                  | 29.520.687           | –               | 29.520.687           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten              | 2.904.814          | –                    | –               | 2.904.814            |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten     | –                  | 25.894               | –               | 25.894               |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten              | –                  | 451.266              | –               | 451.266              |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>3.643.499</b>   | <b>1.450.757.312</b> | <b>126.140</b>  | <b>1.454.526.951</b> |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                    |                      |                 |                      |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –                  | (7.161.491)          | –               | (7.161.491)          |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten             | (1.425.842)        | –                    | –               | (1.425.842)          |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten     | –                  | (97.587)             | –               | (97.587)             |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten             | –                  | (916.187)            | –               | (916.187)            |
| Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten   | –                  | (3.863.949)          | –               | (3.863.949)          |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>(1.425.842)</b> | <b>(12.039.214)</b>  | <b>–</b>        | <b>(13.465.056)</b>  |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 10. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Sustainable Asia High Yield

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 30. Juni 2023

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$   | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-----------------|-------------------|-----------------|-------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                 |                   |                 |                   |
| Unternehmensanleihen  | –               | 24.443.469        | –               | 24.443.469        |
| Staatsanleihen  | –               | 1.814.804         | –               | 1.814.804         |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –               | 16.790            | –               | 16.790            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten              | 26.898          | –                 | –               | 26.898            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>26.898</b>   | <b>26.275.063</b> | <b>–</b>        | <b>26.301.961</b> |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                 |                   |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –               | (12.886)          | –               | (12.886)          |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten             | (1.250)         | –                 | –               | (1.250)           |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>(1.250)</b>  | <b>(12.886)</b>   | <b>–</b>        | <b>(14.136)</b>   |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$   | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-----------------|-------------------|-----------------|-------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                 |                   |                 |                   |
| Unternehmensanleihen  | –               | 27.495.016        | –               | 27.495.016        |
| Staatsanleihen  | –               | 837.924           | –               | 837.924           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –               | 282.337           | –               | 282.337           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten              | 13.122          | –                 | –               | 13.122            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>13.122</b>   | <b>28.615.277</b> | <b>–</b>        | <b>28.628.399</b> |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                 |                   |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –               | (29.229)          | –               | (29.229)          |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>–</b>        | <b>(29.229)</b>   | <b>–</b>        | <b>(29.229)</b>   |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 10. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Sustainable Emerging Market Corporate Debt

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 30. Juni 2023

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$   | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-----------------|-------------------|-----------------|-------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                 |                   |                 |                   |
| Unternehmensanleihen  | –               | 85.086.931        | –               | 85.086.931        |
| Staatsanleihen  | –               | 7.025.638         | –               | 7.025.638         |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –               | 786.057           | –               | 786.057           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten              | 84.680          | –                 | –               | 84.680            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>84.680</b>   | <b>92.898.626</b> | <b>–</b>        | <b>92.983.306</b> |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                 |                   |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –               | (173.017)         | –               | (173.017)         |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten             | (21.953)        | –                 | –               | (21.953)          |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>(21.953)</b> | <b>(173.017)</b>  | <b>–</b>        | <b>(194.970)</b>  |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$   | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-----------------|-------------------|-----------------|-------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                 |                   |                 |                   |
| Unternehmensanleihen  | –               | 86.982.672        | –               | 86.982.672        |
| Staatsanleihen  | –               | 4.401.408         | –               | 4.401.408         |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –               | 853.222           | –               | 853.222           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten              | 49.937          | –                 | –               | 49.937            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>49.937</b>   | <b>92.237.302</b> | <b>–</b>        | <b>92.287.239</b> |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                 |                   |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –               | (134.345)         | –               | (134.345)         |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten             | (7.617)         | –                 | –               | (7.617)           |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>(7.617)</b>  | <b>(134.345)</b>  | <b>–</b>        | <b>(141.962)</b>  |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 10. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency<sup>1</sup>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 30. Juni 2023

|   | Stufe 1<br>US\$    | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|--------------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                    |                    |                 |                    |
| Unternehmensanleihen  | –                  | 17.054.936         | –               | 17.054.936         |
| Staatsanleihen  | –                  | 307.548.361        | –               | 307.548.361        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –                  | 3.091.691          | –               | 3.091.691          |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten              | 1.122.298          | –                  | –               | 1.122.298          |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten     | –                  | 83.107             | –               | 83.107             |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>1.122.298</b>   | <b>327.778.095</b> | <b>–</b>        | <b>328.900.393</b> |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                    |                    |                 |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –                  | (2.032.742)        | –               | (2.032.742)        |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten             | (1.502.018)        | –                  | –               | (1.502.018)        |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>(1.502.018)</b> | <b>(2.032.742)</b> | <b>–</b>        | <b>(3.534.760)</b> |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

|   | Stufe 1<br>US\$  | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|------------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                  |                    |                 |                    |
| Unternehmensanleihen  | –                | 7.708.197          | –               | 7.708.197          |
| Staatsanleihen  | –                | 136.106.159        | –               | 136.106.159        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –                | 1.237.337          | –               | 1.237.337          |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten              | 2.512.729        | –                  | –               | 2.512.729          |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten     | –                | 53.826             | –               | 53.826             |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>2.512.729</b> | <b>145.105.519</b> | <b>–</b>        | <b>147.618.248</b> |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                  |                    |                 |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –                | (862.058)          | –               | (862.058)          |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten             | (46.430)         | –                  | –               | (46.430)           |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>(46.430)</b>  | <b>(862.058)</b>   | <b>–</b>        | <b>(908.488)</b>   |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 10. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Systematic Global Sustainable Value

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 30. Juni 2023

|   | Stufe 1<br>US\$   | Stufe 2<br>US\$  | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-------------------|------------------|-----------------|-------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                   |                  |                 |                   |
| Aktien  | 37.125.704        | 7.612.491        | –               | 44.738.195        |
| Immobilienaktiengesellschaften                                | 953.621           | 123.504          | –               | 1.077.125         |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –                 | 8.117            | –               | 8.117             |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>38.079.325</b> | <b>7.744.112</b> | <b>–</b>        | <b>45.823.437</b> |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                   |                  |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –                 | (10.841)         | –               | (10.841)          |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>–</b>          | <b>(10.841)</b>  | <b>–</b>        | <b>(10.841)</b>   |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

|   | Stufe 1<br>US\$   | Stufe 2<br>US\$  | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-------------------|------------------|-----------------|-------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                   |                  |                 |                   |
| Aktien  | 37.427.578        | 9.532.811        | –               | 46.960.389        |
| Immobilienaktiengesellschaften                                | 545.905           | 209.532          | –               | 755.437           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –                 | 125.312          | –               | 125.312           |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>37.973.483</b> | <b>9.867.655</b> | <b>–</b>        | <b>47.841.138</b> |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                   |                  |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –                 | (90.456)         | –               | (90.456)          |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>–</b>          | <b>(90.456)</b>  | <b>–</b>        | <b>(90.456)</b>   |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 10. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Ultra Short Term Euro Bond

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 30. Juni 2023

|   | Stufe 1<br>EUR   | Stufe 2<br>EUR     | Stufe 3<br>EUR | Insgesamt<br>EUR   |
|---|------------------|--------------------|----------------|--------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                  |                    |                |                    |
| Schatzwechsel   | –                | 8.814.082          | –              | 8.814.082          |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)               | –                | 82.768.897         | –              | 82.768.897         |
| Unternehmensanleihen  | –                | 706.243.010        | –              | 706.243.010        |
| Staatsanleihen  | –                | 65.674.673         | –              | 65.674.673         |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –                | 580.681            | –              | 580.681            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten              | 203.260          | –                  | –              | 203.260            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>203.260</b>   | <b>864.081.343</b> | <b>–</b>       | <b>864.284.603</b> |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                  |                    |                |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –                | (3.673)            | –              | (3.673)            |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten             | (838.911)        | –                  | –              | (838.911)          |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten     | –                | (1.053.137)        | –              | (1.053.137)        |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten             | –                | (1.153.715)        | –              | (1.153.715)        |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>(838.911)</b> | <b>(2.210.525)</b> | <b>–</b>       | <b>(3.049.436)</b> |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

|   | Stufe 1<br>EUR     | Stufe 2<br>EUR     | Stufe 3<br>EUR | Insgesamt<br>EUR    |
|---|--------------------|--------------------|----------------|---------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                    |                    |                |                     |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)               | –                  | 72.343.961         | –              | 72.343.961          |
| Unternehmensanleihen  | –                  | 670.503.994        | –              | 670.503.994         |
| Staatsanleihen  | –                  | 56.450.113         | –              | 56.450.113          |
| Nicht realisierter Gewinn aus Inflation-Swap-Kontrakten       | –                  | 9.296              | –              | 9.296               |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –                  | 232.108            | –              | 232.108             |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten              | 9.402.701          | –                  | –              | 9.402.701           |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>9.402.701</b>   | <b>799.539.472</b> | <b>–</b>       | <b>808.942.173</b>  |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                    |                    |                |                     |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –                  | (6.570.781)        | –              | (6.570.781)         |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten             | (1.719.108)        | –                  | –              | (1.719.108)         |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten     | –                  | (543.950)          | –              | (543.950)           |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten             | –                  | (1.735.988)        | –              | (1.735.988)         |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>(1.719.108)</b> | <b>(8.850.719)</b> | <b>–</b>       | <b>(10.569.827)</b> |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 10. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Uncorrelated Strategies

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 30. Juni 2023

|   | Stufe 1<br>US\$     | Stufe 2<br>US\$      | Stufe 3<br>US\$   | Insgesamt<br>US\$    |
|---|---------------------|----------------------|-------------------|----------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                     |                      |                   |                      |
| Aktien  | 87.788.738          | 131.130.168          | –                 | 218.918.906          |
| Immobilienaktiengesellschaften                                | 251.046             | –                    | –                 | 251.046              |
| Participatory Notes   | 279.179             | –                    | –                 | 279.179              |
| Schatzwechsel   | –                   | 1.055.857.127        | –                 | 1.055.857.127        |
| Unternehmensanleihen  | –                   | 266.140.458          | –                 | 266.140.458          |
| Staatsanleihen  | –                   | 21.269.196           | –                 | 21.269.196           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –                   | 91.836.753           | –                 | 91.836.753           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten              | 60.354.516          | –                    | –                 | 60.354.516           |
| Gekaufte Optionskontrakte                                     | 50.468.613          | 191.542.404          | 3.014.301         | 245.025.318          |
| Nicht realisierter Gewinn aus Differenzkontrakten             | –                   | 101.263.748          | 621               | 101.264.369          |
| Beizulegender Zeitwert aus gekauften Swaptions                | –                   | 96.439               | –                 | 96.439               |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten     | –                   | –                    | 156.038           | 156.038              |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten              | –                   | 26.832.287           | –                 | 26.832.287           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten    | –                   | 1.794.588            | –                 | 1.794.588            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Correlation-Swap-Kontrakten     | –                   | –                    | 397.208           | 397.208              |
| Nicht realisierter Gewinn aus Variance-Swap-Kontrakten        | –                   | –                    | 3.190.181         | 3.190.181            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Volatility-Swap-Kontrakten      | –                   | 8.087.297            | 17.451.529        | 25.538.826           |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>199.142.092</b>  | <b>1.895.850.465</b> | <b>24.209.878</b> | <b>2.119.202.435</b> |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                     |                      |                   |                      |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –                   | (54.994.415)         | –                 | (54.994.415)         |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten             | (21.016.163)        | –                    | –                 | (21.016.163)         |
| Verkaufte Optionskontrakte                                    | (15.005.678)        | (309.450.591)        | (700)             | (324.456.969)        |
| Nicht realisierter Verlust aus Differenzkontrakten            | –                   | (138.871.734)        | (266.446)         | (139.138.180)        |
| Beizulegender Zeitwert aus verkaufte Swaptions                | –                   | (43.457)             | –                 | (43.457)             |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten     | –                   | (442.272)            | –                 | (442.272)            |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten             | –                   | (12.007.251)         | –                 | (12.007.251)         |
| Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten   | –                   | (4.917.824)          | –                 | (4.917.824)          |
| Nicht realisierter Verlust aus Variance-Swap-Kontrakten       | –                   | –                    | (534.614)         | (534.614)            |
| Nicht realisierter Verlust aus Volatility-Swap-Kontrakten     | –                   | (493.545)            | (115.425)         | (608.970)            |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>(36.021.841)</b> | <b>(521.221.089)</b> | <b>(917.185)</b>  | <b>(558.160.115)</b> |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 10. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

|   | Stufe 1<br>US\$     | Stufe 2<br>US\$      | Stufe 3<br>US\$  | Insgesamt<br>US\$    |
|---|---------------------|----------------------|------------------|----------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                     |                      |                  |                      |
| Unternehmensanleihen  | –                   | 161.387.060          | –                | 161.387.060          |
| Aktien  | 135.368.028         | –                    | –                | 135.368.028          |
| Staatsanleihen  | –                   | 4.218.750            | –                | 4.218.750            |
| Participatory Notes   | 21.440              | –                    | –                | 21.440               |
| Immobilienaktiengesellschaften                                | 4.976.282           | –                    | –                | 4.976.282            |
| Schatzwechsel   | –                   | 1.582.793.462        | –                | 1.582.793.462        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –                   | 212.294.005          | –                | 212.294.005          |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten              | 40.643.851          | –                    | –                | 40.643.851           |
| Gekaufte Optionskontrakte                                     | 73.572.721          | 128.636.328          | 551.147          | 202.760.196          |
| Nicht realisierter Gewinn aus Differenzkontrakten             | –                   | 78.117.298           | 714              | 78.118.012           |
| Gekaufte Swaptions  | –                   | 1.388.392            | –                | 1.388.392            |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten     | –                   | 1.435.658            | –                | 1.435.658            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten              | –                   | 65.682.162           | –                | 65.682.162           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Inflation-Swap-Kontrakten       | –                   | 27.160.802           | –                | 27.160.802           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten    | –                   | 3.899.449            | –                | 3.899.449            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Correlation-Swap-Kontrakten     | –                   | 700.944              | –                | 700.944              |
| Nicht realisierter Gewinn aus Variance-Swap-Kontrakten        | –                   | 971.550              | –                | 971.550              |
| Nicht realisierter Gewinn aus Volatility-Swap-Kontrakten      | –                   | 32.121.676           | –                | 32.121.676           |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>254.582.322</b>  | <b>2.300.807.536</b> | <b>551.861</b>   | <b>2.555.941.719</b> |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                     |                      |                  |                      |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –                   | (37.812.332)         | –                | (37.812.332)         |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten             | (25.288.052)        | –                    | –                | (25.288.052)         |
| Verkaufte Optionskontrakte                                    | (25.955.164)        | (284.022.074)        | (5.880)          | (309.983.118)        |
| Nicht realisierter Verlust aus Differenzkontrakten            | –                   | (58.427.650)         | (288.575)        | (58.716.225)         |
| Verkaufte Swaptionen  | –                   | (708.024)            | –                | (708.024)            |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten     | –                   | (526.998)            | –                | (526.998)            |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten             | –                   | (23.945.145)         | –                | (23.945.145)         |
| Nicht realisierter Verlust aus Inflation-Swap-Kontrakten      | –                   | (26.861.904)         | –                | (26.861.904)         |
| Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten   | –                   | (1.242.422)          | –                | (1.242.422)          |
| Nicht realisierter Verlust aus Correlation-Swap-Kontrakten    | –                   | (60.576)             | –                | (60.576)             |
| Nicht realisierter Verlust aus Variance-Swap-Kontrakten       | –                   | (421.247)            | –                | (421.247)            |
| Nicht realisierter Verlust aus Volatility-Swap-Kontrakten     | –                   | (4.417.825)          | –                | (4.417.825)          |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>(51.243.216)</b> | <b>(438.446.197)</b> | <b>(294.455)</b> | <b>(489.983.868)</b> |



## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 10. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Uncorrelated Trading\*

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

|   | Stufe 1<br>US\$     | Stufe 2<br>US\$     | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$   |
|---|---------------------|---------------------|-----------------|---------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                     |                     |                 |                     |
| Unternehmensanleihen  | –                   | 13.221.435          | –               | 13.221.435          |
| Aktien  | 16.089.324          | –                   | –               | 16.089.324          |
| Immobilienaktiengesellschaften                                | 3.946.436           | –                   | –               | 3.946.436           |
| Schatzwechsel   | –                   | 449.200.010         | –               | 449.200.010         |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –                   | 54.485.356          | –               | 54.485.356          |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten              | 8.521.839           | –                   | –               | 8.521.839           |
| Gekaufte Optionskontrakte                                     | 15.415.785          | 20.361.008          | 81.777          | 35.858.570          |
| Nicht realisierter Gewinn aus Differenzkontrakten             | –                   | 13.934.583          | –               | 13.934.583          |
| Gekaufte Swaptions  | –                   | 68.848              | –               | 68.848              |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten              | –                   | 1.024.404           | –               | 1.024.404           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten    | –                   | 678.244             | –               | 678.244             |
| Nicht realisierter Gewinn aus Variance-Swap-Kontrakten        | –                   | 319.127             | –               | 319.127             |
| Nicht realisierter Gewinn aus Volatility-Swap-Kontrakten      | –                   | 1.343.255           | –               | 1.343.255           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Correlation-Swap-Kontrakten     | –                   | 0                   | –               | 0                   |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>43.973.384</b>   | <b>554.636.270</b>  | <b>81.777</b>   | <b>598.691.431</b>  |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                     |                     |                 |                     |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –                   | (6.317.151)         | –               | (6.317.151)         |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten             | (4.922.598)         | –                   | –               | (4.922.598)         |
| Verkaufte Optionskontrakte                                    | (5.613.286)         | (36.846.894)        | –               | (42.460.180)        |
| Nicht realisierter Verlust aus Differenzkontrakten            | –                   | (3.269.736)         | –               | (3.269.736)         |
| Verkaufte Swaptionen  | –                   | (20.738)            | –               | (20.738)            |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten     | –                   | (47.926)            | –               | (47.926)            |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten             | –                   | (1.000.582)         | –               | (1.000.582)         |
| Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten   | –                   | (13.154)            | –               | (13.154)            |
| Nicht realisierter Verlust aus Variance-Swap-Kontrakten       | –                   | (332.219)           | –               | (332.219)           |
| Nicht realisierter Verlust aus Volatility-Swap-Kontrakten     | –                   | (939.941)           | –               | (939.941)           |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>(10.535.884)</b> | <b>(48.788.341)</b> | <b>–</b>        | <b>(59.324.225)</b> |

\* Das Portfolio wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst.

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 10. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## US Equity

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 30. Juni 2023

|   | Stufe 1<br>US\$   | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|-------------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                   |                    |                 |                    |
| Aktien  | 39.867.991        | –                  | –               | 39.867.991         |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –                 | 145.198            | –               | 145.198            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>39.867.991</b> | <b>145.198</b>     | <b>–</b>        | <b>40.013.189</b>  |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                   |                    |                 |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –                 | (2.702.136)        | –               | (2.702.136)        |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>–</b>          | <b>(2.702.136)</b> | <b>–</b>        | <b>(2.702.136)</b> |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

|   | Stufe 1<br>US\$   | Stufe 2<br>US\$  | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-------------------|------------------|-----------------|-------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                   |                  |                 |                   |
| Aktien  | 27.005.260        | –                | –               | 27.005.260        |
| Immobilienaktiengesellschaften                                | 478.769           | –                | –               | 478.769           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –                 | 2.158.080        | –               | 2.158.080         |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>27.484.029</b> | <b>2.158.080</b> | <b>–</b>        | <b>29.642.109</b> |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                   |                  |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –                 | (546.931)        | –               | (546.931)         |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>–</b>          | <b>(546.931)</b> | <b>–</b>        | <b>(546.931)</b>  |

## US Equity Index PutWrite

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 30. Juni 2023

|   | Stufe 1<br>US\$    | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|--------------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                    |                    |                 |                    |
| Staatsanleihen  | –                  | 627.916.897        | –               | 627.916.897        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –                  | 5.431.250          | –               | 5.431.250          |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>–</b>           | <b>633.348.147</b> | <b>–</b>        | <b>633.348.147</b> |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                    |                    |                 |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –                  | (248.672)          | –               | (248.672)          |
| Verkaufte Indexoptionskontrakte                               | (3.126.234)        | –                  | –               | (3.126.234)        |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>(3.126.234)</b> | <b>(248.672)</b>   | <b>–</b>        | <b>(3.374.906)</b> |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 10. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## US Equity Index PutWrite (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                 |                 |                 |                   |
| Staatsanleihen  | –               | 632.264.076     | –               | 632.264.076       |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –               | 16.592.327      | –               | 16.592.327        |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | –               | 648.856.403     | –               | 648.856.403       |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                 |                 |                 |                   |
| Verkaufte Optionskontrakte                                    | (12.932.325)    | –               | –               | (12.932.325)      |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –               | (1.350.871)     | –               | (1.350.871)       |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | (12.932.325)    | (1.350.871)     | –               | (14.283.196)      |

## US Large Cap Value

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 30. Juni 2023

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                 |                 |                 |                   |
| Aktien  | 1.776.648.074   | –               | –               | 1.776.648.074     |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –               | 79.357          | –               | 79.357            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | 1.776.648.074   | 79.357          | –               | 1.776.727.431     |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                 |                 |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –               | (203.695)       | –               | (203.695)         |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | –               | (203.695)       | –               | (203.695)         |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                 |                 |                 |                   |
| Aktien  | 1.688.625.847   | –               | –               | 1.688.625.847     |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –               | 973.737         | –               | 973.737           |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | 1.688.625.847   | 973.737         | –               | 1.689.599.584     |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                 |                 |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –               | (102.612)       | –               | (102.612)         |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | –               | (102.612)       | –               | (102.612)         |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 10. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## US Long Short Equity

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 30. Juni 2023

|   | Stufe 1<br>US\$    | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|--------------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                    |                    |                 |                    |
| Aktien  | 176.618.832        | –                  | –               | 176.618.832        |
| Immobilienaktiengesellschaften                                | 2.347.373          | –                  | –               | 2.347.373          |
| Unternehmensanleihen  | –                  | 10.575.797         | –               | 10.575.797         |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –                  | 103.859            | –               | 103.859            |
| Gekaufte Optionskontrakte                                     | 11.733             | –                  | –               | 11.733             |
| Nicht realisierter Gewinn aus Differenzkontrakten             | –                  | 666.632            | –               | 666.632            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>178.977.938</b> | <b>11.346.288</b>  | <b>–</b>        | <b>190.324.226</b> |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                    |                    |                 |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –                  | (579.201)          | –               | (579.201)          |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten             | (895.201)          | –                  | –               | (895.201)          |
| Verkaufte Optionskontrakte                                    | (54.237)           | –                  | –               | (54.237)           |
| Nicht realisierter Verlust aus Differenzkontrakten            | –                  | (3.096.576)        | –               | (3.096.576)        |
| Nicht realisierter Verlust aus Return--Swap-Kontrakten        | –                  | (3.765.767)        | –               | (3.765.767)        |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>(949.438)</b>   | <b>(7.441.544)</b> | <b>–</b>        | <b>(8.390.982)</b> |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

|   | Stufe 1<br>US\$    | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|--------------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                    |                    |                 |                    |
| Unternehmensanleihen  | –                  | 8.400.448          | –               | 8.400.448          |
| Aktien  | 156.744.366        | 1.265.964          | –               | 158.010.330        |
| Participatory Notes   | 3.750              | –                  | –               | 3.750              |
| Immobilienaktiengesellschaften                                | 1.744.930          | –                  | –               | 1.744.930          |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –                  | 6.686.844          | –               | 6.686.844          |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten              | 470.254            | –                  | –               | 470.254            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Differenzkontrakten             | –                  | 3.162.728          | –               | 3.162.728          |
| Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten    | –                  | 664.406            | –               | 664.406            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>158.963.300</b> | <b>20.180.390</b>  | <b>–</b>        | <b>179.143.690</b> |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                    |                    |                 |                    |
| Verkaufte Optionskontrakte                                    | (74.360)           | –                  | –               | (74.360)           |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –                  | (822.791)          | –               | (822.791)          |
| Nicht realisierter Verlust aus Differenzkontrakten            | –                  | (1.291.811)        | –               | (1.291.811)        |
| Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten   | –                  | (700.901)          | –               | (700.901)          |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>(74.360)</b>    | <b>(2.815.503)</b> | <b>–</b>        | <b>(2.889.863)</b> |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 10. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## US Multi Cap Opportunities

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 30. Juni 2023

|   | Stufe 1<br>US\$    | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|--------------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                    |                    |                 |                    |
| Aktien  | 414.573.722        | –                  | –               | 414.573.722        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –                  | 458.319            | –               | 458.319            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>414.573.722</b> | <b>458.319</b>     | <b>–</b>        | <b>415.032.041</b> |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                    |                    |                 |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –                  | (1.390.983)        | –               | (1.390.983)        |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>–</b>           | <b>(1.390.983)</b> | <b>–</b>        | <b>(1.390.983)</b> |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

|   | Stufe 1<br>US\$    | Stufe 2<br>US\$  | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|--------------------|------------------|-----------------|--------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                    |                  |                 |                    |
| Aktien  | 439.025.865        | –                | –               | 439.025.865        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –                  | 2.736.142        | –               | 2.736.142          |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>439.025.865</b> | <b>2.736.142</b> | <b>–</b>        | <b>441.762.007</b> |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                    |                  |                 |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –                  | (587.402)        | –               | (587.402)          |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>–</b>           | <b>(587.402)</b> | <b>–</b>        | <b>(587.402)</b>   |

## US Real Estate Securities

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 30. Juni 2023

|   | Stufe 1<br>US\$    | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|--------------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                    |                    |                 |                    |
| Immobilienaktiengesellschaften                                | 545.757.055        | –                  | –               | 545.757.055        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –                  | 164.230            | –               | 164.230            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>545.757.055</b> | <b>164.230</b>     | <b>–</b>        | <b>545.921.285</b> |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                    |                    |                 |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –                  | (1.253.756)        | –               | (1.253.756)        |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>–</b>           | <b>(1.253.756)</b> | <b>–</b>        | <b>(1.253.756)</b> |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 10. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## US Real Estate Securities (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

|   | Stufe 1<br>US\$    | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|--------------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                    |                    |                 |                    |
| Immobilienaktiengesellschaften                                | 624.531.489        | –                  | –               | 624.531.489        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –                  | 4.089.640          | –               | 4.089.640          |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>624.531.489</b> | <b>4.089.640</b>   | <b>–</b>        | <b>628.621.129</b> |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                    |                    |                 |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –                  | (1.230.032)        | –               | (1.230.032)        |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>–</b>           | <b>(1.230.032)</b> | <b>–</b>        | <b>(1.230.032)</b> |

## US Small Cap

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 30. Juni 2023

|   | Stufe 1<br>US\$    | Stufe 2<br>US\$  | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|--------------------|------------------|-----------------|--------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                    |                  |                 |                    |
| Aktien  | 621.544.384        | 3.417.007        | –               | 624.961.391        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –                  | 38.380           | –               | 38.380             |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>621.544.384</b> | <b>3.455.387</b> | <b>–</b>        | <b>624.999.771</b> |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                    |                  |                 |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –                  | (172.250)        | –               | (172.250)          |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>–</b>           | <b>(172.250)</b> | <b>–</b>        | <b>(172.250)</b>   |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

|   | Stufe 1<br>US\$    | Stufe 2<br>US\$  | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|--------------------|------------------|-----------------|--------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                    |                  |                 |                    |
| Aktien  | 578.779.674        | –                | –               | 578.779.674        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –                  | 949.457          | –               | 949.457            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>578.779.674</b> | <b>949.457</b>   | <b>–</b>        | <b>579.729.131</b> |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                    |                  |                 |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –                  | (236.699)        | –               | (236.699)          |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>–</b>           | <b>(236.699)</b> | <b>–</b>        | <b>(236.699)</b>   |

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 10. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## US Small Cap Intrinsic Value

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 30. Juni 2023

|  | Stufe 1<br>US\$    | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|--|--------------------|-----------------|-----------------|--------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b> |                    |                 |                 |                    |
| Aktien   | 253.897.668        | –               | –               | 253.897.668        |
| Immobilienaktiengesellschaften                             | 1.527.461          | –               | –               | 1.527.461          |
| Unternehmensanleihen                                       | –                  | –               | 0               | 0                  |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                            | <b>255.425.129</b> | <b>–</b>        | <b>0</b>        | <b>255.425.129</b> |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

|  | Stufe 1<br>US\$    | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|--|--------------------|-----------------|-----------------|--------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b> |                    |                 |                 |                    |
| Aktien   | 184.718.734        | –               | –               | 184.718.734        |
| Immobilienaktiengesellschaften                             | 2.170.638          | –               | –               | 2.170.638          |
| Unternehmensanleihen                                       | –                  | –               | 0               | 0                  |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                            | <b>186.889.372</b> | <b>–</b>        | <b>0</b>        | <b>186.889.372</b> |

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

## FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

## 11. WECHSELKURSE

Zur Umrechnung der auf Fremdwährungen lautenden Vermögenswerte und Verbindlichkeiten am Ende des Berichtszeitraums (30. Juni 2023) wurden die folgenden Wechselkurse verwendet:

|                         |                          |                         |                       |                          |
|-------------------------|--------------------------|-------------------------|-----------------------|--------------------------|
| 1 USD = 3,67305 AED     | 1 USD = 21,77685 CZK     | 1 USD = 3,71095 ILS     | 1 USD = 3,62480 PEN   | 1 USD = 35,45500 THB     |
| 1 USD = 495,02000 ARS   | 1 USD = 6,82485 DKK      | 1 USD = 82,03625 INR    | 1 USD = 55,19950 PHP  | 1 USD = 26,07000 TRY     |
| 1 USD = 1,50229 AUD     | 1 USD = 55,09000 DOP     | 1 USD = 144,53500 JPY   | 1 USD = 4,06295 PLN   | 1 USD = 31,14450 TWD     |
| 1 USD = 4,82400 BRL     | 1 USD = 30,90000 EGP     | 1 USD = 140,60000 KES   | 1 USD = 3,64000 QAR   | 1 USD = 3.675,00000 UGX  |
| 1 USD = 1,32325 CAD     | 1 USD = 0,91659 EUR      | 1 USD = 1.317,65000 KRW | 1 USD = 4,54560 RON   | 1 USD = 37,37500 UYU     |
| 1 USD = 0,89465 CHF     | 1 USD = 0,78657 GBP      | 1 USD = 17,15050 MXN    | 1 USD = 107,50000 RSD | 1 USD = 23.585,00000 VND |
| 1 USD = 802,15000 CLP   | 1 USD = 11,37500 GHS     | 1 USD = 4,66750 MYR     | 1 USD = 89,50000 RUB  | 1 USD = 18,89125 ZAR     |
| 1 USD = 7,27480 CNH     | 1 USD = 7,83660 HKD      | 1 USD = 765,50000 NGN   | 1 USD = 3,75070 SAR   | 1 USD = 17,57500 ZMW     |
| 1 USD = 7,26405 CNY     | 1 USD = 341,88820 HUF    | 1 USD = 10,71355 NOK    | 1 USD = 10,80130 SEK  |                          |
| 1 USD = 4.175,77500 COP | 1 USD = 14.992,50000 IDR | 1 USD = 1,63225 NZD     | 1 USD = 1,35335 SGD   |                          |
| 1 EUR = 1,44367 CAD     | 1 EUR = 7,44591 DKK      | 1 EUR = 157,68769 JPY   | 1 EUR = 4,43268 PLN   | 1 EUR = 1,47650 SGD      |
| 1 EUR = 0,97606 CHF     | 1 EUR = 0,85814 GBP      | 1 EUR = 11,68848 NOK    | 1 EUR = 11,78422 SEK  | 1 EUR = 1,09100 USD      |
| 1 EUR = 23,75854 CZK    | 1 EUR = 8,54973 HKD      |                         |                       |                          |
| 1 CNY = 0,12600 EUR     | 1 CNY = 1,07723 HKD      | 1 CNY = 0,13746 USD     |                       |                          |
| 1 CNY = 0,10812 GBP     | 1 CNY = 0,18603 SGD      |                         |                       |                          |
| 1 EUR = 0,00634 EUR     | 1 EUR = 0,00544 GBP      | 1 EUR = 0,00692 USD     |                       |                          |

Zur Umrechnung der auf Fremdwährungen lautenden Vermögenswerte und Verbindlichkeiten am Ende des Geschäftsjahres (31. Dezember 2022) wurden die folgenden Wechselkurse verwendet:

|                         |                          |                         |                       |                          |
|-------------------------|--------------------------|-------------------------|-----------------------|--------------------------|
| 1 USD = 3,67265 AED     | 1 USD = 22,63200 CZK     | 1 USD = 3,52850 ILS     | 1 USD = 3,81350 PEN   | 1 USD = 34,63500 THB     |
| 1 USD = 324,90000 ARS   | 1 USD = 6,96785 DKK      | 1 USD = 82,73000 INR    | 1 USD = 55,72750 PHP  | 1 USD = 18,71950 TRY     |
| 1 USD = 1,47460 AUD     | 1 USD = 56,22000 DOP     | 1 USD = 131,94500 JPY   | 1 USD = 4,38625 PLN   | 1 USD = 30,73550 TWD     |
| 1 USD = 5,27975 BRL     | 1 USD = 24,75500 EGP     | 1 USD = 123,40000 KES   | 1 USD = 3,64175 QAR   | 1 USD = 3.720,00000 UGX  |
| 1 USD = 1,35495 CAD     | 1 USD = 0,93699 EUR      | 1 USD = 1.264,50000 KRW | 1 USD = 4,63605 RON   | 1 USD = 39,76500 UYU     |
| 1 USD = 0,92520 CHF     | 1 USD = 0,83132 GBP      | 1 USD = 19,48725 MXN    | 1 USD = 109,92500 RSD | 1 USD = 23.575,00000 VND |
| 1 USD = 851,95000 CLP   | 1 USD = 10,20000 GHS     | 1 USD = 4,40500 MYR     | 1 USD = 73,00000 RUB  | 1 USD = 17,01500 ZAR     |
| 1 USD = 6,91885 CNH     | 1 USD = 7,80495 HKD      | 1 USD = 460,75000 NGN   | 1 USD = 3,75800 SAR   | 1 USD = 18,07500 ZMW     |
| 1 USD = 6,95170 CNY     | 1 USD = 375,21670 HUF    | 1 USD = 9,85100 NOK     | 1 USD = 10,41950 SEK  |                          |
| 1 USD = 4.848,88500 COP | 1 USD = 15.567,50000 IDR | 1 USD = 1,58115 NZD     | 1 USD = 1,34120 SGD   |                          |
| 1 EUR = 1,57377 AUD     | 1 EUR = 7,43644 DKK      | 1 EUR = 140,81830 JPY   | 1 EUR = 4,68123 PLN   | 1 EUR = 1,43140 SGD      |
| 1 EUR = 1,44607 CAD     | 1 EUR = 0,88723 GBP      | 1 EUR = 10,51348 NOK    | 1 EUR = 11,12021 SEK  | 1 EUR = 1,06725 USD      |
| 1 EUR = 0,98742 CHF     | 1 EUR = 8,32983 HKD      |                         |                       |                          |
| 1 CNY = 0,13543 EUR     | 1 CNY = 1,12807 HKD      | 1 CNY = 0,14453 USD     |                       |                          |
| 1 CNY = 0,12015 GBP     | 1 CNY = 0,19385 SGD      |                         |                       |                          |
| 1 EUR = 0,00758 USD     |                          |                         |                       |                          |



FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023

11. WECHSELKURSE (FORTSETZUNG)

|      |                            |     |                         |     |                             |
|------|----------------------------|-----|-------------------------|-----|-----------------------------|
| AED  | VAE-Dirham                 | HUF | Ungarischer Forint      | RUB | Russischer Rubel            |
| ARS  | Argentinischer Peso        | IDR | Indonesische Rupiah     | SAR | Saudi-Riyal                 |
| AUD  | Australischer Dollar       | ILS | Israelischer Sheckel    | SEK | Schwedische Krone           |
| BRL  | Brasilianischer Real       | INR | Indische Rupie          | SGD | Singapur-Dollar             |
| CAD  | Kanadischer Dollar         | JPY | Japanischer Yen (¥)     | THB | Thailändischer Baht         |
| CHF  | Schweizer Franken          | KES | Kenianischer Schilling  | TRY | Türkische Lira              |
| CLP  | Chilenischer Peso          | KRW | Südkoreanischer Won     | TWD | Neuer taiwanesischer Dollar |
| *CNH | Chinesischer Yuan Renminbi | MXN | Mexikanischer Peso      | UGX | Uganda-Schilling            |
| *CNY | Chinesischer Yuan Renminbi | MYR | Malaysischer Ringgit    | USD | US-Dollar (\$)              |
| COP  | Kolumbianischer Peso       | NGN | Nigerianischer Naira    | UYU | Uruguayischer Peso          |
| CZK  | Tschechische Krone         | NOK | Norwegische Krone       | VND | Vietnamesischer Dong        |
| DKK  | Dänische Krone             | NZD | Neuseeländischer Dollar | ZAR | Südafrikanischer Rand       |
| DOP  | Dominikanischer Peso       | PEN | Peruanischer Sol        | ZMW | Sambischer Kwacha           |
| EGP  | Ägyptisches Pfund          | PHP | Philippinischer Peso    |     |                             |
| EUR  | Euro (€)                   | PLN | Polnischer Zloty        |     |                             |
| GBP  | Britisches Pfund (£)       | QAR | Katar-Rial              |     |                             |
| GHS  | Ghanaischer Cedi           | RON | Rumänischer neuer Leu   |     |                             |
| HKD  | Hongkong-Dollar            | RSD | Serbischer Dinar        |     |                             |

\*Es gibt in China eine offizielle Währung, den chinesischen Yuan Renminbi. Der CNY wird „onshore“, auf dem chinesischen Festland, gehandelt, der CNH „offshore“, in erster Linie in Hongkong, zu jeweils unterschiedlichen Wechselkursen.

12. BERICHTIGUNG DER WÄHRUNGSUMRECHNUNG

Der Konzernabschluss für den Fonds ist auf US-Dollar denominiert. Zum Zwecke der Berichterstattung der Gesamtergebnisse des Fonds wurden die Ergebnisse einiger Portfolios zu den nachstehend angegebenen Kursen in US-Dollar umgerechnet.

| Portfolio                   | Bilanz                |                       | Gewinn- und Verlustrechnung und die Aufstellung über die Entwicklung der auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens |                       |
|-----------------------------|-----------------------|-----------------------|--|-----------------------|
|                             | Schlusskurs           |                       | Durchschnittskurs  |                       |
|                             | 30. Juni 2023         | 31. Dezember 2022     | 30. Juni 2023  | 30. Juni 2022         |
| China A-Share Equity        | US\$ 1 = CNY 7,26405  | US\$ 1 = CNY 6,95170  | US\$ 1 = CNY 6,97407   | US\$ 1 = CNY 6,48004  |
| China Bond                  | US\$ 1 = CNY 7,26405  | US\$ 1 = CNY 6,95170  | US\$ 1 = CNY 6,97407   | US\$ 1 = CNY 6,48004  |
| Corporate Hybrid Bond       | US\$ 1 = EUR 0,91659  | US\$ 1 = EUR 0,93699  | US\$ 1 = EUR 0,92593   | US\$ 1 = EUR 0,91491  |
| Euro Bond Absolute Return   | US\$ 1 = EUR 0,91659  | US\$ 1 = EUR 0,93699  | US\$ 1 = EUR 0,92593   | US\$ 1 = EUR 0,91491  |
| Euro Opportunistic Bond     | US\$ 1 = EUR 0,91659  | US\$ 1 = EUR 0,93699  | US\$ 1 = EUR 0,92593   | US\$ 1 = EUR 0,91491  |
| European High Yield Bond    | US\$ 1 = EUR 0,91659  | US\$ 1 = EUR 0,93699  | US\$ 1 = EUR 0,92593   | US\$ 1 = EUR 0,91491  |
| European Sustainable Equity | US\$ 1 = EUR 0,91659  | US\$ 1 = EUR 0,93699  | US\$ 1 = EUR 0,92593   | US\$ 1 = EUR 0,91491  |
| Japan Equity Engagement     | US\$ 1 = JPY 144,5350 | US\$ 1 = JPY 131,9450 | US\$ 1 = JPY 135,9586  | US\$ 1 = JPY 122,6994 |
| Macro Opportunities FX      | US\$ 1 = EUR 0,91659  | US\$ 1 = EUR 0,93699  | US\$ 1 = EUR 0,92593   | US\$ 1 = EUR 0,91491  |
| Ultra Short Term Euro Bond  | US\$ 1 = EUR 0,91659  | US\$ 1 = EUR 0,93699  | US\$ 1 = EUR 0,92593   | US\$ 1 = EUR 0,91491  |

Aus der Umrechnung des Eröffnungsnettovermögens, der Gewinn- und Verlustrechnung und der Aufstellung über die Entwicklung des auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens ergab sich eine nominale Währungsanpassung von USD (51.504.327) (30. Juni 2022: (346.864.658) US\$). Die Umrechnungsmethode hat keinen Einfluss auf den Wert des Nettovermögens, der den einzelnen Portfolios zuzuschreiben ist.

**FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023****13. VEREINBARUNGEN ÜBER PROVISIONSNACHLÄSSE (SOFT COMMISSIONS)**

Der Manager und verbundene Personen haben in begrenzten Fällen Vereinbarungen über Provisionsnachlässe mit Brokern in Bezug auf Research-Produkte abgeschlossen unter der Voraussetzung, dass sie die beste Ausführung (Best Execution) zur Unterstützung von Anlagenentscheidungen erhalten.

Zu den erhaltenen Research-Leistungen gehören alle standardmäßigen Research-Produkte, insbesondere aktuelle und historische Daten in Bezug auf bestimmte Unternehmen, Branchen und die Finanzwirtschaft insgesamt sowie Informationen über Chancen, Risiken und Trends sowie Analysen in Bezug auf spezielle Situationen. Der Manager ist der Auffassung, dass diese Vereinbarungen den Portfolios zugute kommen, und hat sich davon überzeugt, dass er für die Portfolios die beste Ausführung erhält.

**14. GETRENNTE HAFTUNG**

Der Fonds hat mehrere Portfolios und weitere Portfolios können künftig aufgelegt werden. Mit der Zustimmung der Anteilinhaber des Fonds, die am 3. November 2006 durch einen Sonderbeschluss erteilt wurde, hat der Fonds die getrennte Haftung zwischen seinen Portfolios eingeführt. Ab diesem Datum trägt jedes Portfolio seine eigenen Verbindlichkeiten, und weder der Fonds noch die vom Fonds ernannten Dienstleistungsanbieter noch die Direktoren, Konkursverwalter, Prüfer oder Liquidatoren noch eine sonstige Person erhalten Zugriff auf die Vermögenswerte eines Portfolios zur Begleichung von Verbindlichkeiten eines anderen Portfolios.

**15. EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT**

Der Fonds kann zu den Bedingungen und innerhalb der Grenzen, die von der Zentralbank vorgegeben werden, in Bezug auf Wertpapiere und/oder Finanzinstrumente, einschließlich derivative Instrumente, Anlagetechniken und Instrumente anwenden, vorausgesetzt, dass diese für Zwecke des effizienten Portfoliomanagements (d. h. zur Absicherung, zur Reduzierung von Risiken oder Kosten oder zur Steigerung der Kapital- oder Ertragsrendite) oder für Anlagezwecke angewandt werden. Die angewandten Techniken und Instrumente dürfen nur in Einklang mit den Anlagezielen des jeweiligen Portfolios eingesetzt werden.

Nach Ermessen des Managers und des Sub-Investment-Managers kann jedes Portfolio zu den von den OGAW-Vorschriften der Zentralbank festgelegten Bedingungen und Grenzen für alle Arten von Vermögenswerten, in die das Portfolio anlegen kann, Wertpapierleihgeschäfte („Wertpapierleihverträge“) abschließen, so wie im Abschnitt „Instrumente/Anlageklassen“ im jeweiligen Zusatz für das Portfolio beschrieben. Solche Wertpapierleihgeschäfte können zum Zwecke des effizienten Portfoliomanagements eingesetzt werden.

Wertpapierleihverträge sind Transaktionen, über die ein Portfolio seine Wertpapiere an eine andere Partei, den Kreditnehmer, ausleiht, der vertraglich verpflichtet ist, zum Ende eines vereinbarten Zeitraums äquivalente Wertpapiere zurückzugeben. Solange die Wertpapiere ausgeliehen sind, zahlt der Kreditnehmer dem Portfolio (i) eine Kreditgebühr und (ii) Erträge aus den Wertpapieren.

Der Fonds erhielt für jedes Portfolio, das Wertpapierleihverträge abschloss, Sicherheiten in Höhe von mindestens 102 % des Werts der ausgeliehenen Wertpapiere. Portfolios können nur Wertpapierleihgeschäfte abschließen, im Rahmen derer (i) sie berechtigt sind, zu jeder Zeit die Rückgabe der verliehenen Wertpapiere zu beantragen oder die Wertpapierleihgeschäfte zu kündigen und (ii) die Transaktionen die Verwaltung der Vermögenswerte des Portfolios im Einklang mit seiner Anlagepolitik nicht gefährden. Sofern nicht anderweitig in dem entsprechenden Zusatz festgelegt, beträgt der maximale Anteil eines Nettoinventarwerts eines Portfolios, für den Wertpapierleihgeschäfte abgeschlossen werden können, 50 % und der erwartete Anteil eines Nettoinventarwerts, für den Wertpapierleihgeschäfte abgeschlossen werden, beträgt 0-10 %.

Der Fonds hat Brown Brothers Harriman & Co. (der „Lending Agent“) damit beauftragt, die Wertpapierleihverträge auszuführen, darunter, vorbehaltlich der vorherigen Zustimmung durch den Fonds, die Auswahl der Gegenparteien und die Verwaltung der Sicherheit. Portfolios, die Wertpapierleihverträge eingingen, erhielten das gesamte Einkommen aus diesen Wertpapierleihverträgen, abzüglich direkter und indirekter Betriebskosten, das 90 % des insgesamt generierten Einkommens ausmachte. Die übrigen 10 % wurden an den Lending Agent als Gegenleistung für die direkten und indirekten Betriebskosten für die Erbringung seiner Dienstleistungen und die Bereitstellung seiner Garantie gezahlt. Die Gesellschaft stieg im Juli 2022 aus dem Wertpapierleihprogramm aus, die von den Portfolios in den entsprechenden Zeitraum aus der Wertpapierleihe verdienten Erträge werden separat in der Gewinn- und Verlustrechnung aufgeführt.

Zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022 hatte der Fonds keine Wertpapierleihgeschäfte abgeschlossen.

Im sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 haben der Corporate Hybrid Bond, der Emerging Market Debt Blend und der Short Duration Emerging Market Debt Pensionsgeschäfte abgeschlossen. Die gesamten Zinserträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften lagen für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 bei 2.377 US\$. Die gesamten Zinsaufwendungen aus umgekehrten Pensionsgeschäften lagen für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 bei 210.116 US\$. Direkte und indirekte Kosten im Zusammenhang mit effizienten Portfoliomanagementstechniken können nicht ohne Weiteres bestimmt werden.

Im sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2022 haben der Corporate Hybrid Bond, der Emerging Market Debt - Hard Currency, der Emerging Market Debt Blend, der High Yield Bond und der Short Duration Emerging Market Debt Pensionsgeschäfte abgeschlossen. Die gesamten Zinserträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften lagen für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2022 bei 16.278 US\$. Die gesamten Zinsaufwendungen aus umgekehrten Pensionsgeschäften lagen für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2022 bei 21.259 US\$. Direkte und indirekte Kosten im Zusammenhang mit effizienten Portfoliomanagementstechniken können nicht ohne Weiteres bestimmt werden.

**FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023****16. KREDITFAZILITÄT**

Bei der Sitzung der Direktoren vom 20. Juni 2016 wurde mit The Bank of Tokyo Mitsubishi UFJ Ltd. vereinbart, dass sie zusammen mit einem Syndikat von anderen Banken (zusammen die „Kreditgeber“) dem Fonds in Bezug auf die Portfolios ab dem Datum der Ausfertigung eines Kreditvertrags mit der Bank eine zugesagte Liquiditätsfazilität bis zu einem Höchstbetrag von 500.000.000 US\$ (die „Fazilität“) zur Verfügung stellt, und dass der Gegenwert der Fazilität nur für den vorübergehenden Liquiditätsbedarf oder in Notlagen in Anspruch genommen werden darf. Ab 4. Oktober 2018 wurde der maximale Betrag der zugesagten Liquiditätsfazilität von 500.000.000 US\$ auf 600.000.000 US\$ erhöht. Am 27. März 2020 wurde der maximale Betrag der zugesagten Liquiditätsfazilität von 600.000.000 US\$ auf 975.000.000 US\$ erhöht. Am 1. Oktober 2020 wurde der maximale Betrag der zugesagten Liquiditätsfazilität von 975.000.000 US\$ auf 750.000.000 US\$ reduziert. Am 30. September 2021 wurde der maximale Betrag der zugesagten Liquiditätsfazilität von 750.000.000 US\$ auf 850.000.000 US\$ erhöht. Die Fazilität in Höhe von 850.000.000 USD wurde am 29. September 2022 für den Zeitraum von 364 Tagen für sämtliche Portfolios verlängert. Für die sechs Monate zum 30. Juni 2023 nahmen Event Driven und Tactical Macro nicht an der Fazilität teil. Die Kosten für die Bereitstellungsprovision wurden dementsprechend geändert.

Zum 30. Juni 2023 gab es keine im Rahmen der Fazilität ausstehenden Kredite (31. Dezember 2022: ebenso). IM Sechsmonatszeitraum zum 30. Juni 2023 und im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 wurde die Kreditfazilität von keinem der Portfolios in Anspruch genommen.

**17. UNGEDECKTE KREDITZUSAGEN**

Zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022 hatte der Fonds keine ungedeckten Kreditverbindlichkeiten.

**18. VERGLEICHSAHLEN**

Die im Abschluss angegebenen Vergleichszahlen sind die Zahlen des Sechsmonatszeitraums zum 30. Juni 2022 für die Gewinn- und Verlustrechnung und die Aufstellung über die Entwicklung des auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens und die Zahlen zum 31. Dezember 2022 für die Bilanz.

**19. WICHTIGE EREIGNISSE WÄHREND DES BERICHTSZEITRAUMS**

Die wirtschaftlichen Unsicherheiten und Unsicherheiten am Finanzmarkt blieben angetrieben durch die anhaltend höhere Inflation und die Straffung der Geldpolitik weiter erhöht, da die Zentralbanken die Basiszinssätze erhöht und die Kreditbedingungen verschärft haben, was jüngste Ereignisse im Bankensektor zeigen. Diese Marktbedingungen tragen zu einer zusätzlichen Volatilität und Fluktuation bei den Marktvariablen bei, einschließlich unter anderem den Zinsen, Wechselkursen, Aktienkursen, Rohstoffpreisen, einer Erhöhung der Kreditspreads, implizierter Volatilitäten und Asset-Korrelationen. Das Management überwacht die Ereignisse und jegliche Engagements in Sektoren mit erhöhtem Risiko aktiv.

Ein neuer Multi-Strategy-Nachtrag zum Prospekt, der die Änderung der Berechnungsmethode der erfolgsabhängigen Gebühr für den Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund abdeckt, wurde von der Zentralbank am 3. Januar 2023 vermerkt.

Am 3. Januar 2023 wurden von der Zentralbank ein neuer Sustainable Asia High Yield-Nachtrag zum Prospekt vermerkt.

Am 7. Februar 2023 wurden von der Zentralbank ein neuer Fixed Income-Nachtrag zum Prospekt vermerkt.

Der Neuberger Berman Uncorrelated Trading Fund wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst.

Der Neuberger Berman Global High Yield Sustainable Action Fund wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst.

Der Neuberger Berman Tactical Macro Fund wurde am 30. Juni 2023 aufgelegt.

Tom Finlay trat am 30. Juni 2023 als Direktor des Fonds in den Ruhestand.

Außer den oben erwähnten sind während des Berichtszeitraums keine anderen wesentlichen, den Fonds betreffenden Ereignisse eingetreten.

**20. WESENTLICHE EREIGNISSE SEIT DEM ENDE DES BERICHTSZEITRAUMS**

Mit Wirkung vom 1. Juli 2023 löste Naomi Daly Tom Finlay als Vorsitzenden ab.

Der Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund wurde am 6. Juli 2023 aufgelöst.

Der Neuberger Berman Developed Market FMP – 2027 wurde am 31. Juli 2023 aufgelegt.

Der Neuberger Berman Climate Innovation Fund wurde am 1. August 2023 aufgelegt.

**FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2023****20. WESENTLICHE EREIGNISSE SEIT DEM ENDE DES BERICHTSZEITRAUMS (FORTSETZUNG)**

Eine neue Version des Prospekts des Fonds und neue Zusätze zum Verkaufsprospekt, die sich auf Veränderungen aller Portfolios beziehen, wurden am 2. August 2023 von der Zentralbank entgegengenommen. Die Nachträge zum Verkaufsprospekt umfassen Änderungen an folgenden Fonds: Neuberger Berman China Equity Fund, Neuberger Berman Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency Fund, Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund, Neuberger Berman Global Flexible Credit Income Fund, Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund, Neuberger Berman European High Yield Bond Fund, Neuberger Berman Global High Yield SDG Engagement Fund, Neuberger Berman Next Generation Space Economy Fund, Neuberger Berman InnovAsia 5G Fund, Neuberger Berman Global Equity Megatrends Fund, Neuberger Berman Systematic Global Sustainable Value Fund, Neuberger Berman Global Real Estate Securities Fund, Neuberger Berman US Real Estate Securities Fund, Neuberger Berman Sustainable Asia High Yield Fund und Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund.

Mit Wirkung zum 2. August 2023 wurde der Neuberger Berman Systematic Global Sustainable Value Fund in Neuberger Berman Global Sustainable Value Fund umbenannt.

Auf Empfehlung des Managers und in Übereinstimmung mit den Bedingungen des Prospekts und den Bestimmungen der Satzung hat der Verwaltungsrat als Schließungsdatum für den Neuberger Berman Emerging Markets Select Equity Fund den 7. September 2023 genehmigt.

Die Neuberger Berman Fund Management (China) Limited wird die Neuberger Berman Investment Management (Shanghai) Limited als Anlageberater für Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund, Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund und Neuberger Berman China Bond Fund bis zum Jahresende ersetzen.

Außer den oben erwähnten sind seit Ende des Berichtszeitraums keine wesentlichen, den Fonds betreffenden Ereignisse eingetreten.

**21. GENEHMIGUNG DES ABSCHLUSSES**

Der Halbjahresbericht und der ungeprüfte verkürzte Halbjahresabschluss wurden von den Direktoren am 17. August 2023 genehmigt.

## Anhang I

## GESAMTKOSTENQUOTEN

Für den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 basieren die Gesamtkostenquoten („TERs“) auf die den angegebenen Daten vorangegangenen zwölf Monate.

## 30. Juni 2023

## 5G Connectivity

| Anteilklasse  | Annualisierte TER in %<br>(Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in %<br>(Mit Gebührenverzicht) |
|---|---|--|
| Thesaurierende Klasse AUD A                           | 1,80 %  | 1,80 %   |
| Thesaurierende Klasse CNY A                           | 1,80 %  | 1,80 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR A                           | 1,80 %  | 1,80 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert) | 1,80 %  | 1,80 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR I                           | 0,95 %  | 0,95 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) | 0,95 %  | 0,95 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR I5                          | 0,53 %  | 0,53 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) | 2,60 %  | 2,60 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP A                           | 1,80 %  | 1,80 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | 0,95 %  | 0,95 %   |
| Thesaurierende Klasse HKD A                           | 1,80 %  | 1,80 %   |
| Thesaurierende Klasse SGD A                           | 1,80 %  | 1,80 %   |
| Thesaurierende Klasse USD A                           | 1,80 %  | 1,80 %   |
| Thesaurierende Klasse USD E                           | 2,89 %  | 2,89 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I                           | 0,95 %  | 0,95 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I                            | 0,95 %  | 0,95 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I2                          | 0,78 %  | 0,78 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I3                          | 0,70 %  | 0,70 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I5                          | 0,53 %  | 0,53 %   |
| Thesaurierende Klasse USD M                           | 2,60 %  | 2,60 %   |
| Thesaurierende Klasse USD Z                           | 0,10 %  | 0,10 %   |
| Thesaurierende Klasse ZAR A                           | 1,75 %  | 1,75 %   |
| Thesaurierende Klasse ZAR E                           | 2,89 %  | 2,89 %   |

## Asian Debt - Hard Currency

|  |        |        |
|--|--------|--------|
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 1,97 % | 1,35 % |
| Thesaurierende Klasse USD A            | 1,98 % | 1,35 % |
| Thesaurierende Klasse USD C1           | 3,00 % | 2,35 % |
| Thesaurierende Klasse USD I            | 1,40 % | 0,75 % |

## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (FORTSETZUNG)

## 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

## Asian Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

| Anteilklasse                            | Annualisierte TER in %<br>(Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in %<br>(Mit Gebührenverzicht) |
|---|---|--|
| Ausschüttende Klasse USD I              | 1,42 %  | 0,75 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich) | 0,97 %  | 0,51 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I4            | 0,96 %  | 0,50 %   |
| Thesaurierende Klasse USD M             | 2,59 %  | 1,95 %   |
| Ausschüttende Klasse USD X (Monatlich)  | 1,71 %  | 1,25 %   |
| Thesaurierende Klasse USD X             | 1,83 %  | 1,31 %   |
| Thesaurierende Klasse USD Z             | 0,40 %  | 0,15 %   |

## China A-Share Equity

|   |        |        |
|---|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse CNY I                           | 6,01 % | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) | 4,44 % | 1,20 % |
| Ausschüttende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)  | 6,01 % | 1,20 % |

## China Bond

|  |        |        |
|--|--------|--------|
| Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)                           | 1,55 % | 1,50 % |
| Ausschüttende Klasse CNY I                                       | 0,98 % | 0,85 % |
| Thesaurierende Klasse CNY Z                                      | 0,25 % | 0,20 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I2                                     | 0,77 % | 0,72 % |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) (nicht währungsgesichert) | 1,52 % | 1,50 % |
| Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)            | 0,89 % | 0,85 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z                                      | 0,25 % | 0,20 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z (nicht währungsgesichert)            | 0,25 % | 0,20 % |

## China Equity

|                              |        |        |
|------------------------------|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse CHF I  | 1,22 % | 1,22 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A  | 1,97 % | 1,97 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I  | 1,22 % | 1,22 % |
| Thesaurierende Klasse EUR Z  | 0,11 % | 0,11 % |
| Ausschüttende Klasse GBP A   | 1,96 % | 1,96 % |
| Thesaurierende Klasse SGD A  | 1,97 % | 1,97 % |
| Thesaurierende Klasse USD A  | 1,97 % | 1,97 % |
| Ausschüttende Klasse USD A   | 1,97 % | 1,97 % |
| Thesaurierende Klasse USD I  | 1,22 % | 1,22 % |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 1,00 % | 1,00 % |

## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (FORTSETZUNG)

30. Juni 2023 (Fortsetzung)

## China Equity (Fortsetzung)

| Anteilklasse                | Annualisierte TER in %<br>(Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in %<br>(Mit Gebührenverzicht) |
|-----------------------------|---|--|
| Thesaurierende Klasse USD M | 2,97 %  | 2,97 %   |
| Thesaurierende Klasse USD U | 1,57 %  | 1,57 %   |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,12 %  | 0,12 %   |

## CLO Income

|                             |        |        |
|-----------------------------|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR A | 1,59 % | 1,59 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 0,87 % | 0,87 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I2 | 0,69 % | 0,69 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I2 | 0,68 % | 0,68 % |
| Thesaurierende Klasse GBP Z | 0,09 % | 0,09 % |
| Thesaurierende Klasse SEK I | 0,84 % | 0,84 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 1,59 % | 1,59 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,84 % | 0,84 % |
| Ausschüttende Klasse USD I2 | 0,69 % | 0,69 % |
| Ausschüttende Klasse USD I5 | 0,47 % | 0,47 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,09 % | 0,09 % |

Commodities<sup>1</sup>

|   |        |        |
|---|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | 0,80 % | 0,79 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I5                          | 0,56 % | 0,52 % |
| Thesaurierende Klasse USD A                           | 1,65 % | 1,60 % |
| Thesaurierende Klasse USD I                           | 0,86 % | 0,83 % |
| Thesaurierende Klasse USD I5                          | 0,57 % | 0,52 % |
| Thesaurierende Klasse USD M                           | 2,25 % | 2,20 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z                           | 0,25 % | 0,20 % |

## Corporate Hybrid Bond

|  |        |        |
|--|--------|--------|
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) | 1,27 % | 1,27 % |
| Thesaurierende Klasse CHF P            | 0,64 % | 0,64 % |
| Ausschüttende Klasse CHF P             | 0,64 % | 0,64 % |
| Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) | 1,27 % | 1,27 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A            | 1,27 % | 1,27 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I            | 0,67 % | 0,67 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I             | 0,67 % | 0,67 % |

## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (FORTSETZUNG)

30. Juni 2023 (Fortsetzung)

## Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

| Anteilklasse                           | Annualisierte TER in %<br>(Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in %<br>(Mit Gebührenverzicht) |
|--|---|--|
| Thesaurierende Klasse EUR I2           | 0,55 %  | 0,55 %   |
| Ausschüttende Klasse EUR I2            | 0,55 %  | 0,55 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR I3           | 0,49 %  | 0,49 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR I5           | 0,37 %  | 0,37 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR M            | 1,87 %  | 1,87 %   |
| Ausschüttende Klasse EUR M             | 1,87 %  | 1,87 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR P            | 0,64 %  | 0,64 %   |
| Ausschüttende Klasse EUR P             | 0,64 %  | 0,64 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP I            | 0,67 %  | 0,67 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP I2           | 0,56 %  | 0,56 %   |
| Ausschüttende Klasse GBP I2            | 0,55 %  | 0,55 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP P            | 0,64 %  | 0,64 %   |
| Ausschüttende Klasse GBP P             | 0,64 %  | 0,64 %   |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | 1,27 %  | 1,27 %   |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 1,27 %  | 1,27 %   |
| Thesaurierende Klasse USD A            | 1,27 %  | 1,27 %   |
| Ausschüttende Klasse USD A             | 1,27 %  | 1,27 %   |
| Thesaurierende Klasse USD C1           | 2,27 %  | 2,27 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I            | 0,67 %  | 0,67 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I             | 0,67 %  | 0,67 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I2           | 0,55 %  | 0,55 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I2            | 0,55 %  | 0,55 %   |
| Thesaurierende Klasse USD M            | 1,87 %  | 1,87 %   |
| Ausschüttende Klasse USD M             | 1,87 %  | 1,87 %   |
| Thesaurierende Klasse USD P            | 0,64 %  | 0,64 %   |
| Thesaurierende Klasse USD Z            | 0,07 %  | 0,07 %   |

## Emerging Market Debt - Hard Currency

|  |        |        |
|--|--------|--------|
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)                 | 1,48 % | 1,48 % |
| Ausschüttende Klasse AUD I                             | 0,78 % | 0,78 % |
| Thesaurierende Klasse CAD I3 (nicht währungsgesichert) | 0,58 % | 0,58 % |
| Thesaurierende Klasse CHF I2                           | 0,64 % | 0,64 % |
| Thesaurierende Klasse CHF P                            | 0,75 % | 0,75 % |
| Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)                 | 1,48 % | 1,48 % |



## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (FORTSETZUNG)

30. Juni 2023 (Fortsetzung)

## Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

| Anteilklasse   | Annualisierte TER in %<br>(Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in %<br>(Mit Gebührenverzicht) |
|--|---|--|
| Thesaurierende Klasse EUR A                            | 1,48 %  | 1,48 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR I                            | 0,78 %  | 0,78 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)  | 0,78 %  | 0,78 %   |
| Ausschüttende Klasse EUR I                             | 0,78 %  | 0,78 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR I2                           | 0,64 %  | 0,64 %   |
| Ausschüttende Klasse EUR I2                            | 0,64 %  | 0,64 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR I3                           | 0,57 %  | 0,57 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert) | 0,57 %  | 0,57 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR I4                           | 0,50 %  | 0,50 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert) | 0,43 %  | 0,43 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR M                            | 2,28 %  | 2,28 %   |
| Ausschüttende Klasse EUR M                             | 2,28 %  | 2,28 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR P                            | 0,75 %  | 0,75 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR Z                            | 0,08 %  | 0,08 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP I                            | 0,78 %  | 0,78 %   |
| Ausschüttende Klasse GBP I                             | 0,78 %  | 0,78 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP I2                           | 0,64 %  | 0,64 %   |
| Ausschüttende Klasse GBP I2                            | 0,64 %  | 0,64 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP P                            | 0,75 %  | 0,75 %   |
| Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)                 | 1,48 %  | 1,48 %   |
| Thesaurierende Klasse JPY I                            | 0,78 %  | 0,78 %   |
| Thesaurierende Klasse SEK A                            | 1,48 %  | 1,48 %   |
| Thesaurierende Klasse SEK I2                           | 0,64 %  | 0,64 %   |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)                 | 1,48 %  | 1,48 %   |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)                 | 1,48 %  | 1,48 %   |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 1,48 %  | 1,48 %   |
| Ausschüttende Klasse USD A                             | 1,48 %  | 1,48 %   |
| Thesaurierende Klasse USD C1                           | 2,48 %  | 2,48 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 0,78 %  | 0,78 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I                             | 0,78 %  | 0,78 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I2                           | 0,64 %  | 0,64 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I2                            | 0,64 %  | 0,64 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I3                            | 0,57 %  | 0,57 %   |
| Thesaurierende Klasse USD M                            | 2,28 %  | 2,28 %   |

## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (FORTSETZUNG)

## 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

## Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

| Anteilklasse                | Annualisierte TER in %<br>(Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in %<br>(Mit Gebührenverzicht) |
|-----------------------------|---|--|
| Ausschüttende Klasse USD M  | 2,28 %  | 2,28 %   |
| Thesaurierende Klasse USD P | 0,75 %  | 0,75 %   |
| Thesaurierende Klasse USD X | 0,56 %  | 0,56 %   |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,08 %  | 0,08 %   |

## Emerging Market Debt - Local Currency

|  |        |        |
|--|--------|--------|
| Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich)                 | 2,94 % | 2,94 % |
| Thesaurierende Klasse AUD B                            | 2,94 % | 2,94 % |
| Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich)                | 2,94 % | 2,94 % |
| Thesaurierende Klasse AUD C2                           | 2,86 % | 2,86 % |
| Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)                 | 2,94 % | 2,94 % |
| Thesaurierende Klasse AUD E                            | 2,95 % | 2,95 % |
| Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)                 | 1,94 % | 1,94 % |
| Thesaurierende Klasse AUD T                            | 1,94 % | 1,94 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A                            | 1,65 % | 1,65 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I                            | 0,90 % | 0,90 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)  | 0,89 % | 0,89 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungsgesichert) | 0,74 % | 0,74 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)  | 0,59 % | 0,59 % |
| Thesaurierende Klasse EUR Y (nicht währungsgesichert)  | 0,50 % | 0,50 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I                            | 0,89 % | 0,89 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert) | 0,59 % | 0,59 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)  | 0,60 % | 0,60 % |
| Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)  | 0,50 % | 0,50 % |
| Thesaurierende Klasse SEK A                            | 1,64 % | 1,64 % |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)                 | 1,65 % | 1,65 % |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)                 | 1,64 % | 1,64 % |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 1,64 % | 1,64 % |
| Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich)                 | 2,94 % | 2,94 % |
| Thesaurierende Klasse USD B                            | 2,95 % | 2,95 % |
| Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich)                | 2,94 % | 2,94 % |
| Thesaurierende Klasse USD C2                           | 2,92 % | 2,92 % |
| Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich)                 | 2,94 % | 2,94 % |
| Thesaurierende Klasse USD E                            | 2,94 % | 2,94 % |

## Anhang I (Fortsetzung)

### GESAMTKOSTENQUOTEN (FORTSETZUNG)

30. Juni 2023 (Fortsetzung)

#### Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

| Anteilklasse                            | Annualisierte TER in %<br>(Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in %<br>(Mit Gebührenverzicht) |
|---|---|--|
| Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)  | 0,89 %  | 0,89 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I             | 0,89 %  | 0,89 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I              | 0,90 %  | 0,90 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I2            | 0,74 %  | 0,74 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I5            | 0,53 %  | 0,53 %   |
| Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)  | 1,94 %  | 1,94 %   |
| Thesaurierende Klasse USD T             | 1,94 %  | 1,94 %   |
| Thesaurierende Klasse USD X             | 0,52 %  | 0,48 %   |
| Thesaurierende Klasse USD Y             | 0,50 %  | 0,50 %   |
| Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich)  | 2,94 %  | 2,94 %   |
| Thesaurierende Klasse ZAR B             | 2,94 %  | 2,94 %   |
| Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich) | 2,94 %  | 2,94 %   |
| Thesaurierende Klasse ZAR C2            | 2,99 %  | 2,99 %   |
| Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)  | 2,94 %  | 2,94 %   |
| Thesaurierende Klasse ZAR E             | 2,94 %  | 2,94 %   |
| Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)  | 1,94 %  | 1,94 %   |
| Thesaurierende Klasse ZAR T             | 1,94 %  | 1,94 %   |

#### Emerging Market Debt Blend

|  |        |        |
|--|--------|--------|
| Ausschüttende Klasse AUD I3                            | 0,67 % | 0,66 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A                            | 1,58 % | 1,57 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I                            | 0,88 % | 0,88 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I                             | 0,87 % | 0,87 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I2                           | 0,73 % | 0,73 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I2                            | 0,74 % | 0,73 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I3                            | 0,66 % | 0,66 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert) | 0,60 % | 0,60 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I5                           | 0,53 % | 0,52 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M                            | 2,38 % | 2,37 % |
| Ausschüttende Klasse EUR M                             | 2,38 % | 2,38 % |
| Thesaurierende Klasse EUR Z                            | 0,17 % | 0,17 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I                            | 0,88 % | 0,88 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)  | 0,87 % | 0,87 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I                             | 0,87 % | 0,87 % |

## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (FORTSETZUNG)

## 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

## Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

| Anteilklasse  | Annualisierte TER in %<br>(Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in %<br>(Mit Gebührenverzicht) |
|---|---|--|
| Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)  | 0,88 %  | 0,88 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP P                           | 0,83 %  | 0,83 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) | 0,85 %  | 0,84 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP Z                           | 0,18 %  | 0,17 %   |
| Thesaurierende Klasse NOK U                           | 1,22 %  | 1,22 %   |
| Thesaurierende Klasse SEK A                           | 1,58 %  | 1,57 %   |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)                | 1,58 %  | 1,57 %   |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)                | 1,58 %  | 1,57 %   |
| Thesaurierende Klasse USD A                           | 1,57 %  | 1,57 %   |
| Thesaurierende Klasse USD C1                          | 2,57 %  | 2,57 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I                           | 0,87 %  | 0,87 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I                            | 0,87 %  | 0,87 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I2                           | 0,74 %  | 0,73 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I3                          | 0,66 %  | 0,66 %   |
| Thesaurierende Klasse USD M                           | 2,38 %  | 2,37 %   |
| Ausschüttende Klasse USD M                            | 2,38 %  | 2,38 %   |
| Thesaurierende Klasse USD Z                           | 0,17 %  | 0,17 %   |

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend

|                              |        |        |
|------------------------------|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse AUD I2 | 0,98 % | 0,68 % |
| Thesaurierende Klasse NOK I  | 1,07 % | 0,80 % |
| Thesaurierende Klasse USD I  | 1,18 % | 0,80 % |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 0,98 % | 0,68 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z  | 0,47 % | 0,20 % |

## Emerging Markets Equity

|  |        |        |
|--|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse AUD B                          | 3,36 % | 3,28 % |
| Thesaurierende Klasse AUD C2                         | 3,35 % | 3,27 % |
| Thesaurierende Klasse AUD E                          | 3,31 % | 3,27 % |
| Thesaurierende Klasse AUD T                          | 2,36 % | 2,28 % |
| Ausschüttende Klasse CAD I (nicht währungsgesichert) | 1,36 % | 1,28 % |
| Ausschüttende Klasse CAD I2                          | 1,16 % | 1,08 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I                          | 1,35 % | 1,27 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M                          | 3,37 % | 3,28 % |

## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (FORTSETZUNG)

30. Juni 2023 (Fortsetzung)

## Emerging Markets Equity (Fortsetzung)

| Anteilklasse                 | Annualisierte TER in %<br>(Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in %<br>(Mit Gebührenverzicht) |
|------------------------------|---|--|
| Thesaurierende Klasse EUR Z  | 0,37 %  | 0,28 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP I  | 1,37 %  | 1,28 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP Z  | 0,37 %  | 0,28 %   |
| Thesaurierende Klasse USD A  | 2,37 %  | 2,28 %   |
| Thesaurierende Klasse USD B  | 3,36 %  | 3,28 %   |
| Thesaurierende Klasse USD C2 | 3,27 %  | 3,26 %   |
| Thesaurierende Klasse USD E  | 3,46 %  | 3,29 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I  | 1,33 %  | 1,27 %   |
| Thesaurierende Klasse USD M  | 3,25 %  | 3,24 %   |
| Thesaurierende Klasse USD T  | 2,37 %  | 2,29 %   |
| Thesaurierende Klasse USD Z  | 0,39 %  | 0,28 %   |
| Thesaurierende Klasse ZAR B  | 3,38 %  | 3,28 %   |
| Thesaurierende Klasse ZAR C2 | 3,28 %  | 3,26 %   |
| Thesaurierende Klasse ZAR E  | 3,36 %  | 3,28 %   |
| Thesaurierende Klasse ZAR T  | 2,36 %  | 2,28 %   |

## Emerging Markets Select Equity

|   |        |        |
|---|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) | 1,14 % | 1,14 % |
| Thesaurierende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert) | 1,14 % | 1,14 % |
| Thesaurierende Klasse USD I                           | 1,14 % | 1,14 % |
| Thesaurierende Klasse USD I5                          | 0,70 % | 0,70 % |

## Euro Bond Absolute Return

|                              |        |        |
|------------------------------|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR I  | 0,81 % | 0,65 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I   | 0,82 % | 0,65 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 | 0,59 % | 0,43 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z  | 0,35 % | 0,20 % |

## Euro Opportunistic Bond

|                             |        |        |
|-----------------------------|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR I | 1,56 % | 0,55 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I  | 1,50 % | 0,55 % |

## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (FORTSETZUNG)

30. Juni 2023 (Fortsetzung)

## European High Yield Bond

| Anteilklasse                           | Annualisierte TER in %<br>(Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in %<br>(Mit Gebührenverzicht) |
|--|---|--|
| Thesaurierende Klasse CHF I            | 0,91 %  | 0,80 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR I            | 0,99 %  | 0,80 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR M            | 2,25 %  | 2,00 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR X            | 0,64 %  | 0,40 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR Y            | 0,44 %  | 0,30 %   |
| Ausschüttende Klasse EUR Y             | 1,48 %  | 1,40 %   |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 1,68 %  | 1,40 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I            | 1,15 %  | 0,80 %   |
| Thesaurierende Klasse USD X            | 0,73 %  | 0,40 %   |
| Thesaurierende Klasse USD Z            | 0,44 %  | 0,20 %   |

## European Sustainable Equity

|   |        |        |
|---|--------|--------|
| Ausschüttende Klasse EUR A                            | 1,62 % | 1,62 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I                           | 0,72 % | 0,72 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I                            | 0,72 % | 0,72 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I3                           | 0,55 % | 0,55 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I5                          | 0,43 % | 0,43 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M                           | 2,42 % | 2,42 % |
| Thesaurierende Klasse EUR Z                           | 0,13 % | 0,12 % |
| Thesaurierende Klasse USD A (nicht währungsgesichert) | 1,59 % | 1,59 % |
| Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) | 0,73 % | 0,73 % |
| Thesaurierende Klasse USD M (nicht währungsgesichert) | 2,39 % | 2,39 % |

Event Driven<sup>1</sup>

|                              |        |        |
|------------------------------|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR I  | 1,28 % | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I5 | 0,82 % | 0,70 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I5  | 0,77 % | 0,70 % |
| Thesaurierende Klasse GBP P  | 1,28 % | 1,15 % |
| Thesaurierende Klasse USD I  | 1,42 % | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 0,79 % | 0,70 % |

## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (FORTSETZUNG)

30. Juni 2023 (Fortsetzung)

## Global Bond

| Anteilklasse  | Annualisierte TER in %<br>(Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in %<br>(Mit Gebührenverzicht) |
|---|---|--|
| Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)                          | 0,93 %  | 0,93 %   |
| Thesaurierende Klasse USD C1                                    | 1,61 %  | 1,60 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I Benchmark Währungsgesicherte Klasse | 0,61 %  | 0,60 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I                                     | 0,41 %  | 0,40 %   |
| Thesaurierende Klasse USD M                                     | 1,01 %  | 1,00 %   |
| Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)                          | 0,95 %  | 0,95 %   |
| Thesaurierende Klasse USD Z                                     | 0,21 %  | 0,20 %   |
| Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)                          | 0,93 %  | 0,93 %   |

## Global Diversified Income FMP – 2024

|                             |        |        |
|-----------------------------|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR A | 0,87 % | 0,87 % |
| Ausschüttende Klasse EUR A  | 0,87 % | 0,87 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I  | 0,47 % | 0,47 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I  | 0,47 % | 0,47 % |
| Ausschüttende Klasse HKD A  | 0,87 % | 0,87 % |
| Ausschüttende Klasse SGD A  | 0,87 % | 0,87 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 0,87 % | 0,87 % |
| Ausschüttende Klasse USD A  | 0,87 % | 0,87 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,47 % | 0,47 % |
| Ausschüttende Klasse USD I  | 0,47 % | 0,47 % |
| Thesaurierende Klasse USD X | 0,52 % | 0,52 % |
| Ausschüttende Klasse USD X  | 0,51 % | 0,51 % |

## Global Equity Megatrends

|   |        |        |
|---|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) | 2,73 % | 2,73 % |
| Thesaurierende Klasse USD A                           | 1,93 % | 1,93 % |
| Thesaurierende Klasse USD C1                          | 2,93 % | 2,93 % |
| Thesaurierende Klasse USD I                           | 1,07 % | 1,07 % |
| Thesaurierende Klasse USD M                           | 2,72 % | 2,72 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z                           | 0,22 % | 0,22 % |

## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (FORTSETZUNG)

30. Juni 2023 (Fortsetzung)

## Global Flexible Credit Income

| Anteilklasse                 | Annualisierte TER in %<br>(Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in %<br>(Mit Gebührenverzicht) |
|------------------------------|---|--|
| Thesaurierende Klasse CAD I5 | 0,39 %  | 0,39 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR I  | 0,69 %  | 0,69 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR M  | 2,09 %  | 2,09 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP I5 | 0,39 %  | 0,39 %   |
| Thesaurierende Klasse USD A  | 1,29 %  | 1,29 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I  | 0,69 %  | 0,69 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I   | 0,69 %  | 0,69 %   |
| Thesaurierende Klasse USD M  | 2,09 %  | 2,09 %   |
| Thesaurierende Klasse USD Z  | 0,09 %  | 0,09 %   |

## Global High Yield SDG Engagement

|                                  |        |        |
|----------------------------------|--------|--------|
| Ausschüttende Klasse AUD I       | 0,75 % | 0,70 % |
| Thesaurierende Klasse CHF I4     | 0,51 % | 0,47 % |
| Ausschüttende Klasse CHF I4      | 0,51 % | 0,47 % |
| Thesaurierende Klasse CHF X      | 1,25 % | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I4     | 0,51 % | 0,47 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I4      | 0,52 % | 0,47 % |
| Thesaurierende Klasse EUR X      | 1,25 % | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse EUR Z (PF) | 0,25 % | 0,20 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I4     | 0,51 % | 0,47 % |
| Thesaurierende Klasse GBP X      | 1,25 % | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse USD A      | 1,35 % | 1,30 % |
| Thesaurierende Klasse USD I      | 0,72 % | 0,70 % |
| Thesaurierende Klasse USD I4     | 0,50 % | 0,47 % |
| Ausschüttende Klasse USD M       | 1,95 % | 1,90 % |
| Thesaurierende Klasse USD X      | 1,23 % | 1,19 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z      | 0,15 % | 0,10 % |

## Global Investment Grade Credit

|                             |        |        |
|-----------------------------|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,56 % | 0,45 % |
| Thesaurierende Klasse USD X | 0,36 % | 0,25 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,23 % | 0,15 % |



## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (FORTSETZUNG)

30. Juni 2023 (Fortsetzung)

## Global Opportunistic Bond

| Anteilklasse                 | Annualisierte TER in %<br>(Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in %<br>(Mit Gebührenverzicht) |
|------------------------------|---|--|
| Thesaurierende Klasse EUR I  | 0,69 %  | 0,50 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP P  | 0,67 %  | 0,48 %   |
| Thesaurierende Klasse USD A  | 0,98 %  | 0,80 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I  | 0,69 %  | 0,50 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I   | 0,69 %  | 0,50 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 0,63 %  | 0,44 %   |
| Thesaurierende Klasse USD Z  | 0,39 %  | 0,20 %   |

## Global Real Estate Securities

|   |        |        |
|---|--------|--------|
| Ausschüttende Klasse EUR I5                           | 0,90 % | 0,68 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M                           | 3,03 % | 2,80 % |
| Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert) | 0,53 % | 0,30 % |
| Thesaurierende Klasse GBP Z                           | 0,52 % | 0,30 % |
| Thesaurierende Klasse USD A                           | 2,02 % | 1,80 % |
| Thesaurierende Klasse USD CI                          | 3,02 % | 2,80 % |
| Thesaurierende Klasse USD I                           | 1,27 % | 1,05 % |
| Ausschüttende Klasse USD I5                           | 0,90 % | 0,68 % |
| Thesaurierende Klasse USD M                           | 3,02 % | 2,80 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z                           | 0,51 % | 0,30 % |

## Global Sustainable Equity

|  |        |        |
|--|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert) | 0,44 % | 0,44 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)  | 2,44 % | 2,44 % |
| Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert)  | 0,14 % | 0,14 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)  | 0,75 % | 0,75 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert) | 0,44 % | 0,44 % |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 1,64 % | 1,64 % |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 0,74 % | 0,74 % |
| Ausschüttende Klasse USD I                             | 0,71 % | 0,71 % |
| Thesaurierende Klasse USD M                            | 2,41 % | 2,41 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z                            | 0,15 % | 0,15 % |

## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (FORTSETZUNG)

30. Juni 2023 (Fortsetzung)

## High Yield Bond

| Anteilklasse                             | Annualisierte TER in %<br>(Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in %<br>(Mit Gebührenverzicht) |
|--|---|--|
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)   | 1,29 %  | 1,29 %   |
| Thesaurierende Klasse AUD A              | 1,29 %  | 1,29 %   |
| Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich)   | 2,89 %  | 2,89 %   |
| Thesaurierende Klasse AUD B              | 2,89 %  | 2,89 %   |
| Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich)  | 2,89 %  | 2,89 %   |
| Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)   | 2,89 %  | 2,89 %   |
| Thesaurierende Klasse AUD E              | 2,89 %  | 2,89 %   |
| Ausschüttende Klasse AUD I               | 0,69 %  | 0,69 %   |
| Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)   | 1,89 %  | 1,89 %   |
| Ausschüttende Klasse AUD T (Wöchentlich) | 1,89 %  | 1,89 %   |
| Thesaurierende Klasse AUD T              | 1,89 %  | 1,89 %   |
| Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich)   | 1,29 %  | 1,29 %   |
| Thesaurierende Klasse CHF A              | 1,29 %  | 1,29 %   |
| Thesaurierende Klasse CHF I              | 0,68 %  | 0,68 %   |
| Thesaurierende Klasse CHF I2             | 0,59 %  | 0,59 %   |
| Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)   | 1,29 %  | 1,29 %   |
| Ausschüttende Klasse CNY I (Monatlich)   | 0,69 %  | 0,69 %   |
| Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)   | 1,29 %  | 1,29 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR A              | 1,29 %  | 1,29 %   |
| Ausschüttende Klasse EUR A               | 1,29 %  | 1,29 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR I              | 0,69 %  | 0,69 %   |
| Ausschüttende Klasse EUR I               | 0,69 %  | 0,69 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR I2             | 0,59 %  | 0,59 %   |
| Ausschüttende Klasse EUR I2              | 0,59 %  | 0,59 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR M              | 1,89 %  | 1,89 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR Z              | 0,09 %  | 0,09 %   |
| Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich)   | 1,29 %  | 1,29 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP A              | 1,29 %  | 1,29 %   |
| Ausschüttende Klasse GBP A               | 1,29 %  | 1,29 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP I              | 0,69 %  | 0,69 %   |
| Ausschüttende Klasse GBP I               | 0,69 %  | 0,69 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP I2             | 0,59 %  | 0,59 %   |
| Ausschüttende Klasse GBP I2              | 0,59 %  | 0,59 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP Z              | 0,09 %  | 0,09 %   |

## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (FORTSETZUNG)

## 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

## High Yield Bond (Fortsetzung)

| Anteilklasse                             | Annualisierte TER in %<br>(Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in %<br>(Mit Gebührenverzicht) |
|--|---|--|
| Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)   | 1,29 %  | 1,29 %   |
| Thesaurierende Klasse SEK A              | 1,29 %  | 1,29 %   |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)   | 1,29 %  | 1,29 %   |
| Thesaurierende Klasse SGD A              | 1,29 %  | 1,29 %   |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)   | 1,29 %  | 1,29 %   |
| Ausschüttende Klasse USD A (Wöchentlich) | 1,29 %  | 1,29 %   |
| Thesaurierende Klasse USD A              | 1,29 %  | 1,29 %   |
| Ausschüttende Klasse USD A               | 1,29 %  | 1,29 %   |
| Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich)   | 2,89 %  | 2,89 %   |
| Thesaurierende Klasse USD B              | 2,89 %  | 2,89 %   |
| Thesaurierende Klasse USD C              | 1,89 %  | 1,89 %   |
| Thesaurierende Klasse USD C1             | 2,29 %  | 2,29 %   |
| Ausschüttende Klasse USD C1              | 2,29 %  | 2,29 %   |
| Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich)  | 2,89 %  | 2,89 %   |
| Thesaurierende Klasse USD C2             | 2,89 %  | 2,89 %   |
| Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich)   | 2,89 %  | 2,89 %   |
| Thesaurierende Klasse USD E              | 2,89 %  | 2,89 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)   | 0,69 %  | 0,69 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I              | 0,69 %  | 0,69 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I               | 0,69 %  | 0,69 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I2 (Monatlich)  | 0,59 %  | 0,59 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I2             | 0,59 %  | 0,59 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I2              | 0,59 %  | 0,59 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich)  | 0,45 %  | 0,45 %   |
| Thesaurierende Klasse USD M              | 1,89 %  | 1,89 %   |
| Ausschüttende Klasse USD M               | 1,89 %  | 1,89 %   |
| Thesaurierende Klasse USD P              | 0,66 %  | 0,66 %   |
| Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)   | 1,89 %  | 1,89 %   |
| Ausschüttende Klasse USD T (Wöchentlich) | 1,89 %  | 1,89 %   |
| Thesaurierende Klasse USD T              | 1,89 %  | 1,89 %   |
| Ausschüttende Klasse USD U (Monatlich)   | 0,99 %  | 0,99 %   |
| Thesaurierende Klasse USD U              | 0,99 %  | 0,99 %   |
| Thesaurierende Klasse USD Z              | 0,09 %  | 0,09 %   |
| Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich)   | 2,89 %  | 2,89 %   |

## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (FORTSETZUNG)

## 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

## High Yield Bond (Fortsetzung)

| Anteilklasse                            | Annualisierte TER in %<br>(Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in %<br>(Mit Gebührenverzicht) |
|---|---|--|
| Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich) | 2,89 %  | 2,89 %   |
| Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)  | 2,89 %  | 2,89 %   |
| Thesaurierende Klasse ZAR E             | 2,89 %  | 2,89 %   |
| Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)  | 1,89 %  | 1,89 %   |
| Thesaurierende Klasse ZAR T             | 1,89 %  | 1,89 %   |

## InnovAsia 5G

|   |        |        |
|---|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse CHF I4                          | 2,21 % | 0,71 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A                           | 3,41 % | 1,90 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I4                          | 2,23 % | 0,71 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) | 4,24 % | 2,70 % |
| Thesaurierende Klasse EUR X                           | 3,16 % | 1,65 % |
| Thesaurierende Klasse SGD A                           | 3,40 % | 1,90 % |
| Thesaurierende Klasse SGD I4                          | 2,19 % | 0,71 % |
| Thesaurierende Klasse SGD X                           | 3,20 % | 1,65 % |
| Thesaurierende Klasse USD A                           | 3,01 % | 1,90 % |
| Thesaurierende Klasse USD I                           | 2,43 % | 1,05 % |
| Thesaurierende Klasse USD I4                          | 2,22 % | 0,71 % |
| Thesaurierende Klasse USD M                           | 4,18 % | 2,70 % |
| Thesaurierende Klasse USD X                           | 3,14 % | 1,65 % |

## Japan Equity Engagement

|   |        |        |
|---|--------|--------|
| Ausschüttende Klasse EUR I5                           | 0,55 % | 0,55 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I5                          | 0,55 % | 0,55 % |
| Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) | 0,93 % | 0,93 % |
| Thesaurierende Klasse JPY I                           | 0,98 % | 0,98 % |
| Ausschüttende Klasse JPY I                            | 0,97 % | 0,97 % |
| Thesaurierende Klasse JPY I5                          | 0,55 % | 0,55 % |
| Thesaurierende Klasse JPY Z                           | 0,13 % | 0,13 % |

## Macro Opportunities FX

|                             |        |        |
|-----------------------------|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR I | 1,13 % | 0,80 % |
| Thesaurierende Klasse GBP Z | 0,53 % | 0,20 % |
| Thesaurierende Klasse SEK I | 1,12 % | 0,80 % |

## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (FORTSETZUNG)

30. Juni 2023 (Fortsetzung)

## Macro Opportunities FX (Fortsetzung)

| Anteilklasse                | Annualisierte TER in %<br>(Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in %<br>(Mit Gebührenverzicht) |
|-----------------------------|---|--|
| Ausschüttende Klasse SEK I  | 1,06 %  | 0,80 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I | 1,12 %  | 0,80 %   |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,52 %  | 0,20 %   |

## Multi-Asset Income

|                              |        |        |
|------------------------------|--------|--------|
| Ausschüttende Klasse GBP P   | 3,75 % | 0,82 % |
| Thesaurierende Klasse USD A  | 4,12 % | 1,50 % |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 5,01 % | 2,50 % |
| Thesaurierende Klasse USD I  | 3,71 % | 0,85 % |
| Ausschüttende Klasse USD I   | 3,73 % | 0,85 % |
| Thesaurierende Klasse USD M  | 5,01 % | 2,30 % |

## Next Generation Mobility

|   |        |        |
|---|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR A                           | 1,87 % | 1,87 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I                           | 1,01 % | 1,01 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) | 1,02 % | 1,02 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) | 2,67 % | 2,67 % |
| Thesaurierende Klasse USD A                           | 1,87 % | 1,87 % |
| Thesaurierende Klasse USD C1                          | 2,87 % | 2,87 % |
| Thesaurierende Klasse USD I                           | 1,01 % | 1,01 % |
| Ausschüttende Klasse USD I                            | 1,02 % | 1,02 % |
| Thesaurierende Klasse USD M                           | 2,67 % | 2,67 % |
| Thesaurierende Klasse USD X                           | 1,72 % | 1,72 % |

Next Generation Space Economy<sup>1</sup>

|  |        |        |
|--|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert) | 2,15 % | 0,80 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)  | 4,05 % | 2,70 % |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 2,57 % | 1,05 % |

## Short Duration Emerging Market Debt

|  |        |        |
|--|--------|--------|
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) | 1,07 % | 1,07 % |
| Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich) | 1,07 % | 1,07 % |
| Thesaurierende Klasse CHF A            | 1,07 % | 1,07 % |

## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (FORTSETZUNG)

30. Juni 2023 (Fortsetzung)

## Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

| Anteilklasse                           | Annualisierte TER in %<br>(Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in %<br>(Mit Gebührenverzicht) |
|--|---|--|
| Ausschüttende Klasse CHF A             | 1,07 %  | 1,07 %   |
| Thesaurierende Klasse CHF I            | 0,57 %  | 0,57 %   |
| Ausschüttende Klasse CHF I             | 0,57 %  | 0,57 %   |
| Thesaurierende Klasse CHF I2           | 0,47 %  | 0,47 %   |
| Ausschüttende Klasse CHF I2            | 0,47 %  | 0,47 %   |
| Thesaurierende Klasse CHF I5           | 0,32 %  | 0,32 %   |
| Thesaurierende Klasse CHF P            | 0,54 %  | 0,54 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR A            | 1,07 %  | 1,07 %   |
| Ausschüttende Klasse EUR A             | 1,07 %  | 1,07 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR I            | 0,57 %  | 0,57 %   |
| Ausschüttende Klasse EUR I             | 0,57 %  | 0,57 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR I2           | 0,47 %  | 0,47 %   |
| Ausschüttende Klasse EUR I2            | 0,47 %  | 0,47 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR I5           | 0,32 %  | 0,32 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR M            | 1,67 %  | 1,67 %   |
| Ausschüttende Klasse EUR M             | 1,67 %  | 1,67 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR P            | 0,54 %  | 0,54 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR U            | 0,82 %  | 0,82 %   |
| Ausschüttende Klasse EUR X             | 0,47 %  | 0,47 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP A            | 1,07 %  | 1,07 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP I            | 0,57 %  | 0,57 %   |
| Ausschüttende Klasse GBP I             | 0,57 %  | 0,57 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP I2           | 0,47 %  | 0,47 %   |
| Ausschüttende Klasse GBP I2            | 0,47 %  | 0,47 %   |
| Ausschüttende Klasse GBP I5            | 0,32 %  | 0,32 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP P            | 0,54 %  | 0,54 %   |
| Thesaurierende Klasse JPY I            | 0,57 %  | 0,57 %   |
| Ausschüttende Klasse JPY I             | 0,57 %  | 0,57 %   |
| Thesaurierende Klasse SEK A            | 1,07 %  | 1,07 %   |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | 1,07 %  | 1,07 %   |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 1,07 %  | 1,07 %   |
| Thesaurierende Klasse USD A            | 1,07 %  | 1,07 %   |
| Ausschüttende Klasse USD A             | 1,07 %  | 1,07 %   |
| Thesaurierende Klasse USD C1           | 2,07 %  | 2,07 %   |

## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (FORTSETZUNG)

## 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

## Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

| Anteilklasse                 | Annualisierte TER in %<br>(Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in %<br>(Mit Gebührenverzicht) |
|------------------------------|---|--|
| Ausschüttende Klasse USD C1  | 2,07 %  | 2,07 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I  | 0,57 %  | 0,57 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I   | 0,57 %  | 0,57 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 0,47 %  | 0,47 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I2  | 0,47 %  | 0,47 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 0,32 %  | 0,32 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I5  | 0,32 %  | 0,32 %   |
| Thesaurierende Klasse USD M  | 1,67 %  | 1,67 %   |
| Ausschüttende Klasse USD M   | 1,67 %  | 1,67 %   |
| Thesaurierende Klasse USD P  | 0,54 %  | 0,54 %   |
| Thesaurierende Klasse USD Z  | 0,07 %  | 0,07 %   |

## Short Duration High Yield SDG Engagement

|  |        |        |
|--|--------|--------|
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) | 1,30 % | 1,30 % |
| Thesaurierende Klasse CHF A            | 1,30 % | 1,30 % |
| Thesaurierende Klasse CHF I            | 0,70 % | 0,70 % |
| Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich) | 1,30 % | 1,30 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A            | 1,30 % | 1,30 % |
| Ausschüttende Klasse EUR A             | 1,30 % | 1,30 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I            | 0,70 % | 0,70 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I2           | 0,61 % | 0,61 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M            | 1,90 % | 1,90 % |
| Ausschüttende Klasse EUR M             | 1,90 % | 1,90 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I            | 0,70 % | 0,70 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I             | 0,71 % | 0,71 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I2           | 0,60 % | 0,60 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I2            | 0,60 % | 0,60 % |
| Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) | 1,30 % | 1,30 % |
| Thesaurierende Klasse JPY I            | 0,70 % | 0,70 % |
| Ausschüttende Klasse JPY I             | 0,70 % | 0,70 % |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | 1,30 % | 1,30 % |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 1,30 % | 1,30 % |
| Thesaurierende Klasse USD A            | 1,30 % | 1,30 % |
| Ausschüttende Klasse USD A             | 1,30 % | 1,30 % |

## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (FORTSETZUNG)

## 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

## Short Duration High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

| Anteilklasse                 | Annualisierte TER in %<br>(Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in %<br>(Mit Gebührenverzicht) |
|------------------------------|---|--|
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 2,30 %  | 2,30 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I  | 0,70 %  | 0,70 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I   | 0,71 %  | 0,71 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 0,60 %  | 0,60 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I2  | 0,60 %  | 0,60 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I4 | 0,48 %  | 0,48 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 0,40 %  | 0,40 %   |
| Thesaurierende Klasse USD M  | 1,90 %  | 1,90 %   |
| Ausschüttende Klasse USD M   | 1,90 %  | 1,90 %   |
| Thesaurierende Klasse USD Z  | 0,10 %  | 0,10 %   |

## Strategic Income

|   |        |        |
|---|--------|--------|
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)                | 1,10 % | 1,10 % |
| Ausschüttende Klasse AUD Z (Monatlich)                | 0,11 % | 0,11 % |
| Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)                | 1,09 % | 1,09 % |
| Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)                | 1,10 % | 1,10 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A                           | 1,10 % | 1,10 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I                           | 0,60 % | 0,60 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M                           | 1,71 % | 1,71 % |
| Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich)                | 1,10 % | 1,10 % |
| Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)                | 1,09 % | 1,09 % |
| Thesaurierende Klasse JPY I                           | 0,61 % | 0,61 % |
| Thesaurierende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert) | 0,61 % | 0,61 % |
| Ausschüttende Klasse JPY I CG                         | 0,61 % | 0,61 % |
| Ausschüttende Klasse JPY I                            | 0,61 % | 0,61 % |
| Thesaurierende Klasse JPY Z                           | 0,11 % | 0,11 % |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)                | 1,10 % | 1,10 % |
| Thesaurierende Klasse SGD A                           | 1,10 % | 1,10 % |
| Ausschüttende Klasse SGD I (Monatlich)                | 0,61 % | 0,61 % |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)                | 1,10 % | 1,10 % |
| Thesaurierende Klasse USD A                           | 1,10 % | 1,10 % |
| Ausschüttende Klasse USD A                            | 1,10 % | 1,10 % |
| Thesaurierende Klasse USD C1                          | 2,11 % | 2,11 % |
| Thesaurierende Klasse USD I                           | 0,61 % | 0,61 % |



## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (FORTSETZUNG)

## 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

## Strategic Income (Fortsetzung)

| Anteilklasse                | Annualisierte TER in %<br>(Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in %<br>(Mit Gebührenverzicht) |
|-----------------------------|---|--|
| Ausschüttende Klasse USD I  | 0,60 %  | 0,60 %   |
| Thesaurierende Klasse USD M | 1,70 %  | 1,70 %   |
| Ausschüttende Klasse USD M  | 1,71 %  | 1,71 %   |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,11 %  | 0,11 %   |

## Sustainable Asia High Yield

|  |        |        |
|--|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR X            | 1,25 % | 0,55 % |
| Thesaurierende Klasse GBP X            | 1,30 % | 0,55 % |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 1,98 % | 1,40 % |
| Thesaurierende Klasse USD A            | 2,01 % | 1,40 % |
| Thesaurierende Klasse USD I            | 1,54 % | 0,80 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z            | 0,70 % | 0,20 % |
| Ausschüttende Klasse USD Z             | 0,81 % | 0,20 % |

## Sustainable Emerging Market Corporate Debt

|  |        |        |
|--|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse CHF I            | 1,13 % | 1,00 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A            | 1,96 % | 1,80 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I            | 1,13 % | 1,00 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I3           | 0,81 % | 0,68 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M            | 2,73 % | 2,60 % |
| Ausschüttende Klasse EUR M             | 2,73 % | 2,60 % |
| Thesaurierende Klasse EUR X            | 0,79 % | 0,58 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I            | 1,14 % | 1,00 % |
| Thesaurierende Klasse SEK A            | 1,93 % | 1,80 % |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 1,93 % | 1,80 % |
| Thesaurierende Klasse USD A            | 1,93 % | 1,80 % |
| Thesaurierende Klasse USD C1           | 2,93 % | 2,80 % |
| Thesaurierende Klasse USD I            | 1,13 % | 1,00 % |
| Ausschüttende Klasse USD I             | 1,13 % | 1,00 % |
| Thesaurierende Klasse USD I2           | 0,96 % | 0,84 % |
| Thesaurierende Klasse USD I5           | 0,73 % | 0,60 % |
| Thesaurierende Klasse USD M            | 2,73 % | 2,60 % |
| Ausschüttende Klasse USD M             | 2,74 % | 2,60 % |

## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (FORTSETZUNG)

## 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

Sustainable Emerging Market Debt – Hard Currency<sup>1</sup>

| Anteilklasse                 | Annualisierte TER in %<br>(Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in %<br>(Mit Gebührenverzicht) |
|------------------------------|---|--|
| Thesaurierende Klasse EUR I3 | 0,61 %  | 0,61 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR I4 | 0,51 %  | 0,51 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR X  | 0,49 %  | 0,45 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I  | 0,82 %  | 0,83 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 0,49 %  | 0,49 %   |

## Systematic Global Sustainable Value

|  |        |        |
|--|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR M                            | 2,27 % | 2,00 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert) | 0,85 % | 0,52 % |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 1,46 % | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 0,94 % | 0,75 % |
| Thesaurierende Klasse USD I3                           | 0,90 % | 0,62 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z                            | 0,56 % | 0,30 % |

Tactical Macro<sup>2</sup>

|                              |       |       |
|------------------------------|-------|-------|
| Thesaurierende Klasse USD I  | k. A. | k. A. |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | k. A. | k. A. |
| Thesaurierende Klasse USD Z  | k. A. | k. A. |

## Ultra Short Term Euro Bond

|                              |        |        |
|------------------------------|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse CHF P  | 0,26 % | 0,26 % |
| Thesaurierende Klasse CHF U  | 0,37 % | 0,37 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A  | 0,46 % | 0,46 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I  | 0,27 % | 0,27 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I   | 0,27 % | 0,27 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 | 0,23 % | 0,23 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 | 0,17 % | 0,17 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M  | 1,05 % | 1,05 % |
| Thesaurierende Klasse EUR U  | 0,37 % | 0,37 % |
| Thesaurierende Klasse EUR Z  | 0,08 % | 0,08 % |
| Thesaurierende Klasse USD I  | 0,27 % | 0,27 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z  | 0,08 % | 0,08 % |

## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (FORTSETZUNG)

30. Juni 2023 (Fortsetzung)

## Uncorrelated Strategies

| Anteilklasse                 | Annualisierte TER in %<br>(Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in %<br>(Mit Gebührenverzicht) |
|------------------------------|---|--|
| Thesaurierende Klasse CHF I  | 1,32 %  | 1,32 %   |
| Thesaurierende Klasse CHF I5 | 1,04 %  | 1,04 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR A  | 2,06 %  | 2,06 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR I  | 1,19 %  | 1,19 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 | 1,15 %  | 1,15 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 | 0,83 %  | 0,83 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR M  | 2,88 %  | 2,88 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR P  | 1,17 %  | 1,17 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP I  | 1,22 %  | 1,22 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP I2 | 1,19 %  | 1,19 %   |
| Ausschüttende Klasse GBP I2  | 1,50 %  | 1,50 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP I5 | 0,94 %  | 0,94 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP P  | 1,29 %  | 1,29 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP Z  | 0,58 %  | 0,58 %   |
| Thesaurierende Klasse JPY I  | 1,44 %  | 1,44 %   |
| Thesaurierende Klasse SGD A  | 4,15 %  | 4,15 %   |
| Thesaurierende Klasse USD A  | 2,08 %  | 2,08 %   |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 3,04 %  | 3,04 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I  | 1,37 %  | 1,37 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 1,15 %  | 1,15 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 0,91 %  | 0,91 %   |
| Thesaurierende Klasse USD M  | 2,81 %  | 2,81 %   |
| Thesaurierende Klasse USD P  | 1,19 %  | 1,19 %   |
| Thesaurierende Klasse USD Z  | 0,55 %  | 0,55 %   |

## US Equity

|                              |        |        |
|------------------------------|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse JPY I3 | 0,91 % | 0,73 % |
| Thesaurierende Klasse USD A  | 1,89 % | 1,70 % |
| Thesaurierende Klasse USD I  | 1,14 % | 0,95 % |
| Ausschüttende Klasse USD I   | 1,14 % | 0,95 % |
| Thesaurierende Klasse USD M  | 2,60 % | 2,50 % |

## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (FORTSETZUNG)

## 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

## US Equity Index PutWrite

| Anteilklasse   | Annualisierte TER in %<br>(Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in %<br>(Mit Gebührenverzicht) |
|--|---|--|
| Thesaurierende Klasse EUR I                            | 0,69 %  | 0,69 %   |
| Ausschüttende Klasse EUR I3                            | 0,51 %  | 0,51 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR I4                           | 0,45 %  | 0,45 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR M                            | 2,09 %  | 2,09 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)  | 0,69 %  | 0,69 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP I3                           | 0,51 %  | 0,51 %   |
| Ausschüttende Klasse GBP I3                            | 0,51 %  | 0,51 %   |
| Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert)  | 0,49 %  | 0,49 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert) | 0,45 %  | 0,45 %   |
| Ausschüttende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)   | 0,66 %  | 0,66 %   |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)                 | 1,29 %  | 1,29 %   |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 1,29 %  | 1,29 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)                 | 0,69 %  | 0,69 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 0,69 %  | 0,69 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I3                            | 0,51 %  | 0,51 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I4                           | 0,45 %  | 0,45 %   |
| Thesaurierende Klasse USD M                            | 2,09 %  | 2,09 %   |
| Thesaurierende Klasse USD Z                            | 0,09 %  | 0,09 %   |

## US Large Cap Value

|  |        |        |
|--|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR A                            | 1,56 % | 1,56 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)  | 1,57 % | 1,57 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I                            | 0,76 % | 0,76 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)  | 0,76 % | 0,76 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)  | 0,49 % | 0,49 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert) | 0,42 % | 0,42 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I                            | 0,76 % | 0,76 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)  | 0,76 % | 0,76 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I                             | 0,76 % | 0,76 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)   | 0,76 % | 0,76 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)  | 0,49 % | 0,49 % |
| Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)  | 0,74 % | 0,74 % |
| Ausschüttende Klasse GBP P                             | 0,72 % | 0,72 % |

## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (FORTSETZUNG)

## 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

## US Large Cap Value (Fortsetzung)

| Anteilklasse  | Annualisierte TER in %<br>(Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in %<br>(Mit Gebührenverzicht) |
|---|---|--|
| Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert) | 0,70 %  | 0,70 %   |
| Ausschüttende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)  | 0,69 %  | 0,69 %   |
| Thesaurierende Klasse USD A                           | 1,57 %  | 1,57 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I                           | 0,77 %  | 0,77 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I4                           | 0,49 %  | 0,49 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I5                          | 0,41 %  | 0,41 %   |
| Thesaurierende Klasse USD M                           | 2,37 %  | 2,37 %   |
| Thesaurierende Klasse USD Z                           | 0,07 %  | 0,07 %   |

## US Long Short Equity

|                                  |        |        |
|----------------------------------|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR A      | 2,39 % | 2,39 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I      | 1,48 % | 1,48 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I3     | 1,09 % | 1,09 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M      | 3,20 % | 3,20 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I3      | 1,09 % | 1,09 % |
| Thesaurierende Klasse SGD A1     | 2,10 % | 2,10 % |
| Thesaurierende Klasse USD A (PF) | 1,84 % | 1,84 % |
| Thesaurierende Klasse USD A      | 2,40 % | 2,40 % |
| Thesaurierende Klasse USD A1     | 2,10 % | 2,10 % |
| Ausschüttende Klasse USD I (PF)  | 1,15 % | 1,15 % |
| Thesaurierende Klasse USD I      | 1,50 % | 1,50 % |
| Thesaurierende Klasse USD I3     | 1,09 % | 1,09 % |
| Thesaurierende Klasse USD M      | 3,19 % | 3,19 % |
| Thesaurierende Klasse USD U      | 1,95 % | 1,95 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z      | 0,14 % | 0,14 % |

## US Multi Cap Opportunities

|                              |        |        |
|------------------------------|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse AUD E  | 2,95 % | 2,95 % |
| Thesaurierende Klasse AUD T  | 1,95 % | 1,95 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I3 | 0,65 % | 0,65 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M  | 2,85 % | 2,85 % |
| Thesaurierende Klasse EUR1 A | 1,85 % | 1,85 % |
| Thesaurierende Klasse EUR1 I | 1,00 % | 1,00 % |

## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (FORTSETZUNG)

## 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

## US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)

| Anteilklasse  | Annualisierte TER in %<br>(Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in %<br>(Mit Gebührenverzicht) |
|---|---|--|
| Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert) | 0,64 %  | 0,64 %   |
| Thesaurierende Klasse SGD A                           | 1,85 %  | 1,85 %   |
| Thesaurierende Klasse USD B                           | 2,95 %  | 2,95 %   |
| Thesaurierende Klasse USD C1                          | 2,85 %  | 2,85 %   |
| Thesaurierende Klasse USD C2                          | 2,95 %  | 2,95 %   |
| Thesaurierende Klasse USD E                           | 2,95 %  | 2,95 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I2                          | 0,80 %  | 0,80 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I3                          | 0,65 %  | 0,65 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I3                           | 0,65 %  | 0,65 %   |
| Thesaurierende Klasse USD M                           | 2,84 %  | 2,84 %   |
| Thesaurierende Klasse USD T                           | 1,95 %  | 1,95 %   |
| Thesaurierende Klasse USD U                           | 1,40 %  | 1,40 %   |
| Thesaurierende Klasse USD Z                           | 0,15 %  | 0,15 %   |
| Thesaurierende Klasse USD1 A                          | 1,85 %  | 1,85 %   |
| Thesaurierende Klasse USD1 I                          | 1,00 %  | 1,00 %   |
| Ausschüttende Klasse USD1 I                           | 1,00 %  | 1,00 %   |
| Thesaurierende Klasse ZAR B                           | 2,95 %  | 2,95 %   |
| Thesaurierende Klasse ZAR C2                          | 2,94 %  | 2,94 %   |
| Thesaurierende Klasse ZAR E                           | 2,95 %  | 2,95 %   |
| Thesaurierende Klasse ZAR T                           | 1,95 %  | 1,95 %   |

## US Real Estate Securities

|   |        |        |
|---|--------|--------|
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)  | 1,74 % | 1,74 % |
| Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich)  | 3,04 % | 3,04 % |
| Thesaurierende Klasse AUD B             | 3,03 % | 3,03 % |
| Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich) | 3,02 % | 3,02 % |
| Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)  | 3,03 % | 3,03 % |
| Thesaurierende Klasse AUD E             | 3,04 % | 3,04 % |
| Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)  | 2,03 % | 2,03 % |
| Thesaurierende Klasse AUD T             | 2,03 % | 2,03 % |
| Thesaurierende Klasse CHF A             | 1,74 % | 1,74 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A             | 1,74 % | 1,74 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I             | 0,98 % | 0,98 % |

## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (FORTSETZUNG)

## 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

## US Real Estate Securities (Fortsetzung)

| Anteilklasse                            | Annualisierte TER in %<br>(Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in %<br>(Mit Gebührenverzicht) |
|---|---|--|
| Thesaurierende Klasse EUR M             | 2,73 %  | 2,73 %   |
| Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)  | 1,73 %  | 1,73 %   |
| Thesaurierende Klasse SGD A             | 1,73 %  | 1,73 %   |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)  | 1,73 %  | 1,73 %   |
| Thesaurierende Klasse USD A             | 1,73 %  | 1,73 %   |
| Ausschüttende Klasse USD A              | 1,73 %  | 1,73 %   |
| Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich)  | 3,03 %  | 3,03 %   |
| Thesaurierende Klasse USD B             | 3,03 %  | 3,03 %   |
| Thesaurierende Klasse USD C1            | 2,73 %  | 2,73 %   |
| Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich) | 3,04 %  | 3,04 %   |
| Thesaurierende Klasse USD C2            | 3,04 %  | 3,04 %   |
| Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich)  | 3,03 %  | 3,03 %   |
| Thesaurierende Klasse USD E             | 3,04 %  | 3,04 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)  | 0,98 %  | 0,98 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I             | 0,98 %  | 0,98 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I              | 0,98 %  | 0,98 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I2            | 0,77 %  | 0,77 %   |
| Thesaurierende Klasse USD M             | 2,73 %  | 2,73 %   |
| Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)  | 2,03 %  | 2,03 %   |
| Thesaurierende Klasse USD T             | 2,03 %  | 2,03 %   |
| Thesaurierende Klasse USD Z             | 0,24 %  | 0,24 %   |
| Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich)  | 3,03 %  | 3,03 %   |
| Thesaurierende Klasse ZAR B             | 3,04 %  | 3,04 %   |
| Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich) | 3,04 %  | 3,04 %   |
| Thesaurierende Klasse ZAR C2            | 3,03 %  | 3,03 %   |
| Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)  | 3,03 %  | 3,03 %   |
| Thesaurierende Klasse ZAR E             | 3,04 %  | 3,04 %   |
| Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)  | 2,03 %  | 2,03 %   |
| Thesaurierende Klasse ZAR T             | 2,03 %  | 2,03 %   |

## US Small Cap

|                              |        |        |
|------------------------------|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse AUD B  | 2,92 % | 2,92 % |
| Thesaurierende Klasse AUD C2 | 2,89 % | 2,89 % |

## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (FORTSETZUNG)

## 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

## US Small Cap (Fortsetzung)

| Anteilklasse   | Annualisierte TER in %<br>(Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in %<br>(Mit Gebührenverzicht) |
|--|---|--|
| Thesaurierende Klasse AUD E                            | 2,92 %  | 2,92 %   |
| Thesaurierende Klasse AUD T                            | 1,92 %  | 1,92 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR A                            | 1,82 %  | 1,82 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)  | 1,82 %  | 1,82 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR I                            | 0,97 %  | 0,97 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)  | 0,97 %  | 0,97 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungsgesichert) | 0,80 %  | 0,80 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert) | 0,63 %  | 0,63 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR M                            | 2,82 %  | 2,82 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR Z                            | 0,12 %  | 0,12 %   |
| Ausschüttende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert)   | 0,97 %  | 0,97 %   |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 1,82 %  | 1,82 %   |
| Ausschüttende Klasse USD A                             | 1,82 %  | 1,82 %   |
| Thesaurierende Klasse USD B                            | 2,92 %  | 2,92 %   |
| Thesaurierende Klasse USD C2                           | 2,91 %  | 2,91 %   |
| Thesaurierende Klasse USD E                            | 2,92 %  | 2,92 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 0,97 %  | 0,97 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I                             | 0,97 %  | 0,97 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I3                           | 0,71 %  | 0,71 %   |
| Thesaurierende Klasse USD M                            | 2,84 %  | 2,84 %   |
| Thesaurierende Klasse USD T                            | 1,92 %  | 1,92 %   |
| Thesaurierende Klasse USD Z                            | 0,12 %  | 0,12 %   |
| Thesaurierende Klasse ZAR E                            | 2,92 %  | 2,92 %   |
| Thesaurierende Klasse ZAR T                            | 1,92 %  | 1,92 %   |

## US Small Cap Intrinsic Value

|  |        |        |
|--|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)  | 0,97 % | 0,97 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I2 (nicht währungsgesichert) | 0,80 % | 0,80 % |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 1,82 % | 1,82 % |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 0,97 % | 0,97 % |
| Thesaurierende Klasse USD I2                           | 0,80 % | 0,80 % |
| Thesaurierende Klasse USD M                            | 2,82 % | 2,82 % |

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

<sup>2</sup> Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtszeitraum aufgelegt.



## Anhang II

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN

Die Verordnung über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften („SFTR“) führt Berichtspflichten für Wertpapierfinanzierungsgeschäfte („SFTs“) und Total Return Swaps ein.

Ein Wertpapierfinanzierungsgeschäft (SFT) wird gemäß Artikel 3(11) der SFTR definiert als:

- ein Pensionsgeschäft/umgekehrtes Pensionsgeschäft
- Wertpapier- oder Rohstoffleih- oder ausleihgeschäfte
- eine Kauf- und Rückkauftransaktion oder Verkaufs- und Rückkauftransaktion oder
- ein Lombardgeschäft

Zum 30. Juni 2023 hielten die folgenden Portfolios Total Return Swaps oder Pensionsgeschäfte/umgekehrte Pensionsgeschäfte als unter den Geltungsbereich der SFTR fallende Instrumententypen:

CLO Income  
 Commodities  
 Event Driven  
 Global Flexible Credit Income  
 Short Duration Emerging Market Debt  
 Strategic Income  
 Uncorrelated Strategies  
 US Long Short Equity

#### CLO Income

#### Allgemeine Daten:

Vermögenswerte von Total Return Swaps beliefen sich zum 30. Juni 2023 auf:

| Art von Vermögenswert               | Betrag US\$ | Anteil am NIW (in %) |
|-------------------------------------|-------------|----------------------|
| Total Return Swaps – Vermögenswerte | 12.305      | 0,01                 |

## Anhang II (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### CLO Income (Fortsetzung)

##### Daten zur Wiederverwendung von Sicherheiten:

Die Barsicherheiten gehen auf dem Verwahrkonto für das Portfolio ein und werden deshalb nicht speziell nachverfolgt, um eine Wiederverwendung zu ermitteln. Deshalb können wiederverwendete Barsicherheiten nicht angemessen geprüft werden.

##### Konzentrierte Daten:

Zum 30. Juni 2023 hat das Portfolio keine Wertpapiere als Sicherheiten für die Total Return Swaps erhalten.

Die Gegenparteien von allen Total Return Swaps zum 30. Juni 2023 waren wie folgt:

| Gegenpartei                 | Betrag US\$ |
|-----------------------------|-------------|
| Goldman Sachs International | 12.305      |

##### Verwahrung erhaltener Sicherheiten:

Zum 30. Juni 2023 wurden keine Sicherheiten von der Verwahrstelle entgegengenommen oder gehalten.

##### Konsolidierte Transaktionsdaten:

Zum 30. Juni 2023 gab es keine Sicherheitenpositionen (Barmittel inbegriffen), die in Bezug auf alle Total Return Swaps gestellt oder erhalten wurden.

Die Laufzeiten der Positionen in Total Return Swaps zum 30. Juni 2023 lagen zwischen 1 Monat und 3 Monaten.

##### Verwahrung gestellter Sicherheiten:

Zum 30. Juni 2023 wurden keine Sicherheiten auf getrennten, gepoolten oder sonstigen Konten gehalten.

##### Ertrag/Kosten:

Bei Total Return Swaps sind Transaktionskosten, falls zutreffend, nicht separat identifizierbar. Bei diesen Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und sind Teil der Bruttoanlageperformance der einzelnen Portfolios. Renditen werden als realisierte Gewinne/Verluste und die Veränderung der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus den Swap-Kontrakten während der Berichtsperiode identifiziert.

## Anhang II (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### Commodities

##### Allgemeine Daten:

Vermögenswerte von Total Return Swaps beliefen sich zum 30. Juni 2023 auf:

| Art von Vermögenswert               | Betrag US\$ | Anteil am NIW (in %) |
|-------------------------------------|-------------|----------------------|
| Total Return Swaps – Vermögenswerte | 0           | 0,00                 |

##### Daten zur Wiederverwendung von Sicherheiten:

Die Barsicherheiten gehen auf dem Verwahrkonto für das Portfolio ein und werden deshalb nicht speziell nachverfolgt, um eine Wiederverwendung zu ermitteln. Deshalb können wiederverwendete Barsicherheiten nicht angemessen geprüft werden.

##### Konzentrierte Daten:

Zum 30. Juni 2023 hat das Portfolio keine Wertpapiere als Sicherheiten für die Total Return Swaps erhalten.

Die Gegenparteien von allen Total Return Swaps zum 30. Juni 2023 waren wie folgt:

| Gegenpartei                 | Betrag US\$ |
|-----------------------------|-------------|
| Goldman Sachs International | 0           |

##### Verwahrung erhaltener Sicherheiten:

Zum 30. Juni 2023 werden alle erhaltenen Sicherheiten bei der Verwahrstelle, Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited, verwahrt.

## Anhang II (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### Commodities (Fortsetzung)

##### Konsolidierte Transaktionsdaten:

Die konsolidierten Transaktionsdaten für Sicherheitenpositionen (Barmittel inbegriffen), die für alle Total Return Swaps zum 30. Juni 2023 gestellt oder erhalten wurden, stellten sich wie folgt dar:

|                             | Art der Sicherheit | Betrag US\$* | Qualität** | Laufzeit (Sicherheiten)*** | Währung von Sicherheiten | Gründungsland der Gegenpartei**** | Abwicklung und Clearing |
|-----------------------------|--------------------|--------------|------------|----------------------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------|
| <b>Total Return Swaps</b>   |                    |              |            |                            |                          |                                   |                         |
| Goldman Sachs International | Barsicherheiten    | 6.750.000    | k. A.      | k. A.                      | USD                      | USA                               | OTC                     |

\* Barsicherheiten können eine Kombination aus Swap-Instrumenten umfassen, da ein Teil der Sicherheiten sich auf nicht unter den Geltungsbereich der SFTR fallende Swap-Vereinbarungen bezieht.

\*\* Für Baranlagen oder Verbindlichkeiten gibt es kein Kreditrating. Aufgrund ihrer höchst liquiden Natur gelten auf US-Dollar lautende Barmittel als von höchster Qualität.

\*\*\* Aufgeteilt in 7 Fälligkeitssegmente (< 1 Tag, 1 Tag bis zu 1 Woche, 1 Woche bis zu 1 Monat, 1 Monat bis zu 3 Monaten, 3 Monate bis zu 1 Jahr, > 1 Jahr, offene Laufzeit). Barsicherheiten haben keine Laufzeit.

\*\*\*\* Das Land entspricht der Adresse der aktuellen Gegenpartei.

Die Laufzeiten der Positionen in Total Return Swaps zum 30. Juni 2023 lagen zwischen 1 Monat und 3 Monaten.

##### Verwahrung gestellter Sicherheiten:

Zum 30. Juni 2023 wurden keine Sicherheiten auf getrennten, gepoolten oder sonstigen Konten gehalten.

##### Ertrag/Kosten:

Bei Total Return Swaps sind Transaktionskosten, falls zutreffend, nicht separat identifizierbar. Bei diesen Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und sind Teil der Bruttoanlageperformance der einzelnen Portfolios. Renditen werden als realisierte Gewinne/Verluste und die Veränderung der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus den Swap-Kontrakten während der Berichtsperiode identifiziert.

## Anhang II (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### Event Driven

##### Allgemeine Daten:

Vermögenswerte von Total Return Swaps beliefen sich zum 30. Juni 2023 auf:

| Art von Vermögenswert               | Betrag US\$ | Anteil am NIW (in %) |
|-------------------------------------|-------------|----------------------|
| Total Return Swaps – Vermögenswerte | 428.434     | 0,49                 |

##### Daten zur Wiederverwendung von Sicherheiten:

Die Barsicherheiten gehen auf dem Verwahrkonto für das Portfolio ein und werden deshalb nicht speziell nachverfolgt, um eine Wiederverwendung zu ermitteln. Deshalb können wiederverwendete Barsicherheiten nicht angemessen geprüft werden.

##### Konzentrierte Daten:

Zum 30. Juni 2023 hat das Portfolio keine Wertpapiere als Sicherheiten für die Total Return Swaps erhalten.

Die Gegenparteien von allen Total Return Swaps zum 30. Juni 2023 waren wie folgt:

| Gegenpartei    | Betrag US\$ |
|----------------|-------------|
| Morgan Stanley | 428.434     |

##### Verwahrung erhaltener Sicherheiten:

Zum 30. Juni 2023 wurden keine Sicherheiten von der Verwahrstelle entgegengenommen oder gehalten.

##### Konsolidierte Transaktionsdaten:

Zum 30. Juni 2023 gab es keine Sicherheitenpositionen (Barmittel inbegriffen), die in Bezug auf alle Total Return Swaps gestellt oder erhalten wurden.

Die Laufzeiten der Positionen in Total Return Swaps zum 30. Juni 2023 lag über 1 Jahr.

##### Verwahrung gestellter Sicherheiten:

Zum 30. Juni 2023 wurden keine Sicherheiten auf getrennten, gepoolten oder sonstigen Konten gehalten.

## Anhang II (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### Event Driven (Fortsetzung)

##### Ertrag/Kosten:

Bei Total Return Swaps sind Transaktionskosten, falls zutreffend, nicht separat identifizierbar. Bei diesen Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und sind Teil der Bruttoanlageperformance der einzelnen Portfolios. Renditen werden als realisierte Gewinne/Verluste und die Veränderung der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus den Swap-Kontrakten während der Berichtsperiode identifiziert.

#### Global Flexible Credit Income

##### Allgemeine Daten:

Vermögenswerte von Total Return Swaps beliefen sich zum 30. Juni 2023 auf:

| Art von Vermögenswert               | Betrag US\$ | Anteil am NIW (in %) |
|-------------------------------------|-------------|----------------------|
| Total Return Swaps – Vermögenswerte | 27.731      | 0,01                 |

##### Daten zur Wiederverwendung von Sicherheiten:

Die Barsicherheiten gehen auf dem Verwahrkonto für das Portfolio ein und werden deshalb nicht speziell nachverfolgt, um eine Wiederverwendung zu ermitteln. Deshalb können wiederverwendete Barsicherheiten nicht angemessen geprüft werden.

##### Konzentrierte Daten:

Zum 30. Juni 2023 hat das Portfolio keine Wertpapiere als Sicherheiten für die Total Return Swaps erhalten.

Die Gegenparteien von allen Total Return Swaps zum 30. Juni 2023 waren wie folgt:

| Gegenpartei         | Betrag US\$ |
|---------------------|-------------|
| JPMorgan Chase Bank | 27.731      |

##### Verwahrung erhaltener Sicherheiten:

Zum 30. Juni 2023 wurden keine Sicherheiten von der Verwahrstelle entgegengenommen oder gehalten.

## Anhang II (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### Global Flexible Credit Income (Fortsetzung)

##### Konsolidierte Transaktionsdaten:

Zum 30. Juni 2023 gab es keine Sicherheitenpositionen (Barmittel inbegriffen), die in Bezug auf alle Total Return Swaps gestellt oder erhalten wurden.

Die Laufzeiten der Positionen in Total Return Swaps zum 30. Juni 2023 lagen zwischen 1 Monat und 3 Monaten.

##### Verwahrung gestellter Sicherheiten:

Zum 30. Juni 2023 wurden keine Sicherheiten auf getrennten, gepoolten oder sonstigen Konten gehalten.

##### Ertrag/Kosten:

Bei Total Return Swaps sind Transaktionskosten, falls zutreffend, nicht separat identifizierbar. Bei diesen Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und sind Teil der Bruttoanlageperformance der einzelnen Portfolios. Renditen werden als realisierte Gewinne/Verluste und die Veränderung der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus den Swap-Kontrakten während der Berichtsperiode identifiziert.

#### Short Duration Emerging Market Debt

##### Allgemeine Daten:

Vermögenswerte in umgekehrten Pensionsgeschäften beliefen sich zum 30. Juni 2023 auf:

| Art von Vermögenswert                            | Betrag US\$ | Anteil am NIW (in %) |
|--|-------------|----------------------|
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte – Verbindlichkeiten | 752.400     | 0,01                 |

##### Daten zur Wiederverwendung von Sicherheiten:

Die Barsicherheiten gehen auf dem Verwahrkonto für das Portfolio ein und werden deshalb nicht speziell nachverfolgt, um eine Wiederverwendung zu ermitteln. Deshalb können wiederverwendete Barsicherheiten nicht angemessen geprüft werden.

## Anhang II (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

##### Konzentrierte Daten:

Zum 30. Juni 2023 hat das Portfolio keine Wertpapiere als Sicherheiten für die umgekehrten Pensionsgeschäfte erhalten.

Die Gegenparteien von allen umgekehrten Pensionsgeschäften zum 30. Juni 2023 waren wie folgt:

| Gegenpartei | Betrag US\$ |
|-------------|-------------|
| Citigroup   | 752.400     |

##### Verwahrung erhaltener Sicherheiten:

Zum 30. Juni 2023 werden alle erhaltenen Sicherheiten bei der Verwahrstelle, Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited, verwahrt.

##### Konsolidierte Transaktionsdaten:

Die konsolidierten Transaktionsdaten für Sicherheitenpositionen (Barmittel inbegriffen), die für alle umgekehrten Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2023 gestellt wurden, stellten sich wie folgt dar:

| Umgekehrtes Pensionsgeschäft | Art der Sicherheit   | Betrag US\$* | Qualität** | Laufzeit (Sicherheiten)*** | Währung von Sicherheiten | Gründungsland der Gegenpartei**** | Abwicklung und Clearing |
|------------------------------|--|--------------|------------|----------------------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------|
| Citigroup                    | Sri Lanka Government International Bond, 5.88%, 25/07/2024 | 3.000.000    | D          | > 1 Jahr                   | USD                      | USA                               | OTC                     |

\* Barsicherheiten können eine Kombination aus Swap-Instrumenten umfassen, da ein Teil der Sicherheiten sich auf nicht unter den Geltungsbereich der SFTR fallende Swap-Vereinbarungen bezieht.

\*\* Für Baranlagen oder Verbindlichkeiten gibt es kein Kreditrating. Aufgrund ihrer höchst liquiden Natur gelten auf US-Dollar lautende Barmittel als von höchster Qualität.

\*\*\* Aufgeteilt in 7 Fälligkeitssegmente (< 1 Tag, 1 Tag bis zu 1 Woche, 1 Woche bis zu 1 Monat, 1 Monat bis zu 3 Monaten, 3 Monate bis zu 1 Jahr, > 1 Jahr, offene Laufzeit). Barsicherheiten haben keine Laufzeit.

\*\*\*\* Das Land entspricht der Adresse der aktuellen Gegenpartei.

Die Laufzeiten der Positionen der umgekehrten Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2023 waren offen.



## Anhang II (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

##### Verwahrung gestellter Sicherheiten:

Zum 30. Juni 2023 wurden keine Sicherheiten auf getrennten, gepoolten oder sonstigen Konten gehalten.

##### Ertrag/Kosten:

Bei umgekehrten Pensionsgeschäften sind Transaktionskosten, falls zutreffend, nicht separat identifizierbar. Bei diesen Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und sind Teil der Bruttoanlageperformance der einzelnen Portfolios. Renditen werden als realisierte Gewinne/Verluste und die Veränderung der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus den umgekehrten Pensionsgeschäften während der Berichtsperiode identifiziert.

#### Strategic Income

##### Allgemeine Daten:

Vermögenswerte von Total Return Swaps beliefen sich zum 30. Juni 2023 auf:

| Art von Vermögenswert               | Betrag US\$ | Anteil am NIW (in %) |
|-------------------------------------|-------------|----------------------|
| Total Return Swaps – Vermögenswerte | 499.398     | 0,03                 |

##### Daten zur Wiederverwendung von Sicherheiten:

Die Barsicherheiten gehen auf dem Verwahrkonto für das Portfolio ein und werden deshalb nicht speziell nachverfolgt, um eine Wiederverwendung zu ermitteln. Deshalb können wiederverwendete Barsicherheiten nicht angemessen geprüft werden.

##### Konzentrierte Daten:

Zum 30. Juni 2023 hat das Portfolio keine Wertpapiere als Sicherheiten für die Total Return Swaps erhalten.

Die Gegenparteien von allen Total Return Swaps zum 30. Juni 2023 waren wie folgt:

| Gegenpartei                 | Betrag US\$ |
|-----------------------------|-------------|
| Goldman Sachs International | 499.398     |

## Anhang II (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### Strategic Income (Fortsetzung)

##### Verwahrung erhaltener Sicherheiten:

Zum 30. Juni 2023 werden alle erhaltenen Sicherheiten bei der Verwahrstelle, Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited, verwahrt.

##### Konsolidierte Transaktionsdaten:

Die konsolidierten Transaktionsdaten für Sicherheitenpositionen (Barmittel inbegriffen), die für alle Total Return Swaps zum 30. Juni 2023 gestellt oder erhalten wurden, stellten sich wie folgt dar:

|                             | Art der Sicherheit | Betrag US\$* | Qualität** | Laufzeit (Sicherheiten)*** | Währung von Sicherheiten | Gründungsland der Gegenpartei**** | Abwicklung und Clearing |
|-----------------------------|--------------------|--------------|------------|----------------------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------|
| <b>Total Return Swaps</b>   |                    |              |            |                            |                          |                                   |                         |
| Goldman Sachs International | Barsicherheiten    | (60.000)     | k. A.      | k. A.                      | USD                      | USA                               | OTC                     |

\* Barsicherheiten können eine Kombination aus Swap-Instrumenten umfassen, da ein Teil der Sicherheiten sich auf nicht unter den Geltungsbereich der SFTR fallende Swap-Vereinbarungen bezieht.

\*\* Für Baranlagen oder Verbindlichkeiten gibt es kein Kreditrating. Aufgrund ihrer höchst liquiden Natur gelten auf US-Dollar lautende Barmittel als von höchster Qualität.

\*\*\* Aufgeteilt in 7 Fälligkeitssegmente (< 1 Tag, 1 Tag bis zu 1 Woche, 1 Woche bis zu 1 Monat, 1 Monat bis zu 3 Monaten, 3 Monate bis zu 1 Jahr, > 1 Jahr, offene Laufzeit). Barsicherheiten haben keine Laufzeit.

\*\*\*\* Das Land entspricht der Adresse der aktuellen Gegenpartei.

Die Laufzeiten der Positionen in Total Return Swaps zum 30. Juni 2023 lagen zwischen 1 Monat und 3 Monaten.

##### Verwahrung gestellter Sicherheiten:

Zum 30. Juni 2023 wurden keine Sicherheiten auf getrennten, gepoolten oder sonstigen Konten gehalten.

##### Ertrag/Kosten:

Bei Total Return Swaps sind Transaktionskosten, falls zutreffend, nicht separat identifizierbar. Bei diesen Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und sind Teil der Bruttoanlageperformance der einzelnen Portfolios. Renditen werden als realisierte Gewinne/Verluste und die Veränderung der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus den Swap-Kontrakten während der Berichtsperiode identifiziert.

## Anhang II (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### Uncorrelated Strategies

##### Allgemeine Daten:

Vermögenswerte von Total Return Swaps beliefen sich zum 30. Juni 2023 auf:

| Art von Vermögenswert                  | Betrag US\$ | Anteil am NIW (in %) |
|--|-------------|----------------------|
| Total Return Swaps – Vermögenswerte    | 1.794.588   | 0,08                 |
| Total Return Swaps – Verbindlichkeiten | 4.917.824   | 0,22                 |

##### Daten zur Wiederverwendung von Sicherheiten:

Die Barsicherheiten gehen auf dem Verwahrkonto für das Portfolio ein und werden deshalb nicht speziell nachverfolgt, um eine Wiederverwendung zu ermitteln. Deshalb können wiederverwendete Barsicherheiten nicht angemessen geprüft werden.

##### Konzentrierte Daten:

Zum 30. Juni 2023 hat das Portfolio keine Wertpapiere als Sicherheiten für die Total Return Swaps erhalten.

Die Gegenparteien von allen Total Return Swaps zum 30. Juni 2023 waren wie folgt:

| Gegenpartei                 | Betrag US\$ |
|-----------------------------|-------------|
| Goldman Sachs International | 2.202.852   |
| JPMorgan Chase Bank         | 1.096.724   |
| Morgan Stanley              | 1.859.216   |
| UBS AG                      | 426.636     |
| Société Générale            | 1.126.984   |

##### Verwahrung erhaltener Sicherheiten:

Zum 30. Juni 2023 werden alle erhaltenen Sicherheiten bei der Verwahrstelle, Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited, verwahrt.

## Anhang II (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

##### Konsolidierte Transaktionsdaten:

Die konsolidierten Transaktionsdaten für Sicherheitenpositionen (Barmittel inbegriffen), die für alle Total Return Swaps zum 30. Juni 2023 gestellt oder erhalten wurden, stellten sich wie folgt dar:

|                           | Art der Sicherheit                | Betrag US\$*    | Qualität**  | Laufzeit (Sicherheiten)*** | Währung von Sicherheiten | Gründungsland der Gegenpartei**** | Abwicklung und Clearing |     |
|---------------------------|-----------------------------------|-----------------|-------------|----------------------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------|-----|
| <b>Total Return Swaps</b> |                                   |                 |             |                            |                          |                                   |                         |     |
|                           | Citibank                          | Barsicherheiten | 3.000.000   | k. A.                      | k. A.                    | USD                               | Großbritannien          | OTC |
|                           | BNP Paribas                       | Barsicherheiten | 13.150.000  | k. A.                      | k. A.                    | USD                               | USA                     | OTC |
|                           | Goldman Sachs International       | Barsicherheiten | 2.750.000   | k. A.                      | k. A.                    | USD                               | Großbritannien          | OTC |
|                           | Merrill Lynch International       | Barsicherheiten | 3.940.000   | k. A.                      | k. A.                    | USD                               | USA                     | OTC |
|                           | Morgan Stanley & Co International | Barsicherheiten | (2.630.000) | k. A.                      | k. A.                    | USD                               | USA                     | OTC |
|                           | Nomura International Plc          | Barsicherheiten | 73.990.000  | k. A.                      | k. A.                    | USD                               | USA                     | OTC |
|                           | Société Générale                  | Barsicherheiten | 91.410.000  | k. A.                      | k. A.                    | USD                               | Frankreich              | OTC |
|                           | UBS AG London                     | Barsicherheiten | 8.500.000   | k. A.                      | k. A.                    | USD                               | Großbritannien          | OTC |

\* Barsicherheiten können eine Kombination aus Swap-Instrumenten umfassen, da ein Teil der Sicherheiten sich auf nicht unter den Geltungsbereich der SFTR fallende Swap-Vereinbarungen bezieht.

\*\* Für Baranlagen oder Verbindlichkeiten gibt es kein Kreditrating. Aufgrund ihrer höchst liquiden Natur gelten auf US-Dollar lautende Barmittel als von höchster Qualität.

\*\*\* Aufgeteilt in 7 Fälligkeitssegmente (< 1 Tag, 1 Tag bis zu 1 Woche, 1 Woche bis zu 1 Monat, 1 Monat bis zu 3 Monaten, 3 Monate bis zu 1 Jahr, > 1 Jahr, offene Laufzeit). Barsicherheiten haben keine Laufzeit.

\*\*\*\* Das Land entspricht der Adresse der aktuellen Gegenpartei.

## Anhang II (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

#### Konsolidierte Transaktionsdaten (Fortsetzung):

Die Laufzeiten von Positionen in Total Return Swaps zum 30. Juni 2023 stellten sich wie folgt dar:

| Fälligkeit                             | Betrag US\$ |                      |                        |                          |                        |           | offene Laufzeit |
|--|-------------|----------------------|------------------------|--------------------------|------------------------|-----------|-----------------|
|  | < 1 Tag     | 1 Tag bis zu 1 Woche | 1 Woche bis zu 1 Monat | 1 Monat bis zu 3 Monaten | 3 Monate bis zu 1 Jahr | > 1 Jahr  |                 |
| Total Return Swaps - Vermögenswerte    | -           | -                    | -                      | 542                      | 1.132.219              | 661.827   | -               |
| Total Return Swaps - Verbindlichkeiten | -           | -                    | -                      | -                        | 2.196.494              | 2.721.330 | -               |

#### Verwahrung gestellter Sicherheiten:

Der Anteil der Sicherheiten, die zum 30. Juni 2023 auf getrennten, gepoolten oder sonstigen Konten gehalten wurden, war wie folgt:

|                  | %        |
|------------------|----------|
| Getrennte Konten | 0,00 %   |
| Gepoolte Konten  | 0,00 %   |
| Sonstiges        | 100,00 % |
|                  | 100,00 % |

#### Ertrag/Kosten:

Bei Total Return Swaps sind Transaktionskosten, falls zutreffend, nicht separat identifizierbar. Bei diesen Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und sind Teil der Bruttoanlageperformance der einzelnen Portfolios. Renditen werden als realisierte Gewinne/Verluste und die Veränderung der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus den Swap-Kontrakten während der Berichtsperiode identifiziert.

## Anhang II (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### US Long Short Equity

##### Allgemeine Daten:

Vermögenswerte von Total Return Swaps beliefen sich zum 30. Juni 2023 auf:

| Art von Vermögenswert                  | Betrag US\$ | Anteil am NIW (in %) |
|--|-------------|----------------------|
| Total Return Swaps – Verbindlichkeiten | 3.765.767   | 1,69                 |

##### Daten zur Wiederverwendung von Sicherheiten:

Die Barsicherheiten gehen auf dem Verwahrkonto für das Portfolio ein und werden deshalb nicht speziell nachverfolgt, um eine Wiederverwendung zu ermitteln. Deshalb können wiederverwendete Barsicherheiten nicht angemessen geprüft werden.

##### Konzentrierte Daten:

Zum 30. Juni 2023 hat das Portfolio keine Wertpapiere als Sicherheiten für die Total Return Swaps erhalten.

Die Gegenparteien von allen Total Return Swaps zum 30. Juni 2023 waren wie folgt:

| Gegenpartei                 | Betrag US\$ |
|-----------------------------|-------------|
| Goldman Sachs International | 2.171.744   |
| JPMorgan Chase Bank         | 1.594.023   |

##### Verwahrung erhaltener Sicherheiten:

Zum 30. Juni 2023 wurden keine Sicherheiten von der Verwahrstelle entgegengenommen oder gehalten.

## Anhang II (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### US Long Short Equity (Fortsetzung)

##### Konsolidierte Transaktionsdaten:

Die konsolidierten Transaktionsdaten für Sicherheitenpositionen (Barmittel inbegriffen), die für alle Total Return Swaps zum 30. Juni 2023 gestellt oder erhalten wurden, stellten sich wie folgt dar:

|                             | Art der Sicherheit | Betrag US\$* | Qualität** | Laufzeit (Sicherheiten)*** | Währung von Sicherheiten | Gründungsland der Gegenpartei**** | Abwicklung und Clearing |
|-----------------------------|--------------------|--------------|------------|----------------------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------|
| <b>Total Return Swaps</b>   |                    |              |            |                            |                          |                                   |                         |
| Goldman Sachs International | Barsicherheiten    | 8.520.000    | k. A.      | k. A.                      | USD                      | Großbritannien                    | OTC                     |
| JPMorgan Chase Bank         | Barsicherheiten    | 6.680.000    | k. A.      | k. A.                      | USD                      | USA                               | OTC                     |

\* Barsicherheiten können eine Kombination aus Swap-Instrumenten umfassen, da ein Teil der Sicherheiten sich auf nicht unter den Geltungsbereich der SFTR fallende Swap-Vereinbarungen bezieht.

\*\* Für Baranlagen oder Verbindlichkeiten gibt es kein Kreditrating. Aufgrund ihrer höchst liquiden Natur gelten auf US-Dollar lautende Barmittel als von höchster Qualität.

\*\*\* Aufgeteilt in 7 Fälligkeitssegmente (< 1 Tag, 1 Tag bis zu 1 Woche, 1 Woche bis zu 1 Monat, 1 Monat bis zu 3 Monaten, 3 Monate bis zu 1 Jahr, > 1 Jahr, offene Laufzeit). Barsicherheiten haben keine Laufzeit.

\*\*\*\* Das Land entspricht der Adresse der aktuellen Gegenpartei.

Die Laufzeiten von Positionen in Total Return Swaps zum 30. Juni 2023 stellten sich wie folgt dar:

| Fälligkeit                             | Betrag US\$ |                      |                        |                          |                        |           | offene Laufzeit |
|--|-------------|----------------------|------------------------|--------------------------|------------------------|-----------|-----------------|
|  | < 1 Tag     | 1 Tag bis zu 1 Woche | 1 Woche bis zu 1 Monat | 1 Monat bis zu 3 Monaten | 3 Monate bis zu 1 Jahr | > 1 Jahr  |                 |
| Total Return Swaps - Vermögenswerte    | -           | -                    | -                      | -                        | -                      | -         | -               |
| Total Return Swaps - Verbindlichkeiten | -           | 534.725              | -                      | -                        | 2.202.190              | 1.028.852 | -               |

## Anhang II (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### US Long Short Equity (Fortsetzung)

##### Verwahrung gestellter Sicherheiten:

Der Anteil der Sicherheiten, die zum 30. Juni 2023 auf getrennten, gepoolten oder sonstigen Konten gehalten wurden, war wie folgt:

|                  | %        |
|------------------|----------|
| Getrennte Konten | 0,00 %   |
| Gepoolte Konten  | 0,00 %   |
| Sonstiges        | 100,00 % |
|                  | 100,00 % |

##### Ertrag/Kosten:

Bei Total Return Swaps sind Transaktionskosten, falls zutreffend, nicht separat identifizierbar. Bei diesen Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und sind Teil der Bruttoanlageperformance der einzelnen Portfolios. Renditen werden als realisierte Gewinne/Verluste und die Veränderung der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus den Swap-Kontrakten während der Berichtsperiode identifiziert.

Zum 30. Juni 2023 war keines der Portfolios an Wertpapierleihgeschäften beteiligt.



## Anhang III

### GLOSSAR DER INDIZES

#### **Bloomberg Commodity Index**

Der Index ist ein rollierender Index, der sich aus börsengehandelten Futures-Kontrakten auf physische Rohstoffe zusammensetzt. Der Index verlässt sich bei der Bestimmung der relativen Mengen der aufgenommenen Rohstoffe vor allem auf Liquiditätsdaten von Futureskontrakten sowie auf USD-bereinigte Produktionsdaten. Der Index soll eine hoch liquide und diversifizierte Benchmark für Rohstoffanlagen sein. Die Indexversion, die auf Basis der Gesamtrendite berechnet wird, spiegelt die Renditen auf eine voll besicherte Anlage in den zugrunde liegenden Rohstoff-Futureskontrakten wider, kombiniert mit den Renditen auf in US Treasury Bills investierten Barsicherheiten.

#### **Bloomberg Euro Aggregate Bond Index (Total Return, abgesichert, EUR)**

Der Index umfasst festverzinsliche, in Euro denominierte Anleihen mit Investment-Grade-Rating. Die Aufnahme basiert auf der Währung der Emission und nicht auf dem Domizilland des Emittenten. Die wichtigsten Sektoren des Index sind Staatsanleihen, Unternehmensanleihen, regierungsnahe Anleihen und verbriefte Emissionen.

#### **Bloomberg Global Aggregate Corporate Index (Total Return, Hedged, USD)**

Bei dem Index handelt es sich um ein führendes Maß für globale festverzinsliche Unternehmensanleihen mit Investment-Grade-Rating. Diese mehrere Währungen enthaltende Benchmark umfasst Anleihen von Emittenten der Sektoren Industrie, Versorgung und Finanzwesen aus Industrie- und Schwellenländern. Der Index ist Bestandteil der Global Aggregate and Multiverse Indizes.

#### **Bloomberg Global Aggregate Index (Total Return, abgesichert, USD)**

Der Index misst globale Schuldtitel mit Investment Grade von vierundzwanzig verschiedenen lokalen Währungsmärkten und umfasst festverzinsliche Treasuries, regierungsnahe Titel sowie Unternehmens- und verbriefte Anleihen von Emittenten aus Industrie- und Schwellenländern. Der Index besteht im Wesentlichen aus drei wichtigen regionalen Aggregatkomponenten: dem Bloomberg US Aggregate Bond Index, dem Bloomberg Pan-European Aggregate Bond Index und dem Bloomberg Asian-Pacific Aggregate Index. Neben Wertpapieren aus diesen drei Indizes enthält der Index zudem Papiere mit Investment Grade (Eurodollar, Euro-Yen, kanadische) und für den Index geeignete 144A Wertpapiere, die nicht bereits in diesen drei Indizes enthalten sind. Der Index ist voll in USD abgesichert.

#### **Bloomberg Global Aggregate Index (Total Return, nicht abgesichert, USD)**

Der Index misst globale Schuldtitel mit Investment Grade von vierundzwanzig verschiedenen lokalen Währungsmärkten und umfasst festverzinsliche Treasuries, regierungsnahe Titel sowie Unternehmens- und verbriefte Anleihen von Emittenten aus Industrie- und Schwellenländern. Der Index besteht im Wesentlichen aus drei wichtigen regionalen Aggregatkomponenten: dem Bloomberg US Aggregate Bond Index, dem Bloomberg Pan-European Aggregate Bond Index und dem Bloomberg Asian-Pacific Aggregate Index. Neben Wertpapieren aus diesen drei Indizes enthält der Index zudem Papiere mit Investment Grade (Eurodollar, Euro-Yen, kanadische) und für den Index geeignete 144A Wertpapiere, die nicht bereits in diesen drei Indizes enthalten sind.

#### **Bloomberg US Aggregate Bond Index (Total Return, USD)**

Der Index misst den in US-Dollar denominierten, festverzinslichen, steuerpflichtigen Markt für Anleihen mit Investment Grade und umfasst Treasuries, regierungsnahe Titel und Unternehmensanleihen, Mortgage Backed Securities (Agency Fixed Rate und Hybrid Variable Rate Mortgage Pass-Throughs), forderungsbesicherte Anleihen (Asset-Backed Securities sowie Commercial Mortgage-Backed Securities (Agency und Non-Agency)). Der Index ist eine breit angelegte Benchmark, die den in US-Dollar denominierten, festverzinslichen, steuerpflichtigen Markt für Anleihen mit Investment Grade misst. Dazu gehören Treasuries, regierungsnahe Titel und Unternehmensanleihen, hypothekarisch besicherte Anleihen (MBS), forderungsbesicherte Anleihen (ABS) sowie besicherte MBS.

#### **Cboe S&P 500 PutWrite Index**

Der Index bildet den Wert einer passiven Anlagestrategie ab, die aus einem Overlay von S&P 500 („SPX“) Short-Verkaufsoptionen über ein in ein- und dreimonatige Schatzwechsel investiertes Geldmarktkonto besteht. Die SPX-Verkaufsoptionen werden At-The-Money ausgeführt und monatlich verkauft.

#### **Cboe S&P 500 One-Week PutWrite Index**

Der Index bildet die Wertentwicklung einer hypothetischen Strategie ab, die wöchentlich eine At-the-Money (ATM) S&P 500 Index (SPX)-Verkaufsoption verkauft. Die Fälligkeit der geschriebenen SPX-Verkaufsoption ist eine Woche vor Verfall. Die geschriebene SPX-Verkaufsoption wird über ein in einmonatige Schatzwechsel investiertes Geldmarktkonto besichert. Der Index wird wöchentlich aktualisiert, üblicherweise jeden Freitag.

## Anhang III (Fortsetzung)

### GLOSSAR DER INDIZES (FORTSETZUNG)

#### **FTSE Chinese Government and Policy Bank Bond 0-1 Year Select Index (Total Return, CNY)**

Der Index misst die Wertentwicklung von auf CNY lautenden, festverzinslichen Staatsanleihen in stückloser Form sowie von Policy Bank Bonds, die auf dem chinesischen Festland ausgegeben wurden. Die folgenden Instrumente sind ausgeschlossen: Sparbriefe, spezielle Staatsanleihen, Zentralbankwechsel, Privatplatzierungen und abrufbare und kündbare Anleihen.

#### **FTSE EPRA Nareit Developed Real Estate Index (Total Return, Net of Tax, USD)**

Der Index ist ein um den Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index, der die Wertentwicklung von börsennotierten Immobiliengesellschaften und Real Estate Investment Trusts (REITs) in Industrieländern messen soll. Netto-Gesamtertragsindizes reinvestieren Dividenden nach Abzug der Quellensteuern unter Verwendung eines Steuersatzes (für internationale Indizes), der für gebietsfremde institutionelle Anleger gilt, die nicht von Doppelbesteuerungsabkommen profitieren.

#### **FTSE Nareit All Equity REITs Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD)**

Der Index ist ein um den Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index, der die Wertentwicklung von an der New York Stock Exchange oder der NASDAQ notierten steuerbegünstigten Immobiliengesellschaften (REITs) abbildet. Eigenkapital-REITs umfassen alle steuerbegünstigten REITs mit mehr als 50 Prozent des Gesamtvermögens an qualifizierten Immobilienanlagen mit Ausnahme von grundpfandrechtlich gesicherten Hypotheken.

#### **HFRX Equity Hedge Index (Total Return, USD)**

Der Index umfasst Strategien zur Aktienabsicherung. Strategien zur Aktienabsicherung unterhalten Positionen sowohl Long als auch Short überwiegend in Aktien und derivativen Aktienwerten. Eine große Vielfalt an Anlageprozessen kann zum Einsatz kommen, bis eine Anlageentscheidung getroffen wird, u. a. quantitative und fundamentale Techniken. Strategien können breit gestreut sein oder einen engen Fokus auf bestimmte Sektoren haben und können breit gefächert in Bezug auf die Höhe des Nettoengagements, das vorhandene Leverage-Niveau, die Haltedauer, Konzentrationen von Marktkapitalisierungen und Bewertungsspannen typischer Portfolios sein. Aktien-Hedge-Manager würden in der Regel mindestens 50 % und können in manchen Fällen im Wesentlichen vollständig in Long- als auch Short-Aktienpositionen investiert sein. Die Auswahl der Fonds erfolgt aus einem Pool von mehr als 7.500 Fonds weltweit, die an die Datenbank Hedge Fund Research (HFR) berichten. Die konstituierenden Fonds müssen alle die folgenden Kriterien erfüllen: monatlich berichten; Wertentwicklung nach Abzug aller Gebühren berichten; in US-Dollar denominated sein; aktiv sein und neue Investitionen tätigen; eine mindestens 24-monatige Erfolgsbilanz aufweisen, und der Manager des Fonds muss über mindestens 50 Millionen US-Dollar an verwalteten Vermögen verfügen. Der Index wird vierteljährlich neu ausgerichtet.

#### **ICE BofA European Currency Non-Financial High Yield 3% Constrained Index (Total Return, EUR)**

Der Index misst die Wertentwicklung von in Euro und GBP denominierten Unternehmensanleihen unterhalb von Investment Grade von Nichtfinanzunternehmen, die am Eurobondmarkt und Sterling- oder Euro-Inlandsmärkten öffentlich begeben werden. Das Engagement in einem Emittenten ist auf 3 % begrenzt. Der Index enthält alle nicht finanziellen Wertpapiere des ICE BofA European Currency High Yield Index, begrenzt aber das Engagement bei individuellen Emittenten auf 3 %.

#### **ICE BofA Global High Yield Constrained Index (Total Return, Hedged, USD)**

Der Index bildet die Wertentwicklung von in USD, CAD, GBP und EUR denominierten Unternehmensanleihen unterhalb Investment Grade ab, die an den wichtigsten Inlands- oder Eurobondmärkten öffentlich begeben werden. Das Engagement in jedem der im Index enthaltenen Emittenten ist auf maximal 2 % des Index begrenzt. Der Index enthält alle Wertpapiere des ICE BofA Global High Yield Index, begrenzt aber das Emittentenrisiko auf 2 %.

#### **ICE BofA Global Hybrid Non-Financial 5% Constrained Custom Index (Total Return, Hedged, Euro)**

Der Index bildet die Wertentwicklung von nicht finanziellen hybriden Unternehmensanleihen mit Investment Grade ab, die öffentlich an wichtigen Inlands- und Eurobond-Märkten begeben werden, wobei die Gewichtung jedes Emittenten auf maximal 5 % begrenzt ist.

#### **ICE BofA US Dollar 1-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return, USD)**

Der Index ist eine weit verbreitete Benchmark für kurzfristige Zinssätze. Er gibt einen Hinweis auf die Durchschnittskurse, zu denen Banken für bestimmte Zeiträume in bestimmten Währungen ungesicherte Interbankkredite aufnehmen können.

#### **ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return, USD)**

Der Index bildet die Wertentwicklung eines synthetischen Vermögenswerts ab, der bis zu einer angegebenen Fälligkeit den SOFR-Satz zahlt. Der Index basiert auf dem angenommenen Kauf eines synthetischen Instruments mit genau derselben angegebenen Fälligkeit und einem Kupon in Höhe des an diesem Tag geltenden Fixingkurses. Es wird davon ausgegangen, dass diese Emission am folgenden Werktag verkauft (mit einer Rendite in Höhe des an diesem Tag geltenden Fixingkurses) und in ein neues Instrument umgewandelt wird.

## Anhang III (Fortsetzung)

### GLOSSAR DER INDIZES (FORTSETZUNG)

#### **ICE BofA US High Yield Constrained Index (Total Return, USD)**

Der Index bildet die Wertentwicklung von in US-Dollar denominierten Unternehmensanleihen ohne Investment Grade ab, die öffentlich auf dem US-Inlandsmarkt begeben werden. Neben der Erfüllung anderer Kriterien müssen zulässige Wertpapiere ein Rating unterhalb von Investment Grade aufweisen (basierend auf dem Durchschnitt der Ratings von Moody's, S&P und Fitch) und Risiken gegenüber G10 FX-Ländern, Westeuropa oder Gebieten der USA und Westeuropas ausgesetzt sein. Wertpapiere, die rechtlich in Verzug sind, werden vom Index ausgeschlossen. Indexkomponenten sind kapitalisierungsgewichtet, sofern die Gesamtallokation bei einem einzelnen Emittenten 2 % nicht überschreitet.

#### **ICE BofA 0-1 Year AAA Euro Government Index (Total Return, EUR)**

Der Index ist eine Teilmenge des ICE BofA All Maturity Euro Government Index einschließlich aller Wertpapiere mit einer Fälligkeit von weniger als 1 Jahr und einem Rating von AAA. Der Index bildet die Wertentwicklung von in EUR denominierten Staatsanleihen ab, die von den Euro-Mitgliedsländern öffentlich entweder auf dem Eurobondmarkt oder dem Heimatmarkt des Emittenten begeben werden. Die zulässigen Länder müssen Euro-Mitglieder sein, über ein Investment Grade Rating für langfristige Staatsschulden in Fremdwährung verfügen (basierend auf dem Durchschnitt von Moody's, S&P und Fitch) und über mindestens eine leicht zugängliche, transparente Preisquelle für ihre Wertpapiere verfügen. Um für die Aufnahme in Betracht gezogen zu werden, muss ein Land zum ersten eines Monats Euro-Mitglied sein.

#### **ICE BofA 3-Month US Treasury Bill Index (Total Return, USD)**

Der Index besteht aus einer einzelnen US Treasury Bill-Emission, die zu Beginn eines jeden Monats gekauft und einen ganzen Monat lang gehalten wird. Zum Monatsende wird diese Emission verkauft und durch eine neu ausgewählte Emission ersetzt, die am nächsten zu drei Monaten ab dem Datum des Neuausrichtung, aber nicht darüber hinaus, fällig wird.

#### **JP Morgan Asia Credit Index (JACI) (Total Return, USD)**

Der Index bildet die Gesamtertragsperformance für aktiv gehandelte, in US-Dollar denominierte Schuldtitel in der Region Asien (ohne Japan) ab. JACI ist ein marktkapitalgewichteter Index, der Staatsanleihen, quasistaatliche und Unternehmensanleihen umfasst und nach Ländern, Sektoren und Kreditrating unterteilt ist.

#### **JPMorgan ESG Asia Credit High Yield Index (Total Return, USD) (JESG JACI)**

Der Index bildet die Gesamtertragsperformance für aktiv gehandelte, in US-Dollar denominierte Schuldtitel in der Region Asien (ohne Japan) ohne Investment Grade ab, die bestimmte ESG-Kriterien erfüllen.

#### **JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Index (CEMBI) Diversified Index (Total Return, USD)**

Der Index bildet die Wertentwicklung von in US-Dollar denominierten Unternehmensanleihen aus Schwellenländern ab, darunter Schwellenländer aus Asien, Europa, Lateinamerika und dem Nahen Osten/Afrika. Die diversifizierte Version des Index ist marktkapitalisierungsgewichtet und begrenzt die Gewichtungen der Indexländer mit größeren Unternehmensschuldtiteln, indem sie nur bestimmte Teile der zulässigen aktuellen Beträge der ausstehenden Schuldtitel dieser Länder berücksichtigt. Mit Wirkung vom 31. März 2022 wurden Russland und Weißrussland aus den JPMorgan Fixed Income Indizes ausgeschlossen. Der Marktwert des Index für alle russischen und weißrussischen Schuldtitel wurde auf null festgesetzt, was einen Verlust der gesamten Rendite aufgrund der Marktstörung reflektiert.

#### **JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) - Global Diversified (Total Return, USD)**

Der Index bildet die Wertentwicklung von in US-Dollar denominierten Schuldtiteln staatlicher und quasistaatlicher Emittenten aus Schwellenländern (Brady-Anleihen, Kredite und Euroanleihen) ab, darunter Schwellenländer aus Asien, Europa, Lateinamerika und dem Nahen Osten/Afrika. Die globale Version des Index erfasst ein breites, umfassendes Universum von Emissionen aus Schwellenländern. Die diversifizierte Version des Index ist marktkapitalisierungsgewichtet und begrenzt die Gewichtungen der Indexländer mit größeren Schuldtiteln, indem sie nur bestimmte Teile der zulässigen aktuellen Beträge der ausstehenden Schuldtitel dieser Länder berücksichtigt. Mit Wirkung vom 31. März 2022 wurden Russland und Weißrussland aus den JPMorgan Fixed Income Indizes ausgeschlossen. Der Marktwert des Index für alle russischen und weißrussischen Schuldtitel wurde auf null festgesetzt, was einen Verlust der gesamten Rendite aufgrund der Marktstörung reflektiert.

#### **JPMorgan ESG CEMBI Broad Diversified (Total Return, USD)**

Der Index bildet in US-Dollar denominierte fest- und variabel verzinsliche Schuldtitel aus Schwellenländern ab, die von Unternehmen emittiert werden. Der Index wendet eine ESG-Scoring- und Screening-Methode an, um einerseits Emittenten, die laut ESG-Kriterien höher eingestuft sind, sowie grünen Anleihen den Vorzug zu geben und andererseits Emittenten, die niedriger eingestuft sind, unterzugewichten und zu entfernen.

## Anhang III (Fortsetzung)

### GLOSSAR DER INDIZES (FORTSETZUNG)

#### **JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified Index (Total Return, USD)**

Der Index bildet die Wertentwicklung von liquiden, in US-Dollar denominierten fest- und variabel verzinslichen Schuldtiteln staatlicher und quasistaatlicher Emittenten aus Schwellenländern (Brady-Anleihen, Darlehen und Eurobonds) ab, die eine Restlaufzeit von mindestens 2,5 Jahren haben. Der Index wendet eine ESG-Scoring- und Screening-Methode an, um einerseits Emittenten, die laut ESG-Kriterien höher eingestuft sind, sowie grünen Anleihen den Vorzug zu geben und andererseits Emittenten, die niedriger eingestuft sind, unterzugeschichtet und zu entfernen.

#### **JPMorgan Government Bond Index (GBI) Emerging Markets - Global Diversified (Total Return, Unhedged, USD)**

Der Index bildet die Wertentwicklung von Anleihen in lokaler Währung ab, die von Regierungen der Schwellenländer ausgegeben wurden, einschließlich Schwellenländern aus Asien, Europa, Lateinamerika und dem Nahen Osten/Afrika. Die globale Version des Index enthält nur Länder, die für den Großteil der internationalen Anleger zugänglich sind. Länder mit expliziten Kapitalkontrollen sind ausgeschlossen. Die diversifizierte Version des Index ist nach Marktkapitalisierung gewichtet. Die Höchstgewichtung pro Land beträgt 10 %. Mit Wirkung vom 31. März 2022 wurden Russland und Weißrussland aus den JPMorgan Fixed Income Indizes ausgeschlossen. Der Marktwert des Index für alle russischen und weißrussischen Schuldtitel wurde auf null festgesetzt, was einen Verlust der gesamten Rendite aufgrund der Marktstörung reflektiert.

#### **MSCI All Country World Index (ACWI) (Total Return, abzüglich Steuern, USD)**

Der Index ist ein um den Streubesitz bereinigter, kapitalisierungsgewichteter Index, der die Aktienmarktperformance von Industrie- und Schwellenländern messen soll. Der Index besteht aus 47 Länderindizes, die 23 Industrie- und 24 Schwellenländerindizes umfassen. Die enthaltenen Indizes aus Industrieländern sind: Australien, Österreich, Belgien, Kanada, Dänemark, Finnland, Frankreich, Deutschland, Hongkong, Irland, Israel, Italien, Japan, die Niederlande, Neuseeland, Norwegen, Portugal, Singapur, Spanien, Schweden, die Schweiz, das Vereinigte Königreich und die USA. Die enthaltenen Schwellenländerindizes sind: Brasilien, Chile, China, Kolumbien, Tschechien, Ägypten, Griechenland, Ungarn, Indien, Indonesien, Korea, Kuwait, Malaysia, Mexiko, Peru, die Philippinen, Polen, Katar, Saudi-Arabien, Südafrika, Taiwan, Thailand, die Türkei und die VAE. Chinesische A-Aktien werden seit dem 1. Juni 2018 aufgenommen und sind seit November 2019 teilweise mit 20 % ihrer um den Streubesitz bereinigten Marktkapitalisierung vertreten. Netto-Gesamtertragsindizes reinvestieren Dividenden nach Abzug der Quellensteuern unter Verwendung eines Steuersatzes (für internationale Indizes), der für gebietsfremde institutionelle Anleger gilt, die nicht von Doppelbesteuerungsabkommen profitieren. Mit Wirkung nach Börsenschluss am 9. März 2022 stufte MSCI den Status des MSCI Russia Index um, und zwar von Emerging Markets auf den Status eines eigenständigen Marktes. Zu diesem Zeitpunkt wurden alle russischen Wertpapiere zu einem Endpreis von 0,00001 aus diesem Index entfernt, einschließlich lokal gehandelter russischer Aktien und der russischen ADRs/GDRs.

#### **MSCI All Country World (ACWI) Value Index (Total Return, Net of Tax, USD)**

Der Index ist ein um den Streubesitz bereinigter, kapitalisierungsgewichteter Index, der die Wertentwicklung von Large- und Mid-Cap-Aktien mit, im Großen und Ganzen, Value-Merkmalen aus 23 entwickelten Märkten und 24 Schwellenmärkten repräsentiert. Die Merkmale des Value-Anlagestils für diesen Index werden anhand von drei Variablen definiert: Verhältnis zwischen Kurs und Buchwert (KBV), Verhältnis zwischen Kurs und Gewinn (KGV) basierend auf Prognosen für die nächsten zwölf Monate und Dividendenrendite.

#### **MSCI China A Onshore Index (Total Return, CNY)**

Der Index ist kapitalisierungsgewichtet und besteht aus den A-Aktien großer und mittlerer Marktkapitalisierung von Unternehmen der VR China, die an den Börsen von Shanghai und Shenzhen notiert sind. Der Index erfasst die vertretenen Large- und Mid-Caps unter den an den Börsen Shanghai und Shenzhen notierten chinesischen Wertpapieren. Der Index basiert auf der MSCI Global Investable Market Indexes („GIMI“) Methodik. Es handelt sich dabei um einen umfassenden und konsistenten Ansatz zur Indexerstellung, der aussagekräftige globale Ansichten und überregionale Vergleiche über das gesamte Marktkapitalisierungsspektrum, Sektoren und Stilsegmente hinweg ermöglicht. Diese Methodik zielt darauf ab, eine umfassende Abdeckung der relevanten Anlagegelegenheiten zu bieten, wobei ein deutlicher Schwerpunkt auf der Indexliquidität, der Investitionsfähigkeit und der Replizierbarkeit liegt. Der Index wird vierteljährlich – im Februar, Mai, August und November – mit dem Ziel überprüft, Veränderungen an den zugrunde liegenden Aktienmärkten zeitnah zu berücksichtigen und gleichzeitig übermäßige Indexumsschläge zu begrenzen.

## Anhang III (Fortsetzung)

### GLOSSAR DER INDIZES (FORTSETZUNG)

#### **MSCI China All Shares Index (Total Return, USD)**

Der Index ist ein um den Streubesitz bereinigter, nach Marktkapitalisierung gewichteter Index, der die Aktienmarktperformance chinesischer Anteilklassen messen soll, die in Hongkong, Shanghai, Shenzhen und außerhalb Chinas notiert sind. Er deckt das integrierte Aktienuniversum des MSCI China ab, das A-Aktien, B-Aktien, H-Aktien, Red Chips, P-Chips und ausländische Notierungen außerhalb Chinas oder Hongkongs (z. B. ADRs) umfasst. A-Aktien sind Aktien von in China gegründeten Unternehmen und werden an den Börsen von Shanghai und Shenzhen gehandelt. Sie notieren in Renminbi und unterliegen den Vorschriften für ausländische Investitionen (QFII). B-Aktien sind Aktien von in China gegründeten Unternehmen und werden an den Börsen von Shanghai und Shenzhen gehandelt. Sie notieren Fremdwährungen (Shanghai USD, Shenzhen HKD) und sind für ausländische Anleger zugänglich. H-Aktien sind Aktien von in China gegründeten Unternehmen und werden an der Börse in Hongkong und anderen ausländischen Börsen gehandelt. Red Chips und P-Chips sind Papiere von Unternehmen, die außerhalb Chinas gegründet werden und an der Börse in Hongkong handeln. Red Chips werden in der Regel vom Staat oder einer Provinz oder Gemeinde kontrolliert. P-Chips sind nicht staatliche chinesische Unternehmen, die außerhalb des Festlandes gegründet wurden und in Hongkong gehandelt werden. Netto-Gesamtertragsindizes reinvestieren Dividenden nach Abzug der Quellensteuern unter Verwendung eines Steuersatzes (für internationale Indizes), der für gebietsfremde institutionelle Anleger gilt, die nicht von Doppelbesteuerungsabkommen profitieren.

#### **MSCI Emerging Markets Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD)**

Der Index ist ein um den Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index, der die Aktienmarktperformance von Schwellenländern messen soll. Der Index besteht aus den folgenden 24 Schwellenländerindizes: Brasilien, Chile, China, Kolumbien, Tschechien, Ägypten, Griechenland, Ungarn, Indien, Indonesien, Korea, Kuwait, Malaysia, Mexiko, Peru, die Philippinen, Polen, Katar, Saudi-Arabien, Südafrika, Taiwan, Thailand, die Türkei und die VAE. Chinesische A-Aktien werden seit dem 1. Juni 2018 aufgenommen und sind seit November 2019 teilweise mit 20 % ihrer um den Streubesitz bereinigten Marktkapitalisierung vertreten. Netto-Gesamtertragsindizes reinvestieren Dividenden nach Abzug der Quellensteuern unter Verwendung eines Steuersatzes (für internationale Indizes), der für gebietsfremde institutionelle Anleger gilt, die nicht von Doppelbesteuerungsabkommen profitieren. Mit Wirkung nach Börsenschluss am 9. März 2022 stufte MSCI den Status des MSCI Russia Index um, und zwar von Emerging Markets auf den Status eines eigenständigen Marktes. Zu diesem Zeitpunkt wurden alle russischen Wertpapiere zu einem Endpreis von 0,00001 aus diesem Index entfernt, einschließlich lokal gehandelter russischer Aktien und der russischen ADRs/GDRs.

#### **MSCI Europe Index (Total Return, abzüglich Steuern, EUR)**

Der Index ist ein um den Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index, der die Aktienmarktperformance von entwickelten Märkten in Europa messen soll.

#### **MSCI Japan Small Cap Net Index (Total Return, JPY)**

Der Index soll die Wertentwicklung des Small-Cap-Segments des japanischen Marktes messen.

#### **MSCI World Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD)**

Der Index ist ein um den Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index, der die Aktienmarktperformance von entwickelten Märkten messen soll.

#### **Russell 1000 Value Index (Total Return, Net of Tax, USD)**

Der Index ist ein um den Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index, der die Wertentwicklung des Large-Cap-Value-Segments des US-Aktienmarktes misst. Dazu gehören die Unternehmen im Russell 1000 Index, die ein niedrigeres KBV und niedrigere prognostizierte Wachstumsraten aufweisen. Der Index wird jedes Jahr im Juni neu ausgerichtet.

#### **Russell 2000 Index (Total Return, Net of Tax, USD)**

Der Index ist ein um den Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index, der die Wertentwicklung des Small-Cap-Segments des US-Aktienmarktes misst. Er enthält etwa 2.000 der kleinsten Wertpapiere im Russell 3000 Index (der die Performance der 3.000 größten US-amerikanischen Aktiengesellschaften anhand der gesamten Marktkapitalisierung misst). Der Index wird jedes Jahr im Juni neu ausgerichtet.

#### **Russell 2000 Value Index (Total Return, Net of Tax, USD)**

Der Index ist ein um den Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index, der die Wertentwicklung des Small-Cap-Value-Segments des US-Aktienmarktes misst. Dazu gehören die Unternehmen im Russell 2000 Index, die ein niedrigeres KBV und niedrigere prognostizierte Wachstumsraten aufweisen. Der Index wird jedes Jahr im Juni neu ausgerichtet.

## Anhang III (Fortsetzung)

### GLOSSAR DER INDIZES (FORTSETZUNG)

#### **S&P 500 Index (Total Return, Net of Tax, USD)**

Der Index ist um den Streubesitz bereinigt und marktkapitalisierungsgewichtet, mit Schwerpunkt auf dem Large-Cap-Segment des US-Aktienmarktes. Er umfasst einen wesentlichen Anteil des Gesamtwerts des Marktes.

#### **Gewichteter Durchschnitt aus 2/3 JP Morgan EMBI Global Diversified Investment Grade Index (Total Return, USD) und 1/3 JP Morgan GBI EM Global Diversified Index Investment Grade 15% Cap Index (Total Return, nicht währungsgesichert, USD)**

Der kombinierte Index setzt sich zu 2/3 aus dem JP Morgan EMBI Global Diversified Investment Grade Index (Total return, USD) (wie zuvor beschrieben) und zu 1/3 aus dem JP Morgan GBI-EM Global Diversified Index Investment Grade 15% Cap Index (Total return, USD, nicht währungsgesichert) (wie zuvor beschrieben) zusammen und wird monatlich neu ausgerichtet.

#### **50% JP Morgan GBI Emerging Markets Global Diversified Index (Total Return, nicht währungsgesichert, USD), 25% JP Morgan EMBI Global Diversified Index (Total Return, USD) und 25% JP Morgan CEMBI Diversified Index (Total Return, USD)**

Der kombinierte Index setzt sich zu 25 % aus dem JP Morgan Emerging Markets Bond Index Global Diversified (wie zuvor beschrieben), zu 25 % aus dem JP Morgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified (wie zuvor beschrieben) und zu 50 % aus dem JP Morgan GBI EM Global Diversified Index (wie zuvor beschrieben) zusammen und wird monatlich neu ausgerichtet.

#### **50% Cboe S&P 500 One-Week PutWrite Index / 50% Cboe S&P 500 PutWrite Index**

Der kombinierte Index setzt sich zu 50 % aus dem CBOE S&P 500 One-Week PutWrite Index (wie zuvor beschrieben) und zu 50 % aus dem CBOE S&P 500 PutWrite Index (wie zuvor beschrieben) zusammen.

## Anhang IV

### MANAGER, SUB-INVESTMENT-MANAGER UND UNTERBERATER

| Fondsname   | Manager  | Sub-Investment-Manager  | Unterberater (verbunden)  | Unterberater (nicht verbunden)                         |
|---|--|---|---|--|
| 5G Connectivity   | Neuberger Berman Asset Management Ireland Limited („NBAMIL“) | Neuberger Berman Investment Advisers LLC („NBIA“)<br>Neuberger Berman Asia Limited („NBAL“) |   |  |
| Asian Debt – Hard Currency                              | NBAMIL   | NBIA<br>Neuberger Berman Singapore Pte. Limited („NBS“)                                     |   |  |
| China A-Share Equity                                    | NBAMIL   | NBIA<br>NBAL  |   |  |
| China Bond  | NBAMIL   | NBIA<br>NBS<br>NBAL   | Neuberger Berman Investment Management (Shanghai) Limited („NB Shanghai“) |  |
| China Equity  | NBAMIL   |   |   | Green Court Capital Management Limited („Green Court“) |
| CLO Income  | NBAMIL   | NBIA  |   |  |
| Commodities   | NBAMIL   | NBIA<br>NBEL  |   |  |
| Corporate Hybrid Bond                                   | NBAMIL   | NBIA<br>NBS   |   |  |
| Emerging Market Debt – Hard Currency                    | NBAMIL   | NBIA<br>NBS   |   |  |
| Emerging Market Debt – Local Currency                   | NBAMIL   | NBIA<br>NBS   | NB Shanghai   |  |
| Emerging Market Debt Blend                              | NBAMIL   | NBIA<br>NBS   | NB Shanghai   |  |
| Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend | NBAMIL   | NBIA<br>NBS   |   |  |
| Emerging Markets Equity                                 | NBAMIL   | NBIA<br>NBAL  |   |  |
| Emerging Markets Select Equity                          | NBAMIL   | NBIA<br>NBAL  |   |  |
| Euro Bond Absolute Return                               | NBAMIL   |   |   |  |
| Euro Opportunistic Bond                                 | NBAMIL   |   |   |  |
| European High Yield Bond                                | NBAMIL   | NBIA  |   |  |
| European Sustainable Equity                             | NBAMIL   | NBIA  |   |  |
| Event Driven  | NBAMIL   | NBEL<br>NBIA  |   |  |
| Global Bond   | NBAMIL   | NBIA<br>NBS   |   |  |
| Global Diversified Income FMP – 2024                    | NBAMIL   | NBIA<br>NBS   |   |  |

## Anhang IV (Fortsetzung)

### MANAGER, SUB-INVESTMENT-MANAGER UND UNTERBERATER (FORTSETZUNG)

| Fondsname                                | Manager | Sub-Investment-Manager                       | Unterberater (verbunden) | Unterberater (nicht verbunden) |
|--|---------|--|--------------------------|--------------------------------|
| Global Equity Megatrends                 | NBAMIL  | NBIA   |                          |                                |
| Global Flexible Credit Income            | NBAMIL  | NBIA   |                          |                                |
|  |         | NBS  |                          |                                |
| Global High Yield SDG Engagement         | NBAMIL  | NBIA   |                          |                                |
|  |         | NBS  |                          |                                |
| Global Investment Grade Credit           | NBAMIL  | NBEL   |                          |                                |
|  |         | NBIA   |                          |                                |
| Global Opportunistic Bond                | NBAMIL  | NBIA   |                          |                                |
|  |         | NBS  |                          |                                |
| Global Real Estate Securities            | NBAMIL  | NBIA   |                          |                                |
|  |         | NBAL   |                          |                                |
| Global Sustainable Equity                | NBAMIL  | NBIA   |                          |                                |
| High Yield Bond                          | NBAMIL  | NBIA   |                          |                                |
| InnovAsia 5G                             | NBAMIL  | NBEL   |                          |                                |
|  |         | NBIA   |                          |                                |
|  |         | NBAL   |                          |                                |
| Japan Equity Engagement                  | NBAMIL  | Neuberger Berman East Asia Limited („NBEAL“) |                          |                                |
| Macro Opportunities FX                   | NBAMIL  | NBIA   |                          |                                |
| Multi-Asset Income                       | NBAMIL  | NBIA   |                          |                                |
|  |         | Neuberger Berman Canada ULC („NB Canada“)    |                          |                                |
| Next Generation Mobility                 | NBAMIL  | NBIA   |                          |                                |
|  |         | NBAL   |                          |                                |
| Next Generation Space Economy            | NBAMIL  | NBEL   |                          |                                |
|  |         | NBIA   |                          |                                |
| Short Duration Emerging Market Debt      | NBAMIL  | NBIA   |                          |                                |
|  |         | NBS  |                          |                                |
| Short Duration High Yield SDG Engagement | NBAMIL  | NBIA   |                          |                                |
| Strategic Income                         | NBAMIL  | NBIA   |                          |                                |
|  |         | NBS  |                          |                                |



## Anhang IV (Fortsetzung)

### MANAGER, SUB-INVESTMENT-MANAGER UND UNTERBERATER (FORTSETZUNG)

| Fondsname  | Manager | Sub-Investment-Manager | Unterberater (verbunden)              | Unterberater (nicht verbunden)       |
|--|---------|------------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|
| Sustainable Asia High Yield                      | NBAMIL  | NBEL                   |                                       |                                      |
|  |         | NBIA                   |                                       |                                      |
|  |         | NBS                    |                                       |                                      |
| Sustainable Emerging Market Corporate Debt       | NBAMIL  | NBIA                   |                                       |                                      |
|  |         | NBS                    |                                       |                                      |
| Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency | NBAMIL  | NBEL                   |                                       |                                      |
|  |         | NBIA                   |                                       |                                      |
|  |         | NBS                    |                                       |                                      |
| Systematic Global Sustainable Value              | NBAMIL  | NBIA                   |                                       |                                      |
|  |         | NB Canada              |                                       |                                      |
| Tactical Macro                                   | NBAMIL  | NBEL                   |                                       |                                      |
|  |         | NBIA                   |                                       |                                      |
| Ultra Short Term Euro Bond                       | NBAMIL  |                        |                                       |                                      |
| Uncorrelated Strategies                          | NBAMIL  | NBIA                   | NB Alternatives Advisers LLC („NBAA“) | AltIQ LLP                            |
|  |         |                        |                                       | BH-DG Systematic Trading LLP         |
|  |         |                        |                                       | P/E Global LLC                       |
|  |         |                        |                                       | True Partner Capital USA Holding Inc |
|  |         |                        |                                       | Alcova Asset Management LLP          |
|  |         |                        |                                       | Sandbar Asset Management LLP         |
|  |         |                        |                                       | Crabel Capital Management, LLC       |
|  |         |                        |                                       | AllianceBernstein L.P.               |
|  |         |                        |                                       | Portman Square Capital LLP           |
|  |         |                        |                                       | Soloda Investment Advisors LLP       |
| US Equity  | NBAMIL  | NBIA                   |                                       |                                      |
| US Equity Index PutWrite                         | NBAMIL  | NBIA                   |                                       |                                      |
| US Large Cap Value                               | NBAMIL  | NBEL                   |                                       |                                      |
|  |         | NBIA                   |                                       |                                      |
| US Long Short Equity                             | NBAMIL  | NBIA                   |                                       |                                      |
| US Multi Cap Opportunities                       | NBAMIL  | NBIA                   |                                       |                                      |
| US Real Estate Securities                        | NBAMIL  | NBIA                   |                                       |                                      |
| US Small Cap                                     | NBAMIL  | NBIA                   |                                       |                                      |
| US Small Cap Intrinsic Value                     | NBAMIL  | NBIA                   |                                       |                                      |

Dieses Dokument wird von der Neuberger Berman Asset Management Ireland Limited („NBAMIL“) herausgegeben, die durch die irische Zentralbank (Irish Central Bank, „CBI“) zugelassen ist und reguliert wird und in Irland in 2 Central Plaza, Dame Street, Dublin 2, eingetragen ist. Vertreter und Zahlstelle in der Schweiz ist BNP Paribas Securities Services, succursale de Zurich, Selnaustrasse 16, 8002 Zürich, Schweiz. Erfüllungsort und Gerichtsstand für Anteile an den Teilfonds des Fonds, die in oder von der Schweiz aus angeboten oder vertrieben werden, ist der Sitz des Vertreters in der Schweiz. Der Verkaufsprospekt, die wesentlichen Anlegerinformationen, die Satzung der Gesellschaft, der letzte geprüfte Jahresabschluss und der danach veröffentlichte Halbjahresabschluss des Fonds sind kostenfrei vom Vertreter in der Schweiz zu beziehen.

Neuberger Berman Investment Funds plc (der „Fonds“) ist von der Central Bank of Ireland (die „Zentralbank“) als Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren gemäß den Vorschriften von 2011 zur Umsetzung der EG-Richtlinie über Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (European Communities (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations 2011 (S.I. 352 of 2011) of Ireland) in der jeweils gültigen Fassung („OGAW-Vorschriften“) zugelassen.

Dieses Dokument wurde ausschließlich für Informationszwecke zur Verfügung gestellt und/oder richtet sich nur an Personen, bei denen es sich um professionelle Kunden oder zulässige Gegenparteien handelt. Alle Informationen können sich ohne Mitteilung ändern. Kein Teil dieses Dokuments darf ohne die schriftliche Genehmigung von NBAMIL in irgendeiner Form vervielfältigt werden. Unternehmensdaten, wo relevant, einschließlich Zahlen zu Mitarbeitern und verwaltetem Vermögen, spiegeln die zusammengefassten Daten für die verschiedenen verbundenen Anlageberater wider, die Tochtergesellschaften der Neuberger Berman Group LLC (die „Gesellschaft“) sind. Die Daten aus der Historie/Zeitachse der Gesellschaft reichen zurück bis ins Jahr 1939, das Gründungsjahr von Neuberger & Berman (dem Vorgänger der Neuberger Berman Group LLC) und verdeutlichen die wesentlichen Expansionen des Unternehmens, einschließlich derer, die aus Übernahmen der verschiedenen verbundenen Anlageberater resultierten, die nun die Gesellschaft bilden. Zu den Anlageexperten auf die Bezug genommen wird, zählen Portfoliomanager, Researchanalysten/Partner, Händler und Produktspezialisten sowie ein Team aus spezialisierten Ökonomen/Strategen.

Neuberger Berman ist der Meinung, dass die Informationen zum Datum ihrer Erstellung richtig sind, aber Neuberger Berman gibt gegenüber dem Empfänger dieses Dokuments oder den Endnutzern diesbezüglich keinerlei Erklärungen oder Zusicherungen ab und übernimmt keinerlei Haftung für Handlungen, die auf Basis der hier enthaltenen Informationen durchgeführt werden. Entscheidungen sollten keinesfalls auf Grundlage der in diesem Dokument enthaltenen Informationen und Meinungen oder der Annahme, dass diese richtig oder vollständig sind, getroffen werden. Hierin zum Ausdruck gebrachte Meinungen entsprechen der Meinung der Neuberger Berman und können sich ohne Vorankündigung ändern. Der Fonds ist möglicherweise in manchen Ländern nicht zum Verkauf zugelassen und ist eventuell nicht für jeden Anlegertyp geeignet. Weitere Informationen sind dem aktuellen Verkaufsprospekt zu entnehmen. Zusätzliche Informationen finden Sie auf [www.nb.com/europe/literature.html](http://www.nb.com/europe/literature.html).

Festverzinsliche Wertpapiere unterliegen dem Risiko, dass ein Emittent seine mit der Verbindlichkeit verbundene Verpflichtung zu Kapital- und Zinszahlungen nicht erfüllen kann, und können infolge von Faktoren wie der Zinssensitivität, der Beurteilung der Kreditwürdigkeit des Emittenten durch den Markt und der allgemeinen Marktliquidität (Marktrisiko) Preisschwankungen unterliegen. Festverzinsliche Wertpapiere unterliegen ferner dem Risiko, dass ihr Bonitätsrating oder das ihrer Emittenten herabgesetzt wird, was einen erheblichen Wertverlust solcher Wertpapiere zur Folge haben kann.

Wertpapiere mit niedrigem Rating (Non-Investment-Grade oder High Yield) oder Wertpapiere ohne Rating reagieren mit größerer Wahrscheinlichkeit auf Entwicklungen, die den Markt und das Kreditrisiko beeinflussen, als Wertpapiere mit höheren Ratings, die vor allem auf Veränderungen des allgemeinen Zinsniveaus reagieren. Anleger sollten die relativen Risiken einer Anlage in Hochzinspapieren sorgfältig analysieren und verstehen, dass solche Wertpapiere grundsätzlich nicht für eine kurzfristige Anlage geeignet sind. Anleger, die in einer anderen Währung als der Basiswährung des Fonds zeichnen, sind einem Währungsrisiko ausgesetzt. Schwankungen dieser Wechselkurse können die Kapitalrendite beeinträchtigen.

Die Performance in der Vergangenheit ist kein Indikator für künftige Ergebnisse. Einzelheiten zu den Anlagerisiken, insbesondere zum Liquiditäts-, Zins-, Kredit- und Währungsrisiko, sind dem aktuellen Verkaufsprospekt zu entnehmen. Bitte beachten Sie, dass Dividenden/Zinsen, die der Fonds vereinnahmt, Quellensteuern unterliegen können. Die Benchmark berücksichtigt keine steuerlichen Auswirkungen, und deshalb wurde dieser Abzug nicht in der hierin angegebenen Benchmarkrendite berücksichtigt. Das Anlageziel und die Performancebenchmark sind nur ein Ziel und keine Garantie für die Wertentwicklung des Fonds. Der Index wird nicht gemanagt und ein direktes Investment in diesen ist nicht möglich. Indexrenditen gehen von einer Wiederanlage von Dividenden und Veräußerungsgewinnen aus und berücksichtigen im Gegensatz zu Fondsrenditen keine Gebühren oder Kosten. Nachteilige Veränderungen der Wechselkurse können zu einer Verringerung der Rendite und einem Kapitalverlust führen. Die Anlagen jedes Portfolios können vollständig gegenüber seiner Basiswährung abgesichert sein, was die Währungsrisiken reduzieren, das Portfolio aber anderen Risiken aussetzen kann – wie etwa einem Ausfall einer Gegenpartei. Wie vorstehend erwähnt, sind weitere Informationen zu den spezifischen mit dieser Strategie verbundenen Risiken dem aktuellen Verkaufsprospekt zu entnehmen.

Neuberger Berman ist eine eingetragene Marke.

© 2023 Neuberger Berman